

关于东方红添利 11 号集合资产管理计划项下资产管理合同 条款变更事项の確認函

中国农业银行股份有限公司：

根据《中国人民银行 中国银行保险监督管理委员会 中国证券监督管理委员会 国家外汇管理局 关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“指导意见”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“管理办法”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“运作规定”）及《东方红添利 11 号集合资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的约定，我司拟对《资产管理合同》的相关条款进行变更，集合计划说明书的相关内容一并调整，风险揭示书、托管协议本次不涉及变更。

我司将根据《合同法》、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》的相关规定及《资产管理合同》的约定进行本次合同变更，相关条款具体修改和流程如下：

（一）《资产管理合同》的修改内容

序号	位置	原条款	现条款
1	《资产管理合同》 “十七、投资限制及禁止行为”中 “（一）投资限制”	为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为： 1、集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；	为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为： 1、集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；

序号	位置	原条款	现条款
		2、集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的180%，中国证监会另有规定的除外； 3、本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的25%；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（“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%”由管理人自行监控）； 4、本计划投资于单一证券投资基金不得超过本计划资产净值的20%； 5、本计划持有的单只债券市值不得超过计划资产净值的10%，投资于单一债券的数量不得超过该债券发行规模的20%（利率债除外）； 6、投资银行存款、同业存单，交易对手应该在本计划白名单范围内，白名单由管理人负责建立及不定期维护，生效后的	2、集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的180%，中国证监会另有规定的除外； 3、本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的25%；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（“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%”由管理人自行监控）； 4、本计划投资于单一证券投资基金不得超过本计划资产净值的20%； 5、本计划持有的单只债券市值不得超过计划资产净值的10%，投资于单一债券的数量不得超过该债券发行规模的20%； 6、投资银行存款、同业存单，交易对手应该在本计划白名单范围内，白名单由管理人负责建立及不定期维护，生效后的

序号	位置	原条款	现条款
		最新名单应邮件发送托管人及委托人。 7、同业存款发行主体的国内机构评级不低于 AA； 8、投资的可转债、可交债的主体评级不得低于 AA-；投资于主体评级为 AA-的可转债、可交债的比例合计不超过集合计划资产总值的 20%； 9、本计划应投资于银行间市场及交易所上市的资产支持证券优先级、银行间市场上市的资产支持票据优先级；其外部债项评级应为 AAA 及以上且主体评级（原始权益人）应为 AA+（含）以上，且剩余期限不超过 3 年；其底层资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产。（“其底层资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产”由管理人自行监控） 10、除本合同另有约定外，本计划投资的全部信用债券及其他固定收益类资产主体评级应在 AA（含）以上；本计划持有期间，若其信用等级下降、不再符合该投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以	最新名单应邮件发送托管人及委托人。 7、同业存款发行主体的国内机构评级不低于 AA； 8、可转债、可交债债项评级不低于 AA，没有债项评级的，以主体评级为准；投资时可转债转股溢价率不超过 50%，当可转债纯债溢价率不超过 10% 时，转股溢价率不超过 100%。（其中“投资时可转债转股溢价率不超过 50%，当可转债纯债溢价率不超过 10% 时，转股溢价率不超过 100%”由管理人自行监控。） 9、本计划应投资于银行间市场及交易所上市的资产支持证券优先级、银行间市场上市的资产支持票据优先级；其外部债项评级应为 AAA 及以上且主体评级（原始权益人）应为 AA+（含）以上，且剩余期限不超过 3 年；其底层资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产。（“其底层资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产”由管理人自行监控） 10、除本合同另有约定外，本计划投资的全部信用债券及其

序号	位置	原条款	现条款
		全部卖出（本限制不包含可转换债和可交换债）； 11、评级机构不包括中债资信； 12、投资国债期货必须以套期保值为目的，且只能做空，卖出国债期货合约价值总额不超过集合计划持有的固定收益类资产总市值的 100%（固定收益类资产是指：国债、地方政府债、央行票据、金融债、公司债（含非公开发行公司债）、企业债、可转换债券（含私募可转换债）、可交换债（含私募可交换债）、可分离交易债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、债券型基金、股票型及混合型分级基金的优先级份额、银行间市场及交易所上市的资产支持证券、银行间市场上市的资产支持票据、非公开定向债务融资工具，以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等）； 13、本计划不得投资于中小企业私募债、创业板定向债； 14、本计划投资股票型及混合型分级基金的优先级份额、债	他固定收益类资产主体评级应在 AA（含）以上；本计划持有期间，若其信用等级下降、不再符合该投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出（本限制不包含可转换债和可交换债）； 11、评级机构不包括中债资信； 12、投资国债期货必须以套期保值为目的，且只能做空，卖出国债期货合约价值总额不超过集合计划持有的固定收益类资产总市值的 100%（固定收益类资产是指：国债、地方政府债、央行票据、金融债、公司债（含非公开发行公司债）、企业债、可转换债券（含私募可转换债）、可交换债（含私募可交换债）、可分离交易债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、债券型基金、股票型及混合型分级基金的优先级份额、银行间市场及交易所上市的资产支持证券、银行间市场上市的资产支持票据、非公开定向债务融资工具，以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等）；

序号	位置	原条款	现条款
		券型基金合计不得超过计划资产净值的 20%； 15、本集合计划禁止投资于法律法规规定的非标准化资产； 16、法律法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。	13、本计划不得投资于中小企业私募债、创业板定向债； 14、本计划投资股票型及混合型分级基金的优先级份额、债券型基金合计不得超过计划资产净值的 20%； 15、本集合计划禁止投资于法律法规规定的非标准化资产； 16、法律法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。 投资监督事项的制定和调整应为托管人投资监督系统的开发和测试预留合理必要时间。

（二）具体流程

1. 与贵行沟通，并邮寄书面确认函。
2. 收到贵行的确认函回执后，我司将在公司网站公告《资产管理合同》条款变更事宜，并按《资产管理合同》的约定在公告后 5 个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向委托人发送合同变更征询意见函。委托人不同意变更的，应在征询意见函发出后的最近一个开放期或临时开放期内（以下统称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；委托人未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为委托人同意合同变更。委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

委托人不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在合同

变更生效日次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）。

委托人同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后变更《资产管理合同》的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

3. 合同变更于指定开放期结束后的第一个工作日起生效，公告内容即成为《资产管理合同》组成部分
4. 管理人应在合同变更生效日起五个工作日内将相关情况报相关监管机构或自律组织等备案。

以上事宜，请贵行确认。

上海东方证券资产管理有限公司（公章或经授权的业务往来印章）

签署日：2020 年 月 日



《关于东方红添利 11 号集合资产管理计划项下资产管理合同条款变更事项的确认函》的复函

上海东方证券资产管理有限公司：

《关于东方红添利 11 号集合资产管理计划项下资产管理合同条款变更事项的确认函》我行已收悉，请贵司严格按照按《东方红添利 11 号集合资产管理合同》“二十六、合同的补充、修改与变更”中的约定进行操作，以确保本次修改变更合同的程序及内容合法有效。在贵司按照上述要求执行的前提下，我行同意你司在《关于东方红添利 11 号集合资产管理计划项下资产管理合同条款变更事项的确认函》中所提及的《资产管理合同》等相关法律文本条款的变更，并将委托人同意或不同意的整体情况事后告知我行。

中国农业银行股份有限公司（公章或经授权的业务往来印章）

签署日：2020 年 月 日

