

关于申万利位 1 号集合资产管理计划 合同变更征询意见函（202204）

宁波银行股份有限公司：

申银万国期货有限公司（以下简称“我公司”）在贵司托管的申万利位 1 号集合资产管理计划（以下简称“该计划”）已成立，我公司拟根据《申万利位 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的约定对该计划相关条款进行变更。

我公司特向贵司征询《申万利位 1 号集合资产管理计划资产管理合同》相关条款变更的意见。

《申万利位 1 号集合资产管理计划资产管理合同》条款具体修改如下：

章节	修改前	修改后
第十九节 资产管理 计划资产 的估值和 会计核算	<p>（2）债券估值方法</p> <p>在证券交易所市场挂牌交易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；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>在证券交易所市场挂牌交易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估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种</p>	<p>（2）债券估值方法</p> <p>证券交易所固定收益品种默认采用中证指数有限公司（简称“中证”）提供的估值净价估值。在证券交易所市场挂牌交易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；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>证券交易所固定收益品种默认采用中证指数有限公司（简称“中证”）提供的估值净价估值。在证券交易所市场挂牌交易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</p>

宁波银行股份有限公司
托管业务合同

申

<p>的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。</p> <p>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。</p> <p>银行间债券（大额可转让存单、中期票据）的估值采用中央国债登记结算有限责任公司提供的相应品种当日的价格计算，无活跃交易的非公开债务融资工具（PPN）等债务融资工具按照成本估值。</p> <p>交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。</p> <p>全国银行间市场交易的资产支持证券，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价格进行估值。</p>	<p>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估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。</p> <p>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。</p> <p>银行间固定收益品种默认采用中央国债登记结算有限责任公司（简称“中债”）提供的估值净价估值。</p>
--	---

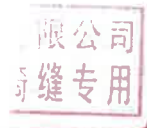
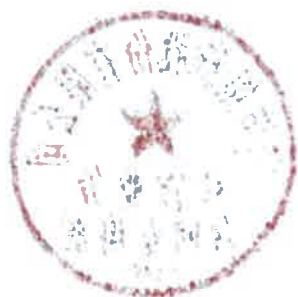
二、变更流程

我司通过本函向贵司征询意见，在与贵司书面达成一致意见并收到贵司的《复函》后，我司将按照资管合同的约定向计划份额持有人披露资管合同变更事宜。合同变更生效后按监管规定及时向监管机构报备。

以上变更事宜从 2022 年 4 月 30 日开始生效，若由于计划管理人未按照资管合同的约定向计划份额持有人披露资管合同变更事宜而导致托管人无法在 2022 年 4 月 30 日生效时间开始执行变更的，由此造成的任何形式的纠纷与托管人无关，由管理人承担由此造成的法律后果。在无充分文件证明变更生效时间前，托

管人将严格按照原协议履行其托管职责。以上事宜，请贵司确认。

本函正本一式两份，贵司留存一份，我司执一份。



复函

申银万国期货有限公司：

贵司发来的《申万利位 1 号集合资产管理计划资产管理合同变更的意见征询函（202204）》收悉，经研究，对贵司在来函中所述的合同条款变更内容不持异议。

本确认函一式两份，双方各执一份。

宁波银行股份有限公司（盖章）



签署日：2022年4月14日

司