

---

## 华夏基金-渤鑫 1 号集合资产管理计划

### 资产管理合同之补充协议（二）

资产管理人（全称）：华夏基金管理有限公司

资产托管人（全称）：渤海银行股份有限公司北京分行

鉴于资产委托人、资产管理人、资产托管人已签署《华夏基金-渤鑫 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：华夏基金-渤鑫 1 号-托管）及《华夏基金-渤鑫 1 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（一）》（上述合同以下称“原合同”），现三方特就原合同相关事宜订立以下补充协议。本补充协议中的所有术语，除非另有说明，否则其定义与原合同中的定义相同。

#### 一、调整“投资比例超限的处理方式及流程”相关表述

删除原合同“第十一节 资产管理计划的投资”“（三）投资比例超限的处理方式及流程”中如下内容：

“在本合同到期日前 30 个交易内，因资产管理计划财产变现需要，本计划财产的投资比例限制可以不符合上述资产配置比例规定。”

#### 二、调整“越权交易”相关表述

删除原合同“第十七节 越权交易”“（四）越权交易的例外”中如下内容：

“2. 本合同终止前 30 个交易日内，资产管理人有权对委托财产所投资证券进行变现，由此造成投资比例、投资范围不符合投资政策及附件《交易监控合规表》规定的，视为被动超标，不属于越权交易。”

#### 三、调整“资产管理合同的变更、终止与财产清算”相关表述

删除原合同“第二十三节 资产管理合同的变更、终止与财产清算”“（八）资产管理计划清算剩余财产的分配”中如下内容：

“在合同终止日前，资产管理人必须将投资组合内所有证券变现。”

---

#### 四、修改“投资范围”相关内容

将原合同“第五节 资产管理计划的基本情况”“（五）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”“2. 主要投资方向”及“第十一节 资产管理计划的投资”“（二）投资范围”及“附件一：交易监控合规表”“监控范围”中“投资范围”条款：

“1. 权益类资产：在国内依法发行的股票（含主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市或注册上市的股票）、港股通标的股票、股票 ETF、股票型基金（含指数型基金、指数增强型基金）、混合型基金；

2. 固定收益类资产：银行存款、可转债、债券 ETF、固定收益型基金；

3. 现金类资产：现金、货币基金、债券逆回购；

4. 期货和衍生品类资产：股指期货。”

修改为：

“1. 在国内依法发行的股票（含主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市或注册上市的股票）、港股通标的股票、股票 ETF、股票型基金（含指数型基金、指数增强型基金）、混合型基金；

2. 银行存款、可转债、债券 ETF、固定收益型基金；

3. 现金、货币基金、债券逆回购；

4. 股指期货。”

#### 五、修改“投资比例及限制”相关内容

1、将原合同“第五节 资产管理计划的基本情况”“（五）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”“3. 投资比例及限制”及“第十一节 资产管理计划的投资”“（七）投资限制”及“附件一：交易监控合规表”“监控比例及限制”中如下条款：

“（1）本计划投资于固定收益类资产、期货和衍生品类资产比例均不高于资产管理计划总资产的 80%，投资于股票等权益类资产的比例占资产管理计划

---

总资产的 50%-88%。本计划通过跟踪估值水平、盈利预期等市场指标以及宏观经济指标来确定权益类资产配置比例。当权益市场大部分股票处于未被充分定价的低估状态，且管理人认为未来资产回报率提高的，本计划将维持较高的股票资产配置比例至 80%-88%。同时，本计划将审慎判断后续市场环境变化，如股票指数估值水平超出合理范围的，本计划将适度调低股票资产配置比例至 50%-80%。

（2）净敞口绝对值不高于本计划净资产的 10%（净敞口指：股票、股指期货多空价值轧差后的净值）。

（3）本计划投资单只权益类资产的市值不超过计划所持权益资产的市值的 5%。因个股连续涨停导致该个股比例被动超限后，自其收盘价不涨停之日起 3 个交易日内比例调整完毕。

（4）本计划不得投资于 ST、\*ST 类股票和最近一年年受到证监会及交易所立案调查的公司股票。如果被动持有上述类型股票则需 5 个交易日内减持完毕（如遇停牌等导致股票无法交易则时间顺延）。

（5）投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 10%；资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

（6）本计划投资单只证券或单只公募证券投资基金的市值，不超过该证券市值或公募证券投资基金市值的 10%；本计划不得投资场外封闭式运作基金、定期开放基金等流通受限的基金。”

修改为：

“（1）本计划投资于股票等权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产比例均不高于资产管理计划总资产的 80%。

（2）股票和股指期货多头净敞口绝对值不高于本计划净资产的 10%（净敞口指：股票、股指期货多空价值轧差后的净值）。

---

（3）本计划投资单只股票的市值不超过计划所持权益资产的市值的 5%。因个股连续涨停导致该个股比例被动超限后，自其收盘价不涨停之日起 3 个交易日内比例调整完毕。

（4）本计划不得投资于 ST、\*ST 类股票和最近一年年受到证监会及交易所立案调查的公司股票。如果被动持有上述类型股票则需 5 个交易日内减持完毕（如遇停牌等导致股票无法交易则时间顺延）。

（5）投资于同一资产（公募基金除外）的资金不得超过本计划资产净值的 10%；投资于单只公募基金的资金不得超过本计划资产净值的 25%；资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。

（6）本计划投资单只证券或单只公募证券投资基金的市值，不超过该证券市值或公募证券投资基金市值的 10%。”

2、在原合同“第五节 资产管理计划的基本情况”“（五）资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”“3. 投资比例及限制”及“第十一节 资产管理计划的投资”“（七）投资限制”及“附件一：交易监控合规表”“监控比例及限制”增加如下条款：

“本计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算。”

六、本补充协议生效后，即成为原合同不可分割的组成部分，与原合同具有同等法律效力。除本补充协议中明确所作修改的条款之外，原合同的其余部分应完全继续有效。本补充协议与原合同不一致的，以本补充协议为准；本补充协议未约定的，按照原合同执行。

七、资产委托人为法人或其他组织的，本补充协议自全体资产委托人、资产管理人、资产托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人（负责人）或授权代表签字或盖章之日起生效；资产委托人为自然人的，本补充协议自全

---

体资产委托人本人签字、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章并由双方法定代表人（负责人）或授权代表签字或盖章之日起生效。

资产委托人以电子形式签署资产管理合同、风险揭示书、补充协议等法律文件的，与资产委托人签署纸质版资产管理合同、风险揭示书、补充协议等法律文件具备同等法律效力，资产委托人均受资产管理合同、风险揭示书、补充协议等法律文件约束。资产委托人通过身份验证等方式登录指定的网络系统，确认同意接受电子形式资产管理合同、风险揭示书、补充协议或其他文书的，即视为资产委托人已签署资产管理合同、风险揭示书、补充协议或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书、补充协议或其他文书上手写签名或者盖章具有同等法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书、纸质补充协议或其他文书。

八、本补充协议一式【三】份，本协议当事人各执一份，每份协议具有同等法律效力。

（以下无正文）

本页无正文，为《华夏基金-渤鑫1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议（二）》签署页

资产委托人:

自然人（签字）：                  或 法人或其他组织（盖章）：  
法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

签署日期:        年    月    日

资产管理人：华夏基金管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）

签署日期:        年    月    日

资产托管人：渤海银行股份有限公司北京分行（盖章）

法定代表人/负责人或授权代表（签字或盖章）

签署日期:        年    月    日