

关于东方红添盈 2 号集合资产管理计划项下资产管理合同 条款变更事项的确函

中国建设银行股份有限公司深圳市分行：

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《东方红添盈 2 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”）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、风险揭示书的相关内容一并调整。

我司将根据《中华人民共和国民法典》、《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》的相关规定及《东方红添盈 2 号集合资产管理计划资产管理合同》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）资产管理合同修改内容

序号	位置	原条款	现条款
1	《资产管理合同》 “一、前言”	1、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“《合同指引》”）和其他有关规定。	1、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《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》”）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“《合同指引》”）和其他有关规定。
2	《资产管理合同》	（二）管理人 1、管理人的基本情况 名称：上海东方证券资产管理有限公司（简称“东证资管”“东方红”）	（二）管理人 1、管理人的基本情况 名称：上海东方证券资产管理有限公司（简称“东证资管”“东方红”）

序号	位置	原条款	现条款
	“四、当事人及权利义务”	住所：上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层 法定代表人：潘鑫军 联系人：陈嘉颖 通讯地址：上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 37 层 邮政编码：200010 联系电话：021-63325888	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：陈嘉颖 通讯地址：上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 8 层 邮政编码：200010 联系电话：021- 53952686
3	《资产管理合同》 “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 本资产管理计划常规开放期为每自然周周一、周三、周四，如遇非工作日本集合计划不开放，顺延至当周下一工作日，若当周无下一个工作日的，则不再顺延。。若前述工作日为非港股通交易日，则本集合计划当日不开放，开放期顺延。具体开放安排以管理人公告为准，届时管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。本计划不接受违约退出。 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或其他特殊情况，管理人将视情况对办理参与及/或退出的日期及时间进行相应的调整并公告。 如在开放日内发生不可抗力或其他情形致使联交所临时停市、港股通交易暂停，无法按时开放申购与赎回业务的，开放日中止，顺延至港股通交易恢复之日。开放日的具体调整以管理人公告为准。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。	（二）参与和退出的开放日和时间 本资产管理计划常规开放期为每自然周周一、周三、周四，如遇非工作日本集合计划不开放，顺延至当周下一工作日，若当周无下一个工作日的，则不再顺延。若前述工作日为非港股通交易日，则本集合计划当日不开放，开放期顺延。具体开放安排以管理人公告为准，届时管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。本计划不接受违约退出。 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或其他特殊情况，管理人将视情况对办理参与及/或退出的日期及时间进行相应的调整并公告。 如在开放日内发生不可抗力或其他情形致使联交所临时停市、港股通交易暂停，无法按时开放申购与赎回业务的，开放日中止，顺延至港股通交易恢复之日。开放日的具体调整以管理人公告为准。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。
4	《资产管理合同》 “十一、资产管理计划的投资”	（六）投资策略 6、期货投资策略 （4）责任承担 管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿。对于其他相关方的原因给	（六）投资策略 6、期货投资策略 （4）责任承担 管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿。对于其他相关方的原因给

序号	位置	原条款	现条款
		投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。 （5）期货保证金的流动性应急处理机制 1）应急触发条件 管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。 2）保证金补充机制 如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。 3）损失责任承担等 因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿，但管理人不承担委托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。	投资者造成的损失，非管理人过错的，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。 （5）期货保证金的流动性应急处理机制 1）应急触发条件 管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。 2）保证金补充机制 如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。 3）损失责任承担等 因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿，但管理人不承担委托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失，非管理人过错的，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议（如有）为准。
5	《资产管理合同》“十七、投资指令的发送、确	（七）交易及交收清算安排 6、投资银行存款的特别约定 （2）相关协议的签署 管理人在投资银行存款之前，需与存款银行签订具体存款协议。具体存款协议应包括但不限于以下内容： 	（七）交易及交收清算安排 6、投资银行存款的特别约定 （2）相关协议的签署 管理人在投资银行存款之前，需与存款银行签订具体存款协议。具体存款协议应包括但不限于以下内容：

序号	位置	原条款	现条款
	认与执行”	9) 需要由存款银行/管理人提供上门送、取单服务的，应在存款协议中明确，存款银行/管理人对存款证实书的真实性负责，并承担移交过程中由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。 (3) 办理资产管理计划投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取，可采取以下方式： 由存款银行/管理人提供上门送、取单服务。在上门送、取单时，存款银行/管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件，以便托管人进行核查。	9) 应在存款协议中明确，存款银行/管理人对存款证实书的真实性负责，并承担移交过程中由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。 (3) 办理资产管理计划投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取，存款银行/管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件，以便托管人进行核查。
6	《资产管理合同》 “二十三、风险揭示”	(一) 资产管理计划面临的一般风险 13、合同变更的风险 (1) 本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改的，管理人和托管人协商一致后，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同及说明书进行修改，并及时在管理人网站公告修改内容。更新或修改的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。 (2) 除因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订以外的合同变更时，管理人将向投资者发送合同变更征询意见函，投资者可选择在指定开放期退出或继续参与本集合计划。部分投资者可能因为未能提供有效的联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人，而无法及时获	(一) 资产管理计划面临的一般风险 13、合同变更的风险 本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券投资基金业协会自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则颁布或修订，或相关监管机构或自律组织对本集合计划备案补正意见的要求涉及到合同修改的，管理人和托管人协商一致后，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，或根据相关监管机构或自律组织备案补正意见的要求对本合同及说明书进行修改，并及时在管理人网站公告修改内容。更新或修改的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。投资者可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。

序号	位置	原条款	现条款
		知合同变更事项，如果投资者因上述情况未能按时退出本计划，可能会被视为同意合同变更，从而存在风险。另外，合同中约定： 1) “投资者不同意变更的，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；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更”。在此情况下，投资者对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。 2) “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投资者，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份额净值）”，在此情况下，会导致投资者的计划份额减少至零。	
7	《资产管理合同》 “二十四、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 2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，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；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排： 投资者不同意变更的，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投资者，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份额净值）。 投资者同意，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本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。	（一）资产管理合同的变更 2、因其他原因需要变更资产管理合同的，管理人、托管人需协商一致且取得全体集合计划投资者同意后，方可变更资产管理合同。

序号	位置	原条款	现条款
		合同变更于指定开放期结束后的第一个工作日起生效，公告内容即成为本合同组成部分。 特别约定：在本集合计划投资者人数少于 10 名（含 10 名）的情况下，经全体投资者、管理人、托管人同意，也可通过签署补充协议的方式进行合同变更，采用该等方式变更合同的，可不受上述合同变更程序限制。	
8	《资产管理合同》“二十六、违约责任”	（一）管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定，给资产管理计划财产或者投资者造成的直接损失，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人免责： 7、投资者未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人致使资产管理计划财产发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担任何责任，投资者并就管理人与托管人由此遭致的损失承担赔偿责任。	（一）管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定，给资产管理计划财产或者投资者造成的直接损失，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人免责： 7、投资者未能事前就其关联证券或其他禁止交易证券明确告知管理人致使资产管理计划财产发生违规投资行为的，管理人与托管人均不承担任何责任（管理人和托管人有过错的除外），投资者并就管理人与托管人由此遭致的直接经济损失承担赔偿责任。

（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《东方红添盈 2 号集合资产管理计划资产管理合同》条款变更事宜，并按《东方红添盈 2 号集合资产管理计划资产管理合同》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投资者发送合同变更征询意见函。投资者不同意变更的，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；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意资产管理合同变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意资产管理合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在资产管理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份额净值）。

投资者同意，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. 资产管理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. 管理人应在资产管理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：2021 年 月 日

《关于东方红添盈 2 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：

《关于东方红添盈 2 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《东方红添盈 2 号集合资产管理计划资产管理合同》“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”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《关于东方红添盈 2 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。

中国建设银行股份有限公司深圳市分行（公章或经授权的业务往来印章）



签署日：2021 年 5 月 28 日