
华夏基金-纯债 3 号集合资产管理计划 资产管理合同之补充协议

资产管理人：华夏基金管理有限公司

资产托管人：兴业银行股份有限公司

鉴于资产委托人、资产管理人、资产托管人已签署《华夏基金-纯债 3 号集合资产管理计划资产管理合同》（上述合同以下简称“原合同”）。现经资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致，同意就原合同相关条款进行修改，达成本协议如下：

一、调整关联交易相关条款

1、将原合同“十四、利益冲突及关联交易”中如下内容：

“（一）关联交易及利益冲突情形

资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人运用固有资金开展投资或者资产管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。

本计划可以投资于资产管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，无须资产委托人的个别授权。该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产。

（二）关联交易及利益冲突的应对及处理

资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事前文已经明确列明的关联交易情形，资产管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得资产委托人的授权，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。对于资产管理计划在投资运作过程中从事除前述列明情形以外的其他关联交易的，资产管理人事后应当定期、全面、客观的向资产委托人和托管人进行披露。若该等关联交易构成重大关联交易的，则资产管理人应当事先取得资产委托人的同意，并应当提供充分证据证明未损害资产委托人利益。对同一标的投资金额超过本计划资产净值的 20%，视为重大关联交易。

资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当坚持资产委托人利益优先原则，从充分维护资产委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违

法违规行为。在发生该等利益冲突时，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向资产委托人提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对资产委托人利益的影响等。”

修改为：

“（一）利益冲突情形及处理

1、尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理受托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人及其关联方、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人及其关联方运用固有资金开展投资或者资产管理人管理的其他资产管理产品（包括本计划投资经理管理的其他资产管理产品）开展投资可能产生的利益冲突；其他可能产生利益冲突的情况等。

2、资产管理计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，资产管理人应当妥善处理该等利益冲突，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，如对资产委托人产生实质不利影响，资产管理人应当视具体利益冲突情形选择在向资产委托人提供的定期报告或临时报告中披露，具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对资产委托人利益的影响等。

（二）关联交易情形及处理

1、关联方范围

本资产管理计划的关联方包括：

- （1）资产管理人；
- （2）资产托管人；
- （3）资产管理人的控股股东、实际控制人；
- （4）资产托管人的控股股东、实际控制人；
- （5）与资产管理人有重大利害关系的公司；
- （6）与资产托管人有重大利害关系的公司；
- （7）法律法规、监管规定、自律规则认定的其他关联方。

资产管理人的关联方名单通过资产管理计划年度报告披露，资产托管人的关联方名单通过资产托管人网站或资产托管人提供的其他方式披露。

2、重大关联交易和一般关联交易的划分标准

(1)重大关联交易

本资产管理计划的重大关联交易包括但不限于：

①一级市场申购资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的股票、可转换债券；

②二级市场交易资产管理人、资产托管人及其关联方发行的股票、可转换债券，当日单券交易金额合计超过前一估值日组合净资产 1%且在 500 万元以上的；

③一级市场申购资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券申购金额合计超过前一估值日组合净资产 5%且在 1000 万元以上的；

④二级市场交易资产管理人、资产托管人及其关联方发行的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券交易金额（以面值计算）合计超过前一估值日组合净资产 5%且在 1000 万元以上的；

⑤法律法规、监管规定、自律规则规定的其他重大关联交易。

(2)一般关联交易

本资产管理计划的一般关联交易包括但不限于：

①投资资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的老股东配售（配股配债等公司行为）；

②二级市场交易资产管理人、资产托管人及其关联方发行的股票、可转换债券，当日单券交易金额合计占前一估值日组合净资产 1%以内或不超过 500 万元（含）的；

③一级市场申购资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券申购金额合计占前一估值日组合净资产 5%以内或不超过 1000 万元（含）的；

④二级市场交易资产管理人、资产托管人及其关联方发行的债券（不含可转换债券）、资产证券化产品，当日单券交易金额（以面值计算）合计占前一估值日组合净资产 5%以内或不超过 1000 万元（含）的；

⑤与资产管理人及其关联方、资产托管人进行股票大宗交易、固定收益类投资标的的二级市

场现券询价交易、逆回购交易；

- ⑥逆回购质押券为资产管理人及其关联方、资产托管人发行的证券；
- ⑦开立资产管理人及其关联方、资产托管人的交易席位、期货账户、海外交易账户；
- ⑧投资资产管理人及其关联方、资产托管人发行的公募基金、私募资产管理计划；
- ⑨法律法规、监管规定、自律规则规定的其他关联交易。

3、关联交易审批程序

资产管理人按照其公司制度履行关联交易内部审批程序。对于资产管理人公司制度要求进行内部审批的关联交易，由投资部门就相关关联交易进行审批，风险管理部门负责投资合规性审核，交易管理部门负责交易执行。

4、关联交易特别风险提示

提示资产委托人注意：虽然资产管理人积极遵循资产委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作，但仍可能因资产管理人运用资产管理计划财产从事关联交易被监管部门认为存在重大风险，进而可能影响资产委托人的利益。关联交易涉及的证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响受托财产的投资收益。

对于一般关联交易，资产委托人签署合同即视为同意本资产管理计划从事一般关联交易，资产管理人无需就具体一般关联交易另行取得资产委托人的个别授权和同意，资产委托人主要通过信息披露文件事后了解一般关联交易信息，存在无法及时知悉相关交易的风险。对于重大关联交易，虽然资产管理人将通过合同约定方式就具体重大关联交易向资产委托人征询意见，但仍然存在资产委托人未及时关注到资产管理人意见征询信息，从而影响资产委托人行使相关权利的风险。

5、关联交易的处理

(1) 资产委托人知悉并同意，资产委托人签署本合同即视为同意本资产管理计划从事前述一般关联交易，资产管理人无需就具体一般关联交易另行取得资产委托人的个别授权和同意，但该等一般关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待受托财产，并依据

相关要求履行信息披露义务。

(2) 本资产管理计划参与重大关联交易的，应当逐笔取得资产委托人同意，并依据相关要求履行信息披露义务。

资产管理人通过公告、邮件或征询意见函等方式就具体重大关联交易向资产委托人征询意见。资产委托人应及时关注资产管理人网站公告、邮件或征询意见函等发送情况。资产委托人应在公告、邮件或征询意见函等指定的日期内按指定的形式回复书面意见，具体安排如下：

①资产委托人在公告、邮件或征询意见函等规定期限内未回复意见的，视同该资产委托人同意，资产管理人不再另行通知。

②一个及以上资产委托人明确回复不同意的，本资产管理计划将不进行该笔重大关联交易。

③资产委托人回复意见但意见不明确的，则视为该资产委托人不同意，按照第②条资产委托人不同意的方式处理。

(三) 关于本章节约定的关联方范围、重大关联交易和一般关联交易的划分标准、关联交易审批程序、处理方式等，如法律法规另有规定、监管机构另有要求或资产管理人公司制度发生变更的，资产管理人可以按照法律法规、监管要求和公司制度调整相关内容并按本合同约定告知资产委托人和资产托管人，**资产管理人通过在其网站发布公告等方式告知即视为履行告知义务。”**

2、**删除**原合同“五、资产管理计划的基本情况”“(四) 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、本计划主要投资方向:”中如下内容：

“本计划可以在本合同约定的投资范围内，运用委托财产投资于资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的证券或金融产品或进行其他关联交易，无需资产委托人的个别授权，但法律法规另有规定或本合同另有约定的除外。以上投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，不得存在内幕交易、利用非公开信息交易、操纵市场、利益输送等任何违法违规行为。”

3、**删除**原合同“十一、资产管理计划的投资”“(二) 投资范围及比例”中如下内容：

“本计划可以投资于资产管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，无须资产委托人的个别授权，但法律法规另有规定或本合同另有约定的除外。该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产。”

4、**删除**原合同“附件 3：投资监督事项表”“投资范围”中如下内容：

“本计划可以投资于资产管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，无须资产委托人的个别授权。该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产。”

5、**删除**原合同“附件 2：关联方名单”中的“一、管理人关联方名单：”及项下内容，资产管理人的关联方名单通过资产管理计划年度报告披露。

6、将原合同“二十四、风险揭示”中如下内容：

“（九）关联交易及利益冲突的风险提

资产委托人知悉并同意，在符合合同约定的前提下，本计划可投资于资产管理人、资产托管人及其关联方发行或承销的证券、基金或金融产品，租用资产管理人关联方提供的证券交易单元，或进行其他关联交易，存在关联交易的风险。资产管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，资产委托人认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关风险。

资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理委托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人及其关联方（包括及不限于投资顾问）、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人及其关联方运用固有资金开展投资或者资产管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益

甚至发生损失等。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关风险。”

修改为：

“（九）关联交易及利益冲突风险

1、资产委托人知悉并同意，本计划可按照资产管理合同约定从事关联交易，存在关联交易的风险。资产管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，资产委托人认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关风险。

对于一般关联交易，资产委托人签署合同即视为同意本资产管理计划从事一般关联交易，资产管理人无需就具体一般关联交易另行取得资产委托人的个别授权和同意，资产委托人主要通过信息披露文件事后了解一般关联交易信息，存在无法及时知悉相关交易的风险。对于重大关联交易，虽然资产管理人将通过合同约定方式就具体重大关联交易向资产委托人征询意见，但仍然存在资产委托人未及时关注到资产管理人意见征询信息，从而影响资产委托人行使相关权利的风险。

2、资产委托人知悉，尽管资产管理人承诺谨慎勤勉地管理受托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能会存在一些利益冲突情形，包括但不限于：资产管理人及其关联方、资产托管人开展不同业务类型可能产生的利益冲突；资产管理人及其关联方运用固有资金开展投资或者资产管理人管理的其他资产管理产品（包括本计划投资经理管理的其他资产管理产品）开展投资可能产生的利益冲突；其他可能产生利益冲突的情况等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。资产委托人认可此等情形的存在并自愿承担相关风险。”

二、调整资产管理计划参与退出相关内容

将原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中如下内容：

“（十三）资产管理人禁止以自有资金参与
资产管理人不得以自有资金参与本计划。”

修改为：

“（十三）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出

本合同项下，证券期货经营机构及其子公司不得以自有资金参与其自身或者其子公司管理的集合资产管理计划。”

三、调整资产管理计划和合同期限

将原合同“五、资产管理计划的基本情况”“(五) 资产管理计划的存续期限”中如下内容：

“自本计划成立日起 3 年。如发生本合同约定的计划提前终止或展期情形时，本计划可提前终止或展期。”

修改为：

“本计划存续期至 2026 年 12 月 31 日。如发生本合同约定的资产管理计划提前终止或展期情形时，本计划可提前终止或展期。”

四、调整估值方法

将原合同“二十、资产管理计划财产的估值和会计核算”“(一) 资产管理计划财产的估值”“5.估值方法”中如下内容：

“（1）固定收益证券的估值

1) 交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构（例如中证指数公司）提供的相应品种对应的估值净价估值。

2) 交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价

4) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，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。对银行间市场未上市，且第三方估值机构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，按成本估值。

5) 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。

6) 银行存款、通知存款、质押式回购以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。”

修改为：

“（1）固定收益证券的估值

1) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值；交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

2) 交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

3) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值。

4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

5) 对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用估值技术确定其公允价值。

6) 对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间采用第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值。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。

7) 银行存款、通知存款、质押式回购以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。

8) 上述第三方估值机构提供的估值全价指第三方估值机构直接提供的估值全价或第三方估值机构提供的估值净价加每百元应计利息。

9) 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。”

五、调整管理费率

将原合同“二十一、资产管理计划的费用与税收”“(二) 费用计提方法、计提标准和支付

方法”中如下内容：

“1. 资产管理人的管理费

资产管理计划财产的年管理费率为 0.18%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.18\% \div 365$$

H 为每日应计提的资产管理费

E 为前一日的计划财产净值，首日按本计划成立规模计算

本计划的管理费自本计划成立日（含）起，每日计提，按季支付，由资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，自动在每季初的第 5 个交易日按照指定的账户路径进行资金支付，资产管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的管理费。”

修改为：

“1. 资产管理人的管理费

资产管理计划财产的年管理费率为 0.15%。计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div 365$$

H 为每日应计提的资产管理费

E 为前一日的计划财产净值，首日按本计划成立规模计算

本计划的管理费自本计划成立日（含）起，每日计提，按季支付，由资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，自动在每季初的第 5 个交易日按照指定的账户路径进行资金支付，资产管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。计划终止后，依据清算程序支付尚未支付的管理费。”

六、本补充协议是对原合同的修订和补充，本补充协议与原合同不一致的，以本补充协议为准，本补充协议未尽事宜，按原合同的约定执行。

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、补充协议、风险揭示书等法律文件的，与资产委托人签署纸质版资产管理合同、补充协议、风险揭示书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、补充协议、风险揭示书等法律文件约束。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、补充协议、风险揭示书或其他文书的，即视为资产委托人已签署资产管理合同、补充协议、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质补充协议、纸质风险揭示书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、纸质补充协议或纸质风险揭示书或其他文书。

八、本补充协议一式三份，当事人各执一份，每份具有同等效力。

自然人（签字）：_____ 或 法人或其他组织（盖章）：_____

签署日期: 年 月 日 签署日期: 年 月 日

签署日期： 年 月 日

签署日期： 年 月 日