

关于中航证券鑫航 56 号集合资产管理计划资产管理合同变更的公告

尊敬的投资者：

中航证券鑫航 56 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2020 年 7 月 17 日成立。根据《中航证券鑫航 56 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》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《中华人民共和国民法典》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称《指导意见》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称《合同指引》）等监管有关法律法规及中国证券投资基金业协会等相关自律性文件的规定，经与托管人兴业银行股份有限公司协商一致，我公司于 2022 年 6 月 27 日对《中航证券鑫航 56 号集合资产管理计划资产管理合同》、计划说明书以及风险揭示书相关条款进行变更。合同的具体修订内容前后对比见附件。

根据《中航证券鑫航 56 号集合资产管理计划资产管理合同》第二十五节的规定，“由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后 5 个工作日内以书面等方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人应在公告日发布后的 5 个工作日内反馈意见，5 个工作日内未反馈意见的视做同意变更，委托人不同意变更的，应在公告发布日后的 10 个交易日内提出退出本集合计划的申请。公告发布日后的 10 个交易日后，合同生效。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意。

委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）。

委托人同意，无论其是否提出退出申请，5 个工作日内未反馈意见的视做同意变更，变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。”

根据上述合同约定，本次合同修改管理人在公告后 5 个工作日内以管理人指定网站公告和短信书面等方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人在收到公

告、短信后的10个工作日内的开放日或10个工作日期限届满后的首个开放日(以下统称“指定开放日”)提出退出本集合计划的申请;委托人未在前述时间回复意见的也未在指定开放日退出计划的,视为委托人同意合同变更。

合同变更自本公告之日起10个工作日生效,具体生效时间以管理人变更生效公告为准。自合同变更生效之日起,公告内容即成为本集合计划合同的组成部分。

特此公告。

附件:中航证券鑫航56号集合资产管理计划资产管理合同条款变更对照表



附件：中航证券鑫航 56 号集合资产管理计划资产管理合同条款变更对照表

修改之处	原合同	修改为
第四节 当事人及权利义务	托管人 机构名称：兴业银行股份有限公司 负责人：陶以平（代为履行法定代表人职权） 通信地址：上海市银城路 167 号 邮政编码：200120 联系人：杨申 联系电话：021-52629999	托管人 机构名称：兴业银行股份有限公司 负责人：吕家进 通信地址：上海市银城路 167 号 邮政编码：200120 联系人：倪倩 联系电话：021-52629999
第四节 当事人及权利义务	无（33）	（33）除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。
第五节 资产管理计划的基本情况	金融衍生品（含国债期货）。	金融衍生品（仅国债期货）。
第五节 资产管理计划的基本情况	本集合计划属于固定收益型产品属于中风险收益品种（R3）。适合稳健型（C3）及以上投资者。	本集合计划属于固定收益型产品属于中低风险收益品种（R2）。适合稳健型（C2）及以上投资者。
第十一节 资产管理计划的投资	金融衍生品（含国债期货）。	金融衍生品（仅国债期货）。
第十一节 资产管理计划的投资	本集合计划属于固定收益型产品属于中风险收益品种（R3）。适合稳健型（C3）及以上投资者。	本集合计划属于固定收益型产品属于中低风险收益品种（R2）。适合稳健型（C2）及以上投资者。
第十八节 越权交易的界定	金融衍生品（含国债期货）。	金融衍生品（仅国债期货）。
第二十节 资产管理计划财产的估值和会计核算	7、估值方法 估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。	7、估值方法 估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》《证券公司金融工具估值方法指引》《资产管理产品相关会计处理规定》、及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。资产管理人、资产托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基

	(1) 回购交易成本列示, 按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息。 (2) 投资固定收益品种的估值方法 1) 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。 2) 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; 估值日无交易的, 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, 可参考监管机构和行业协会估值意见, 或者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。 3) 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, 按最近交易日债券收盘价减去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, 可参考监管机构和行业协会估值意见, 或者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。 4) 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, 按成本法估值。 5) 投资国债期货合约, 一般以估值当日结算价进行估值, 估值当日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日	金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。 (1) 回购交易成本列示, 按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息。 (2) 投资固定收益品种的估值方法 1) 同一固定收益品种同时在两个或两个以上市场交易的, 按各品种所处的市场分别估值。 2) 交易所上市交易的可转换债券, 按估值日收盘价减去债券应收利息得到的净价估值; 估值日无交易, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日收盘价减去债券应收利息得到的净价估值; 估值日无交易, 且最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日的收盘价确定公允价格。 交易所上市交易的国债, 按估值日收盘价估值; 估值日无交易, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近交易日收盘价估值; 估值日无交易, 且最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的, 可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素, 调整最近交易日的收盘价确定公允价格。 交易所上市交易的债券 (国债和可转换债除外), 采用中证指数有限公司提供的估值日当日估值净价进行估值。 3) 银行间市场交易的固定收益品种, 按中央国债登记结算有限责任公司当日提供的估值日当日价格数据确定公允价值。对未在银行间市场上市交易, 且中央国债登记结算有限责任公司未提供估值价格的固定收益品
--	--	--

	结算价估值。 6) 交易所上市的资产支持证券、私募债、可交换债等非公开发行债券, 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, 按照成本法估值。 7) 在对银行间市场的固定收益品种估值时, 应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。 8) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券, 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。对未在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的, 按成本估值。	种, 在发行利率与二级市场利率不存在明显差异、未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下, 可采用发行净价估值。 4) 对在交易所上市但无交易价格, 且第三方估值机构未能提供价格数据的固定收益品种, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 参考近期投资价格进行估值。
第二十一节 资产管理计划的费用与税收	户名: 中航证券有限公司 开户行: 上海浦东发展银行北京亚运村支行 账号: 91160153400000014	户名: 中航证券有限公司 开户行: 招商银行股份有限公司南昌站前西路支行 账 号: 7919 0006 8410 866
第二十四节 风险揭示	本集合计划属于固定收益型产品属于中风险收益品种 (R3)。适合稳健型 (C3) 及以上投资者。	本集合计划属于固定收益型产品属于中低风险收益品种 (R2)。适合稳健型 (C2) 及以上投资者。
第二十五节 资产管理计划合同的变更、终止与财产清算	无赎回终止条款	增加终止条款“ 2、委托人全部赎回本集合计划所有份额触发集合计划终止清算”
第二十八节 资产管理合同的效力	本集合计划终止, 但本合同项下的清算条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。	(删除此条)

