

关于中信期货信安1号集合资产管理计划

合同变更的公告

尊敬的委托人、托管人：

根据《中信期货信安1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）关于合同变更的约定，经管理人与托管人协商一致，决定变更《合同》的部分条款。本次变更方案如下：

一、合同变更依据

根据《合同》第二十四节“资产管理合同的变更、终止与财产清算”，对《合同》相关条款进行变更。

二、合同变更内容

1、对《合同》第十九节“资产管理计划财产的估值和会计核算”作出修改：

原合同约定为：

“三、估值程序

资产管理人与资产托管人在每个交易日的下一工作日对本交易日的资产管理计划财产进行估值。

估值核对日包括每周最后一个交易日、每月最后一个交易日、开放日、收益分配日、终止日以及其他资产管理人和资产托管人认为需要核对净值的日期。资产管理人和资产托管人对估值核对日的净值进行核对确认。资产管理人将估值核对日计划财产净值以电子邮件或其他资产管理人和资产托管人认可的方式发送给托管人。资产托管人复核后，将复核结果反馈给资产管理人。月末、季末、年中和年末估值复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。

……

五、估值方法

1. 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如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；

(2) 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，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 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) 交易所上市不活跃市场的有价证券及交易所上市的资产支持证券，选取中央国债登记结算有限责任公司提供的第三方估值净价进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

2. 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价（收盘价）估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值或经管理人与托管人协商一致同意可按本合同估值方法如下所列公式确定公允价值。

3. 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，选取中央国债登记结算有限责任公司提供的第三方估值净价进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值，在持有期内逐日计提应收利息。”

现变更为：

“三、 估值程序

资产管理人与资产托管人在每个交易日的下一工作日对本交易日的资产管理计划财产进行估值并核对。

资产管理人和资产托管人对估值核对日的净值进行核对确认。资产管理人将估值核对日计划财产净值以电子邮件或其他资产管理人和资产托管人认可的方式发送给托管人。资产托管人复核后，将复核结果反馈给资产管理人。月末、季末、年中和年末估值复核与本集合计划会计账目的核对同时进行。

.....

五、 估值方法

1、 证券交易所上市的有价证券的估值

(1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如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；若遇到沪深交易所因法定节假日闭市而港交所开市，沪港通、深港通股票以沪深交易所最近交易日的市价（收盘价）估值。

(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日中证指数有限公司提供的第三方估值净价进行估值，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，按最近交易日的中证指数有限公司提供的第三方估值净价进行估值。如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，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 交易所上市未实行净价交易的债券（除可转换债券）按估值日中证指数有限公司提供的第三方估值净价进行估值；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，按最近交易日中证指数有限公司提供的第三方估值净价进行估值。如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) 可转换债券按估值日收盘价减去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，按最近交易日收盘价减去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的，可参考类似投资品种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) 交易所上市不活跃市场的有价证券及交易所上市的资产支持证券，选取中证指数有限公司提供的第三方估值净价进行估值，如不存在中证指数有限公司估值时，采用估值技术确定公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股（有明确锁定期在发行时明确限售期的股票除外），按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行未上市的股票、可转换债券、和权证，采用估值技术确定公允价值；

(3) 有明确锁定期或在发行时有明确限售期的股票（不包括全国中小企业股份转让系统的股票），包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、首次公开发行网下配售有限限售期的股票、大宗交易买入有限限售期的股票，按监管机构或行业协会的有关规定确定公允价值。对于基金业协会规定的流通受限股票估值取值中的“流通受限股票的流动性折扣”，当估值日【中央国债登记结算有限责任公司】未提供该流动性折扣时，则优先采用距估值日最近交易日【中央国债登记结算有限责任公司】提供的流动性折扣进行估值处理。若【中央国债登记结算有限责任公司】从未提供该流通受限股票的流动性折扣，则按估值日该流通受限股票在证券交易所、全国中小企业股份转让系统上市或挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值。

3、全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，选取中央国债登记结算有限责任公司提供的第三方估值净价进行估值，如不存在中央国债登记结算有限责任公司估值时，采用估值技术确定公允价值。”

2、《合同》其他内容不变。

三、委托人退出方案的安排

根据《合同》约定，管理人将2023年06月01日至2023年06月15日设置为本次合同变更的征询期。如委托人不同意本次合同变更，可选择在2023年06月15日开放日申请退出本资产管理计划，管理人将受理委托人的退出申请，并为委托人办理退出业务。委托人没有办理退出申请的，视为委托人同意变更。

四、合同变更的效力

本次合同变更自2023年06月16日起生效。委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。本次合同变更未涉及事项，仍以合同的约定为准。

特此公告。

