

# 关于东方红-新睿3号集合资产管理计划 变更条款相关事项の確認函

上海浦东发展银行股份有限公司：

根据《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《细则》)、《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《业务规范》)，我司拟对东方红-新睿3号集合资产管理计划(以下简称“东方红-新睿3号”)的相关条款进行变更，《东方红-新睿3号集合资产管理计划说明书》(以下简称“说明书”)、《上海东方证券资产管理有限公司东方红-新睿3号集合资产管理计划风险揭示书》(以下简称“风险揭示书”)、《东方红-新睿3号集合资产管理计划投资监督事项之补充约定》(以下简称“补充约定”)等相关内容一并调整。

我司将根据《管理办法》、《细则》及《业务规范》的相关规定及《东方红-新睿3号集合资产管理合同》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) 修改内容及修改原因

### 1、东方红-新睿3号集合资产管理合同修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
1	一、前言	为规范东方红-新睿3号集合资产管理计划(以下简称“集合计	为规范东方红-新睿3号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计	根据法律

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
		划”或“计划”)运作,明确《东方红-新睿3号集合资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务试行办法》(以下简称《试行办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则(试行)》(以下简称《细则》)等法律法规和中国证监会的有关规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《试行办法》、《细则》、《东方红-新睿3号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。	划”)运作,明确《东方红-新睿3号集合资产管理合同》(以下简称“本合同”)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《实施细则》、《细则》)、《私募投资基金监督管理暂行办法》(证监会第105号令)等有关法律法规及中国证券业协会《证券公司客户资产管理业务规范》(以下简称《规范》)等自律性文件的规定,委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件,当事人按照《管理办法》、《细则》、《规范》、《东方红-新睿3号集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。	法规调整
2	三、东方红-新睿3号集合资产管理计划的基本情况 (四)投资范围和投资比例	<p>1、投资范围</p> <p>国内依法发行的权益类资产、固定收益类资产、现金类资产及法律法规允许集合计划投资的其他金融工具。集合计划可以参与融资融券交易,也可以将其持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司。</p> <p>2、资产配置比例(占资产净值比例)</p> <p>(1)固定收益类资产:包括债券逆回购(期限大于7天)、国债(到期日在1年以上)、公司债、企业债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、政策性金融债、央行票据(到期日在1年以上)、中期票据、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、资产支持受益凭证等,占资产净值的0-135%。</p> <p>(2)权益类资产:股票(包括新股申购所得股票,参与定向增发所得股票)、股票型基金、混合型基金、权证等占资产</p>	<p>1、投资范围</p> <p>国内依法发行的权益类资产、固定收益类资产、现金类资产、衍生金融工具及法律法规允许集合计划投资的其他金融工具。集合计划可以参与融资融券交易,也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。本集合计划可以参与股票质押式回购业务,集合资产管理计划为融出方的,在股票质押回购中质权人登记为管理人。</p> <p>2、资产配置比例(占资产净值比例)</p> <p>(1)固定收益类资产:包括债券逆回购(期限大于7天)、政府债券(到期日在1年以上)、公司债、企业债、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券、短期融资券、政策性金融债、中小企业私募债、债券型基金、央行票据(到期日在1年以上)、中期票据、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、股票型及混合型分级基金的优先级份额、股票质押式回</p>	<p>(1)根据法律法规,增加股票质押式回购、国债期货等投资标的;</p> <p>(2)权益类资产投资上限提高至135%;</p> <p>(3)折价</p>

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
		<p>净值的0-95%。其中权证上限为3%。</p> <p>(3) 现金类资产：现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、定活两便存款）、货币市场基金、期限为7天内（含7天）的债券逆回购、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据等高流动性短期金融产品等，在集合计划封闭期和开放期内占资产净值均不低于5%。</p> <p>(4) 具有折价套利机会的资产，是指通过某种交易方式使得购置价格低于二级市场价格，或者通过某些交易方式和金融工具的运用具有套利可能的资产，包括：折价的大宗交易所得资产、折价的定向增发股票、定向增发破发股票、折价的封闭式基金、可转换债券及可转换债券转换所得的股票等，上述资产与现金类资产的总和不低于资产净值的70%。</p> <p>(5) 卖出股指期货合约价值总额不超过集合计划持有的权益类资产总市值的20%。</p> <p>(6) 买入股指期货合约价值总额不超过集合计划资产净值的10%。</p> <p>(7) 在任一时点持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计不超过资产净值的95%。</p> <p>(8) 在任何交易日日终，在扣除股指期货合约占用的交易保证金后，保持不低于集合资产管理计划资产净值5%的现金及到期日在1年以内（含1年）的政府债券。</p> <p>(9) 集合计划可以参与证券回购，但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的40%。</p>	<p>购业务（作为融出方）、资产支持证券等，占资产净值的<b>0-135%</b>。</p> <p>(2) 权益类资产：股票（包括新股申购所得股票，参与定向增发所得股票）、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）、权证等，占资产净值的<b>0-135%</b>，其中权证上限为3%。</p> <p>(3) 现金类资产：现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、定活两便存款、同业存款、可转让存单等各类存款）、货币市场基金、期限为7天内（含7天）的债券逆回购、到期日在1年内（含1年）的国债、到期日在1年内（含1年）的央行票据等高流动性短期金融产品等，在集合计划封闭期和开放期内占资产净值均不低于5%。</p> <p>(4) 衍生金融工具：股指期货、国债期货等，其中股指期货、国债期货投资范围是在中国金融期货交易所挂牌交易的股指期货合约和国债期货合约。买入股指期货合约价值总额不超过集合计划资产净值的10%；卖出股指期货合约价值总额不超过集合计划持有的权益类资产总市值的20%；在任何交易日日终，集合计划买入、卖出国债期货合约价值轧差计算后不超过资产净值的120%。</p> <p>(5) 具有折价套利机会的资产，是指通过某种交易方式使得购置价格低于二级市场价格，或者通过某些交易方式和金融工具的运用具有套利可能的资产，包括：购置价格低于当日收盘价格的的大宗交易所得资产、发行价格低于获配当日收盘价的定向增发股票、购置价格低于处于锁定期间的定向增发发行价格的股票、购置价格低于最近一年内大股东或上市公司高管增持价格的股票、购置价格低于单位净值的封闭式基金、可转换债券及可转换债券转换所得的股票等、可交换债券及可交换债券转换所得的股票等，上述资产与现金类资产的总和不低于资产净值的</p>	<p>套利+现金类资产下限由70%调低至50%，并进一步明确解释了“折价套利”资产的范围。</p>

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
			<p>50%。</p> <p>(6) 在任一时点持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计不超过资产净值的135%。</p> <p>(7) 如集合计划投资股指期货和/或国债期货, 在任何交易日日终, 在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后, 保持不低于集合资产管理计划资产净值5%的现金及到期日在1年以内(含1年)的政府债券。</p> <p>(8) 集合计划可以参与证券回购, 但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的40%。</p>	
3	五、管理人自有资金参与本集合计划	五、管理人不以自有资金参与本集合计划 管理人不以自有资金参与本集合计划。	<p>五、管理人自有资金参与本集合计划 管理人以自有资金参与本集合计划的:</p> <p>(一) 自有资金参与的条件</p> <p>在本集合计划推广期起始日至集合计划终止日内, 管理人可以以自有资金参与本集合计划。</p> <p>在本集合计划存续期间, 为应对集合计划巨额退出, 解决流动性风险, 在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下, 管理人可以自有资金参与本集合计划, 但需事后及时告知委托人和托管人, 并按规定报监管机构备案。</p> <p>管理人以自有资金参与本集合计划, 应符合《管理办法》、《细则》、《规范》和中国证监会及中国证券业协会、中国证券投资基金业协会的相关规定。</p> <p>(二) 自有资金参与的金额和比例</p> <p>管理人自有资金持有本集合计划份额不超过集合计划总份额的20%。</p> <p>(三) 自有资金收益分配、责任承担方式和金额</p> <p>管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的</p>	为自有资金参与集合计划留下空间

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
			<p>权利，也有承担与计划份额相对应损失的责任。</p> <p>(四) 自有资金退出的条件            管理人自有资金参与部分在出现以下情况之一时，可以退出本集合计划：            1、管理人自有资金参与份额，满足参与时间不少于6个月条件时，可与其他委托人同样办理退出业务。            2、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规及本合同规定比例。            3、法律法规或监管机构规定的允许自有资金退出的其他情况。</p> <p>(五) 管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月，参与、退出时应当提前5个工作日告知委托人和托管人。</p> <p>(六) 为应对巨额退出，解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人。</p> <p>(七) 因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限时的处理原则及处理措施：            因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划的比例超过计划总份额的20%时，管理人在具备参与、退出本计划条件之日起10个交易日内可以将自有资金比例降至许可范围内。</p> <p>(八) 风险揭示            管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制风险。</p> <p>(九) 信息披露            管理人及时在管理人指定网站公告自有资金参与的相关情况。</p>	

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
4	六、集合计划账户管理 (一) 集合计划托管银行账户的开立和管理	根据《试行办法》、《细则》和相关规定, 托管人将以集合资产管理计划的名义开立专用托管银行账户, 保管集合计划的银行存款。该账户的开设和管理由托管人负责, 管理人提供必要协助。本集合计划成立后的一切货币收支活动, 均需通过该托管银行账户进行。	根据《管理办法》、《细则》、《规范》和相关规定, 托管人将以集合资产管理计划的名义开立专用托管银行账户, 保管集合计划的银行存款。该账户的开设和管理由托管人负责, 管理人提供必要协助。本集合计划成立后的一切货币收支活动, 均需通过该托管银行账户进行。	根据法律法规调整
5	七、集合计划资产托管	东方红-新睿 3 号集合资产管理计划资产交由托管人负责托管, 管理人与托管人必须按照《试行办法》、《细则》、本合同及其他有关规定签订托管协议。	东方红-新睿 3 号集合资产管理计划资产交由托管人负责托管, 管理人与托管人必须按照《管理办法》、《细则》、《规范》、本合同及其他有关规定签订托管协议。	根据法律法规调整
6	八、投资限制	为维护委托人的合法权益, 本集合计划投资禁止从事下列行为: 1、集合计划参与证券回购融入资金余额超过集合计划资产净值的40%; 2、将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途; 3、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资; 4、将集合计划投资于一家公司发行的证券超过资产净值的10%; 5、管理人将其所管理的客户资产投资于一家公司发行的证券, 按证券面值计算, 超过该证券发行总量的10%; 6、本集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券 (包括管理人母公司保荐 (主承销) 的证券) 的	为维护委托人的合法权益, 本集合计划投资禁止从事下列行为: 1、集合计划参与证券回购融入资金余额超过集合计划资产净值的40%; 2、将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途; 3、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资; 4、将集合计划投资于一家公司发行的证券超过资产净值的10%; 5、管理人将其所管理的客户资产投资于一家公司发行的证券, 超过该证券发行总量的10%; 6、本集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券 (包括管理人母公司保荐 (主承销) 的证券) 的资金超过资产净值的7%。因集合计划资产申购新股新券或参与大宗交易, 致使投资不符合本规定的, 管理人应在具备调整机会的五个工作日内进行调整, 以符合上述规定。法律法规另有规定时, 从其规定;	根据投资范围、比例相应修订

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
		<p>资金超过资产净值的7%。因集合计划资产申购新股新券或参与大宗交易，致使投资不符合本规定的，管理人应在具备调整机会的五个工作日内进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定；</p> <p>7、投资于信托公司发行的产品；</p> <p>8、集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的现金总额，申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>9、在任一时点，集合资产管理计划持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计超过资产净值的95%；</p> <p>10、在任何交易日日终，在扣除股指期货合约占用的交易保证金后，持有的现金及到期日在1年以内的政府债券（含1年）低于集合资产管理计划资产净值的5%；</p> <p>11、集合计划持有的卖出股指期货合约价值总额超过集合计划持有的权益类资产总市值的20%；</p> <p>12、集合计划持有的买入股指期货合约价值总额超过集合计划资产净值的10%；</p> <p>13、中国证监会禁止的其他行为。</p>	<p>7、集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的现金总额，申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>8、在任一时点，集合资产管理计划持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计超过资产净值的135%；</p> <p>9、如集合计划投资股指期货和/或国债期货，在任何交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后，持有的现金及到期日在1年以内的政府债券（含1年）低于集合资产管理计划资产净值的5%；</p> <p>10、集合计划持有的卖出股指期货合约价值总额超过集合计划持有的权益类资产总市值的20%；</p> <p>11、集合计划持有的买入股指期货合约价值总额超过集合计划资产净值的10%；</p> <p>12、在任何交易日日终，集合计划买入、卖出国债期货合约价值轧差计算后超过资产净值的120%；</p> <p>13、中国证监会禁止的其他行为。</p>	
7	十一、集合计划的信息披露	<p>(一) 集合计划的信息披露将严格按照《试行办法》、《细则》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定进行。</p> <p>(二) 《说明书》、《集合资产管理合同》</p> <p>管理人依据《试行办法》和《细则》提供《说明书》、《集合资产管理合同》以备投资者查阅。</p>	<p>(二) 集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《细则》、《规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定进行。</p> <p>(二) 《说明书》、《集合资产管理合同》</p> <p>管理人依据《管理办法》、《细则》和《规范》提供《说明书》、《集合资产管理合同》以备投资者查阅。</p>	根据法律法规调整
8	十一、集	1、定期报告	1、定期报告	(1) 根据

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
	合计划的 信息披露 (三)集 合计划成 立后信息 披露的内 容和披露 时间	<p>定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度(年度)报告、托管季度(年度)报告、年度审计报告和对账单。</p> <p>(1) 集合计划单位净值报告。 自集合计划成立之日,每周第一个工作日披露上周末单位净值;开放期内每个工作日披露截止前一个工作日的单位净值。</p> <p>(2) 集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。 管理人每季度向委托人提供资产管理季度报告,托管季度报告在每季度由托管人先行提供给管理人,由管理人代托管人向委托人提供。资产管理季度报告和托管季度报告应对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动、托管情况等作出详细的说明;资产管理季度报告须经托管人复核。上述报告应于每季度结束后的15个工作日内由管理人负责披露。集合资产管理合同生效不满二个月的,可以不编制季度报告。 按照《证券公司参与股指期货交易指引》的规定,管理人将在资产管理季度报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货交易的有关情况,包括投资目的、持仓情况、损益情况等,并充分说明投资股指期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。</p> <p>(3) 集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告。 管理人每年度向委托人提供资产管理年度报告,托管年度报告在每年由托管人先行提供给管理人,由管理人代托管人向委托人提供。资产管理年度报告和托管年度报告对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动、托管情况等作出详细</p>	<p>定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度(年度)报告、托管季度(年度)报告、年度审计报告和对账单。</p> <p>(1) 集合计划单位净值报告。 自集合计划成立之日,每周第一个工作日披露上周末单位净值;开放期内每个工作日披露截止前一个工作日的单位净值。</p> <p>(2) 集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。 管理人每季度向委托人提供资产管理季度报告,托管季度报告在每季度由托管人先行提供给管理人,由管理人代托管人向委托人提供。资产管理季度报告和托管季度报告应对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动、重大关联交易、托管情况等作出详细的说明;资产管理季度报告由管理人编制,经托管人复核后由管理人公告,并按相关规定报监管机构备案。上述报告应于每季度结束后的15个工作日内由管理人负责披露。集合资产管理合同生效不满二个月的,可以不编制季度报告。 集合计划投资股指期货和/或国债期货的,管理人应当在资产管理季度报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货和/或国债期货交易的有关情况,包括投资目的、持仓情况、损益情况等,并充分说明投资股指期货和/或国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。</p> <p>(3) 集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告。 管理人每年度向委托人提供资产管理年度报告,托管年度报告在每年由托管人先行提供给管理人,由管理人代托管人向委托人提供。资产管理年度报告和托管年度报告对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动、重大关联交易、托管情况等作出详细的说明。资产管理年度报告由管理人编制,经托管人复核后由管理人公告,并按相关规定报监管机构</p>	<p>法律法规调整;</p> <p>(2) 根据投资范围相应修订</p>

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
		<p>的说明；资产管理年度报告须经托管人复核。上述报告应于每会计年度结束后的60个工作日内由管理人负责披露。集合资产管理合同生效不满三个月的，可以不编制年度报告。</p> <p>按照《证券公司参与股指期货交易指引》的规定，管理人将在资产管理年度报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。</p> <p>（4）年度审计报告。</p> <p>管理人应按照有关法律法规的规定聘请会计师事务所对集合计划的运营情况单独进行年度审计，于每个会计年度结束后的60个工作日内提供给委托人和托管人。</p> <p>（5）对账单。</p> <p>管理人应按照有关法律法规的规定编制对账单，对委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况作出说明，每季度结束后向委托人提供。对账单的提供形式为邮寄或电子形式，委托人可以选择提供方式，默认的提供方式为电子形式（管理人将根据实际情况选择使用电子邮件、手机信息、管理人网站服务等方式）。</p> <p>2、临时报告</p> <p>集合计划存续期间发生以下可能对集合计划运作产生重大影响的事件时，管理人必须按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时在管理人网站进行信息披露：</p> <p>（1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管</p>	<p>备案。上述报告应于每会计年度结束后的60个工作日内由管理人负责披露。集合资产管理合同生效不满三个月的，可以不编制年度报告。</p> <p>集合计划投资股指期货和/或国债期货的，管理人应当在资产管理年度报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货和/或国债期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货和/或国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。</p> <p>（4）年度审计报告。</p> <p>管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合资产管理计划出具单项审计意见。</p> <p>管理人应当将审计结果按相关规定报监管机构备案，并将本集合资产管理计划的单项审计意见提供给委托人和托管人。</p> <p>（5）对账单。</p> <p>管理人应按照有关法律法规的规定编制对账单，对委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况作出说明，每季度结束后向委托人提供。对账单的提供形式为邮寄或电子形式，委托人可以选择提供方式，默认的提供方式为电子形式（管理人将根据实际情况选择使用电子邮件、手机信息、管理人网站服务等方式）。</p> <p>2、临时报告</p> <p>集合计划存续期间发生以下可能对集合计划运作产生重大影响的事件时，管理人必须按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时在管理人网站进行信息披露：</p> <p>（1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人員或</p>	

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
		<p>理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项，管理人应当及时将有关情况向住所地中国证监会派出机构报告，并向委托人披露；</p> <p>(2) 集合计划资产的估值错误导致错误偏差达到计划资产净值的0.5%；</p> <p>(3) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>(4) 发生巨额退出并导致延期退出的情形；</p> <p>(5) 集合计划终止和清算；</p> <p>(6) 合同的补充、修改与变更；</p> <p>(7) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(8) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；</p> <p>(9) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>(10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>(11) 其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</p>	<p>投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项，管理人应当及时将有关情况向住所地中国证监会派出机构报告，并向委托人披露；</p> <p>(2) 集合计划资产的估值错误导致错误偏差达到计划资产净值的0.5%；</p> <p>(3) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>(4) 发生巨额退出并导致延期退出的情形；</p> <p>(5) 集合计划终止和清算；</p> <p>(6) 合同的补充、修改与变更；</p> <p>(7) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(8) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；</p> <p>(9) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>(10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>(11) 管理人将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券或与管理人有关联方关系的公司承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易；</p> <p>(12) 其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</p>	
9	十二、委托人的权利和义务 (二) 委托人的义务	<p>1、委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；</p> <p>2、按照本合同及《说明书》约定缴纳委托资金，承担本合同约定的费用；</p> <p>3、按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；</p> <p>4、不得转让本合同及《说明书》约定的权利义务（法律法规</p>	<p>1、委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；委托人应当以真实身份参与集合计划；自然人不得用筹集的他人资金参与集合计划，法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他推广机构提供合法筹集资金的证明文件；委托人承诺在参与集合资产管理计划之前，已经是管理人或者其他推广机构的客户；</p>	根据相关法律法规细化表述

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
		另有规定的除外)； 5、法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》约定的其他义务。	2、按照本合同及《说明书》约定缴纳委托资金，承担本合同约定的费用； 3、按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失； 4、不得违规转让其所拥有的计划份额； 5、委托人应当如实提供与签署合同相关的信息和资料。委托人应当以自己的名义在参与网点开立指定资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料 6、除非在本合同约定的可办理退出业务的开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系； 7、法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》约定的其他义务。	
10	十六、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结	十六、集合计划份额的非交易过户和冻结 (一) 集合计划的非交易过户 非交易过户是指不采用参与、退出等集合计划交易方式，将一定数量的集合计划单位按照一定规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理。 (二) 集合计划的冻结 集合计划注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。	十六、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结 (一) 集合计划份额的转让 集合计划存续期间，在集合计划具备交易条件后，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。 (二) 集合计划的非交易过户 非交易过户是指不采用参与、退出等集合计划交易方式，将一定数量的集合计划单位按照一定规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理。 (三) 集合计划的冻结	增加集合计划份额转让条款

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
			集合计划注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。	
11	十七、集合计划终止和清算 (二) 集合计划的清算	<p>1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；</p> <p>2、集合计划终止后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果，并报监管机构备案；清算过程中的有关重大事项须及时公布；</p> <p>3、清算结果披露后 7 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。</p> <p>若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给委托人。</p>	<p>1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；</p> <p>2、集合计划终止后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果，并报监管机构备案；清算过程中的有关重大事项须及时公布；</p> <p>3、清算结束后，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、业绩报酬及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；</p> <p>若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给委托人。</p>	根据相关法律法规调整
12	十九、违约责任与争议处理 (二) 法律适用及	本合同受中华人民共和国法律（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交有管辖权的法院提起诉讼。	本合同受中华人民共和国法律（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（仲裁地：上海），按照仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁，该仲裁裁决是终局的，对各方均有约	争议处理方式修改

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
	争议的处理		束力。	
13	二十二、合同的补充、修改与变更	<p>本合同生效后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。</p> <p>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。管理人须在公告后五个工作日内向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的十五个工作日内提出退出本集合计划的申请，未提出退出申请的，视同委托人已经同意合同变更；若委托人未对合同变更事项表态，也未在征询意见函发出后的十五个工作日内提出退出申请的，视同委托人已经同意合同变更。</p> <p>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。</p> <p>合同变更于公告日起二十个工作日后生效，公告内容即成为本合同组成部分。管理人应在合同变更完成后5个工作日内将相关情况报中国证券业协会备案，同时抄送管理人所在地中国证监会派出机构。</p> <p>合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。</p> <p>委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同</p>	<p>本合同生效后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，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，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，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。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同第十五条之规定申请退出本集合计划。</p> <p>本集合计划成立后，相关材料需要按相关规定报监管机构备案。管理人按照监管机构的要求补正备案材料涉及到本合同修改的，委托人特此授权管理人经与托管人协商一致后，由管理人公告补正后的合同，补正的内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。</p> <p>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。管理人须在公告后五个工作日内向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的十五个工作日内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：</p> <p>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</p>	根据相关法律法规调整

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
		等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。	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。 合同变更于公告日起二十个工作日后生效，公告内容即成为本合同组成部分。管理人应在合同变更完成后5个工作日内将变更后的合同按相关规定报监管机构备案。 合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。 委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。	

## 2、东方红-新睿3号集合资产管理计划说明书修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
1	释义	4、《试行办法》：指经中国证监会批准发布并于2004年2月1日实施的《证券公司客户资产管理业务试行办法》。 5、《细则》：指经中国证监会批准发布并于2008年7月1日实施的《证券公司集合资产管理业务实施细则（试行）》。	4、《管理办法》：指2013年6月26日中国证监会发布并施行的《证券公司客户资产管理业务管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订； 5、《实施细则》、《细则》：指2013年6月26日中国证监会发布并施行的《证券公司集合资产管理业务实施细则》及颁布机关对其不时做出的修订； 6、元：指人民币元。	根据法律法规调整

		6、元：指人民币元。 7、中国证监会：指中国证券监督管理委员会。	7、中国证监会：指中国证券监督管理委员会。 8、证券业协会：指中国证券业协会。 9、基金业协会：指中国证券投资基金业协会。	
2	第七章 投资理念 与投资策略 四、投资 策略	10、股指期货投资策略 本集合计划投资股指期货以套期保值为目的，以回避市场风险。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益。	10、期货投资策略 (1) 股指期货投资策略 本集合计划投资股指期货的主要目的是回避市场风险和实施套利策略。故股指期货空头的合约价值主要与股票组合的多头价值相对应。管理人通过动态管理股指期货合约数量，以萃取相应股票组合的超额收益或获取低风险套利收益。另外，管理人在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易，以更好地提高产品收益。 (2) 国债期货的投资策略 本集合计划参与国债期货的主要目的是套期保值和套利，在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易，以更好地提高产品收益。管理人将根据不同的市场行情动态管理国债期货合约数量，在控制风险的前提下萃取收益。 (3) 风险控制 由于期货交易尤其是进行投机交易会涉及到对行情进行判断，因而存在着较高的市场风险，管理人会对以投机为目的的交易进行严格的控制和监管。首先，严格控制投机交易的规模，不得超过管理人有关规定的规模进行交易；其次，管理人将对期货的风险敞口进行监控，不得超过合同约定的范围。 (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财产损失，管理人应赔偿。对于其他相关方的原因给委托人造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代	根据投资范围调整相应的投资策略

			<p>表集合计划委托人的利益向过错方追偿。委托人同意并确认：有关股指期货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为准；有关国债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。</p> <p>（5）期货保证金的流动性应急处理机制</p> <p>1) 应急触发条件</p> <p>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。</p> <p>2) 保证金补充机制</p> <p>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。</p> <p>3) 损失责任承担等</p> <p>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委托人造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划委托人的利益向过错方追偿。委托人同意并确认：有关股指期货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为准；有关国债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。</p>	
3	第十一章 集合计划的 资产估	<p>1、上市流通的股票和债券</p> <p>（1）上市流通的股票，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，但最近交易日后经济环</p>	<p>以下估值方法中所指的固定收益品种，是指在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所及中国证监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</p>	<p>（1）根据 法律法规 调整固定</p>

<p>值 七、估值 方法</p>	<p>境未发生重大变化的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在0.25%以上的，参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》，采用指数收益法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实地反映股票的公允价值，计划管理人可以与计划托管人协商采用其它估值方法，对停牌股票进行估值。</p> <p>（2）在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的收盘价估值；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>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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，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；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，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价（净</p>	<p>据、企业债、公司债、商业银行金融债、可转换债券、中小企业私募债、证券公司短期债、资产支持证券、非公开定向债务融资工具、同业存单等债券品种。</p> <p>（1）证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>A、沪深交易所上市的有价证券（包括股票、权证、封闭式基金、上市开放式基金（LOF）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>B、沪深交易所上市实行净价交易的固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，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，按最近交易日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。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>C、交易所上市实行全价交易的固定收益品种按估值日收盘价减去收盘价中所含的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，按最近交易日收盘价减去收盘价中所含的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化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>D、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计量日的公允价值；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</p>	<p>收益品种 估值方法： （2）增加 投资证券 衍生品、融 资融券、股 票质押式 回购等投 资标的的 估值方法</p>
--------------------------	---	--	--

	<p>价)进行调整, 确定公允价值进行估值。</p> <p>2、未上市的股票</p> <p>(1)首次发行的股票, 采用估值技术确定公允价值进行估值, 在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下, 按成本估值。</p> <p>(2)首次公开发行有明确锁定期的股票, 同一股票在交易所上市后, 按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第1条确定的估值价格进行估值。</p> <p>(3)送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票, 按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第1、(1)条确定的估值价格进行估值。</p> <p>3、非公开发行股票</p> <p>(1)估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1、(1)条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本时, 应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第1、(1)条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值;</p> <p>(2)估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第1、(1)条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本时, 应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值:</p> $FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$ <p>其中: FV为估值日该非公开发行股票的价值; C为该非公开发行股票的初始取得成本; P为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价; <math>D_l</math>为该非公开发行股票锁定期所含的交易</p>	<p>情况下, 则应采用估值技术确定其公允价值;</p> <p>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。交易所上市的资产支持证券、私募债券, 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应区分如下情况处理:</p> <p>A、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>B、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>C、首次公开发行有明确锁定期的股票, 同一股票在交易所上市后, 按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价值。</p> <p>(3)因持有股票而享有的配股权, 从配股除权日起到配股确认日止, 如果收盘价高于配股价, 按收盘价高于配股价的差额估值。收盘价等于或低于配股价, 则估值为零。</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, 以第三方估值机构提供的价格数据估值; 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, 按成本估值。</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)中小企业私募债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>(7)证券公司短期公司债券, 按估值技术估值。国家有最新规定的, 按其规定进行估值。</p> <p>(8)开放式基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))以估值</p>	
--	---	---	--

	<p>天数：<math>D_r</math>为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。</p> <p>4、权证</p> <p>（1）上市流通权证按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，但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；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）首次发行未上市的权证，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）因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。</p> <p>（4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p>5、首次发行未上市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。</p> <p>6、银行间债券的估值采用中央国债登记结算有限责任公司提供的中债收益率曲线估值价格计算</p> <p>7、资产支持受益凭证的估值方法</p> <p>（1）交易所以大宗交易方式转让的资产支持受益凭证，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>（2）全国银行间市场交易的资产支持受益凭证，根据行业协</p>	<p>日前一工作日基金净值估值（货币市场基金按成本估值，每天按前一开放日公布的万份收益计提收益），估值日前一工作日开放式基金单位净值未公布的，以前最近一个工作日基金净值计算。尚未公布过基金份额净值的，应以账面价值估值。如果前一开放日至估值日该基金分红除权，则按前一开放日基金份额净值减单位份额分红额后的差额估值。</p> <p>（9）集合资产管理计划以估值日前一工作日集合资产管理计划单位净值估值，估值日前一工作日集合资产管理计划单位净值未公布的，以前最近一个工作日集合资产管理计划单位净值计算。</p> <p>（10）股票质押式回购交易的估值方法</p> <p>A、对于投资股票质押式回购交易的，以成本列示，按协议或预期收益在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>B、异常情况处理：</p> <p>①股票质押式回购提前购回 提前购回约定利率与到期购回一致，不影响定向计划估值。</p> <p>②股票质押式回购延期购回 延期购回利率与到期购回的利率不一致的，管理人与托管人在综合考虑估值影响的前提下，与托管人确定估值方法。原则上以以下方式估值：在发出延期购回的当日起，以延期购回利率计提利息。融入方自发起初始交易指令至发出延期购回指令的期间，因原股票质押式回购交易商定利率与延期购回利率而产生的应付资金差额，自发出延期购回指令当日起向后摊余估值。</p> <p>③股票质押式回购违约部分估值方式 如有确凿证据表明发生融入方违约，常规的估值不能客观反映资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映资产公允价值的方法估值。</p>	
--	---	---	--

	<p>会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。</p> <p>(3) 国家有最新规定的，按其规定进行估值。</p> <p>8、证券投资基金的估值方法</p> <p>(1) 同一基金分别在两个或两个以上市场交易、登记的，按照所处市场的公允价值分别估值。</p> <p>(2) 在证券交易所交易、登记的上市流通封闭式基金、ETF基金、场内登记的LOF基金等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。在场外交易、登记的开放式基金（含场外登记的LOF基金）按前一日基金单位净值估值。前一日未公布基金单位净值的，以最近公布的基金单位净值估值；在基金首次公布单位净值之前按照购入成本估值。</p> <p>(3) 未上市的封闭式基金按估值日的净值估值，若估值日未公布净值，按最近公布的净值估值。</p> <p>(4) 货币市场基金按成本估值，每天按前一开放日公布的万分收益计提收益，估值日无交易的，按最近交易日基金单位净值估值。</p> <p>9、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>10、ETF套利在途资金等项目的估值由管理人与托管人根据ETF的申购、赎回规则协商确定。</p> <p>11、股指期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。</p> <p>12、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成</p>	<p>(11) 投资证券衍生品的估值方法</p> <p>A、从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；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，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，调整最近交易市价，确定公允价格。</p> <p>B、首次发行未上市的权证，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>C、因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值进行估值。在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行估值。</p> <p>D、股指期货合约以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的结算价估值。</p> <p>E、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最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>F、期权、利率远期、利率互换等其他衍生品的估值方法，以管理人实际投资期权、利率远期、利率互换交易前与托管人及衍生品经纪服务商（如有）签署的《操作备忘录》约定为准。</p> <p>(12) 存款的估值方法</p> <p>持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。</p> <p>(13) 融资融券交易和将持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司投资品种的估值方法</p> <p>融资买入产生的融入负债（资金）、融券卖出产生的融出资产（资金）</p>	
--	--	---	--

		<p>交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。</p> <p>如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。管理人应于新规定实施后及时在管理人网站和/或推广网点通告委托人。</p> <p>13、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时或因其它任何不可抗力致使集合管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合管理人必须按规定完成估值工作。</p>	<p>按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>(14) 如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。</p> <p>如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。管理人应于新规定实施后及时在管理人网站和/或推广网点通告委托人。</p> <p>(15) 暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时或因其它任何不可抗力致使集合管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合管理人必须按规定完成估值工作。</p>	
4	<p>第十八章 风险揭示及其相应风险防范措施</p> <p>五、本集合资产管理计划特有风险</p>	<p>1、本集合计划成立后三个月为封闭期，封闭期结束后的每个工作日开放，委托人将面临在封闭期内无法退出集合计划的风险。</p> <p>2、本集合计划推广期规模上限为 40 亿份（含参与资金利息转增份额），存续期达到一定规模时，管理人有权暂停申购。委托人可能面临因集合计划规模达到上限而无法参与本集合计划的风险。</p> <p>3、本集合计划开放期每日办理申购的交易时间结束后，管理人将对当日（T 日）净申购规模实行汇总统计，当管理人认为集合计划资产规模过大导致无法找到合适的投资品种，或可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害集合计划现有持有人的利益时，管理人有权于 T+1 日上午九点前发出停止申购指令，根据参与时间优先的原则宣布超过预定规模的申购无效，委托人将面临在开放期无法成功参与本集合计划的风险。</p>	<p>1、本集合计划成立后三个月为封闭期，封闭期结束后的每个工作日开放，推广期及开放期本集合计划达到一定规模时，管理人有权停止认/申购。委托人可能面临因上述原因而无法参与本集合计划的风险。</p> <p>2、本集合计划推广期规模上限为 40 亿份（含参与资金利息转增份额），存续期达到一定规模时，管理人有权暂停申购。委托人可能面临因集合计划规模达到上限而无法参与本集合计划的风险。</p> <p>3、本集合计划开放期每日办理申购的交易时间结束后，管理人将对当日（T 日）净申购规模实行汇总统计，当管理人认为集合计划资产规模过大导致无法找到合适的投资品种，或可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害集合计划现有持有人的利益时，管理人有权于 T+1 日上午九点前发出停止申购指令，根据参与时间优先的原则宣布超过预定规模的申购无效，委托人将面临在开放期无法成功参与本集合计划的风险。</p> <p>4、本集合计划存续期间，当计划的委托人少于 2 人，集合计划将终止。委托人可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。</p>	<p>根据法律法规修改、细化风险揭示</p>

		<p>4、本集合计划存续期间，当计划的委托人少于 2 人，集合计划将终止。委托人可能面临集合计划因上述原因终止而停止投资的风险。</p> <p>5、本集合计划合同变更时，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后五个工作日内向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后的十五个工作日内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退出计划的，视为委托人同意合同变更。合同变更于公告日起二十个工作日后生效。部分委托人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，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人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。</p>	<p>5、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则颁布或修订，管理人和托管人协商一致后，可对本合同与上述法律法规和相关政策不一致的地方进行更新或修改并及时在管理人网站公告修改内容。更新或修改内容在管理人网站公告满五个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。委托人可能面临由于上述原因发生合同变更的风险。</p> <p>6、除因法律、法规、规章、中国证监会的规定、中国证券业协会及中国证券投资基金业协会的自律管理规则、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所交易规则颁布或修订以外的合同变更时，管理人将向委托人邮寄合同变更征询意见函，委托人可选择在开放期退出或继续参与本集合计划。部分委托人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，而无法及时获知合同变更事项，如果委托人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：</p> <p>（1）“委托人不同意变更的，应在征询意见发出后十五个工作日内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退出计划的，视为委托人同意合同变更”，在此情况下，委托人对默认情况的忽略或误解，可能存在潜在风险。</p> <p>（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）”，在此情况下，会导致委托人的计划份额减少至零。</p>	
5	第十八章 风险揭示	<p>8、集合计划参与股指期货的风险</p> <p>（1）本集合计划使用股指期货的目的是套期保值，风险较纯</p>	<p>9、集合计划参与股指期货的风险</p> <p>（1）本集合计划使用股指期货的目的是套期保值，风险较纯粹投机要</p>	根据投资范围相应

<p>及其相应风险防范措施</p> <p>五、本集合资产管理计划特有风险</p>	<p>粹投机要小，总体可控。但由于股票多头和股指期货空头头寸在流动性、风险收益特征及交易规则上的不同可能造成两个头寸对相同市场风险的反应存在差异，尤其是对大幅度的市场波动反应不一定完全同步，从而加大投资组合市场价值的短期风险。</p> <p>(2) 股指期货采用保证金交易的特征使投资组合的空头头寸在沪深 300 股指期货上涨时需要追加保证金，如果无法及时补足保证金将面临空头头寸被平仓的风险。由于本集合计划在非保证金账户还保留与保证金账户相同资金量的现金或一年期以内债券，且在股指上升过程中股票多头的流动性一般很强，可及时卖出获取现金，故空头头寸被强制平仓的风险非常之小。</p> <p>(3) 使用股指期货对冲市场风险的过程中，委托财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。但总体而言，基差风险绝对值较小，属于可控、可知、可承担的风险。</p> <p>风险对策：管理人和推广机构将向客户详细介绍产品条款及签署方式，使客户充分理解上述风险含义，确保客户在知悉上述风险的前提下签署风险揭示书及合同、参与本集合计划。管理人将及时在公司网站公告合同变更事宜并邮寄合同变更征询意见函，确保委托人及时知悉合同变更事宜。管理人在股指期货投资过程中加强股指期货投资策略的研究，对期货合约规模、保证金变化等进行动态的监管，对集合计划的风险暴露做出充分估计，针对各种不同的市场状况事先做好应</p>	<p>小，总体可控。但由于股票多头和股指期货空头头寸在流动性、风险收益特征及交易规则上的不同可能造成两个头寸对相同市场风险的反应存在差异，尤其是对大幅度的市场波动反应不一定完全同步，从而加大投资组合市场价值的短期风险。</p> <p>(2) 股指期货采用保证金交易的特征使投资组合的空头头寸在沪深 300 股指期货上涨时需要追加保证金，如果无法及时补足保证金将面临空头头寸被平仓的风险。由于本集合计划在非保证金账户还保留与保证金账户相同资金量的现金或一年期以内债券，且在股指上升过程中股票多头的流动性一般很强，可及时卖出获取现金，故空头头寸被强制平仓的风险非常之小。</p> <p>(3) 使用股指期货对冲市场风险的过程中，委托财产可能因为股指期货合约与标的指数价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。但总体而言，基差风险绝对值较小，属于可控、可知、可承担的风险。</p> <p>10、参与融资融券的特定风险</p> <p>如法律、行政法规或中国证监会允许集合计划参与融资融券交易，则本集合计划面临参与融资融券交易的潜在风险。</p> <p>(1) 亏损放大风险</p> <p>融资融券交易提供了放大机制，若融资融券交易的标的证券价格向不利方向变动，集合计划投资的损失将被放大。同时，计划资产还要承担融资融券的利息/费用成本，将会加大投资者的总体损失。</p> <p>(2) 强制平仓风险</p> <p>若集合计划参与融资融券的担保比例达到或低于平仓线，将触发强制平仓机制。该情况下，集合计划可能会承担被强制平仓的品种、数量、价格、时机等方面的损失。平仓后集合计划也存在继续被追索的风险。</p>	<p>修订风险揭示</p>
--	--	---	---------------

	<p>对预案。</p>	<p>(3) 提前了结风险</p> <p>由于融券卖出的证券被调整出融资融券标的证券范围、被终止上市以及发生其他法律法规规定的情况，融资融券交易将被提前了结，对集合计划投资带来风险。</p> <p>11、交易所股票质押式回购业务风险</p> <p>集合计划可以参与交易所股票质押式回购业务，可能存在着包括但不限于如下风险：</p> <p>(1) 因股票质押失败而影响集合计划投资收益的风险。</p> <p>(2) 若股票质押式回购业务中标的证券在待购回期间发生被 ST、*ST、暂停或终止上市等事件，或出现融资方质押资产被冻结、融资方财务状况恶化无法履行回购义务、融资方被司法通知进入破产程序等情况时，可能会影响集合计划的收益。</p> <p>(3) 因融资方违约，管理人需要通过司法途径或其他方式向融资方主张权利，可能长时间无法收回回购价款，从而导致集合计划资产长时间无法变现并分配或最终无法变现并分配的风险。</p> <p>(4) 融资方违约，质押标的证券被违约处置后，可能仍然无法足额偿付回购价款，从而影响集合计划的收益。</p> <p>(5) 集合计划在股票质押回购待购回期间提前终止，但回购尚未到期或违约处置未完成导致集合计划无法及时收回回购价款，从而带来风险。</p> <p>(6) 质押标的证券为有限售条件股份，违约处置时仍处于限售期，无法及时处置的风险。标的证券为有限售条件股份，初始交易或补充质押成交当日，司法机关对标的证券进行司法冻结的，中国结算深圳分公司优先办理司法冻结，导致相应交易交收失败的风险。</p> <p>(7) 标的证券被质押后，因融资方的原因导致标的证券被司法冻结或强制执行，导致标的证券无法处置或无法及时处置的风险。</p>	
--	-------------	---	--

			<p>(8) 证券公司未按照约定尽职履行交易申报、合并管理、盯市、违约处置等职责从而损害集合计划委托人的利益的风险。</p> <p>(9) 待购回期间，证券公司根据证券交易所、监管部门的要求或其他情况，暂停或终止股票质押式回购交易权限的，会影响本集合计划的收益，从而带来风险。</p> <p>12、国债期货投资风险</p> <p>(1) 杠杆性风险。国债期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。</p> <p>(2) 到期日风险。国债期货合约到期时，如计划仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将计划持有的合约进行现金交割，计划存在无法继续持有到期合约的可能，具有到期日风险。国债期货合约采取实物交割方式，如计划未能在规定期限内如数交付可交割国债或者未能在规定期限内如数缴纳交割贷款，将构成交割违约，交易所将收取相应的惩罚性违约金。</p> <p>(3) 强制平仓风险。如计划参与交割不符合交易所或者期货公司相关业务规定，期货公司有权不接受计划的交割申请或对计划的未平仓合约强行平仓，由此产生的费用和结果将由集合计划承担。</p> <p>(4) 使用国债期货对冲市场风险的过程中，委托财产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临期现基差风险。在需要将期货合约展期时，合约平仓时的价格与下一个新合约开仓时的价格之差也存在不确定性，面临跨期基差风险。</p> <p>13、本集合计划将有部分资产投资于中小企业私募债，将面临如下风险：</p> <p>(1) 由于中小企业私募债券采取非公开发行的方式发行，即使在市场流动性比较好的情况下，个别债券的流动性可能较差，从而使得集合资产管理计划在进行个券操作时，可能难以按计划买入或卖出相应的数量，或买入卖出行为对价格产生比较大的影响，增加个券的建仓成本或</p>
--	--	--	---

			<p>变现成本。</p> <p>(2) 中小企业私募债信用等级较一般债券较低,存在着发行人不能按时足额还本付息的风险,此外,当发行人信用评级降低时,集合资产管理计划所投资的债券可能面临价格下跌风险。</p> <p>14、集合计划参与保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划的风险:</p> <p>(1) 本集合计划参与上述投资品种的目的主要是获取稳定收益,从历史情况看,此类投资品种风险可控。但由于多种原因,上述投资品种的基础投资标的可能无法变现,使得上述投资品种无法实现预期收益,从而带来风险。</p> <p>(2) 由于商业银行理财计划无公开交易市场,可能无法及时变现,从而给本集合计划带来流动性风险。</p> <p>15、证券回购的特有风险</p> <p>正回购即融资回购,是一方以一定规模债券向另一方作抵押融入资金,并承诺在日后再从另一方购回所抵押债券的交易行为。抵押债券所获得的资金可以再行投资或抵押,相当于放大原始资金的倍数,具有较大的投资风险。根据合同约定,本集合计划可以参与证券回购,但参与证券回购融入资金余额不得超过本计划资产净值的40%。</p> <p>16、本集合计划成立后,相关材料需要按规定报监管机构备案。管理人按照监管机构要求补正可能涉及到本合同的修改,管理人届时与托管人达成一致后公告补正后的合同,各方按补正后的合同享有权利、履行义务。上述合同的修改会给委托人带来一定的风险。</p> <p>风险对策:管理人和推广机构将向客户详细介绍产品条款及签署方式,使客户充分理解上述风险含义,确保客户在知悉上述风险的前提下签署风险揭示书及合同、参与本集合计划。管理人将及时在公司网站公告合同变更事宜并邮寄合同变更征询意见函,确保委托人及时知悉合同变更事宜。管理人在投资过程中加强对股指期货、国债期货、融资融券、股</p>	
--	--	--	---	--

票质押式回购等投资策略的研究，对期货合约规模、保证金变化等进行动态的监管，对集合计划的风险暴露做出充分估计，针对各种不同的市场状况事先做好应对预案。

3、东方红-新睿3号集合资产管理计划投资监督事项之补充约定（编号：东方红集合托管-新睿3号01）修改对照明细表

序号	位置	原条款	现条款	修改原因																																																																								
1	附件一、与管理人、托管人有关联方的公司名单	<p>与管理人有关联方关系的公司发行的证券名单：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>证券名称</th> <th>证券代码</th> <th>关联方关系</th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>长城开发</td><td>000021</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>长城信息</td><td>000748</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>上海建工</td><td>600170</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>时代出版</td><td>600551</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>百联股份</td><td>600631</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>浦东金桥</td><td>600639</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>申能股份</td><td>600642</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>上海机电</td><td>600835</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>上海九百</td><td>600838</td><td>母公司股东方</td></tr> <tr><td>上海电气</td><td>601727</td><td>母公司股东方</td></tr> </tbody> </table>	证券名称	证券代码	关联方关系	长城开发	000021	母公司股东方	长城信息	000748	母公司股东方	上海建工	600170	母公司股东方	时代出版	600551	母公司股东方	百联股份	600631	母公司股东方	浦东金桥	600639	母公司股东方	申能股份	600642	母公司股东方	上海机电	600835	母公司股东方	上海九百	600838	母公司股东方	上海电气	601727	母公司股东方	<p>与管理人有关联方关系的公司名单（截至2015年4月）：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>序号</th> <th>公司全称</th> <th>关联关系</th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>1</td><td>东方证券股份有限公司</td><td>持有本公司100%股份的公司</td></tr> <tr><td>2</td><td>上海东证期货有限公司</td><td>东方证券全资控股子公司</td></tr> <tr><td>3</td><td>东方证券资本投资有限公司</td><td>东方证券全资控股子公司</td></tr> <tr><td>4</td><td>东方金融控股（香港）有限公司</td><td>东方证券全资控股子公司</td></tr> <tr><td>5</td><td>上海东方证券创新投资有限公司</td><td>东方证券全资控股子公司</td></tr> <tr><td>6</td><td>东方花旗证券有限公司</td><td>东方证券持有66%股份的公司</td></tr> <tr><td>7</td><td>杭州东方银帝投资管理有限公司</td><td>东方证券间接控制公司</td></tr> <tr><td>8</td><td>东方证券（香港）有限公司</td><td>东方证券间接控制公司</td></tr> <tr><td>9</td><td>东方期货（香港）有限公司</td><td>东方证券间接控制公司</td></tr> <tr><td>10</td><td>东方资管（香港）有限公司</td><td>东方证券间接控制公司</td></tr> <tr><td>11</td><td>东方融资（香港）有限公司</td><td>东方证券间接控制公司</td></tr> <tr><td>12</td><td>东方信贷财务（香港）有限公司</td><td>东方证券间接控制公司</td></tr> </tbody> </table>	序号	公司全称	关联关系	1	东方证券股份有限公司	持有本公司100%股份的公司	2	上海东证期货有限公司	东方证券全资控股子公司	3	东方证券资本投资有限公司	东方证券全资控股子公司	4	东方金融控股（香港）有限公司	东方证券全资控股子公司	5	上海东方证券创新投资有限公司	东方证券全资控股子公司	6	东方花旗证券有限公司	东方证券持有66%股份的公司	7	杭州东方银帝投资管理有限公司	东方证券间接控制公司	8	东方证券（香港）有限公司	东方证券间接控制公司	9	东方期货（香港）有限公司	东方证券间接控制公司	10	东方资管（香港）有限公司	东方证券间接控制公司	11	东方融资（香港）有限公司	东方证券间接控制公司	12	东方信贷财务（香港）有限公司	东方证券间接控制公司	根据实际情况更新管理人关联方公司名
证券名称	证券代码	关联方关系																																																																										
长城开发	000021	母公司股东方																																																																										
长城信息	000748	母公司股东方																																																																										
上海建工	600170	母公司股东方																																																																										
时代出版	600551	母公司股东方																																																																										
百联股份	600631	母公司股东方																																																																										
浦东金桥	600639	母公司股东方																																																																										
申能股份	600642	母公司股东方																																																																										
上海机电	600835	母公司股东方																																																																										
上海九百	600838	母公司股东方																																																																										
上海电气	601727	母公司股东方																																																																										
序号	公司全称	关联关系																																																																										
1	东方证券股份有限公司	持有本公司100%股份的公司																																																																										
2	上海东证期货有限公司	东方证券全资控股子公司																																																																										
3	东方证券资本投资有限公司	东方证券全资控股子公司																																																																										
4	东方金融控股（香港）有限公司	东方证券全资控股子公司																																																																										
5	上海东方证券创新投资有限公司	东方证券全资控股子公司																																																																										
6	东方花旗证券有限公司	东方证券持有66%股份的公司																																																																										
7	杭州东方银帝投资管理有限公司	东方证券间接控制公司																																																																										
8	东方证券（香港）有限公司	东方证券间接控制公司																																																																										
9	东方期货（香港）有限公司	东方证券间接控制公司																																																																										
10	东方资管（香港）有限公司	东方证券间接控制公司																																																																										
11	东方融资（香港）有限公司	东方证券间接控制公司																																																																										
12	东方信贷财务（香港）有限公司	东方证券间接控制公司																																																																										

序号	位置	原条款	现条款	修改原因																																																																																							
2	附件一、与托管人、托管人关联方关系的公司名单	<p>与托管人有关联方关系的公司发行的证券名单:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>证券名称</th> <th>证券代码</th> <th>关联方关系</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>浦发银行</td> <td>600000</td> <td>托管人</td> </tr> <tr> <td>浦银安盛价值成长</td> <td>519110</td> <td>控股公司发行基金</td> </tr> <tr> <td>浦银安盛优化收益 A</td> <td>519111</td> <td>控股公司发行基金</td> </tr> <tr> <td>浦银安盛优化收益 C</td> <td>519112</td> <td>控股公司发行基金</td> </tr> <tr> <td>浦银安盛沪深 300</td> <td>519116</td> <td>控股公司发行基金</td> </tr> <tr> <td>浦银安盛货币 A</td> <td>519509</td> <td>控股公司发行基金</td> </tr> <tr> <td>浦银安盛货币 B</td> <td>519510</td> <td>控股公司发行基金</td> </tr> <tr> <td>浦银安盛红利精选</td> <td>519115</td> <td>控股公司发行基金</td> </tr> <tr> <td>浦银安盛精致生活</td> <td>519113</td> <td>控股公司发行基金</td> </tr> </tbody> </table>	证券名称	证券代码	关联方关系	浦发银行	600000	托管人	浦银安盛价值成长	519110	控股公司发行基金	浦银安盛优化收益 A	519111	控股公司发行基金	浦银安盛优化收益 C	519112	控股公司发行基金	浦银安盛沪深 300	519116	控股公司发行基金	浦银安盛货币 A	519509	控股公司发行基金	浦银安盛货币 B	519510	控股公司发行基金	浦银安盛红利精选	519115	控股公司发行基金	浦银安盛精致生活	519113	控股公司发行基金	<p>与托管人有关联方关系的公司名单:</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>序号</th> <th>公司全称</th> <th>关联关系</th> </tr> </thead> <tbody> <tr><td>1</td><td>上海国有资产经营有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>2</td><td>上海达盛资产经营有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>3</td><td>上海城高资产经营有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>4</td><td>上海国际集团资产管理有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>5</td><td>上海国融莘闵置业有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>6</td><td>上海国际集团资产经营有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>7</td><td>上海国利货币经纪有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>8</td><td>上海国际集团(香港)有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>9</td><td>上海国际信托有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>10</td><td>上海国鑫投资发展有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>11</td><td>上海衡高置业发展有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>12</td><td>上海夏阳湖投资管理有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>13</td><td>新上海国际大厦有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>14</td><td>上海国际(香港)控股有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>15</td><td>上投摩根基金管理有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>16</td><td>上信资产管理有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>17</td><td>上海国智置业发展有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> <tr><td>18</td><td>鼎通投资有限公司</td><td>关联法人上海国际集团公司子公司</td></tr> </tbody> </table>	序号	公司全称	关联关系	1	上海国有资产经营有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	2	上海达盛资产经营有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	3	上海城高资产经营有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	4	上海国际集团资产管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	5	上海国融莘闵置业有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	6	上海国际集团资产经营有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	7	上海国利货币经纪有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	8	上海国际集团(香港)有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	9	上海国际信托有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	10	上海国鑫投资发展有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	11	上海衡高置业发展有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	12	上海夏阳湖投资管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	13	新上海国际大厦有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	14	上海国际(香港)控股有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	15	上投摩根基金管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	16	上信资产管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	17	上海国智置业发展有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	18	鼎通投资有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司	根据实际情况更新托管人关联方公司名单
证券名称	证券代码	关联方关系																																																																																									
浦发银行	600000	托管人																																																																																									
浦银安盛价值成长	519110	控股公司发行基金																																																																																									
浦银安盛优化收益 A	519111	控股公司发行基金																																																																																									
浦银安盛优化收益 C	519112	控股公司发行基金																																																																																									
浦银安盛沪深 300	519116	控股公司发行基金																																																																																									
浦银安盛货币 A	519509	控股公司发行基金																																																																																									
浦银安盛货币 B	519510	控股公司发行基金																																																																																									
浦银安盛红利精选	519115	控股公司发行基金																																																																																									
浦银安盛精致生活	519113	控股公司发行基金																																																																																									
序号	公司全称	关联关系																																																																																									
1	上海国有资产经营有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
2	上海达盛资产经营有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
3	上海城高资产经营有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
4	上海国际集团资产管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
5	上海国融莘闵置业有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
6	上海国际集团资产经营有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
7	上海国利货币经纪有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
8	上海国际集团(香港)有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
9	上海国际信托有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
10	上海国鑫投资发展有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
11	上海衡高置业发展有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
12	上海夏阳湖投资管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
13	新上海国际大厦有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
14	上海国际(香港)控股有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
15	上投摩根基金管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
16	上信资产管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
17	上海国智置业发展有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									
18	鼎通投资有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司																																																																																									

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
			19 上海复旦国际学术交流中心有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司
			20 上海绅士商城有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司
			21 上投摩根资产管理（香港）有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司
			22 上海上信健康产业投资发展有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司
			23 海际（深圳）投资管理有限公司	关联法人上海国际集团公司子公司
			24 中国移动通信有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			25 Advanced Roaming & Clearing House	关联法人中国移动有限公司子公司
			26 中国移动投资有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			27 中国移动香港有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			28 中国移动国际控股有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			29 ASPIRE HOLDINGS LIMITED	关联法人中国移动有限公司子公司
			30 中国移动通信集团广东有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			31 中国移动通信集团福建有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			32 中国移动通信集团北京有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			33 中国移动通信集团河北有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			34 中国移动通信集团广西有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			35 中国移动通信集团重庆有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			36 中国移动通信集团湖南有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			37 中国移动通信集团内蒙古有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司

序号	位置	原条款	现条款			修改原因
			38	中国移动通信集团贵州有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			39	中国移动通信集团甘肃有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			40	中国移动通信集团新疆有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			41	卓望数码技术（深圳）有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			42	中国移动国际有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			43	中移（苏州）软件技术有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			44	中国移动通信集团财务有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			45	中国移动通信集团浙江有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			46	中国移动通信集团河南有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			47	中国移动通信集团上海有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			48	中国移动通信集团辽宁有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			49	中国移动通信集团安徽有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			50	中国移动通信集团四川有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			51	中国移动通信集团陕西有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			52	中国移动通信集团吉林有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			53	中国移动通信集团云南有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			54	中国移动通信集团青海有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			55	中国移动（深圳）有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			56	卓望信息网络（深圳）有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			57	中国移动通信集团终端有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	
			58	中移（杭州）信息技术有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司	

序号	位置	原条款	现条款	修改原因
			59 福建福诺移动通信技术有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			60 中国移动通信集团江苏有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			61 中国移动通信集团海南有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			62 中国移动通信集团天津有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			63 中国移动通信集团山东有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			64 中国移动通信集团江西有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			65 中国移动通信集团湖北有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			66 中国移动通信集团山西有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			67 中国移动通信集团黑龙江有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			68 中国移动通信集团西藏有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			69 中国移动通信集团宁夏有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			70 卓望信息技术（北京）有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			71 中国移动通信集团设计院有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			72 中移物联网有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			73 中移在线服务有限公司	关联法人中国移动有限公司子公司
			74 绵竹浦发村镇银行	托管人发起设立
			75 巩义浦发村镇银行	托管人发起设立
			76 邹平浦发村镇银行	托管人发起设立
			77 江阴浦发村镇银行	托管人发起设立
			78 浙江平阳浦发村镇银行	托管人发起设立
			79 临武浦发村镇银行	托管人发起设立

序号	位置	原条款	现条款			修改原因
			80	公主岭浦发村镇银行	托管人发起设立	
			81	富民浦发村镇银行	托管人发起设立	
			82	天津宝坻浦发村镇银行	托管人发起设立	
			83	溧阳浦发村镇银行	托管人发起设立	
			84	资兴浦发村镇银行	托管人发起设立	
			85	泽州浦发村镇银行	托管人发起设立	
			86	韩城浦发村镇银行	托管人发起设立	
			87	沅江浦发村镇银行	托管人发起设立	
			88	临川浦发村镇银行	托管人发起设立	
			89	衡南浦发村镇银行	托管人发起设立	
			90	宁波海曙浦发村镇银行	托管人发起设立	
			91	奉贤浦发村镇银行	托管人发起设立	
			92	重庆巴南浦发村镇银行	托管人发起设立	
			93	大连甘井子浦发村镇银行	托管人发起设立	
			94	浙江新昌浦发村镇银行	托管人发起设立	
			95	茶陵浦发村镇银行	托管人发起设立	
			96	哈尔滨呼兰浦发村镇银行	托管人发起设立	
			97	榆中浦发村镇银行	托管人发起设立	
			98	乌鲁木齐米东浦发村镇银行	托管人发起设立	

(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-新睿 3 号合同变更事宜，并按《东方红-新睿 3 号集合资产管理合同》的约定在公告后 5 个工作日内向委托人发送合同变更征询意见。委托人不同意变更的，应在征询意见发出后十五个工作日内提出退出本集合计划的申请，未提出退出申请的，视同委托人已经同意合同变更；若委托人未对合同变更事项表态，也未在征询意见函发出后的十五个工作日内提出退出申请的，视同委托人已经同意合同变更。

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。

合同变更于公告日起二十个工作日后生效，公告内容即成为《东方红-新睿 3 号集合资产管理合同》组成部分。

3. 管理人应在合同变更完成后 5 个工作日内将相关情况按相关规定报监管机构备案。

以上事宜，请贵行确认。

上海东方证券资产管理有限公司（盖章）

签署日：2015 年 月 日

## 确 认 函 回 执

上海东方证券资产管理有限公司：

《关于东方红-新睿 3 号集合资产管理计划变更条款相关事项の確認函》我行已收悉，请贵司严格按照《东方红-新睿 3 号集合资产管理合同》中的“二十二、合同的补充、修改与变更”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-新睿 3 号集合资产管理计划变更条款相关事项の確認函》中所提及的相关条款的变更、具体修订的事项和内容，并请贵司在本次修改合同内容生效后将相关生效公告发送我行知晓。

上海浦东发展银行股份有限公司（公章或合同专用章）

签署日： 年 月 日