

关于东方红添鑫 1 号集合资产管理计划 合同变更的公告

鉴于投资者、管理人、托管人已签署合同编号为“(JH)东方红-中国银行 2020 年 2 号”的《东方红添鑫 1 号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“资管合同”),根据资管合同“二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算”“(一)资产管理合同的变更”的约定,“全体投资者、资产管理人和资产托管人书面协商一致后,可对资产管理合同内容进行变更,资产管理合同另有约定的除外。.....资产管理计划改变投向和比例的,应当事先取得投资者同意。”

现经全体投资者、管理人上海东方证券资产管理有限公司、托管人中国银行股份有限公司北京市分行协商一致,以签署补充协议的方式进行合同变更,本次变更内容详见以下资管合同修订事项,《东方红添鑫 1 号集合资产管理计划说明书》、《东方红添鑫 1 号集合资产管理计划风险揭示书》、《东方红添鑫 1 号集合资产管理计划资产托管协议》相关内容一并调整。

资管合同修订事项:

1、资管合同“一、前言”中“《中华人民共和国合同法》”修改为“《中华人民共和国民法典》”;

2、资管合同“二、释义”第 38 款修改为:

“38、销售机构、代理销售机构:指上海东方证券资产管理有限公司和/或符合中国证监会规定的条件,取得基金销售资格并接受管理人委托,代为办理本计划认购、参与、退出等业务的机构,具体销售机构以管理人通过公告及电子邮件方式向投资者的通知为准;”

3、资管合同“二、释义”新增(其后条款序号相应调整):

“43、港股通标的股票:内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票;”

4、资管合同“二、释义”更新托管协议编号：

“44、托管协议：指管理人与托管人签订的《东方红添鑫 1 号集合资产管理计划资产托管协议》（**托管协议编号：北京-QSJH2021004**”）。

5、资管合同“四、当事人及权利义务”“（一）当事人的基本情况”“2、管理人”修改为：

名称：上海东方证券资产管理有限公司

住所：上海市黄浦区中山南路 109 号 7 层-11 层

法定代表人：宋雪枫

联系人：黄莹

通讯地址：上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 8 层

联系电话：**021-53952723**

6、资管合同“四、当事人及权利义务”“（三）管理人的权利义务”“2、管理人的义务”第（7）款修改为：

“（7）严格按照资产管理合同管理本资产管理计划财产，建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理、**消费者权益保护**及人事管理等制度，保证本资产管理计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理、分别记账，分别投资，不得出现超范围、超比例投资等违规行为；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；”

并增加（其后条款序号相应调整）：

“（27）管理人应按照《管理办法》的规定计提风险准备金或者按照规定计量操作风险资本或相应风险资本准备。《管理办法》等法律法规变动的，管理人可根据最新法律法规的要求调整风险准备金或风险资本准备的计提规则；

（28）管理人应按照《证券法》、《证券投资基金法》、《国务院办公厅关于加强金融消费者权益保护工作的指导意见》、《中国人民银行金融消费者权益保护实施办法》、《最高人民法院全国法院民商事审判工作会议纪要》等相关规定（如适用）建立并完善消费者权益保护工作体制机制，妥善处理消费者权益保护相关纠纷；

(29) 管理人应对提供给投资者的信息（包括但不限于投资标的的具体情况、资产管理计划资产净值和份额净值、业绩报酬数据、资产管理计划年度报告、季度报告、净值报告、临时报告等报告中的相关信息）质量负责，确保上述信息的真实性、准确性和完整性；”

7、资管合同“五、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”“4、产品风险等级”修改为：

“本计划产品风险等级为 R2（中低风险）。

如果相关法律法规规则要求或因实际情况需要等，需调高或降低本计划风险等级的，管理人可以调整产品风险等级，并至少提前 1 个工作日通过公告及电子邮件等方式告知投资者，无需进行合同变更。”

8、资管合同“六、资产管理计划的募集”“（一）资产管理计划的募集期限、募集方式、募集对象”“2、募集方式”项下第一段修改为：

“本资产管理计划通过管理人的直销机构及/或与管理人签订本计划销售代理协议的其他代理销售机构进行募集。具体销售机构名单、联系方式以管理人通过公告及电子邮件等方式向投资者的通知为准。”

9、资管合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“（一）参与和退出场所”修改为：

“本资产管理计划参与和退出场所为管理人的直销机构及/或与管理人签订本计划销售代理协议的其他销售机构的营业场所，或按销售机构提供的其他方式办理参与和退出。具体销售机构名单、联系方式以管理人通过公告及电子邮件等方式向投资者的通知为准。”

10、资管合同“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”修改为：

本集合计划自计划成立日起每自然周开放一次，开放期为每周一、周三和周四，如遇非工作日或非港股通交易日本集合计划不开放，顺延至下周下一工作日，若当周无下一个工作日的，则不再顺延。具体开放日期以管理人通过公告及电子

邮件等方式向投资者的通知为准。

业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。

若中国证监会会有新的规定，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，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整并告知投资者。管理人应至少提前一个工作日发布公告并以邮件方式告知投资者。

本计划开放退出期内，主动投资于流动性受限资产的市值合计不超过资产净值的 20%，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%。

11、资管合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“（三）临时开放期”修改为：

“如果本集合计划合同变更或展期时，管理人可通过公告及电子邮件等方式通知投资者临时退出开放期，投资者可在临时退出开放期退出集合计划（但不得参与集合计划）。 ”

12、资管合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“（七）巨额退出的认定及处理方式” “3、告知客户的方式”修改为：

“发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人指定网站公告并通过电子邮件方式告知投资者，并说明有关处理方法。”

13、资管合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“（八）连续巨额退出的认定和处理方式”“2、连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付”修改为：

“本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人指定网站上进行公告同时通过电子邮件方式告知投资者”。

14、资管合同“八、资产管理计划的参与、退出与转让”“（十三）管理人自有资金参与”“8、信息披露”修改为：

“管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与及退出的相关情况并通过

电子邮件方式告知投资者”。

15、资管合同“十一、资产管理计划的投资”“（二）投资范围及比例”“1、投资范围”新增“港股通标的股票”并将告知方式修改为公告及邮件通知：

本资产管理计划资金按照《运作规定》的要求进行组合投资，具体可投资以下品种：

（1）权益类资产：股票（包括在主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票，以及新股申购所得股票，参与定向增发所得股票）、**港股通标的股票**、存托凭证（包括在科创板上市的存托凭证）、股票型基金（不含股票型分级基金的优先级份额）、混合型基金（不含混合型分级基金的优先级份额）等；

（2）固定收益类及货币市场工具：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、可交换债（含私募可交换债）、可分离交易债券、永续债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、中小企业私募债、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、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；股票型及混合型分级基金的优先级份额、债券型基金；银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券逆回购、标准化票据等，以及监管机构允许集合资产管理计划投资的其他货币市场工具；

（3）商品及金融衍生品类资产：权证、股指期货、国债期货、商品期货、场内期权等场内标准化投资品种；

（4）现金（活期存款）；

（5）集合计划可以参与证券回购，但集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 140%；

受限于本合同第十四章“利益冲突及关联交易”的规定，投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行或承销期内承销的证券，管理人应根据法律、行政法规、中国证监会的规定事后及时通过管理人的网站公告并且邮件告知等方式告知投资者，通过邮件的方式告知托管人。投资者已明确知悉并愿意承担因上述关联交易可能

导致的管理人/管理人关联方双重管理及收费等事项及风险。以上投资行为应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待计划财产。

托管人接收关联交易通知的指定邮箱为：tgylwjrgb_bj@mail.notes.bank-of-china.com；tuogyy_bj@mail.notes.bank-of-china.com。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围，若法律法规另有规定的，从其规定。

16、资管合同“十一、资产管理计划的投资”“（四）风险收益特征”修改为：

“本计划风险等级为 R2，具有中低风险和收益的特征。如果相关法律法规规则要求或因实际情况需要等，需调高或降低本计划风险等级的，管理人可以调整产品风险等级，并至少提前 1 个工作日通过公告及电子邮件等方式告知投资者，无需进行合同变更。”

17、资管合同“十一、资产管理计划的投资”“（六）投资策略”新增（其后条款序号相应调整）：

“（2）港股通标的股票投资策略

本计划的港股通投资策略与 A 股类似，通过行业配置和个股选择，重点投资于受惠于中国经济转型、升级，且处于合理价位的具备核心竞争力股票。”

18、资管合同“十一、资产管理计划的投资”“（十二）风控经理”“2.风控经理的职责”增加最后一段：

“风控经理应定期以及根据资产委托人要求不定期述职，包括但不限于：投资收益分配情况及本金收回情况、资产管理人各项职责落实情况、各类合同等法律文件的适时修订情况等。”

19、资管合同“十一、资产管理计划的投资”增加“（十三）预警及止损机制”：

“（十三）预警及止损机制

为维护投资者的利益，本计划设置预警线和止损线，并于每个估值日后对计划份额净值进行监控。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。由管理人于每个估值日估值结束后对当日计划份额净值进行监控。

若任一估值日本计划份额净值等于或低于预警线，触发预警机制，管理人应于下一个交易日（T+1 日）9:00 前以电子邮件及电话形式提醒投资者。

若任一估值日计划份额净值等于或低于止损线，触发止损机制，管理人应于该估值日的下一个工作日起对委托财产进行不可逆的变现操作，直至全部变现为止(当出现无法变现资产时除外)。止损变现完成后，本计划提前终止。如本资产管理产品终止之日有未能流通变现的资产，清算小组应在该资产可流通变现时及时变现，直至所有未能流通变现的资产全部清算完毕。所变现计划资产归投资者所有。

投资者确认，委托财产的计划份额净值达到预警及止损线是管理人采取相应行动的起点，在管理人变现后，委托财产的计划份额净值可能会低于预警及止损线，该等预警及止损措施安排不是资产管理人对委托资产净值的保证或担保。管理人按上述约定执行产生的后果由投资者承担，管理人不承担责任。”

20、资管合同“十四、利益冲突及关联交易”“（一）关联交易及利益冲突情形”修改为：

“1、本计划投资和运作过程中，在本计划投资范围内，资产管理人可能运用委托财产从事关联交易，将委托财产投资于管理人、托管人及其控股股东、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、管理人管理的证券投资基金。

2、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：

（1）资产管理人及其附属机构有权以自有资金参与本集合计划。

（2）资产管理人的控股股东、实际控制人或者其他关联方均有权参与本集合计划；

（3）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。

（4）其他可能产生利益冲突的情形。”

21、资管合同“十四、利益冲突及关联交易”“（二）关联交易及利益冲突的应对及处理”修改为：

“1、关联交易的应对及处理

管理人应建立健全内部控制和风险合规管理制度，采取有效措施，做好充分的信息隔离和利益冲突管理，遵循投资者利益优先的原则，防范、管控可能的利益冲突。投资者签署本合同即视为其授权管理人可以从事上述利益冲突情形下的投资于本机构、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者承销期内承销的证券。管理人严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，在交易完成后及时书面通知托管人，通过邮件告知投资者，并按相关规定报告或备案。若涉及其他重大关联交易，管理人严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，事先取得投资者的同意，并有充分证据证明未损害投资者利益。在交易完成后及时书面通知托管人，通过邮件告知投资者，并按相关规定报告或备案。

2、利益冲突的应对及处理：

（1）若涉及了本章第（一）款约定的利益冲突第（1）项的情形，管理人及其附属机构严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险。（2）若涉及了本章第（一）款约定的利益冲突第（2）项的情形，管理人将确保严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，该部分投资者与集合计划其他客户份额享有同等权益、承担同等风险。管理人及时向投资者进行披露，并对该资产管理计划账户进行监控，以及根据相关规定及时进行报告。

（3）若涉及了本章第（一）款约定的利益冲突第（3）项的情形，资产管理人将从充分维护投资者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。

（4）若涉及了其他利益冲突情形的，管理人将确保严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，从充分维护投资者利益角度积极处理该等利益冲突。

在发生上述利益冲突时，资产管理人将视具体利益冲突情形选择在向投资者提供的定期报告或临时报告中披露。”

22、资管合同“十五、投资经理的指定与变更”修改为：

“本资产管理计划财产投资经理为侯振新先生。

投资经理简历：上海东方证券资产管理有限公司私募固定收益投资部总经理、投资经理，复旦大学经济学硕士，证券从业 12 年，曾任交通银行资产管理业务中心资本市场部副总经理、中信银行资产管理业务中心处长。

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。

若资产管理人根据业务需要拟变更投资经理，应事先取得投资者的**电子邮件等书面形式**同意；且投资者有权根据投资经理的业绩表现要求管理人更换投资经理。投资经理的变更无需履行合同变更程序，但管理人应在投资经理变更后的 5 个工作日内在其网站上公告相关事项。”

23、资管合同“二十、资产管理计划财产的估值和会计核算”“(三) 估值对象和估值方法”“2、估值方法”更新固定收益品种的估值方法为：

“(2) 投资固定收益品种的估值方法

1) 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。

2) 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净价进行估值；

3) 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净价或推荐估值净价进行估值；

4) 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；

5) 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。在证券交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

6) 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。

7) 在证券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计量日的公允价值进行估值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则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。”

24、资管合同“二十三、信息披露与报告”“（一）向投资者提供的报告”“4、临时报告”中的（3）、（4）（5）项修改为：

“（3）涉及管理人、计划财产、资产托管业务的重大诉讼、仲裁；

（4）管理人、托管人托管业务部门与本合同项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的立案调查；

（5）管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理出现重大负面事件或因委托资产管理业务相关行为受到严重行政处罚，托管人的托管业务或托管业务部门负责人因委托资产托管业务相关行为受到严重行政处罚；”

25、资管合同“二十四、风险揭示”“（一）资产管理计划面临的一般风险”“7、关联交易及利益冲突风险”修改为：

“本计划可投资于由管理人、托管人或其关联方管理的产品或者与管理人、托管人或其关联方进行交易，这构成管理人与本计划的关联交易，存在关联交易风险。”

26、资管合同“二十四、风险揭示”“（二）资产管理计划面临的特定风险”新增（其后条款序号相应调整）：

“（9）参与港股通标的股票的风险

本计划可以投资港股通标的股票，将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险,包括但不限于：

1) 海外市场风险

本计划在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

2) 股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本计划的波动风险可能相对较大。

3) 汇率风险

本计划在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率，港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，本计划可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本计划在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本计划将因此而遭遇资金被额外占用进而降低资产管理计划投资效率的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

4) 港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本计划可能因为港股通市场每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

5) 港股通可投资标的的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入，本计划可能因为港股通可投资标的的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

6) 港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有内地与香港均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯、港股不能及时卖出的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），导致资产管理计划所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中

体现市场反应，可能带来一定的流动性风险，造成其价格波动骤然增大，进而导致本计划所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

7) 交收制度带来的资产管理计划流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本计划在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险。

8) 港股通标的权益分派、转换等的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本计划存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

9) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及 *ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本计划可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给资产管理计划带来损失的风险。

10) 港股通规则变动带来的风险

本计划是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本计划存在因港股通规则变动而带来资产管理计划投资受阻

或所持资产组合价值发生波动的风险。

11) 其他可能的风险

除上述显著风险外，本计划参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本计划存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

②在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动性较为缺乏，本计划投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

③在本计划参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本计划可能面临以下风险：（一）因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本计划应收资金或证券被暂不交付或处置；（二）结算参与人对本计划出现交收违约导致本计划未能取得应收证券或资金；（三）结算参与人向中国结算发送的有关本计划的证券划付指令有误的导致本计划权益受损；（四）其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本计划利益受到损害的情况。

⑤本计划可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分资产管理计划资产投资于港股或选择不投资于港股，资产管理计划资产并非必然投资港股。”

27、资管合同“二十四、风险揭示”“（二）资产管理计划面临的特定风险”新增：

“3、触及止损线后提前结束的风险

本集合计划运行期间，在本集合计划被强制止损、所有投资标的全部变现，本集合计划提前终止，从而给委托人带来一定的风险。”

28、资管合同“二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算”“（一）资产

管理合同的变更”项下第 4 款修改为：

“4、管理人应当合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利，具体以管理人公告及通过电子邮件方式向投资者的通知为准。”

29、资管合同“二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算”“（二）资产管理计划/合同的展期”修改为：

“（二）资产管理计划/合同的展期

本集合计划存续期满，若符合展期的条件，在取得托管人书面同意的情况下，则可以展期：

1、展期的条件

（1）资产管理计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和资产管理合同的约定；

（2）资产管理计划展期没有损害投资者利益的情形；

（3）中国证监会规定的其他条件。

本集合计划展期的，还应当符合本集合计划的成立条件。

2、展期的程序与期限

（1）展期的程序：

1）展期的公告

本集合计划符合展期条件拟展期时，管理人在管理人指定网站上公告并**邮件通知投资者**集合计划的具体展期方案。

2）投资者答复

管理人应征求投资者意见，投资者应根据管理人**邮件通知**要求在规定的期限内明确答复意见。若投资者同意本集合计划展期，则投资者应根据管理人**邮件通知**要求在规定的期限内重新签订资产管理合同。截至存续期届满日，投资者未给出明确答复的，视为不同意展期。

3）不同意展期的投资者所持有份额的处理办法

展期经管理人**公告及邮件通知**后，不同意展期的投资者，可以在原存续期届满前的开放日通过销售机构办理退出手续；未在原存续期届满前的开放日办理退出手续的，管理人保障投资者到期合法终止合同的权利，管理人将在本集合计划原存续期届满之日将该部分投资者份额全部退出。

4) 展期的成立

存续期满，集合计划符合展期条件，管理人将在存续期满后 10 个工作日内公告本集合计划展期成立。

5) 展期的失败

若集合计划展期失败，本集合计划将进入清算终止程序。

(2) 展期的期限：管理人应在公告及邮件通知投资者具体展期方案时确定展期的具体期限。

3、展期情况备案

本集合计划展期后 5 个工作日内，管理人将展期情况邮件通知投资者并按照国家法律法规要求报相关监管机构或自律组织等备案。”

30、资管合同“二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算”“(三) 资产管理计划/合同的终止”新增（其后条款序号相应调整）：

“11、资产管理人出现下列情形之一的，全体资产委托人有权一致决定终止本合同并不承担任何违约责任：

(1) 经委托人评估，管理人在金融消费者/投资者权益保护工作机制方面存在重大缺陷（包括但不限于客户信息泄露、恶意欺诈、乱收费等）；

(2) 管理人对委托人的投诉工作处理不当（包括但不限于未积极配合处理、处理结果损害委托人或委托人客户的利益等）；

(3) 管理人违反法律法规或监管关于金融消费者/投资者权益保护的其他要求。”

31、资管合同“二十六、违约责任”增加第（四）款（其后条款序号相应调整）：

“（四）管理人应对提供给投资者的信息（包括但不限于投资运作情况、持仓情况、资产管理计划资产净值和份额净值、业绩报酬数据、资产管理计划年度报告、季度报告、净值报告、临时报告等报告中的相关信息）的真实性、准确性、完整性负责。若上述管理人提供给投资者的信息的真实性、准确性或完整性存在瑕疵，投资者有权行使本合同项下一项或多项救济措施，追究管理人的违约责任。包括但不限于，管理人应当对因信息真实性、准确性或完整性瑕疵给资产管理计划财产或者投资者造成的损失依法承担赔偿责任。”

32、资管合同“二十七、保密”第（三）款中删除重复文字“的”，修改为：

“（三）每一方均应确保其本身及其与本次交易有关的董事、高级职员和其他与本次交易有关的雇员同样遵守本合同约定的保密义务。”

本次合同变更于 **2021 年 3 月 4 日** 起生效，公告内容即成为资管合同组成部分，投资者可至我司网站（www.dfham.com）查阅变更后的《东方红添鑫 1 号集合资产管理计划资产管理合同》、《东方红添鑫 1 号集合资产管理计划说明书》、《东方红添鑫 1 号集合资产管理计划风险揭示书》。

感谢广大投资者一直以来给予的关注和支持！如有疑问，投资者可咨询：上海东方证券资产管理有限公司；网址：www.dfham.com；服务热线：4009200808。

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 3 月 4 日