
**华夏基金-方舟中证 500 指数增强 1 号集合资产管理计划
资产管理合同之补充协议一**

合同编号：光银托管北京 2021JJ0038-补 01

资产委托人：详见签署页

资产管理人（全称）：华夏基金管理有限公司

资产托管人（全称）：中国光大银行股份有限公司北京分行

鉴于资产管理人、资产托管人、资产委托人三方已签署合同编号为光银托管北京 2021JJ0038 的《华夏基金-方舟中证 500 指数增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）。现三方协商一致，对资产管理合同做出调整并签署本补充协议。

一、调整利益冲突及关联交易相关内容

1、将资产管理合同“十四、利益冲突及关联交易”项下如下内容：

“（一）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。

（二）若利益冲突情形对本计划造成实质不利影响的，资产管理人将根据法律法规及监管要求及时以书面方式向资产委托人披露利益冲突情形及处理方式。

（三）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。

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及其重大关联交易情形，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，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。应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

（四）托管人应根据管理人的要求提供关联方名单。”

修改为：

“（一）关联交易及利益冲突情形

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。

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，风险管理部负责投资合规性审核，交易管理部负责交易执行。

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利益输送、内幕交易的风险，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，进而可能影响委托财产的投资收益。

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。

（二）关联交易及利益冲突的应对及处理

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，公平对待委托财产，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。

3、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。

4、本资产管理计划从事关联交易的，资产管理人应事后全面、客观地向资产委托人和资产托管人进行披露。

(三) 关于本章约定的关联方范围、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，无需履行合同变更程序，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。

(四) 托管人应根据管理人要求提供关联方名单。”

2、删除资产管理合同“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、主要投资方向”项下如下内容：

“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。”

3、删除资产管理合同“十一、资产管理计划的投资”“(二) 投资范围及比例”“1、投资范围”项下如下内容：

“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。”

4、将资产管理合同“二十四、风险揭示”“(一)资产管理计划面临的一般风险”“7、关联交易风险”项下如下内容：

“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、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用委托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。该类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，进而可能影响委托财产的投资收益。”

修改为：

“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。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、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用委托财产从事关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。该类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，进而可能影响委托财产的投资收益。”

5、删除资产管理合同“附件1：交易监控合规表”“1、监控范围”项下如下内容：

“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。”

二、调整资产管理计划参与退出相关内容

将资产管理合同“八、资产管理计划的参与、退出和转让”“(十二) 资产管理人自有资金参与”项下如下内容：

“资产管理人以自有资金投资所持的本计划份额，与资产委托人所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

资产管理人的自有资金参与本计划持有期限不得少于六个月。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知资产委托人和资产托管人。

资产管理人的自有资金参与本计划的份额不得超过计划总份额的 20%。资产管理人及其下设机构（含员工）以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超限的，资产管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时完成调整。”

修改为：

“资产管理人有权以自有资金投资本资产管理计划，但资产管理人并无义务以自有资金参与本计划。资产管理人以自有资金投资本资产管理计划的，资产管理人自有资金参与份额不承担任何风险补偿责任，与资产委托人所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

资产管理人以自有资金参与、退出本计划的，应当提前 5 个工作日告知资产委托人和资产托管人，并取得其同意。资产管理人通过公告、邮件或征询意见函等方式就资产管理人自有资金参与、退出事宜向资产委托人、资产托管人征询意见。资产委托人、资产托管人应及时关注资产管理人网站公告、邮件或征询意见函发送情况。资产委托人、资产托管人在公告、邮件或征询意见函等规定期限内未回复意见的，视同资产委托人、资产托管人同意。

资产管理人以自有资金参与本计划的，持有期限不得少于六个月。

资产管理人及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的 50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，资产管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时完成调整。法律法规、监管机构及自律组织另有规定的，从其规定。”

三、调整业绩报酬相关内容

将资产管理合同“二十一、资产管理计划的费用与税收”“(二)费用计提方法、计提标准和支付方式”“3. 资产管理人的业绩报酬”项下如下内容：

“(1) 业绩报酬的提取时间

在符合业绩报酬计提条件时，在资产委托人全部或部分退出本计划、本计划终止以及本计划成立日每个年度对应日的前一交易日，由资产管理人从委托人资产中提取业绩报酬。

(2) 业绩报酬的计提规则

1) 按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。

2) 在投资者退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。

3) 本计划成立日每个年度对应日的前一交易日，管理人对本计划所有份额按委托人每笔认购或参与份额分别计算业绩报酬，并采用份额强制退出的方式支付业绩报酬，其中：

强制退出总金额=应支付的业绩报酬

强制退出总份额=强制退出总金额/强制退出当日计划份额净值

强制退出时，退出费率为 0

4) 即使委托人在退出本计划或计划终止时净值有所下跌，已计提或支付的业绩报酬不退还委托人。

(3) 业绩报酬的计算方法

每份集合计划份额的业绩报酬以该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如无上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，初始募集期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与确认日，下同）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。

$$R = \frac{A-B}{C} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

A 为本次业绩报酬计提日的累计单位净值；

B 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的累计单位净值；

C 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日的单位净值；

D 为该笔份额上一个实际发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（含）与本次业绩报酬计提日的下一工作日的前一自然日（含）间隔天数。

该笔集合计划份额提取的业绩报酬如下：

年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (H _i) 计算方法
$R \leq R_x$	0	$H_i = 0$
$R_x < R$	M1	$H_i = (R - R_x) \times M_1 \times C \times F \times \frac{D}{365}$

其中：F 为该笔提取业绩报酬的份额；年化业绩报酬计提基准 R_x 为 1.5%、提取比例 M1 为 20%。业绩报酬计提基准仅用于约定计提业绩报酬的标准，不构成资产管理人对集合计划收益的承诺或保证。

同一资产委托人退出时，注册登记机构将根据退出份额的持有期限，按照先进先出的原则逐笔计提业绩报酬。如果委托人退出的份额涉及多笔参与份额，则按每笔参与份额分别计算提取业绩报酬。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，资产托管人不进行复核，管理人向托管人发送划款指令，资产托管人仅根据资产管理人指令一次性支付给管理人。”

修改为：

“（1）业绩报酬计提原则

- 1) 按投资者每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。
- 2) 在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日计提业绩报酬。
- 3) 本集合计划分红确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。本计划从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每 6 个月一次。

在投资者退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。

- 4) 在本集合计划分红、投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者在分红时所持有份额、投资者退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余部分不受影响。

5) 如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的,为了准确地体现产品最终的投资业绩表现,则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算,期间业绩表现相应依据在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值与上一次业绩报酬计提日的份额累计净值之间的变化,而期间长度则依据上一次业绩报酬计提日至计划终止日之间的间隔天数。

(2) 业绩报酬计提方法

本集合计划业绩报酬的计提以上一个发生过业绩报酬计提的业绩报酬计提日(以下简称“上一个业绩报酬计提日”)至本次业绩报酬计提日的期间为基准;如投资者该笔份额未发生过业绩报酬计提,募集期参与的,以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日,存续期内参与的,以参与确认为上一个业绩报酬计提日,下同。投资者退出时,按照“先进先出”法,分别计算每一笔参与份额应收的管理人业绩报酬。

1) 期间年化收益率计算

$$\text{期间年化收益率 } R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$$

P1=投资者本次业绩报酬计提日的份额累计净值

P0 =投资者上一个业绩报酬计提日的份额累计净值

P0x=投资者上一个业绩报酬计提日的份额净值

T=投资者上一个业绩报酬计提日(含)到本次业绩报酬计提日(不含)的间隔天数。

如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的,为了准确地体现产品最终的投资业绩表现,则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算,投资者本次业绩报酬计提日的份额累计净值相应采用在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值。

2) 管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

管理人根据投资者每笔参与份额的期间年化收益率,对期间年化收益率超过1.5%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下:

期间年化收	收取	管理人业绩报酬计算公式
-------	----	-------------

益率	比例	
$R \leq 1.5\%$	0	$E=0$
$1.5\% < R$	20%	$E=N \times P0_x \times (R-1.5\%) \times (T \div 365) \times 20\%$

E=该笔参与对应的管理人业绩报酬

N=投资者该笔参与在上一个业绩报酬计提日的份额数

3) 将所有参与笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬 (ΣE)。

$$\Sigma E=E_1+E_2+E_3+\dots+E_n$$

其中的 n 为所对应的参与笔数。

业绩报酬由资产管理人负责计算，资产托管人不进行复核，由资产管理人向资产托管人发送划款指令，资产托管人根据资产管理人指令从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人。”

四、调整收益分配相关内容

将资产管理合同“二十二、资产管理计划的收益分配”项下如下内容：

“本资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及本资产管理的合同约定执行。

(一) 可供分配利润的构成

本资产管理计划可供分配利润为截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

资产管理计划收益包括：计划投资所得红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入（根据产品的实际情况进行相应调整）。因运用计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。

(二) 收益分配原则（根据产品的实际情况进行相应调整）

1、每一计划份额享有同等分配权。

2、本资产管理计划收益分配方式为现金分红。收益分配时发生的银行转账等手续费用由资产委托人自行承担。

3、在符合有关计划收益分配条件的前提下，本计划收益每年最多分配 4 次。

4、若本合同生效不满3个月则可不进行收益分配。

5、收益分配的基准日为可供分配利润的计算截止日。

6、计划收益分配基准日的计划份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值。

7、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（三）收益分配方案的确定与通知

收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

收益分配方案由资产管理人拟定，并由资产托管人复核后，由资产管理人告知资产委托人，并按法律法规及中国证监会或基金业协会的规定履行相应程序（如需）。

（四）收益分配的执行方式

在收益分配方案公布后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向资产托管人发送划款指令，资产托管人仅按照资产管理人的指令及时进行现金收益的划付。”

修改为：

“（一）资产管理计划收益分配方案依据现行法律法规以及合同约定执行。

（二）本计划可供分配利润的构成如下：

本资产管理计划可供分配利润（即“可分配收益”）为截至分红基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

资产管理计划收益包括：计划投资所得红利、股息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收入。因运用计划财产带来的成本或费用的节约计入收益。

（三）收益分配原则

1. 资产管理计划存续期内，每个会计年度11月的最后一个自然日为“分红评价日”，在符合收益分配条件的前提下，管理人决定向投资者分配收益的，则分红评价日为分红基准日，资产管理计划收益每年最多分配【1】次。

2. 资产管理计划收益分配方式为现金分红。

3. 本计划收益分配发放日距离分红基准日（可分配收益计算截止日）不超

过 20 个工作日。

4. 收益分配时，如果符合本合同约定的业绩报酬计提条件的，按合同约定计提和支付业绩报酬。

5. 收益分配后计划份额净值不能低于面值；即分红基准日的计划份额净值减去每单位计划份额收益分配金额后不能低于面值。

5. 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案的确定与通知

1. 计划收益分配方案中应载明截止分红基准日的可供分配利润、计划收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

2. 资产管理计划收益分配方案由管理人拟订，由托管人复核，并由管理人告知投资者，管理人在其网站公告即视为履行告知义务。

（五）收益分配的执行方式

收益分配方案确定后，管理人依据具体方案的规定进行收益分配，托管人依据收益分配方案配合执行管理人收益分配指令。

计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。”

五、调整估值方法相关内容

1. 将资产管理合同“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”“(2) 处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：”项下如下内容：

“B、首次公开发行未上市的股票、债券，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。”

修改为：

“B、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。”

2. 将资产管理合同“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”项下如下内容：

“(3) 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。”

修改为：

“（3）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。”

六、调整越权交易相关内容

将资产管理合同“十八、越权交易的界定”“（二）越权交易的处理程序”中如下内容：

“3、非因资产管理人主观因素导致本计划投资突破本合同投资范围中约定的投资比例的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个交易日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。”

修改为：

“3、非因资产管理人主观因素导致本计划投资突破本合同投资范围、投资比例及限制的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个交易日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。”

七、修改当事人相关信息

1、将资产管理合同“四、当事人及权利义务”“（二）资产管理人”项下如下内容：

“1、资产管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院

法定代表人：杨明辉

联系人：李怡洋

通讯地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座9层

邮政编码：100033

联系电话：88066461”

修改为：

“1、资产管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院

法定代表人：杨明辉

联系人：郭雨桐

通讯地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座9层

邮政编码：100033

联系电话：010-58225160”

2、将资产管理合同“附件4 各方业务人员联系表”项下如下内容：

“

资产管理人	华夏基金	业务人员及其工作职责	办公电话	手机	邮箱
	管理	李怡洋	88066461	18610117142	liyiyang@chinaamc.com
	有限	风险管理部	88066070		zhangsy@chinaamc.com
	公司	指定邮寄地址及邮编		指定传真	指定邮箱
		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座9层			liyiyang@chinaamc.com

”

修改为：

“

	华夏基金	业务人员及其工作职责	办公电话	手机	邮箱
--	------	------------	------	----	----

资 产 管 理 人	管理	郭雨桐	010-58225160	/	guoyt@chinaamc.com
	有限	风险管理部	010-88066070	/	zhangsy@chinaamc.com
	公	指定邮寄地址及邮编		指定传真	指定邮箱
	司	北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 9 层		/	/

”

八、本补充协议作为资产管理合同不可分割的一部分，与资产管理合同具有同等法律效力。资产管理合同终止时，本补充协议自动终止。资产管理合同与本补充协议约定不一致的，以本补充协议的约定为准；本补充协议未予变更的条款，仍按资产管理合同约定执行。

九、如果法律法规、监管规则发布或变更导致资产管理合同及本补充协议不符合法律法规或监管要求的，各方当事人同意应及时对资产管理合同及本补充协议进行相应变更和调整。

十、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。

十一、本补充协议一式叁份，合同当事人各执壹份，每份均具有同等法律效

力。

(以下无正文)

(本页无正文, 为《华夏基金-方舟中证 500 指数增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议》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

法定代表人或授权代表:

签署日期: 年 月 日

资产托管人: 中国光大银行股份有限公司北京分行

法定代表人/负责人或授权代表:

签署日期: 年 月 日