

专项计划名称：中国交建PPP项目13期资产支持专项计划

证券代码：261022 证券简称：ZJ南翼优

证券代码：261023 证券简称：ZJ南翼次

关于中国交建PPP项目13期资产支持专项计划预期收益率调整的公告

本公司保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担相应的法律责任。

一、专项计划与资产支持证券的基本信息

中国交建PPP项目13期资产支持专项计划(以下简称“专项计划”)自2023年10月31日由中信证券股份有限公司(以下简称“管理人”)设立并开始运作,预期到期日为2030年6月26日。专项计划设置优先级和次级两种资产支持证券,基本信息如下:

表 1. 基本信息表

证券代码	证券简称	起息日	到期日	收益分配方式	信用评级	年化收益率	发行金额(亿元)	未偿本金余额(亿元)
261022	ZJ南翼优	2023/10/31	2030/6/26	每半年付息, 过手摊还本金	AAA	3.40%	7.97	4.703097
261023	ZJ南翼次	2023/10/31	2030/6/26	期间按顺序享有期间收益, 到期享有剩余收益	无	/	0.43	0.43

二、资产支持证券预期收益率调整情况

(一) 预期收益率调整条款具体内容

根据《中国交建PPP项目13期资产支持专项计划说明书》的约定, 预期收益率调整条款具体内容如下:

在每个票面利率调整公告日前, 经计划管理人、销售机构与回售承诺人协商, 计划管理人根据其与销售机构、回售承诺人协商一致的结果对优先级资产支持证券的预期收益率进行调整, 调整结果应由计划管理人于该票面利率调整公告日向

资产支持证券持有人公告。特别地，投资者认购或受让优先级资产支持证券的，视为同意和接受计划管理人的预期收益率调整权的行使。

经计划管理人行使票面利率调整权并经计划管理人披露票面利率调整公告后，调整后的预期收益率自票面利率调整公告日后所紧邻的对应回售行权日起（含该日）开始生效并持续有效，直至专项计划的最后一个兑付日届至或计划管理人再次行使票面利率调整权的结果生效。

（二）本次预期收益率调整情况

经计划管理人、销售机构与回售承诺人中交上海航道局有限公司协商，计划管理人将对优先级资产支持证券“ZJ 南翼优”（证券代码：261022）预期收益率进行下调，调整后的预期收益率为 2.56%，调整生效日为 2026 年 6 月 26 日（含该日），本次调整于 2026 年 6 月 26 日（含该日）至专项计划的最后一个兑付日届至或计划管理人再次行使票面利率调整权的结果期间生效。

三、其他

除非本公告另有定义或上下文另有所指，本公告中适用的词语与《标准条款》及《计划说明书》中定义的词语具有相同含义。

特此公告。

(本页无正文，为《关于中国交建 PPP 项目 13 期资产支持专项计划预期收益率调整的公告》之盖章页)

