

关于安信资管月月盈1号集合资产管理计划

合同变更的征询意见函公告

根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，及《安信资管月月盈1号集合资产管理计划合同》“资产管理合同的变更、终止与财产清算”的约定，经与托管人广发银行股份有限公司协商一致，管理人国投证券资产管理有限公司将对《安信资管月月盈1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）中相关内容进行变更（以下简称“本次变更”），现就本次变更相关事项公告如下：

一、合同主要变更内容：

1、原资管合同“第4部分 当事人及权利义务”

| 原条款： | 现修改为： |
|--|--|
| 一、投资者、管理人和托管人的基本情况 … (二) 管理人 机构名称： <u>安信证券</u> 资产管理有限公司 法定代表人： <u>李力</u> … 联系人： <u>马志茹</u> 联系电话：0755-8168 <u>1509</u> | 一、投资者、管理人和托管人的基本情况 … (二) 管理人 机构名称： <u>国投证券</u> 资产管理有限公司 法定代表人： <u>王斌</u> … 联系人： <u>唐研然</u> 联系电话：0755-8168 <u>2693</u> |

2、原资管合同“第8部分 资产管理计划的参与、退出与转让”

| 原条款： | 现修改为： |
|--|--|
| 十五、管理人自有资金参与及退出 (一) 自有资金参与 … 3、自有资金参与的金额和比例 | 十五、管理人自有资金参与及退出 (一) 自有资金参与 … 3、自有资金参与的金额和比例 |

| | |
|---|--|
| <p>(1) <u>如管理人在初始募集期和存续期以自有资金参与本资产管理计划，管理人自有资金参与资产管理计划的份额不超过资产管理计划总份额的15%，管理人及其附属机构以自有资金参与资产管理计划的份额合计不得超过资产管理计划总份额的50%。</u></p> | <p>(1) <u>证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合资产管理计划的份额合计不得超过该资产管理计划总份额的50%，其中管理人及母公司国投证券股份有限公司自有资金参与本集合资产管理计划的份额不超过本资产管理计划总份额的28%。中国证监会另有规定的，从其规定。</u></p> |
|---|--|

3、原资管合同“第19部分 资产管理计划财产的估值和会计核算”

| 原条款： | 现修改为： |
|---|---|
| <p>三、估值方法</p> <p>(一) 基金产品估值方法</p> <p>...</p> <p>2、交易所基金（包括封闭基金场内交易的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值。</p> <p><u>3、货币市场基金按成本估值，每天按公布的估值日前一日万份收益计提收益。</u></p> <p>...</p> <p>(三) 债券估值方法</p> <p>1、在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权债券，选取中证指数行</p> | <p>三、估值方法</p> <p>(一) 基金产品估值方法</p> <p>...</p> <p>2、交易所基金（包括封闭基金场内交易的交易型指数基金ETF、上市型开放式基金LOF）按照其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值。<u>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，将参考监管机构或行业协会有关规定，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。</u></p> <p><u>3、市值型货币市场基金按估值日前一日基金净值估值，估值日前一日基金净值未公布的，则按基金产品最近披露的净值估值。非市值型货币市场基金按公布的估值日前一日的每万份收益计提收益，估值日前一日基金未公布收益的，则按估值技术估值。</u></p> <p>...</p> <p>(三) 债券估值方法</p> <p>1、在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的不含权债券<u>（含公开发行和非</u></p> |

| | |
|--|--|
| <p>情提供的相应品种当日的估值<u>净价</u>。</p> <p>对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权债券，选取中证指数行情提供的相应品种当日的唯一估值<u>净价</u>或推荐估值<u>净价</u>。</p> <p>对于在交易所上市的可转债、可交换债券按估值日收盘价<u>减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价</u>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<u>减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价</u>进行估值。</p> <p>对于在交易所市场上市净价交易的公募可交换债，选取每日收盘价作为估值<u>净价</u>。</p> <p><u>对于在交易所市场挂牌转让的非公开发行债券，采用第三方机构（此处指中证指数有限公司）提供的估值价格确定公允价值；第三方机构无法提供估值价格时，采用估值技术确定公允价值。</u></p> <p>对于在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，<u>对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动</u></p> | <p><u>公开发行债券</u>），选取中证指数行情提供的相应品种当日的估值<u>全价</u>。</p> <p>对于在交易所市场上市交易或挂牌转让的含权债券<u>（含公开发行和非公开发行债券）</u>，选取中证指数行情提供的相应品种当日的唯一估值<u>全价</u>或推荐估值<u>全价</u>。<u>对于含投资人回售权的债券，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。</u></p> <p>对于在交易所上市的可转债、可交换债券按估值日收盘价<u>作为估值全价</u>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<u>作为估值全价</u>进行估值。</p> <p>对于在交易所市场上市净价交易的公募可交换债，选取每日收盘价<u>并加计每百元税前应计利息</u>作为估值<u>全价</u>。</p> <p>对于在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，<u>选取中证指数行情提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。如中证指数行情未提供估值价，采用估值技术确定公允价值。</u></p> |
|--|--|

或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值。

2、银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理：

对于在银行间市场上不含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的估值净价。

对于在银行间市场上含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价。对于含投资人回售权的债券，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

对于银行间市场未上市，且中债未提供估值价格的债券，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，采用估值技术确定公允价值。

3、对于银行间市场发行的资产支持证券按中央国债登记结算公司提供的估值价进行估值。对于在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用第三方机构（此处指中证指数有限公司）提供的估值价格确定公允价值；第三方机构无法提供估值价格时，采用估值技术确定公允价值。

...

(四) 同业存单的估值

同业存单按估值日中债估值提供的估值净价估值，中债估值未提供价格的，按成本估值。

2、银行间市场交易的债券，按如下估值方式处理：

对于在银行间市场上不含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的估值全价。

对于在银行间市场上含权的债券，选取中债估值提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。对于含投资人回售权的债券，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间建议选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

对于银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值全价的债券，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，采用估值技术确定公允价值。

3、对于银行间市场发行的资产支持证券按中央国债登记结算公司提供的估值全价进行估值。对于在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用第三方机构（此处指中证指数有限公司）提供的估值全价确定公允价值；第三方机构无法提供估值全价时，采用估值技术确定公允价值。

...

(四) 同业存单的估值

同业存单按估值日中债估值提供的估值全价估值，中债估值未提供价格的，采用估值技术确定公允价值。

4、上述条款对应说明书内相关条款一并修改。

二、合同变更安排

1、征询意见期

本次变更征询意见期为：2026年3月5日至2026年3月11日。

2、回复意见

请委托人在征询意见期内，书面签署附件一《关于安信资管月月盈1号集合资产管理计划合同变更的回复意见函》（以下简称“《回复函》”）反馈意见，未签署《回复函》的委托人或逾期回复的委托人视为同意合同的变更，同意合同变更的委托人，无需签署新合同。

3、退出安排

（1）不同意变更或回复意见不明确的委托人，可于征询意见期2026年3月11日退出本集合计划；

（2）不同意变更或回复意见不明确但未于征询意见期退出的，管理人将在征询意见期最后一个工作日即2026年3月11日日终做强制退出处理；

（3）未回复意见且未于征询意见期退出的，视同投资者同意本合同变更，管理人不再另行通知。

三、合同变更生效日

本合同满足法律法规要求的集合计划成立要件后，本合同变更生效。合同变更生效日为征询意见期结束次一工作日，即2026年3月12日。

四、其他事项

1、本资产管理计划将于2026年3月11日正常办理参与以及退出业务，于2026年3月11日办理参与业务的投资者，管理人默认投资者已知悉本次变更的相关

内容,并同意本次合同变更,管理人将依据变更生效后新合同进行资产管理业务。

2、本公告发布同时向投资者就合同变更事宜征求意见,不再另行征询,敬请各位委托人根据公告要求予以函复。

如有疑问,可咨询电话:95517。

国投证券资产管理有限公司

2026年3月4日

附件一

关于安信资管月月盈 1 号集合资产管理计划 合同变更的回复意见函

本委托人 同意 / 不同意国投证券资产管理有限公司于 2026 年 3 月 4 日发布的《关于安信资管月月盈 1 号集合资产管理计划合同变更的征询意见函公告》中有关安信资管月月盈 1 号集合资产管理计划合同变更相关事项。

特此函复。

投资者：

证件号码：

手机号码：

日期：

注：委托人在签署完毕后，请拍照或扫描发送至邮箱：axzg@sdicsc.com.cn。