

---

华夏基金-甄盈 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）：中信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-甄盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《华夏基金-甄盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议》（如有）（上述合同及补充协议以下合称“原合同”）。现各方协商一致，对原合同做出调整并签署本补充协议。

**一、调整资产管理计划的开放日**

1、将原合同“五、资产管理计划的基本情况”“(三) 资产管理计划的运作方式”中如下内容：

“定期开放式。本计划每季度可多次开放计划份额的参与和退出，开放日为每周的周二、周三、周五（如遇非工作日，则该日不作为开放日），每个开放日内均可参与或退出，管理人有权决定具体的开放时间及开放期安排等所有事宜。具体开放时间等事宜以资产管理人通告为准，届时资产管理人网站上发布公告或邮件通知委托人即视为履行了告知义务，管理人至少提前 1 个工作日发布公告或邮件通知。”

修改为：

“定期开放式。本计划每季度可多次开放计划份额的参与和退出，开放日为每周的周一、周四、周五（如遇非工作日，则该日不作为开放日且不顺延），每个开放日内均可参与或退出，具体办理时间为开放日内上海证券交易所、深圳证券交易所正常交易日的交易时间。

若中国证监会或基金业协会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，或基于本计划运作需求等，资产管理人有权视情况对前述安排进行相应的调整并通过公告等形式告知资产委托人。资产管理人提前在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。”

---

2、将原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“(二)参与和退出的开放日和时间”中如下内容：

“定期开放式。本计划每季度可多次开放计划份额的参与和退出，开放日为每周的周二、周三与周五（如遇非工作日，则该日不作为开放日），每个开放日内均可参与或退出，开放时间为开放日的 9：00 至 15：00，管理人有权决定具体的开放时间 & 开放期安排等所有事宜。具体开放时间等事宜以资产管理人通告为准，届时资产管理人网站上发布公告或邮件通知委托人即视为履行了告知义务，管理人至少提前 1 个工作日发布公告或邮件通知。

若资产委托人在上述约定的开放期之外申请计划份额退出，则视为违约退出。本计划不允许违约退出。

若中国证监会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，资产管理人将视情况对本条规定进行相应的调整并告知资产委托人。资产管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务”

修改为：

“定期开放式。本计划每季度可多次开放计划份额的参与和退出，开放日为每周的周一、周四、周五（如遇非工作日，则该日不作为开放日且不顺延），每个开放日内均可参与或退出，具体办理时间为开放日内上海证券交易所、深圳证券交易所正常交易日的交易时间。

若资产委托人在上述约定的开放日之外申请计划份额退出，则视为违约退出。本计划不允许违约退出。

若中国证监会或基金业协会有新的规定，或出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，或基于本计划运作需求等，资产管理人有权视情况对前述安排进行相应的调整并通过公告等形式告知资产委托人。资产管理人提前在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。”

## 二、调整资产管理计划的募集相关内容

1、将原合同“六、资产管理计划的募集”“(一)资产管理计划份额的募集期限、募集方式、募集对象”“2、募集方式”中如下内容：

---

“本资产管理计划通过资产管理人的直销柜台进行募集。”

**修改为：**

“本资产管理计划通过资产管理人的直销机构和/或代销机构进行募集。资产管理人可以调整销售机构名单，具体销售机构名单、联系方式以计划说明书约定为准。”

**2、将原合同“六、资产管理计划的募集”中如下内容：**

“（六）本资产管理计划募集结算专用账户

**1、交通银行账户**

户名：华夏基金管理有限公司直销资金专户

账号：110060149018000349649

大额行号：301100000023

开户银行名称：交通银行北京分行营业部

**2、中国建设银行账户**

户名：华夏基金管理有限公司直销资金专户

账号：11001046500056001600

大额行号：105100008038

开户银行名称：中国建设银行北京复兴支行

**3、中国工商银行账户**

户名：华夏基金管理有限公司直销资金专户

账号：0200250119000000892

大额行号：102100025013

开户银行名称：中国工商银行股份有限公司北京复兴门支行

**4、招商银行账户：**

户名：华夏基金管理有限公司直销资金专户

账号：866589001110001

大额行号：308100005264

开户银行名称：招商银行北京分行金融街支行

**5、兴业银行账户：**

---

户名：华夏基金管理有限公司

账号：32660100100373856

大额行号：309100006665

开户银行名称：兴业银行北京分行营业部”

**修改为：**

“（六）本资产管理计划销售机构募集账户信息具体以计划说明书登载为准。”

### **三、调整资产管理计划参与退出相关内容**

#### **1、将原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中如下内容：**

“（一）参与和退出场所

本资产管理计划参与和退出场所为资产管理人的直销机构。”

**修改为：**

“（一）参与和退出场所

本资产管理计划参与和退出场所为资产管理人的直销机构和/或代销机构。

资产管理人可以调整销售机构名单，具体销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的计划说明书为准。”

#### **2、将原合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中如下内容：**

“（十四）资产管理人自有资金参与

如资产管理人以自有资金所持的本计划份额，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%。资产管理人及其附属机构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。

为应对集合资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可

---

的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，资产管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出集合资产管理计划可不受本条规定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。”

**修改为：**

“（十四）证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出

证券期货经营机构及其子公司以自有资金（下称“自有资金”）参与其自身或者其子公司管理的单个集合资产管理计划（下称“该集合资产管理计划”）的，证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与投资者所持的份额享有同等权益、承担同等风险。

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与该集合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%。因资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，应当依照法律法规及本合同的约定及时完成调整。

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出该集合资产管理计划的，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，且持有期限不得少于 6 个月，因资产管理计划规模变动等客观因素导致自有资金参与比例被动超标，自有资金根据法律法规要求退出的情形除外，但资产管理人事后应当通过公告等方式及时告知资产委托人和资产托管人。

证券期货经营机构及其子公司以自有资金在该集合资产管理计划开放期参与、退出本计划的，资产管理人通过公告、邮件或征询意见函等方式就自有资金参与、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。证券期货经营机构及其子公司以自有资金在初始募集期参与该集合资产管理计划的，资产委托人、资产托管人签署本资产管理合同即视为同意该参与事项。

法律法规、监管机构及自律组织另有规定的，从其规定。”

#### **四、调整关联交易相关内容**

1、将原合同“十三、利益冲突及关联交易”中如下内容：

---

“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。

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。

资产委托人同意，资产管理人可以在允许的投资范围内运用委托资产投资于资产托管人、资产管理人及其关联方管理、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。以上投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托资产。本计划从事重大关联交易的，资产管理人应事后及时、全面、客观地向投资者和托管人进行披露。”

**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投资者利益优先的原则、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，进而可能影响投资者的利益。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，资产管理人运用资产管理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，事后及时告知资产委托人和资产托管人。

（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，事后及时告知资产委托人和资产托管人。

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、将原合同“二十三、风险揭示”“(二) 一般风险揭示”“8、关联交易及利益冲突的风险提示”中如下内容：

“8.1 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

---

资产委托人、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。

8.2 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、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：**

“8.1 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发现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。

8.2 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。”

## 五、调整风险揭示相关内容

### 1、在原合同“二十三、风险揭示”“(一) 特殊风险提示”项下新增如下内容：

#### “3、资产管理计划委托募集所涉风险

资产管理人可以委托取得基金销售业务资格的机构募集本计划，代销机构可能存在违法违规地公开宣传资产管理计划、误导投资者购买与其风险承受能力不相符合的产品等行为，代销机构的违法违规行为可能导致投资者合法权益受损。资产委托人同意，因代销机构违法违规、未履行投资者适当性管理义务或者因代销机构自身原因导致投资者损失的，应由代销机构承担相应责任。

#### 4、电子合同签署风险

若资产管理合同等法律文件采用电子形式签署，则存在使用电子信息系统的固有网络风险，如以资产委托人名义发出的电子指令操作均视为其本人/机构的行为，任何人不得以其采用数据电文的形式、或非本人/机构操作等为理由而否定已签署资产管理合同等法律文件的法律效力。资产委托人承诺自愿承担电子签名操作的一切后果，并将安全妥善保管赖以完成电子签名操作的自身身份验证信息。”

### 2、将原合同“二十三、风险揭示”“(二) 一般风险揭示”“1、本金损失风险”中如下内容：

“本计划属于中风险（R3）投资品种，适合专业投资者和风险识别、评估、承受能力评级为 C3 以上的普通投资者，本计划投资者应同时满足合格投资者要求。”

#### 修改为：

“本计划风险等级为中低风险（R2），适合专业投资者以及风险识别、评估、承受能力等级为 C2 及以上的普通投资者，本计划投资者应同时符合合格投资者

---

要求。”

## 六、调整资产管理合同的效力相关内容

将原合同“二十八、资产管理合同的效力”中如下内容：

“（一）资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人的，本合同自资产委托人、资产管理人和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章（签字或加盖名章）之日起成立；资产委托人为自然人的，本合同自资产委托人本人签字或授权的代理人签字、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签章（签字或加盖名章）之日起成立。本合同于本计划成立之日起生效。”

修改为：

“（一）资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。资产委托人为法人或其他组织的，本合同自资产委托人、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成立；资产委托人为自然人的，本合同自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成立。本合同于本计划成立之日起生效。

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、纸质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或纸质风险揭示书或纸质补充协议或其他文书。”

## 七、调整业绩报酬条款

将原合同“二十、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”中如下内容：

“在资产委托人全部或部分退出本资产管理计划或本资产管理计划终止财产清算完毕时，资产管理人按资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额在该期间超额收益的 40%收取业绩报酬。业绩报酬以资产委托人每笔退出份额或本资产管理计划终止时所持资产在该期间的投资增值部分（包含收益分配部分和净值增长部分）高于预先设定的业绩报酬计提基准的部分为基础进行计算，具体计算方法如下：

业绩报酬计提基准	业绩报酬提取比例
6.6%（含）以下	0
6.6%以上	40%

业绩报酬的计算公式如下：

- 1) 如果  $NAV1 \leq NAV0 * (1 + 6.6\% * T / 365)$ ，则业绩报酬为 0；
- 2) 如果  $NAV1 > NAV0 * (1 + 6.6\% * T / 365)$ ，则业绩报酬 =  $S_i \times NAV0 \times [(NAV1 - NAV0) / NAV0 - 6.6\% * T / 365] \times 40\%$

其中：

$S_i$  为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有的份额

$NAV0$  为资产委托人每笔退出份额或计划终止时持有份额所对应的认购或参与时的计划份额净值

$NAV1$  为退出受理日或计划终止日的计划份额净值加上持有期每份额累计派发现金红利

$T$  为资产委托人每笔退出份额或计划终止时所持有份额自资产管理计划成立日或参与确认日起始的持有天数

业绩报酬由注册登记机构负责计算，资产管理人向资产托管人发送划款指令，由资产托管人从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人，托管人无需复核。”

修改为：

“本计划不收取业绩报酬。”

---

#### 八、修改资产管理人信息

将原合同“四、当事人及权利义务”“(二) 资产管理人”中如下内容：

“1、资产管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：杨明辉

联系人：朱旻昊

联系电话：010-88066052”

修改为：

“1、资产管理人概况

名称：华夏基金管理有限公司

注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

法定代表人：张佑君

联系人：朱旻昊

联系电话：010-88066052”。

#### 九、修改资产管理计划的基本情况

1、将原合同“五、资产管理计划的基本情况”“(二) 资产管理计划的类别”中如下内容：

“混合类集合资产管理计划。”

修改为：

“固定收益类集合资产管理计划。”

2、将原合同“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”中如下内容：

“1、本计划的投资目标：

在严格控制风险的前提下，追求委托财产的稳健增值。

---

## 2、主要投资方向：

(1) 权益类资产：在上海、深圳证券交易所及香港联交所上市交易的股票（含科创板股票），含新股申购（含科创板新股），股票型证券投资基金；

(2) 货币市场工具及固定收益类资产：债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可交换债券（含非公开发行）、可转换债券以及其他债券）、资产支持证券、债券型证券投资基金、债券逆回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场基金；

(3) 金融衍生品类资产：股指期货。

特别提示：本计划可参与证券回购。

## 3、投资比例：

(1) 本资产管理计划的总资产不得超过净资产的 140%。

(2) 本资产管理计划投资于固定收益类资产市值、权益类资产市值、商品衍生品类资产市值占计划资产总值的比例均低于 80%。

(3) 本资产管理计划投资于权益类资产市值、商品衍生品类资产市值占计划资产总值的比例均不超过 30%。在任何交易日日终，权益类资产净风险敞口（持有的股指期货合约价值与股票及偏股类基金资产的市值轧差计算），合计为本资产管理计划资产净值的 0%~30%。

(4) 计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 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、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种除外。前述同一资产指的是单一证券或单一基金。

(5) 不得主动投资分级基金 B 类份额（简称分级 B）。

(6) 不得投资于 ST、\*ST、SST、S\*ST 股票。

(7) 本计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。

(8) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

(9) 本计划投资于可转债、可交换债的市值不得超过计划资产总值的 20%。

---

(10) 本资产管理计划持有信用债（须有主体评级或债项评级）的主体评级或债项评级在 AA+级（含）以上。同业存单发行体外部主体评级或外部债项评级不低于 AA+；银行存款类资产，存款银行应满足外部主体评级 AA+（含）以上。资产证券化产品，优先档的公开债项评级应为 AA+级（含）以上。

本计划评级机构不含中债资信评估有限责任公司，评级结果取最新。

(11) 本计划投资于单一上市公司发行的股票不超过该上市公司总股本的 4.99%。

(12) 本计划投资于单一信用债发行人发行的债券不超过产品资产净值的 25%。

(13) 本计划不投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

(14) 法律法规、中国证监会以及资产管理合同规定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，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十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。如法律法规或监管机构以后允许本产品投资的其他产品，资产委托人、资产管理人、资产托管人三方签署补充协议后，可以将其纳入投资范围。委托人确认本计划可以投资于资产管理人管理的证券投资基金。

4、产品风险等级：本计划属于中风险（R3）资产管理产品。”

**修改为：**

“1、投资目标

在合理控制投资风险的前提下，力争实现受托财产的稳健增值。

2、主要投资方向

(1) 固定收益类资产：国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、可转债、可交换债、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款等）、同业存单等。

(2) 权益类资产：依法发行、上市的股票（含新股认购及定向增发）。



---

(3) 期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货、股指期权、股票期权等证券期货交易所交易的投资品种等。

(4) 公募基金：股票型基金、混合型基金、债券型基金、商品基金、QDII 基金、REITs 基金、货币市场基金等。

(5) 债券正回购、债券逆回购、银行活期存款。

(6) 法律法规或中国证监会允许投资的其它金融工具。

**特别提示：本计划可投资于债券回购。投资者已充分理解并接受本计划投资债券回购所附带的信用风险、流动性风险、利率风险、交易对手风险等风险。**

### 3、投资比例和限制

(1) 本计划投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%；投资者同意，在本计划存续期间，为规避特定风险，本计划投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于资产管理计划总资产的 80%。本条所述的“特定风险”指因市场剧烈波动、特定类别资产风险收益特征发生重大变化等因素对本资产管理计划产生不利影响的风险。

(2) 本计划总资产占净资产的比例不得超过 140%。本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过资产管理计划净资产 50%的，本计划的总资产不得超过净资产的 120%，资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制。

(3) 本计划投资于资产管理产品的，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。

(4) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 10%；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。

(5) 本计划每季度多次开放的，主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的 20%。

(6) 本计划在其开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不得低于本计划资产净值的 10%。

---

(7) 本计划不得投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

(8) 本计划投资于单一上市公司发行的股票不超过该上市公司总股本的 4.99%。

(9) 本计划投资单一信用债券集中度不超过本计划资产净值的 10%，投资单一主体发行的信用债比例不超过本计划资产净值的 50%。

(10) 本计划所投资债券的债项评级不低于 AA+，其中短期债项评级不低于 A-1，可转债、可交换债债项评级不得低于 AA-；无债项评级的参考主体评级；评级机构以管理人认定为准。

(11) 本计划不得投资于收益凭证在内的非标资产；不得投资于资产支持证券劣后级、资产支持票据劣后级；不得主动投资分级基金 B 类份额（简称分级 B）；不得投资于 ST、\*ST、SST、S\*ST 股票。

(12) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外因素导致本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定或者合同约定的投资比例及限制的，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 个交易日内调整至符合要求。法律法规另有规定的，从其规定。

#### 4、产品风险等级

本计划风险等级为中低风险（R2），适合专业投资者以及风险识别、评估、承受能力等级为 C2 及以上的普通投资者，本计划投资者应同时符合合格投资者要求。

投资者承诺并确认自身风险承受能力与本计划风险等级相匹配，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。”

### 十、修改资产管理计划的投资

#### 1、将原合同“十二、资产管理计划的投资”中如下内容：

##### “（一）投资目标

在严格控制风险的前提下，追求委托财产的稳健增值。

##### （二）投资范围

1、本计划主要投资于法律法规和监管机构允许投资的以下几类资产：

---

(1) 权益类资产：在上海、深圳证券交易所及香港联交所上市交易的股票（含科创板股票），含新股申购（含科创板新股），股票型证券投资基金；

(2) 货币市场工具及固定收益类资产：债券（包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可交换债券（含非公开发行）、可转换债券以及其他债券）、资产支持证券、债券型证券投资基金、债券逆回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场基金；

(3) 金融衍生品类资产：股指期货。

特别提示：本计划可参与证券回购。

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、基金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。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。

本资产管理计划为混合型计划，投资于权益类资产、固定收益类资产、商品衍生品类资产的比例均低于本计划总资产的 80%。

### （三）投资策略

本组合的投资目标为通过积极的主动研究，在严格控制风险，承担一定回撤的基础上，力争为投资者提供长期稳健增值，实现绝对收益目标。具体投资目标（收益率和回撤控制）的实现，将通过战略资产配置和战术资产配置，根据周期阶段，做股债仓位管理；并通过股票和债券投资，获取确定性收益。

#### 1、战略资产配置

战略资产配置的目标是辅助投资经理对超长期限投资组合的资产配置进行管理，在一定程度上管理长期收益率不达预期的风险。战略资产配置立足三年甚至更长的周期，核心聚焦在对经济增长速度和结构的长期预测，长期趋势对资产配置有重要影响。

#### 2、战术资产配置

将战略性资产配置结果和华夏基金对各类资产收益的主观预期结合起来，使用 MVP 模型和货币信用周期模型进行战术性资产调整，得到优化调整后的资产配

---

置权重，捕捉中短期投资机会，力争为组合提供更多超额收益来源。

基于此，投资团队将投资时钟的分析框架进行完善，形成基于宏观（Macro-economy）、估值（Value）、政策（Policy）的 MVP 分析模型。组合将在战略资产配置的基础上作战术调整，给出优化的资产配置比例，为组合提供更多超额收益来源。

### 3、股票投资策略

#### （1）板块轮动行业配置

在市场行情发展过程中，市场上的领涨龙头从一个板块转为另外一个板块，不同的板块在市场行情的不同阶段各自带领大盘上涨的现象；行业轮动是板块轮动最常讨论的一种，也是主题等其他板块轮动的基础。

a、从行业层面寻找影响行业选择的因子

b、基于不同市场环境动态调整

#### （2）个股选择

a、首先在选股过程中，有众多有效的选股因子。

盈利能力：盈利在复苏期基本失效，而在衰退期表现突出。主要是由于衰退时收益率曲线剧烈下降，因此具备确切盈利预期的个股具备较好的防御性。

成长能力：永恒的主题，但可预测性不高。

杠杆率：滞涨和衰退期，由于股票市场在经历了一轮泡沫后开始下跌，企业盈利也随之恶化，因此市场更加倾向投资自有资本充裕，负债结构相对合理的个股。而复苏期，企业提高负债用于扩大生产，投资者不介意承担较高的债务风险。

流动性：投资者对高换手的个股一贯慎重。

技术指标：在复苏期，由于经济加速发展，股票市场进入繁荣阶段，股价反转因素值得关注。

市值规模：在复苏期由于经济的快速发展带动股市进入繁荣时期，因此具有高弹性的小市值股票往往受到追捧。而在过热期，出于对通货膨胀的担忧，投资者的保值需求相当强烈，周期性价值股受到关注。

b、绝大多数选股因子都具有较大的波动性，甚至具备一定的周期性，因此必须动态调整选股因子。

c、宏观经济周期的时间顺序，阶段之间的领先、滞后时间以及市场变动的

---

规模都不是简单重复的，每个因子的风格转换都是一个缓慢而不断变化的过程，因此必须不断地进行因子风格轮动。历史数据表明过热期表现最突出的是估值、成长、盈利等因子，但近年效果不好；类似的，之前的滞涨期估值和盈利因子普遍失效，而成长因子反而具有较好的效果。

#### 4、债券投资策略

债券投资的三大原则为低波动、多策略、稳定回报。收益来自于利息收益和价差带来的损益。市场利率的变动使债券的交易价格随之涨跌，在将组合按市价对所持有的债券进行估值时，有可能出现盈利或亏损的情况。

债券投资将遵循“稳定回报”的理念，力争在市场利率上升与下降的环境下都带来绝对收益回报，从而实现资产保值，并持续性地以稳定正回报的方式实现增值。重点考虑因素如下：

##### （1）“核心-交易”的投资模式

根据对未来债券市场的判断，债券组合采用战略性配置与战术性交易结合的方法，将核心资产重点持有，结合市场上出现的机会进行战术配置调整或回购放大操作。在具体操作中，根据具体的市场情况和新品种发行的情况，控制并调整配置过程。

（2）灵活运用多种投资策略：债券类属配置策略、久期偏离策略、信用利差策略、收益率曲线骑乘策略、融资放大策略、资产支持证券投资策略等。”

#### 修改为：

##### “（一）投资目标

在合理控制投资风险的前提下，力争实现受托财产的稳健增值。

##### （二）投资范围

（1）固定收益类资产：国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、可转债、可交换债、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款等）、同业存单等。

（2）权益类资产：依法发行、上市的股票（含新股认购及定向增发）。

（3）期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货、股指期权、股票期权等证券期货交易所交易的投资品种等。

---

(4) 公募基金：股票型基金、混合型基金、债券型基金、商品基金、QDII 基金、REITs 基金、货币市场基金等。

(5) 债券正回购、债券逆回购、银行活期存款。

(6) 法律法规或中国证监会允许投资的其它金融工具。

**特别提示：本计划可投资于债券回购。投资者已充分理解并接受本计划投资债券回购所附带的信用风险、流动性风险、利率风险、交易对手风险等风险。**

### (三) 投资策略

#### 1、资产配置策略

资产管理人将密切关注国内外宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及国内外资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在本合同约定的投资范围内，确定各类型资产的具体配置比例。

#### 2、债券投资策略

本计划在债券投资方面，通过深入分析宏观经济数据、货币政策和利率变化趋势以及不同类属的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以久期控制和结构分布策略为主，以收益率曲线策略、利差策略等为辅，力争构造能够提供稳定收益的债券和货币市场工具组合。

#### 3、股票投资策略

本计划采用定量分析和定性分析相结合的方法甄选拟投资标的，并通过对拟投资标的的估值考量，结合其流动性分析，确定股票组合，集中投资并动态监测和调整，以保证最终股票组合的质量。”

### 2、将原合同“十二、资产管理计划的投资”中如下内容：

#### “(五) 投资限制

1、本资产管理计划的总资产不得超过净资产的 140%。

2、本资产管理计划投资于固定收益类资产市值、权益类资产市值、商品衍生品类资产市值占计划资产总值的比例均低于 80%。

3、本资产管理计划投资于权益类资产市值、商品衍生品类资产市值占计划资产总值的比例均不超过 30%。在任何交易日日终，权益类资产净风险敞口（持

---

有的股指期货合约价值与股票及偏股类基金资产的市值轧差计算), 合计为本资产管理计划资产净值的 0%~30%。

4、计划投资于同一资产的资金, 不得超过该计划资产净值的 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、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种除外。前述同一资产指的是单一证券或单一基金。

5、不得主动投资分级基金 B 类份额 (简称分级 B)。

6、不得投资于 ST、\*ST、SST、S\*ST 股票。

7、本计划开放退出期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于计划资产净值的 10%。

8、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

9、本计划投资于可转债、可交换债的市值不得超过计划资产总值的 20%。

10、本资产管理计划持有信用债 (须有主体评级或债项评级) 的主体评级或债项评级在 AA+级 (含) 以上。同业存单发行体外部主体评级或外部债项评级不低于 AA+; 银行存款类资产, 存款银行应满足外部主体评级 AA+ (含) 以上。资产证券化产品, 优先档的公开债项评级应为 AA+级 (含) 以上。

本计划评级机构不含中债资信评估有限责任公司, 评级结果取最新。

11、本计划投资于单一上市公司发行的股票不超过该上市公司总股本的 4.99%。

12、本计划投资于单一信用债发行人发行的债券不超过产品资产净值的 25%。

13、本计划不投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

14、法律法规、中国证监会以及资产管理合同规定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的, 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十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的, 资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构

---

和证券投资基金业协会报告。如法律法规或监管机构以后允许本产品投资的其他产品，资产委托人、资产管理人、资产托管人三方签署补充协议后，可以将其纳入投资范围。委托人确认本计划可以投资于资产管理人管理的证券投资基金。”

**修改为：**

**“（五）投资比例和限制**

（1）本计划投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%；投资者同意，在本计划存续期间，为规避特定风险，本计划投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于资产管理计划总资产的 80%。本条所述的“特定风险”指因市场剧烈波动、特定类别资产风险收益特征发生重大变化等因素对本资产管理计划产生不利影响的风险。

（2）本计划总资产占净资产的比例不得超过 140%。本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过资产管理计划净资产 50%的，本计划的总资产不得超过净资产的 120%，资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制。

（3）本计划投资于资产管理产品的，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。

（4）本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 10%；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。

（5）本计划每季度多次开放的，主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的 20%。

（6）本计划在其开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不得低于本计划资产净值的 10%。

（7）本计划不得投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

（8）本计划投资于单一上市公司发行的股票不超过该上市公司总股本的 4.99%。

（9）本计划投资单一信用债券集中度不超过本计划资产净值的 10%，投资



---

单一主体发行的信用债比例不超过本计划资产净值的 50%。

(10) 本计划所投资债券的债项评级不低于 AA+，其中短期债项评级不低于 A-1，可转债、可交换债债项评级不得低于 AA-；无债项评级的参考主体评级；评级机构以管理人认定为准。

(11) 本计划不得投资于收益凭证在内的非标资产；不得投资于资产支持证券劣后级、资产支持票据劣后级；不得主动投资分级基金 B 类份额（简称分级 B）；不得投资于 ST、\*ST、SST、S\*ST 股票。

(12) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外因素导致本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定或者合同约定的投资比例及限制的，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 个交易日内调整至符合要求。法律法规另有规定的，从其规定。”

### 3、删除原合同“十二、资产管理计划的投资”中如下内容：

#### “（六）预警及止损条款

为保护资产委托人的利益，控制本计划财产损失风险，设置预警止损线，如下：

本计划预警线为计划份额净值 0.85 元，止损线为计划份额净值 0.80 元。

本计划存续期内，任一交易日（T 日）日终，计划份额净值触及 0.85 预警线或以下时，资产管理人应自 T+1 日起 10 个工作日内将本计划权益类与衍生品类资产的仓位调降至净资产 20%（含）以下。若触发预警机制后的任一交易日终本计划份额净值高于 0.85，则自该估值日的下一交易日起上述限制取消。

本计划存续期内，任一交易日（T 日）日终，计划份额净值触及 0.80 止损线或低于止损线，自 T+1 日起 10 个工作日内将本计划权益类与衍生品类资产的仓位调降至 0%。若触发预警机制后的任一交易日终本计划净值高于 0.80，则自该估值日的下一交易日起上述限制取消。”

### 4、将原合同“十二、资产管理计划的投资”“（九）风险收益特征”中如下内容：

---

“本计划属于中风险（R3）资产管理产品，适合专业投资者以及风险识别、评估、承受能力等级为 C3 及以上的普通投资者，本计划投资者应同时符合合格投资者要求。”

**修改为：**

“本计划属于中低风险（R2）资产管理产品，适合专业投资者以及风险识别、评估、承受能力等级为 C2 及以上的普通投资者，本计划投资者应同时符合合格投资者要求。”

#### **十一、修改越权交易相关内容**

##### **1、将原合同“十八、越权交易”“(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（包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素）导致本计划投资突破投资比例和投资限制的，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 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（包括但不限于证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素）导致本计划投资突破投资比例和投资限制的，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。”

##### **2、将原合同“十八、越权交易”“(三)资产托管人对资产管理人的投资监督”中如下内容：**

“1、资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权，资产托管人承诺对本计划如下投资事项进行监督，如本合同其他章节的约定与本款约定不一致的，资产托管人对资产管理人投资行为的监督内容与标准均以本款约定为准：

（1）权益类资产：在上海、深圳证券交易所及香港联交所上市交易的股票（含科创板股票），含新股申购（含科创板新股），股票型证券投资基金；

---

(2) 货币市场工具及固定收益类资产：债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、可交换债券(含非公开发行)、可转换债券以及其他债券、资产支持证券、债券型证券投资基金、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场基金；

(3) 金融衍生品类资产：股指期货。

## 2、对投资限制的监督

资产托管人根据本合同的约定仅对投资限制行为中的下述条款进行监督：

(1) 本资产管理计划的总资产不得超过净资产的 140%。

(2) 本资产管理计划投资于固定收益类资产市值、权益类资产市值、商品衍生品类资产市值占计划资产总值的比例均低于 80%。

(3) 本资产管理计划投资于权益类资产市值、商品衍生品类资产市值占计划资产总值的比例均不超过 30%。在任何交易日日终，权益类资产净风险敞口(持有的股指期货合约价值与股票及偏股类基金资产的市值轧差计算)，合计为本资产管理计划资产净值的 0%~30%。

(4) 计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 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、政策性金融债等中国证监会认可的投资品种除外。前述同一资产指的是单一证券或单一基金。

(5) 不得主动投资分级基金 B 类份额(简称分级 B)。

(6) 不得投资于 ST、\*ST、SST、S\*ST 股票。

(7) 本计划开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。

(8) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。

(9) 本计划投资于可转债、可交换债的市值不得超过计划资产总值的 20%。

(10) 本资产管理计划持有信用债(须有主体评级或债项评级)的主体评级或债项评级在 AA+级(含)以上。同业存单发行体外部主体评级或外部债项评级不低于 AA+；银行存款类资产，存款银行应满足外部主体评级 AA+(含)以上。

---

资产证券化产品，优先档的公开债项评级应为 AA+级（含）以上。

本计划评级机构不含中债资信评估有限责任公司，评级结果取最新。

（11）本计划投资于单一上市公司发行的股票不超过该上市公司总股本的 4.99%。

（12）本计划投资于单一信用债发行人发行的债券不超过产品资产净值的 25%。

（13）本计划不投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

（14）法律法规、中国证监会以及资产管理合同规定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，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十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。如法律法规或监管机构以后允许本产品投资的其他产品，资产委托人、资产管理人、资产托管人三方签署补充协议后，可以将其纳入投资范围。委托人确认本计划可以投资于资产管理人管理的证券投资基金。”

**修改为：**

“资产托管人对资产管理人的投资行为行使监督权，资产托管人承诺对本章约定的投资事项进行监督，如本合同其他章节的约定与本章约定不一致的，资产托管人对资产管理人投资行为的监督内容与标准均以本章约定为准。

#### 1、资产托管人对投资范围的监督

（1）固定收益类资产：国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、短期融资券、超短期融资券、可转债、可交换债、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、资产支持票据、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款等）、同业存单等。

（2）权益类资产：依法发行、上市的股票（含新股认购及定向增发）。

（3）期货和衍生品类资产：国债期货、股指期货、股指期权、股票期权等证券期货交易所交易的投资品种等。

（4）公募基金：股票型基金、混合型基金、债券型基金、商品基金、QDII

---

基金、REITs 基金、货币市场基金等。

(5) 债券正回购、债券逆回购、银行活期存款。

(6) 法律法规或中国证监会允许投资的其它金融工具。

## 2、资产托管人对投资比例和限制的监督

(1) 本计划投资于固定收益类资产的比例不低于资产管理计划总资产的 80%；投资者同意，在本计划存续期间，为规避特定风险，本计划投资于固定收益类资产的比例可以低于资产管理计划总资产的 80%，但不得持续 6 个月低于资产管理计划总资产的 80%。本条所述的“特定风险”指因市场剧烈波动、特定类别资产风险收益特征发生重大变化等因素对本资产管理计划产生不利影响的风险。

(2) 本计划总资产占净资产的比例不得超过 140%。本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过资产管理计划净资产 50%的，本计划的总资产不得超过净资产的 120%，资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制。

(3) 本计划投资于资产管理产品的，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。

(4) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 10%；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。

(5) 本计划每季度多次开放的，主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本计划资产净值的 20%。

(6) 本计划在其开放退出期内，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不得低于本计划资产净值的 10%。

(7) 本计划不得投资于除公募基金以外的其他资产管理产品。

(8) 本计划投资于单一上市公司发行的股票不超过该上市公司总股本的 4.99%。

(9) 本计划投资单一信用债券集中度不超过本计划资产净值的 10%，投资单一主体发行的信用债比例不超过本计划资产净值的 50%。

---

(10) 本计划所投资债券的债项评级不低于 AA+，其中短期债项评级不低于 A-1，可转债、可交换债债项评级不得低于 AA-；无债项评级的参考主体评级；评级机构以管理人认定为准。

(11) 本计划不得投资于收益凭证在内的非标资产；不得投资于资产支持证券劣后级、资产支持票据劣后级；不得主动投资分级基金 B 类份额（简称分级 B）；不得投资于 ST、\*ST、SST、S\*ST 股票。

(12) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外因素导致本计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定或者合同约定的投资比例及限制的，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 个交易日内调整至符合要求。法律法规另有规定的，从其规定。”

## 十二、调整资产管理计划的投资经理

将原合同“十四、投资经理的制定与变更”“(一) 投资经理的指定”中如下内容：

### “1、投资经理的指定

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定，且本投资经理与资产管理人所管理的证券投资基金的基金经理不相互兼任。

### 2、本计划投资经理

本资产管理计划股票投资经理为孙彬先生、张超先生，债券投资经理为周欣先生。投资经理简历如下：

(1) 孙彬，2007 年 7 月加入华夏基金管理有限公司，现任华夏基金党委委员、总经理助理、机构权益投资部行政负责人、资产配置部行政负责人、机构投委会主任委员、投资经理，负责机构投资业务，分管资产配置部、机构权益投资部和机构债券投资部。曾任行业研究员、投资研究部总经理助理、基金经理助理、投资研究部副总监、投资研究部总监、股票投资部行政负责人、华夏大盘精选证券投资基金、华夏行业精选证券投资基金基金经理等。

(2) 张超，数学学士、金融学硕士。2011 年 7 月至今就职于华夏基金管理有限公司机构权益投资部。历任研究员、投资经理助理、投资经理。研究员期间覆盖

---

地产、周期、公用事业、TMT 等行业。张超擅长综合股票和固收+组合管理，宏观依托配置策略的整体判断，中观配置策略+行业景气比较决定行业配置，微观自下而上公司基本面研究决定个股买卖。

(3) 周欣，2011 年加入华夏基金，中央财经大学金融学硕士，历任机构产品部组合经理、机构债券投资部投资经理助理、非标固定收益类资产研究员。现任机构债券投资部债券投资经理、非标投资委员会委员、非标投资部行政负责人，投资风格稳健，管理组合类型涵盖全国社保、企业年金、职业年金及专户理财。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。”

**修改为：**

**“1、投资经理的指定**

资产管理计划投资经理由资产管理人负责指定。

**2、本计划投资经理**

本资产管理计划投资经理为周欣先生。投资经理简历如下：

周欣，2011 年加入华夏基金，中央财经大学金融学硕士，历任机构产品部组合经理、机构债券投资部投资经理助理、非标固定收益类资产研究员。现任机构债券投资部债券投资经理、非标投资委员会委员、非标投资部行政负责人，投资风格稳健，管理组合类型涵盖全国社保、企业年金、职业年金及专户理财。

本计划投资经理已经依法取得基金从业资格，具有三年以上投资管理、投资研究、投资咨询等相关业务经验，具备良好的诚信记录和职业操守，且最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。”

**十三、修改估值方法**

1、将原合同“十九、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”“(1) 证券交易所上市的有价证券的估值”中如下内容：

“B、对于在交易所上市交易的固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；

---

C、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。

D、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。

E、对于部分特殊证券（第三方估值机构未提供价格的，基本面发生重大变化或债券发生重大违约等因素导致价格不公允的证券），资产管理人与资产托管人协商一致后，采用估值技术确定公允价值。”

**修改为：**

“B、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。

C、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。

D、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。

E、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。

F、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。

G、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。”

## 2、将原合同“十九、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：”中如下内容：

“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，采用估值技术确定公允价值。”

3、将原合同“十九、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：

“(3) 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。”

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。

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。

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。

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。”

#### 十四、调整资产管理计划存续期与合同期限

1、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：

“本计划存续期为 60 个月，自计划成立日起算；本计划成立日以管理人官

---

网发布的公告为准。”

**修改为：**

“本计划存续期为 120 个月，自计划成立日起算；本计划成立日以管理人官网发布的公告为准。”

**2、将原合同“二十六、资产管理合同的效力”中如下内容：**

“（三）本合同有效期为：本计划存续期为 60 个月，自计划成立日起算。”

**修改为：**

“（三）本合同有效期为 120 个月。”

十五、本补充协议作为原合同不可分割的一部分，与原合同具有同等法律效力。本补充协议与原合同约定不一致的，以本补充协议的约定为准；本补充协议未予变更的条款，仍按原合同约定执行。

十六、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。

十七、本补充协议一式叁份，各方当事人各执壹份，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-甄盈 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：中信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