

关于西部证券安心 2 号集合资产管理计划资产管理 合同变更的公告

尊敬的西部证券安心 2 号集合资产管理计划投资者：

为更好满足投资者需求，经与托管人兴业银行股份有限公司协商，我司作为西部证券安心 2 号集合资产管理计划管理人，拟对《西部证券安心 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）中的相关条款进行变更。

具体变更方案如下：

一、合同变更主要内容

标题	变更前	变更后
第四部分 当事人的权利与义务 一、合同当事人 (二) 管理人	西部证券股份有限公司 注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室 办公地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室 法定代表人：徐朝晖 联系人：王家剑 联系电话：021-68866057 传真号码：021-68866317 网址：www.west95582.com	西部证券股份有限公司 注册地址：陕西省西安市新城区东大街 319 号 8 幢 10000 室 办公地址：上海市浦东新区耀体路 276 号 1501 室-1508 室 法定代表人：徐朝晖 联系人：吕珂忻 联系电话：021-68867065 传真号码：021-68866317 网址：www.west95582.com
第四部分 当事人的权利与义务 二、合同当事人 (三) 托管人	兴业银行股份有限公司 法定代表人/负责人：陶以平（代为履行法定代表人职权） 住所：上海市浦东新区银城路 167 号 联系人：曾思绮 联系电话：021-52629999	兴业银行股份有限公司 法定代表人：吕家进 住所：福州市湖东路 154 号 通讯地址：上海市浦东新区银城路 167 号 联系人：林诗琪 联系电话：021-52629999
第二十部分 资产管理计划财产的估值和会计核算 三、估值方法	1、债券估值 (1) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值。如估值	1、债券估值 (1) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值； (2) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定

日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素或参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易市价，确定公允价格； (2) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素或参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易市价，确定公允价格； (3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 (4) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的固定收益品种，按成本估值 (5) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。当情况发生变化，管理人认为成本法不能公允计量该资产的价值时，管理人应当及时进行调整。 (6) 非公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠	收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值； (3) 交易所上市交易的可转换债券、实行全价交易的可交换债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或债券发行机构发生影响债券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； (4) 交易所上市实行净价交易的可交换债券，按估值日的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或债券发行机构未发生影响债券价格的重大事件的，按最近交易日债券收盘价估值。如最近交易日后经济环境发生了重大变化或债券发行机构发生影响债券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； (5) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值； (6) 对于在上海证券交易所固定收益平台或者深圳证券交易所综合协议平台交易的债券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值，若第三方估值机构未提供估值价格，采用估值技术确定公允价
---	---

	计量公允价值的情况下，按成本估值。 (7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。 (8) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1)-(7)小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1)-(7)小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。 2、债券逆(正)回购按首期实付金额作为成本列示，按合同利率扣除(增加)费用后在实际持有期间内逐日确定利息收入(利息支出)。 3、银行存款、同业存单以成本列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，在知悉当日进行账务调整，不做追溯调整。 4、货币市场基金在持有期间内以成本估值，以基金管理公司公布的前一日收益计提收益。 5、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。如：银行间债券估值如遇特殊情况，由管理人和托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价	值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值； (7) 在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据中债登公司公布的收益率曲线及估值价格估值。对银行间市场未上市，且中债登公司未提供估值价格的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值； (8) 对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券、资产支持票据和私募债券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值价格进行估值。若第三方估值机构未提供估值价格，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值； (9) 非公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值； (10) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值； (11) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1)-(10)小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1)-(10)小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线
--	--	--

	格估值。 6、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。 7、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时，或因其他任何不可抗力（包括但不限于战争、自然灾害）致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。	等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。 2、债券逆（正）回购按首期实付金额作为成本列示，按合同利率扣除（增加）费用后在实际持有期间内逐日确定利息收入（利息支出）。有客观证据表明该证券回购资产的价值发生重大变化时，参考重大变化因素确定公允价值进行估值，应充分考虑其特点对信用风险的风险缓释作用，合理确认损失准备，对质押券的公允价值高于买入返售金融资产账面价值的逆回购，在计量预期信用损失时可认为违约损失率接近于零，在出现质押券的公允价值不足以覆盖买入返售金融资产账面价值的情况时，计量预期信用损失，中国证券登记结算有限责任公司为中央对手方的债券质押式逆回购的情况除外。 3、银行存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入，应充分考虑其特点对信用风险的风险缓释作用，合理确认损失准备，对于提前支取利息不受损的定期存款和协议存款，参照活期存款，在计量预期信用损失时可认为违约损失率接近于零。如提前支取或利率发生变化，在知悉当日进行账务调整，不做追溯调整。 4、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值，若第三方估值机构未提供估值价格，管理人与托管人协商，并按相关法规的规定，谨慎确定公允价值，按最能反映公允价值的价格估值。 5、持有的货币市场基金，以基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益每日计提红利。 6、本集合计划可以采用第三方估值机构按照
--	--	--

		上述公允价值确定原则提供的估值价格数据，具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定。 7、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。如：银行间债券估值如遇特殊情况，由管理人和托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。 8、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。 9、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时，或因其他任何不可抗力（包括但不限于战争、自然灾害）致使集合计划管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。
第二十一部分 资产管理计划的费用与税收 二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式 （一）资产管理人的管理费	在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的【0.7】%年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ 本资产管理计划年管理费率为【0.7】% H为每日应计提的资产管理计划管理费 E为前一日资产管理计划资产净值（产品成立首日按推广期参与资金及其推广期内产生的利息的总额计算）	在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的【0.5】%年费率计提。计算方法如下： $H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ 本资产管理计划年管理费率为【0.5】% H为每日应计提的资产管理计划管理费 E为前一日资产管理计划资产净值（产品成立首日按推广期参与资金及其推广期内产生的利息的总额计算）
第二十一部分 资产管理计划的费用与税收 二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式	管理人和托管人与投资者协商一致后，可根据市场发展情况调整资产管理费率和资产托管费率，修改本合同并报中国证监会证券投资基金业协会备案。	管理人可以调减管理费率，并在新的管理费率开始实施前在管理人网站公告并发送至托管人。 管理人、托管人可以协商调减托管费率，并在

与支付方式		新的托管费率开始实施前在管理人网站公告并发送至托管人。
(七) 费率的调整		

二、合同变更方案的安排

本次合同变更已获得托管人书面许可,根据《资产管理合同》约定,合同变更内容应当及时在管理人网站通告投资者。如果投资者未在通告发出后的3日内提出异议的,应视为其同意管理人对本合同做出变更。投资者不同意管理人对合同进行变更的,可于本集合计划的开放日2022年1月24日、1月26日提出退出申请;逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意合同变更但逾期未退出的投资者,均视为同意本合同变更。

三、合同变更的生效

合同变更内容在征询意见结束后,若同意合同变更的投资者不少于2人,则本次合同变更内容将于2022年1月27日生效,具体时间见管理人网站公告。

自变更生效之日起,公告内容即成为合同组成部分。投资者、管理人和托管人无需就本次合同变更另行签字。合同变更生效后,委托人、管理人和托管人应当按照变更生效后的内容行使各自相关权利,履行相应义务。

四、咨询方式及信息查询

- 1、联系电话:95582、021-50772859;
- 2、电子邮箱:xbzgkf@xbzqzg.com;
- 3、投资者可登陆管理人网站: <http://www.west95582.com>,完成注册后可查询自身所持产品份额明细和有关产品信息。

