

上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划
资产管理合同之补充协议（二）

委托人

名称：杭州联华华商集团有限公司
通讯地址：杭州市下城区庆春路 86 号
法定代表人：张慧勤
联系人：陈石军
联系电话：13666682877



管理人

名称：上海证券有限责任公司
通讯地址：上海市黄浦区四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼
法定代表人：何伟
联系人：王兆
联系电话：021-53686316



托管人

名称：中国建设银行股份有限公司上海市分行
通讯地址：上海市陆家嘴环路 900 号
负责人：刘军
授权代理人：房师新
联系人：陈晨
联系电话：021-58880000

鉴于：

资产委托人、资产管理人和资产托管人已签订编号为 MADA20211-0005 的《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同》、《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同之补充协议（一）》、《关于上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划的续期征询函》及其回执（以下并称“《资产管理合同》”）。现资产委托人、资产管理人和资产托管人经协商一致，达成如下补充协议：

一、根据上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划（以下简称“本计划”）《资产管理合同》“二十、资产管理合同的变更与终止”的约定，对本计划的合同条款进行以下变更。

具体变更内容如下：

涉及条款	变更前	变更后
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、投资范围： 本计划为基金中基金资产管理计划，将总资产的 80%以上投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品，包括但不限于公开募集证券投资基金、基金管理公司及其子公司发行的资产管理产品、期货公司及其子公司发行的资产管理产品、证券公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的资产管理产品。 （1）固定收益类资产： 包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易债）、可交换债、	2、投资范围： 本计划为基金中基金资产管理计划，将总资产的 80%以上投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品，包括但不限于公开募集证券投资基金、基金管理公司及其子公司发行的资产管理产品、期货公司及其子公司发行的资产管理产品、证券公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、商业银行及其理财子公司理财产品、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的资产管理产品。 （1）固定收益类资产： 包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转

	<p>经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开公司债、资产支持证券（ABS）、债券型基金，接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划等固定收益类资产。</p> <p>（2）权益类资产：包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的A股股票（包括一级市场申购和二级市场买卖）（不含ST），股票型基金、混合型基金（包括ETF和LOF）等。</p> <p>（3）接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品。</p> <p>（4）接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品（不包括投资场外衍生品）。</p>	<p>换债券（含可分离交易债）、可交换债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开公司债、资产支持证券（ABS）、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划等固定收益类资产。</p> <p>（2）权益类资产：包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的A股股票（包括一级市场申购和二级市场买卖）（不含ST），股票型基金、混合型基金（包括ETF和LOF）、接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品等。</p> <p>（3）接受国务院金融监督管理机构监管发行的混合类资产管理产品。</p> <p>（4）接受国务院金融监督管理机构监管发行的期货和衍生品类资产管理产品（不投资于场外衍生品）。</p> <p>（5）债券正回购。</p>
<p>五、资产管理计划的基本情况</p> <p>（四）资产管理计划的投资目标、主要</p>	<p>3、投资比例：</p> <p>本计划为混合类FOF资产管理计划，投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定。</p> <p>（1）债券类资产占资产总值的比例：0-80%（不含）。其中，除货币基金、债券</p>	<p>3、投资比例：</p> <p>本计划为混合类FOF资产管理计划，投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定。</p> <p>（1）固定收益类资产占资产总值的比例：0-80%（不含）。其中，除货币基金、债券</p>

<p>投资方向、投资比例、产品风险等级</p>	<p>型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划以外部分占比为 0-20%（不含）。</p> <p>（2）权益类资产占资产总值的比例：0-50%（不含）。</p> <p>（3）接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品：0%-80%（不含）。</p> <p>（4）接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品（不包括投资场外衍生品）：0%-50%（不含）。</p> <p>（5）债券正回购：本计划的总资产不得超过净资产的 200%。</p> <p>（6）本计划所投资的资产管理产品，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额。（管理人穿透以投资的资管产品提供的估值数据为准。）合并计算后，固定收益类、权益类、商品及金融衍生品类资产均不得超过净资产的 80%。</p>	<p>型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划以外部分占比为 0-20%（不含）。</p> <p>其中，债券正回购融入资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%，债券逆回购融出资金余额不超过上一日计划资产净值的 100%，法律法规政策另有规定的除外。</p> <p>（2）权益类资产占资产总值的比例：0-50%（不含）。</p> <p>（3）期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例占资产总值的比例为：不低于 20%，且期货和衍生品账户权益占资产总值的比例为：不超过 50%（含）（限对冲、套利策略，不投资场外衍生品）。</p> <p>（4）管理人对上述各类资产的投资比例进行穿透计算，穿透计算的数据来源以投资的资产管理产品提供的最新估值数据为准。</p>
<p>八、资产管理计划的投资 （二）投资范围及比例</p>	<p>1、投资范围： 本计划为基金中基金资产管理计划，将总资产的 80%以上投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品，包括但不限于公开募集证券投资基金、基金管理公司及其子公司发行的资产管理产品、期货公司及其子公司发行的资产管理产品、证券公司及其子公司资产</p>	<p>1、投资范围： 本计划为基金中基金资产管理计划，将总资产的 80%以上投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品，包括但不限于公开募集证券投资基金、基金管理公司及其子公司发行的资产管理产品、期货公司及其子公司发行的资产管理产品、证券公司及其子公司资产</p>

<p>管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的资产管理产品。</p> <p>(1) 固定收益类资产：包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易债）、可交换债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开公司债、资产支持证券（ABS）、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划等固定收益类资产；</p> <p>(2) 权益类资产：包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的 A 股股票（包括一级市场申购和二级市场买卖）（不含 ST），股票型基金、混合型基金（包括 ETF 和 LOF）等。</p> <p>(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品。</p> <p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品（不包括投资场外衍生品）。</p>	<p>管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、商业银行及其理财子公司理财产品、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的资产管理产品。</p> <p>(1) 固定收益类资产：包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债（含次级债、混合资本债）、中央银行票据、同业存单、可转换债券（含可分离交易债）、可交换债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据（ABN）、非公开定向债务融资工具（PPN）等）、非公开公司债、资产支持证券（ABS）、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划等固定收益类资产。</p> <p>(2) 权益类资产：包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的 A 股股票（包括一级市场申购和二级市场买卖）（不含 ST），股票型基金、混合型基金（包括 ETF 和 LOF）、接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品等。</p> <p>(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的混合类资产管理产品。</p>
---	---

	<p>2、投资比例：</p> <p>本计划为混合类单一资产管理计划，投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定。</p> <p>(1) 债券类资产占资产总值的比例：0-80%(不含)。其中，除货币基金、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划以外部分占比为0-20%(不含)。</p> <p>(2) 权益类资产占资产总值的比例：0-50%(不含)。</p> <p>(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品：0%-80%(不含)。</p> <p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品(不包括投资场外衍生品)：0%-50%(不含)。</p> <p>(5) 债券正回购：本计划的总资产不得超过净资产的200%。</p> <p>(6) 本计划所投资的资产管理产品，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或同类资产的金额。(管理人穿透以投资的资管产品提供的估值数据为准。)合并计算后，固定收益类、权益类、商品及金融衍生品类资产均不得超过净资产的80%。</p>	<p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的期货和衍生品类资产管理产品(不投资于场外衍生品)。</p> <p>(5) 债券正回购。</p> <p>2、投资比例：</p> <p>本计划为混合类FOF资产管理计划，投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定。</p> <p>(1) 固定收益类资产占资产总值的比例：0-80%(不含)。其中，除货币基金、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划以外部分占比为0-20%(不含)。</p> <p>其中，债券正回购融入资金余额不超过上一日计划资产净值的100%，债券逆回购融出资金余额不超过上一日计划资产净值的100%，法律法规政策另有规定的除外。</p> <p>(2) 权益类资产占资产总值的比例：0-50%(不含)。</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例占资产总值的比例为：不低于20%，且期货和衍生品账户权益占资产总值的比例为：不超过50%(含)(限对冲、套利策略，不投资场外衍生品)。</p> <p>(4) 管理人对上述各类资产的投资比例进行穿透计算，穿透计算的数据来源以投资的资产管理产品提供的最新估值数据为准。</p>
--	---	--

<p>八、资产管理计划的投资</p>	<p>(七) 业绩报酬计提基准</p> <p>本单一计划的业绩报酬计提基准为 10%，管理人对年化收益率 R 超过业绩报酬计提基准的收益部分提取 10% 的业绩报酬。</p>	<p>(七) 业绩比较基准</p> <p>本计划不设置业绩比较基准。</p>
<p>十四、越权交易 (三) 资产托管人对资产管理人投资运作的监督</p>	<p>2、托管人对管理人的投资行为行使监督权</p> <p>托管人根据合同的约定,对下述资产投资范围、投资比例进行监督。</p> <p>1、投资范围:</p> <p>(1) 固定收益类资产: 包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债(含次级债、混合资本债)、中央银行票据、同业存单、可转换债券(含可分离交易债)、可交换债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具(如超短期融资券、短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据(ABN)、非公开定向债务融资工具(PPN)等)、非公开公司债、资产支持证券(ABS)、债券型基金等固定收益类资产;</p> <p>(2) 权益类资产: 包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的 A 股股票(包括一级市场申购和二级市场买卖)(不含 ST)、股票型基金、混合型基金(包括 ETF 和 LOF)等。</p> <p>(3) 接受国务院金融监督管理机构监管</p>	<p>2、托管人对管理人的投资行为行使监督权</p> <p>托管人根据合同的约定,对下述资产管理计划的投资范围、投资比例进行监督。</p> <p>1、投资范围:</p> <p>本计划为基金中基金资产管理计划,将总资产的 80% 以上投资于接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品,包括但不限于公开募集证券投资基金、基金管理公司及其子公司发行的资产管理产品、期货公司及其子公司发行的资产管理产品、证券公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、商业银行及其理财子公司理财产品、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的资产管理产品。</p> <p>(1) 固定收益类资产: 包括但不限于现金、银行存款、货币市场工具、货币市场基金、债券逆回购、交易所和银行间上市交易的国债、地方政府债、企业债券、公司债券、各类金融债(含次级债、混合资本债)、中央银行票据、同业存单、可转换债券(含可分离交易债)、可交换债、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具(如超短期融资券、</p>

<p>发行的权益类资产管理产品。</p> <p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品(不包括投资场外衍生品)。</p> <p>2、投资比例:</p> <p>本计划为混合类单一资产管理计划,投资组合在各类资产上的投资比例,将严格遵守相关法律法规的规定。</p> <p>(1) 债券类资产占资产总值的比例:0-80%(不含)。</p> <p>(2) 权益类资产占资产总值的比例:0-50%(不含)。</p> <p>(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品:0%~80%(不含)。</p> <p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的商品及金融衍生品类资产管理产品:0%~50%(不含)。</p> <p>(5) 债券正回购:本计划的总资产不得超过净资产的200%。</p> <p>托管人履行投资监督义务受限于管理人提供的数据和信息的,由管理人对所提供信息的真实性、准确性和完整性负责。</p> <p>托管人对本条约定的委托资产的投资监督和检查自本资产管理计划合同生效之日起开始。</p>	<p>短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、资产支持票据(ABN)、非公开定向债务融资工具(PPN)等)、非公开公司债、资产支持证券(ABS)、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划等固定收益类资产。</p> <p>(2) 权益类资产:包括但不限于国内依法公开发行上市在沪深证券交易所市场交易的A股股票(包括一级市场申购和二级市场买卖)(不含ST),股票型基金、混合型基金(包括ETF和LOF)、接受国务院金融监督管理机构监管发行的权益类资产管理产品等。</p> <p>(3) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的混合类资产管理产品。</p> <p>(4) 接受国务院金融监督管理机构监管发行的期货和衍生品类资产管理产品。</p> <p>(5) 债券正回购。</p> <p>2、投资比例:</p> <p>本计划为混合类FOF资产管理计划,投资组合在各类资产上的投资比例,将严格遵守相关法律法规的规定。</p> <p>(1) 固定收益类资产占资产总值的比例:0-80%(不含)。其中,除货币基金、债券型基金、接受国务院金融监督管理机构监管发行的固定收益类资产管理计划以外部分占比为0-20%(不含)。</p> <p>其中,债券正回购融入资金余额不超过上</p>
---	---

		<p>一日计划资产净值的100%，债券逆回购融出资金余额不超过上一日计划资产净值的100%，法律法规政策另有规定的除外。</p> <p>(2) 权益类资产占资产总值的比例：0-50%(不含)。</p> <p>(3) 期货和衍生品类资产的持仓合约价值的比例占资产总值的比例为：不低于20%，且期货和衍生品账户权益占资产总值的比例为：不超过50%(含)。</p> <p>(4) 管理人根据所投资资产管理产品披露投资组合的频率核查本资产管理计划所投资其他资产管理产品的估值表和净值数据等信息，按照穿透原则合并计算资产管理计划投资于同一或同类资产的金額及比例并进行监督。</p> <p>托管人履行投资监督义务受限于管理人提供的数据和信息的，由管理人对所提供信息的真实性、准确性和完整性负责。</p> <p>托管人对本条约定的委托资产的投资监督和检查自本资产管理计划合同生效之日起开始。</p>
<p>十四、越权交易 (三) 资产托管人对资产管理人投资运作的监督</p>	<p>4、资产托管人对资产管理计划财产投资范围的监督和检查自本合同生效之日起开始；对投资比例限制的监督和检查自6个月的建仓期后开始在本合同到期日前一个月内，因资产管理计划财产变现需要，本资产管理计划财产的投资比例限制可以不符合上述规定。</p>	<p>4、资产托管人对资产管理计划财产投资范围的监督和检查自本合同生效之日起开始；对投资比例限制的监督和检查自6个月的建仓期后开始。</p>

<p>十五、资产管理计划财产的估值和会计核算</p>	<p>(四) 估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值方法：</p> <p>(1) 证券交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(2) 证券交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(3) 证券交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变</p>	<p>(四) 估值方法</p> <p>1、固定收益品种的估值方法：</p> <p>本合同所称的固定收益品种，包括在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的国债、中央银行债、政策性银行债、短期融资券、中期票据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、可交换债券、证券公司短期债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券投资品种，以及同业存款、债券回购等其他在活跃市场中没有报价但回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。</p> <p>(1) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价。</p> <p>(2) 对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取第三方估值基准服务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。</p> <p>(3) 对于含投资者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选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信</p>
----------------------------	--	--

	<p>化因素，调整最近交易市价，确定公允价值；</p> <p>(4) 证券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；对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募证券，用估值技术进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。管理人应持续评估上述做法的适当性，并在情况发生改变时与托管人协商并做出适当调整。</p> <p>(5) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，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。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券的估值方法应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价(收盘价)估值；该日无交易的，以最近一日的市价(收盘价)估值；</p> <p>(2) 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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在证券交易所上市后，按证券交易所上市的同一股票的市价(收盘价)估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允</p>	<p>用风险变化对公允价值的影响。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。</p> <p>(4) 对于在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。</p> <p>(5) 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，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</p> <p>(6) 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。</p> <p>(7) 银行存款以本金列示，按相应利率逐日计提利息。</p> <p>(8) 第三方估值基准服务机构的选取原则</p> <p>对于证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种，采用中证指数有限公司提供的数据。对于银行间债券市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种，采用中债金融估值中心有限公司提供的数据。</p> <p>2、回购协议的估值方法</p> <p>持有的回购协议以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>3、投资证券投资基金的估值方法</p> <p>(1) 持有的交易所上市基金(包括封闭式</p>
--	--	--

<p>价值。</p> <p>3、证券投资基金的估值方法：</p> <p>(1) 上市流通的证券投资基金按估值日前一日本所在证券交易所的收盘价估值；估值日前一日本无交易的，以最近交易日的收盘价估值；</p> <p>(2) 其他证券投资基金按估值日公布的基金份额净值估值，当日未公布的，以最近交易日公布的基金份额净值为准。(如果本计划以开放式证券投资基金为主要投资对象，场外投资的开放式证券投资基金按照估值当日基金份额净值估值，当日无净值的，以最近交易日取得的基金份额净值为准。)</p> <p>(3) 持有的货币市场基金，按估值日前一日本公布的每万份收益估值，估值日前一日本未公布的，以最近交易日公布的每万份收益估值(如果本计划以开放式证券投资基金为主要投资对象，持有的货币市场基金，按估值日前一日的每万份收益估值，估值日前一日本未公布的，以最近交易日公布的每万份收益估值)</p> <p>(4) 全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>(5) 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。</p> <p>(6) 期货合约按估值日其所在交易所的结算价估值；估值当日无结算价的，且最</p>	<p>基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易、最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；</p> <p>(2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))，按估值日的基金份额净值估值；估值日基金份额净值无公布的，按此前公布的最近交易日的基金份额净值估值；</p> <p>(3) 持有的货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；</p> <p>(4) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；未公布份额净值的，管理人与托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。</p> <p>(5) 基金特殊情况的估值处理 如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，根据以下原则进行估值：</p>
--	---

<p>近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p> <p>(7) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>(8) 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>(9) 银行存款以成本列示，利息在实际收到时入账。</p> <p>(10) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的私募基金产品，包括但不限于基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在基金业协会登记的私募基金管理人发行的资产管理产品，按照估值日前一日私募基金产品公布的单位净值估值，如估值日前一日单位净值未公布的，以前最近一个交易日公布的产品份额净值估值。</p> <p>4、如使用侧袋估值等特殊估值方法的，应进行明确约定，并在风险揭示书中进行特别揭示。</p> <p>5、如资产管理人或资产托管人发现对资产管理计划财产的估值违反本合同项下订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。</p>	<p>以所投资基金的份额净值估值的，若所投资基金与资产管理产品估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的份额净值为基础估值。</p> <p>以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的份额净值为基础或参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素调整最近交易市价，确定公允价值。</p> <p>若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，将根据份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。</p> <p>4、股票的估值方法</p> <p>(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；</p> <p>(2) 上市流通股票估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>(3) 首次发行未上市的股票，采用估值</p>
--	---

		<p>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,按成本价估值。</p> <p>(4) 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票,按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值;该日无交易的,以最近一日的收盘价估值。</p> <p>(5) 非公开发行、首次公开发行时公司股东公开发售以及通过大宗交易取得的有明确锁定期的股票,按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。</p> <p>5、接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品的估值方法 持有的接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品,以其资产管理人提供的估值日份额净值或虚拟份额净值估值;估值日未提供份额净值或虚拟份额净值的,以前最近一次提供的份额净值或虚拟份额净值估值。</p> <p>6、如使用侧袋估值等特殊估值方法的,应进行明确约定,并在风险揭示书中进行特别揭示。</p> <p>7、如资产管理人或资产托管人发现对资产管理计划财产的估值违反本合同项下订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时,应立即通知对方,共同查明原因,双方协商解决。</p>
十六、资产	1、资产管理人的管理费	1、资产管理人的管理费

<p>管理计划的费用与税收</p> <p>(三) 费用计提方法、计提标准和支付方式</p>	<p>资产管理计划财产的年管理费率为0.3%，计算方法如下：</p> <p>管理费=前一日资产管理计划财产净值×年管理费率÷365</p>	<p>本资产管理计划对计划财产中持有的本资产管理人自身管理的部分不收取管理费。资产管理计划财产的年管理费率为0.3%，计算方法如下：</p> <p>管理费=(前一日资产管理计划财产净值-前一日持有的自身管理的资产管理计划净值)×年管理费率÷365</p>
<p>十六、资产管理计划的费用与税收</p> <p>(三) 费用计提方法、计提标准和支付方式</p>	<p>3、业绩报酬</p> <p>在两类情况下管理人将根据年化收益率(R)、业绩报酬计提基准(RE)提取业绩报酬(E)，一类是委托人提取资产或本资产管理计划终止清算时提取业绩报酬，称为退出提取；另一类是分红时提取业绩报酬，称为分红提取。分红提取的业绩报酬计提频率不高于六个月一次。本资产管理计划的业绩报酬计提基准为6%，管理人对年化收益率R超过业绩报酬计提基准的收益部分提取10%的业绩报酬。</p> <p>(1) 管理人对委托人的每笔计划份额按参与时间的不同加以区分，对每笔计划份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>.....</p>	<p>3、业绩报酬</p> <p>在两类情况下管理人将根据年化收益率(R)、业绩报酬计提基准(RE)提取业绩报酬(E)，一类是委托人提取资产或本资产管理计划终止清算时提取业绩报酬，称为退出提取；另一类是分红时提取业绩报酬，称为分红提取。分红提取的业绩报酬计提频率不高于十二个月一次。</p> <p>业绩报酬计提标准为：</p> <p>当R>RE时，对超过RE的收益部分提取20%的业绩报酬，即$E=K \times (R-RE) \times 20\% \times (D \div 365)$。</p> <p>自2024年1月1日起，业绩报酬计提基准RE具体数值为4.25%。后续运作期内，管理人可根据央行三年定存基准利率对业绩报酬计提基准进行动态调整，调整后的RE的具体数值以管理人提前至少五个工作日发送至委托人、托管人的书面通知为准。</p> <p>委托人如果对RE的数值有异议的，应当于收到书面通知之日起三个工作日内以书面方式向管理人提出反馈意见，未在三</p>

		<p>个工作日内向管理人提出书面异议的,视为已确认。</p> <p>(1) 管理人对委托人的每笔计划份额按参与时间的不同加以区分,对每笔计划份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p>.....</p>
<p>十七、资产管理计划的收益分配</p>	<p>(三) 收益分配原则</p> <p>本资产管理计划收益分配应遵循下列原则:</p> <p>(1) 本计划存续期内,收益分配日不设置固定日期,收益分配采用现金分配的方式。</p> <p>(2) 当委托人提取委托资产时,管理人根据委托资产收益情况确定收益分配日期、收益分配金额等,并告知委托人。</p> <p>(3) 收益分配的金额计量单位为人民币元,按四舍五入法保留到小数点后两位,由此误差产生的损失由计划资产承担,产生的收益归计划资产所有。</p> <p>(4) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。</p>	<p>(三) 收益分配原则</p> <p>本资产管理计划收益分配应遵循下列原则:</p> <p>(1) 本计划存续期内收益分配每年不超过2次,收益分配日不设置固定日期,收益分配采用现金分配的方式,具体收益分配时间以收益分配方案为准。</p> <p>(2) 当委托人提取委托资产时,管理人根据委托资产收益情况确定收益分配日期、收益分配金额等,并告知委托人。</p> <p>(3) 收益分配的金额计量单位为人民币元,按四舍五入法保留到小数点后两位,由此误差产生的损失由计划资产承担,产生的收益归计划资产所有。</p> <p>(4) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。</p>

<p style="text-align: center;">十八、信息披露与报告</p>	<p>(一) 向投资者提供的报告</p> <p>1、年度报告</p> <p>资产管理人应当在每年结束后2个月内,编制完成资产管理计划财产年度报告,资产管理人在年度报告完成当日,将其发送资产托管人,资产托管人收到后2个月内复核其中的财务数据,并将复核结果书面通知资产管理人,由资产管理人将年度报告送交投资者。资产管理合同成立未满3个月或者存续期间不足3个月的,可不编制上一年度资产管理合同财务年度报告。年度报告包括但不限于下列信息:</p> <p>①资产管理人履职报告;</p> <p>②资产托管人履职报告;</p> <p>③资产管理计划投资表现;</p> <p>④资产管理计划投资组合报告;</p> <p>⑤资产管理计划运用杠杆情况(如有);</p> <p>⑥资产管理计划财务会计报告;</p> <p>⑦资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬(如有)等费用的计提基准、计提方式和支付方式;</p> <p>⑧投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;</p> <p>⑨中国证监会规定的其他事项。</p> <p>2、季度报告</p> <p>资产管理人应当在每季度结束之日起10个工作日内,编制完成资产管理计划财产季度报告,资产管理人在季度报告完成当日,将其发送资产托管人,资产托管人收</p>	<p>资产管理人、资产托管人应当根据法律法规的规定及合同的约定向资产委托人、监管机构履行报告义务,若法律法规、中国证监会、基金业协会对信息披露文件的种类、内容与格式有新的规定的,从其规定。</p> <p>(一) 资产管理人的信息披露义务</p> <p>1、资产管理人向资产委托人履行信息披露义务</p> <p>资产管理人应向资产委托人提供下列信息披露文件:</p> <p>(1) 资产管理合同、计划说明书和风险揭示书</p> <p>资产管理人募集资产管理计划,除向投资者提供资产管理合同外,还应当制作计划说明书和风险揭示书,详细说明资产管理计划管理和运作情况,充分揭示资产管理计划的各类风险。计划说明书披露的信息应当与资产管理合同内容一致。风险揭示书应当作为资产管理计划合同的一部分交由投资者签字确认。</p> <p>(2) 资产管理计划净值,资产管理计划参与、退出价格</p> <p>资产管理人应在每个工作日将上一工作日经资产托管人复核的计划净值和计划份额净值以电子邮件形式提交资产委托人。</p> <p>(3) 资产管理计划定期报告,包括季度报告和年度报告</p> <p>管理人应当向投资者提供资产管理计划</p>
--	--	---

<p>到后 10 个工作日内复核其中的财务数据，并将复核结果书面通知资产管理人，由资产管理人将季度报告送交投资者。资产管理合同成立未满 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，可不编制上一季度资产管理合同财务季度报告。</p> <p>季度报告包括但不限于下列信息：</p> <p>①资产管理人履职报告；</p> <p>②资产托管人履职报告；</p> <p>③资产管理计划投资表现；</p> <p>④资产管理计划投资组合报告；</p> <p>⑤资产管理计划运用杠杆情况（如有）；</p> <p>⑥资产管理计划财务会计报告；</p> <p>⑦资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；</p> <p>⑧投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；</p> <p>⑨中国证监会规定的其他事项。</p> <p>3、发生资产管理合同约定或可能影响投资者利益的重大事项时，在事项发生之日起五日内向投资者披露。</p> <p>（二）向监管机构提供的报告</p> <p>资产管理人、资产托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务，列明资产管理人、资产托管人向监管机构报告的种类、内容、时间和途径等有关事项。</p> <p>（三）投资者可向资产管理人查询资产管理计划财产投资运作情况、向资产托管人</p>	<p>季度报告和年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，年度报告包括但不限于下列信息：</p> <p>1) 管理人履职报告；</p> <p>2) 托管人履职报告（如有）；</p> <p>3) 资产管理计划投资表现；</p> <p>4) 资产管理计划投资组合报告；</p> <p>5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；</p> <p>6) 资产管理计划财务会计报告；</p> <p>7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；</p> <p>8) 投资经理变更、关联交易等涉及投资者权益的重大事项；</p> <p>9) 中国证监会规定的其他事项。</p> <p>资产管理计划季度报告应当披露前款除第 6) 项之外的其他信息。</p> <p>资产管理人应于每季度结束之日起一个月内披露季度报告。资产管理人应于每季度结束之日起制作、完成季度报告，并将季度报告以邮件或其他双方约定的方式提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 7 个工作日内对相关财务数据进行完成复核，并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理人应于每年度结束之日起四个月内披露年度报告。其中，资产管理人在每年结束之日起制作、完成年度报告并以邮件或其他双方约定的方式提供资产托管人复核，资产托管人在收到后 30 天</p>
--	---

	<p>查询资产管理计划财产托管情况。投资者能够按照资产管理合同约定的时间和方式查阅或者复制所披露的信息资料。</p>	<p>内对相关财务数据进行复核,并将复核结果书面通知资产管理人。资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的,资产管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告。</p> <p>(4) 重大事项的临时报告</p> <p>发生资产管理合同约定的或者可能影响投资者利益的重大事项时,资产管理人应在事项发生之日起五个工作日内向投资者披露。包括但不限于:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 本资产管理计划投资经理发生变动。 2) 涉及资产管理计划财产、资产托管业务的诉讼。 3) 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调查。 4) 法律法规和中国证监会规定的其他事项。 <p>(5) 资产管理计划清算报告</p> <p>资产管理计划终止的,资产管理人应当在资产管理计划清算结束后 20 个工作日内,将清算报告提交投资者。</p> <p>(6) 中国证监会规定的其他事项</p> <p>2、资产管理人向监管机构履行信息披露义务</p> <p>资产管理人应当根据法律法规和中国证监会等监管机构的要求履行信息披露义务。</p> <p>(二) 资产托管人的信息披露义务</p> <p>资产托管人应当根据法律法规的规定、监</p>
--	--	---

		<p>管机构的要求及本合同的约定向资产委托人、监管机构履行信息披露义务以及对相关信息披露文件的复核义务,包括但不限于净值报告、季度报告、年度报告等。</p> <p>(三)资产管理人向资产委托人进行信息披露的信息查询的方式</p> <p>资产管理人向资产委托人提供的报告,将严格按照《基金法》、《管理办法》等相关法规、中国证监会、基金业协会的规定等通过以下至少一种方式进行。资产管理人可根据实际情况选择以下一种或多种方式进行信息披露。</p> <p>1、 邮寄服务</p> <p>资产管理人或代理销售机构向资产委托人邮寄年度、季度报告、净值报告、临时报告等有关本计划的信息。资产委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更,资产委托人应当及时通知资产管理人。</p> <p>2、 传真或电子邮件</p> <p>如资产委托人留有传真号、电子邮箱等联系方式的,资产管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将报告信息通知资产委托人。传真号、电子邮箱如有变更,资产委托人应当及时通知资产管理人。</p> <p>3、 资产管理人网站: www.shzq.com</p>
附件 18	<p>1、 关联交易的定义</p> <p>关联交易是指本管理人所管理的资产管理计划与本公司、托管人及前述机构的控</p>	<p>1、 关联交易的定义</p> <p>关联交易是指本管理人所管理的资产管理计划与本公司、托管人及前述机构的控</p>

<p>股股东、实际控制人或者其他关联方之间发生的证券投资交易行为,包括但不限于资产管理计划投资于关联方发行的债券或者承销期内承销的债券,认购关联方发行的基金、集合资产管理计划、信托计划或理财产品等,或者为关联方提供单一资产管理业务服务、关联方认购公司发行的集合资产管理计划等。</p> <p>2、关联交易的标准</p> <p>资产管理计划参与涉及标的额达到或超过人民币 3000 万元的关联交易,属于重大关联交易。</p> <p>上述重大关联交易以外的关联交易为一般关联交易。</p> <p>对于重大关联交易的标准,后续监管部门、自律组织另有规定的,从其规定,本合同不再修改。</p> <p>3、关联交易的处理方式</p> <p>委托人签署本合同即视为其授权管理人可以从事符合第 2 款规定标准的一般关联交易。管理人应严格遵守法律、行政法规、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、委托人,并按相关规定报告或备案。</p> <p>如本单一计划拟从事重大关联交易的,应当事先以书面形式征询投资者意见,并取得投资者的书面同意,未取得投资者书面同意的,管理人不得从事重大关联交易。从事重大关联交易的,管理人应当单独于</p>	<p>股股东、实际控制人或者其他关联方之间发生的证券投资交易行为,包括但不限于下列情形:</p> <p>(1) 资产管理计划投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券;</p> <p>(2) 资产管理计划投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划;</p> <p>(3) 与关联方开展证券等交易,交易对手方、质押券涉及关联方。</p> <p>法律法规另有规定的,从其规定,本合同不再修改。</p> <p>2、关联交易的标准</p> <p>(1) 资产管理计划重大关联交易包括:</p> <p>1) 运用资产管理计划财产买卖公司、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的证券或承销期内承销的证券;</p> <p>2) 大集合产品的单笔关联交易超过该产品资产净值 10%, 私募资产管理计划参与关联交易涉及的标的额达到或超过人民币 3000 万元的,视为重大关联交易。但正常业务中发生的关联交易不视为重大关联交易,包括但不限于资产管理产品通过关联方交易单元进行的交易、从资产管理产品资产中支付给管理人、托管人的关联方的管理费、托管费、公司开展的私募 FOF 集合资产管理计划投资于公司管理的其他资产管理产品等关联交易。</p>
--	---

<p>事后及时告知托管人、委托人，同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（如需）。</p> <p>管理人从事关联交易，将遵循委托人利益优先原则，严格履行内部审批机制，确保关联交易价格公允，不损害委托人利益，并防范利益冲突等违法违规行为。计划管理人承诺运用受托管理资产从事关联交易的不会损害投资者利益。</p> <p>4、管理人关联方的披露查询方式</p> <p>管理人的关联方名单详见本通知附件。关联方名单有变化的，管理人通过告知函等书面形式向合同相关方予以披露。</p> <p>5、关联交易的内部控制措施</p> <p>管理人已制定《上海证券有限责任公司资产管理总部关联交易实施细则》，严格按照内部制度规定履行关联交易内部控制程序。资产管理计划参与关联交易的，由投资经理制订关联交易情况说明书，经部门负责人审批后，提交总部合规风控部审核。涉及重大关联交易的，还需经资产管理总部投资决策委员会审议。</p> <p>管理人关联交易内部控制措施有重大变化的，管理人将在官方网站（www.shzq.com）或者定期报告中予以披露。</p>	<p>(2) 资产管理产品开展重大关联交易以外的关联交易属于一般关联交易。</p> <p>(3) 对于关联交易的标准，后续监管部门、自律组织另有规定的，从其规定；管理人亦有权在遵守法律法规、政策规定且不损害委托人利益的前提下，调整关联交易的标准。管理人通过管理人网站公告或定期报告的形式将更新后的关联交易标准披露给委托人，本合同不再修改。</p> <p>3、关联交易的处理方式</p> <p>委托人签署本合同即视为其授权管理人可以从事符合第2款规定标准的一般关联交易。管理人应严格遵守法律、行政法规、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、委托人，并按相关规定报告或备案。</p> <p>如本单一计划拟从事重大关联交易的，应当事先以书面形式征询投资者意见，并取得投资者的书面同意，未取得投资者书面同意的，管理人不得从事重大关联交易。从事重大关联交易的，管理人应当单独于事后及时告知托管人、委托人，同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（如需）。</p> <p>管理人从事关联交易，将遵循委托人利益优先原则，严格履行内部审批机制，确保关联交易价格公允，不损害委托人利益，并防范利益冲突等违法违规行为。计划管理人承诺运用受托管理资产从事关联交</p>
---	---

		<p>易的不会损害投资者利益。</p> <p>4、管理人关联方的披露查询方式</p> <p>管理人的关联方名单详见管理人书面通知。</p> <p>关联方名单有变化的,管理人通过告知函等书面形式向合同相关方予以披露。</p> <p>5、关联交易的内部控制措施</p> <p>管理人从事关联交易,应当符合本合同约定的投资目标及策略。管理人已制定《上海证券有限责任公司资产管理总部关联交易实施细则》,严格按照内部制度规定履行关联交易内部控制程序。资产管理计划参与关联交易的,由投资经理制订关联交易情况说明书,说明书应包含定价公允性说明,经部门负责人审批后,提交总部合规风控部审核。涉及重大关联交易的,还需经资产管理总部投资决策委员会审议。</p> <p>管理人关联交易内部控制措施有重大变化的,管理人将在官方网站(www.shzq.com)或者定期报告中予以披露。</p>
--	--	---

二、委托资产总额

本计划项下委托资产总金额为人民币 13.5 亿元,由委托人于二零二四年二月二十九日前将剩余未缴付部分(以 2024 年 1 月 1 日为基准日,未缴付金额=委托资产总金额-基准日计划净资产金额)足额缴付至本计划托管账户。

三、资产管理计划的展期

经委托人、管理人和托管人协商一致，本资产管理计划存续期限自 2024 年 1 月 1 日起展期至 2026 年 12 月 31 日（包括首尾两日）。

四、期货和衍生品投资的特别说明

本资管计划存续期间，当市场出现系统性机会，使得对冲类策略与套利类策略的收益预期提升时（如经济基本面、政策面、企业盈利等利好因素，有效提升权益市场活跃度，带来高性价比的投资机会），管理人可以相应提升期货和衍生品类资产的投资比例，则本计划直接或间接投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值比例可不低于 80%，且账户权益价值高于 20%，但该类资产的投资仅限于执行对冲、套利策略。

五、资产管理计划的风险等级

管理人根据相关法律法规及其内部相关制度规定，以及上述投资范围、投资比例，将本资产管理计划的风险等级评价为 R3 中风险投资品种，适合专业投资者和风险承受能力评估结果为 C3 稳健型及以上的合格投资者持有。

六、资产委托人签署本补充协议前，已充分阅读并知悉上述条款变更内容以及可能给计划财产或自身权益造成的影响，愿意自行承担由此可能导致的投资风险。

七、本补充协议所使用之术语，如无例外之说明，应与《资产管理合同》相同之术语具有相同之含义。本补充协议未作规定处，以《资产管理合同》的规定为准。

八、本补充协议由资产委托人、资产管理人和资产托管人法定代表人/负责人或授权代理人签字或盖章并加盖公章或合同专用章后生效。

九、本补充协议一式叁份，资产委托人、资产管理人和资产托管人各执壹份，具有同等法律效力。

十、本补充协议是对资产管理合同进行的重大变更或补充，资产管理人应当按照基金业协会的相关要求进行备案。（以下无正文）

(本页无正文，为《上海证券翱翔蓝海 FOF 单一资产管理计划资产管理合同之补充协议
(二)》之签署页)

委托人(公章): 杭州联华华商集团有限公司

法定代表人或授权代理人(盖章或签字):



[Handwritten signature]

签署日期: 2023年9月27日

管理人(公章): 上海证券有限责任公司

法定代表人或授权代理人(盖章或签字):



[Handwritten signature]

签署日期: 2023年9月25日

托管人(盖章): 中国建设银行股份有限公司上海市分行

负责人或授权代理人(盖章或签字):



[Handwritten signature]

签署日期: 2023年9月22日

(以最后一方签署日期为生效日期)

