

协议编号:

托管编号: 21-QB-01137446-01-001

申万添宁双周盈 1 号集合资产管理计划资产管理合同 之补充协议

资产投资人

名称:

证件名称:

证件号码:

法定代表人或授权代表 (法人或其他组织填写):

通讯地址:

联系人:

联系电话:

若资产投资人通过电子签名签署本协议的, 投资人的相关信息 (包括但不限于上述信息) 在协议数据电文中列示。

资产管理人

名称: 申银万国期货有限公司

住所地: 中国 (上海) 自由贸易试验区东方路 800 号 7 楼、8 楼、10 楼、11 楼、3401 室

法定代表人: 尚恒

联系人: 蒋辰瑶

联系电话: 021-50588047

资产托管人

名称: 中信证券股份有限公司

法定代表人: 张佑君

通讯地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

联系电话: 95548-3

边
子

申银万国
骑缝

一、鉴于本协议各方已签署《申万添宁双周盈1号集合资产管理计划资产管理合同》及其合同变更文件（若有；合同变更文件包括通过补充协议、通知函、公告等法律法规规定或合同约定的方式进行合同变更的文件），以上统称为“《资产管理合同》”。现经各方协商一致签署本协议，同意对《资产管理合同》进行如下变更：

1、《资产合法性及投资者适当性承诺书》、《资产管理合同》第【二、六】节关于合格投资者的部分约定如下：

“（3）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会（以下简称基金业协会）登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构。

（5）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）。”

自本协议的变更执行日起，上述内容变更如下：

“（3）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、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、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理公司、财务公司及中国证监会认定的其他机构；

（5）基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；”

2、《资产管理合同》第【四】节第【（二）】条第1款约定如下：

“名称：申银万国期货有限公司

住所：上海市浦东新区东方路800号宝安大厦7、8、10楼

通讯地址：上海市浦东新区东方路800号宝安大厦7楼

法定代表人：李建中

联系人：唐春洋

联系电话：021-50585760”

自本协议的变更执行日起，上述内容变更如下：

“名称：申银万国期货有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区东方路800号7楼、8楼、10楼、11楼、3401室

通讯地址：上海市浦东新区东方路800号宝安大厦7楼

法定代表人：尚恒

联系人：蒋辰瑶

联系电话：021-50588047”

3、《资产管理合同》第【八】节第【(六)】条约定如下：

“(六) 资产管理人及其附属机构以自有资金参与相关限制

管理人以自有资金参与本计划的，按照以下规定执行：

1、自有资金参与的条件和方式：资产管理人以自有资金参与本计划，应符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及基金业协会的相关规定。

2、自有资金的参与比例：资产管理人自有资金参与部分不得超过本计划份额的20%；资产管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，资产管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标。

3、管理人自有资金参与本计划的持有期限不得低于6个月，参与、退出时应当提前5个工作日在官方网站向资产委托人披露，并通知资产托管人。

4、为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，资产管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出本计划可不受上述第2、3款规定的限制，但应当及时告知资产委托人和资产托管人，并向相关派出机构及基金业协会报告。

5、自有资金的收益分配：资产管理人自有资金参与的份额按照本合同的规定享有收益分配，并承担相应责任。”

自本协议的变更执行日起，上述内容变更如下：

“(六) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与相关限制

证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的，按照以下规定执行：

1、自有资金参与的条件和方式：证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划，应符合《管理办法》、《运作规定》和中国证监会及基金业协会的相关规定。

2、自有资金的参与比例：证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的份额合计不得超过本计划总份额的50%。中国证监会对自有资金投资比例另有规定的，从其规定。因本计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应当依照中国证监会规定及本合同的约定及时调整达标。

3、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划的，持有期限不得少于6个月。

证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出集合资产管理计划的，管理人应当提前5个工作日通过合同约定的信息披露方式通知全体投资者和托管人，并取得其同意。如果投资者和托管人未在证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出本集合计划日(含)之前提出异议的，应视为投资者和托管人同意证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出本集合计划的安排。若投资者不同意，管理人保障其退出的权利，不同意的投资者可在通知后的最近一个开放日选择退出。未回复意见以及未在最近一个开放日退出的投资者，均视为同意证券期货经营机构及其子公司自有资金的参与和退出安排。

4、为应对本计划巨额退出以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出本计划可不受上述第2、3款规定的限制，但管理人应当及时告知投资者和资产托管人，并按监管要求报告相关机构。

5、因本计划规模变动等客观因素导致证券期货经营机构及其子公司自有资金参与集合计划比例被动超标的，证券期货经营机构及其子公司应当及时调整达标，具体退出份额以证券期货经营机构及其子公司决定为准，豁免“持有期限不少于6个月”和“提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意”的规定。管理人应及时通过合同约定的信息披露方式通知全体投资者和托管人自有资金参与被动超限情况。

6、自有资金的收益分配：证券期货经营机构及其子公司自有资金参与的份额按照本合同的规定享有收益分配，并承担相应责任。”

4、《资产管理合同》第【十一】节第【(二)】条部分约定如下：

“(二) 投资范围及比例

.....

除上述另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定投资比例的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个工作日内进行调整，但监管机构规定的特殊情形除外。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及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。法律法规、监管部门或自律组织另有规定或要求的，从其规定及要求。

因计划终止等原因导致计划财产需要变现的，本计划财产的投资比例限制可以不符合上述计划投资比例规定。”

自本协议的变更执行日起，上述内容变更如下：

“(二) 投资范围及比例

.....

除上述另有约定外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等资产管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定投资比例的，资产管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 20 个工作日内进行调整，但监管机构规定的特殊情形除外。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及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。法律法规、监管部门或自律组织另有规定或要求的，从其规定及要求。

因计划终止等原因导致计划财产需要变现的，本计划财产的投资比例限制可以不符合上述计划投资比例规定。”

5、自本协议的变更执行日起，《资产管理合同》第【十一】节第【(六)】条新增约定如下：

“9、如本计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产的 50%，则本计划的总资产不得超过净资产的 120%，投资于国债、中央银行票据、

券
同

形
专

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。(托管人对关联方数据取自上海大智慧财汇数据科技有限公司(财汇资讯)等第三方资讯数据,如管理人使用的数据与托管人不一致,则以管理人书面说明为准)”

6、《资产管理合同》第【十二】节约定如下:

“资产管理人可运用计划财产投资于资产管理人、资产托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他关联关系的关联方发行的证券或承销期内承销的证券,但需要建立健全内部审批机制和评估机制,并遵循资产投资人利益优先的原则,保护资产投资人合法权益。对于本计划投资过程中发生的关联交易事件,资产管理人应事后在公司官网上及时、全面、客观的向资产投资人披露事件详情,并在季度报中按本资产管理合同约定形式告知资产投资人。运用受托管理资产从事重大关联交易的,应事先取得投资者同意,并有充分证据证明未损害投资者利益。

资产管理人可运用计划财产投资于资产管理人、资产托管人及其关联方或者与上述主体有其他重大利害关系的主体直接或间接管理或代理销售的、或提供客户服务的、或者该等主体持有的符合本合同投资范围规定的投资产品。但需要遵循资产投资人利益优先的原则、防范利益冲突,保护资产投资人合法权益。对于本计划投资过程中发生的利益冲突事件,资产管理人应事后在公司官网上向资产投资人披露事件详情,并在季度报中按本资产管理合同约定形式告知资产投资人。

资产投资人签署本合同即表明其已经知晓并同意本计划将进行上述关联交易。

资产投资人不得因本计划投资收益劣于资产管理人及其关联方管理的其他类似投资产品,而向资产管理人或资产托管人提出任何损失或损害补偿的要求。”

自本协议的变更执行日起,上述内容变更如下:

“(一) 存在或可能存在的利益冲突情形:

1、本计划可能投资于管理人、托管人及其关联方发行的证券或者承销期内承销的证券;

- 2、本计划可能投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划；
- 3、本计划可能与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方。
- 4、其他依据法律法规、监管规定可能存在利益冲突的情形。

管理人确认其已建立防范利益输送和利益冲突的机制，确认该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍可能构成关联交易，存在利益冲突风险。

（二）关联交易的认定标准

（1）重大关联交易

重大关联交易是指本资产管理计划投资于资产管理人、资产托管人和/或投资顾问及前述机构的控股股东、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，资产管理计划与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方或者从事其他重大关联交易，以及法律法规规定的其他重大关联交易情形。

（2）一般关联交易

一般关联交易是指本资产管理计划投资于法律法规规定和资产管理人认定的重大关联交易之外的其他关联交易。

本计划一般关联交易与重大关联交易的认定标准由管理人自行认定。若相关监管部门或自律组织发布关于重大关联交易的具体标准，以监管部门或自律组织发布的标准为准。

（三）关联方范围：

本计划的关联方范围包括但不限于按照《企业会计准则第 36 号—关联方披露》规定确定的管理人、托管人及其的控股股东、实际控制人或者其他关联方。

管理人通过管理人网站向投资人披露“管理人关联方名单”，并通过电子邮件或双方约定的其他方式告知托管人，并在关联方名单发生变更时在管理人网站上及时更新并通过邮件或其他双方约定的形式通知托管人。

资产托管人应将“托管人关联方名单”告知资产管理人，并在关联方名单发生变更时及时通知。投资者可通过托管人官方网站查阅其年报获取托管人的关联方名单。托管人及其关联方发行的证券或承销期内承销的证券等信息，以公开信息披露为准。

（四）存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率

投资人签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易情形，管理人无需就一般关联交易再行分别取得资产投资人的授权。

管理人将委托资产投资于重大关联交易的，应事先采取逐笔征求意见或公告确认的方式取得投资人的同意，并安排临时开放日供不同意的投资人退出本计划（该退出不受本合同“资产管理计划的参与、退出与转让”章节中关于本计划赎回的期限限制）。

上述关联交易应当按照市场通行的方式和条件进行，并符合合同约定的投资目标及策略。管理人应当遵循投资人利益优先的原则，公平对待参与财产，防止利益冲突，不得损害投资人利益。

在一般及重大关联交易发生后，管理人应及时通过官方网站公告通知投资人并通过邮件或其他双方约定的形式通知托管人，并有充分证据证明未损害投资人利益，进行及时、全面、客观的披露。采取切实有效措施防范利益冲突，保护投资人合法权益，并向中国证监会相关派出机构报告。

管理人承诺不以资产管理计划的资金与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向本机构注资等。

（五）关联交易审批与内控机制

管理人根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及配套规定的要求，已经制定了相应关联交易管理内控制度。

根据制度要求，资产管理计划拟发生关联交易的，应事先征得投资者同意，并在关联交易实际发生前发起关联交易审议程序，将拟发生的关联交易提交投资决策小组审批同意，再依据《申银万国期货有限公司关联交易管理制度》关联交易的审议程序执行审批程序；事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

特别提示：投资人签署本合同即表明其已经知晓并同意上述关联交易的相关内容。

投资人知晓并同意本计划的投资对象可能包括资产管理人或关联方管理的金融产品或者本计划可能与管理人、托管人或其关联方进行交易。本计划销售机构可能包含资产管理人的关联方，本计划可能聘请资产管理人、资产托管人或其关联方为本计划经纪机构。投资人签署本合同即代表明确知悉且自愿承担

该类风险。投资人务必注意关联交易及利益冲突风险，在充分考量的基础上，审慎参与本计划。投资人不得因本资产管理计划投资收益劣于管理人、托管人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。”

7、《资产管理合同》第【十九】节第【(二)】条第1款部分约定如下：

“1、资产管理人的管理费和业绩报酬

(1) 资产管理人的管理费

资产管理计划财产的年管理费率为【1.5%】。计算方法如下：

$H = E \times R \div \text{当年实际天数}$

H为每日应计提的管理费

R为本计划的管理费率

E为前一日的计划资产净值

本计划的管理费自资产管理计划成立日起，每日计提，按季支付。当季应收管理费由资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，自行在下季初十个工作日内于计划财产中扣收，并按照指定的账户路径进行资金支付，资产管理人无需再出具资金划拨指令。费用扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。

(2) 资产管理人的业绩报酬

在本计划分红确认日（若有）、退出确认日和计划终止确认日，管理人将根据委托人每笔参与份额的期间年化收益率（R），如该笔参与份额期间年化收益率在6%以上的，对该笔参与份额期间年化收益率在6%以上的部分按40%比例收取业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。

.....

期间年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
$R \leq 6\%$	0	$E = 0$
$6\% < R$	40%	$E = N \times P0x \times (R - 6\%) \times 40\% \times (T \div 365)$

.....

”

自本协议的变更执行日起，上述内容变更如下：

“1、资产管理人的管理费和业绩报酬

(1) 资产管理人的管理费

资产管理计划财产的年管理费率为【1.2%】。计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年实际天数}$$

H 为每日应计提的管理费

R 为本计划的管理费率

E 为前一日的计划资产净值

本计划的管理费每日计提，按季支付。当季应收管理费由资产托管人根据与资产管理人核对一致的财务数据，自行在下季初十个工作日内于计划财产中扣收，并按照指定的账户路径进行资金支付，资产管理人无需再出具资金划拨指令。费用扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系资产托管人协商解决。

(2) 资产管理人的业绩报酬

在本计划分红确认日（若有）、退出确认日和计划终止确认日，管理人将根据投资人每笔参与份额的期间年化收益率（R），如该笔参与份额期间年化收益率在 5.6% 以上的，对该笔参与份额期间年化收益率在 5.6% 以上的部分按 40% 比例收取业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。

.....

期间年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
$R \leq 5.6\%$	0	$E = 0$
$5.6\% < R$	40%	$E = N \times P_{0x} \times (R - 5.6\%) \times 40\% \times (T \div 365)$

.....

”

8、《资产管理合同》第【二十二】节和《风险揭示书》第【(二)】条第 8 款约定如下：

“8、关联交易风险

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。”

自本协议的变更执行日起，上述内容变更如下：

“8、关联交易风险

在本计划存续期内，在不损害投资人利益的前提下，管理人在根据资产管理合同规定管理、运用和处分计划财产时，可能运用计划资产进行关联交易，关联交易分为一般关联交易和重大关联交易。

管理人从事一般关联交易的，虽然资产管理人积极遵循资产投资人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险，管理人也无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响投资者的利益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事一般关联交易。该等事先约定同意、事后统一披露的方式可能造成投资者无法及时知悉本计划从事一般关联交易并采取措施，投资者愿承担由此造成的参与财产损失（如有）。

管理人从事重大关联交易的，可能因为重大关联交易金额或比例较高对本计划的投资运作产生较大影响。对于重大关联交易，管理人将事先取得投资者同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响计划财产的投资收益。”

9、自本协议变更执行日起，《资产管理合同》第二十七节新增如下事项：

“或有事件：资产托管人获得监管机构批复或核准可以独资或者控股的具有独立法人资格的子公司（“托管子公司”）从事托管业务。

资产管理人、投资者皆同意，如果或有事件发生，资产托管人有权单方在资产托管人网站以公告通知的方式将本合同中应由资产托管人享有的权利和承担的义务概括转让给托管子公司。自该等公告通知载明的指定时间（含）起，上述概括转让被视为自动完成，本合同项下托管人变更为托管子公司，各方无须就此另行签订协议。

申万添宁双周盈1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议

资产托管人保证托管子公司具备开展此项业务的相关资格和能力。”

10、《资产管理合同》内“资产委托人、委托人”表述统一更新为“资产投资人、投资人”。

二、《资产管理合同》规定的专用术语适用于本协议，本协议中的相关术语具有《资产管理合同》规定的含义。

三、本协议构成《资产管理合同》不可分割的一部分，本协议与《资产管理合同》具有同等法律效力，《资产管理合同》的相关内容本协议不一致的，以本协议为准；本协议没有约定的事项仍适用《资产管理合同》的规定。

四、本协议的成立、生效及执行

1、本协议的签署采用纸质协议方式的，资产投资人为法人或其他组织的，本协议自资产投资人、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人或授权代表签字（或盖章）之日起成立；资产投资人为自然人的，本协议自资产投资人本人或授权代表签字（或盖章）、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人或授权代表签字（或盖章）之日起成立。

本协议的签署采用电子签名方式的，本协议自资产管理人和资产托管人法定代表人或授权代表签字（或盖章）并加盖公章或合同专用章、资产投资人以电子签名方式签署本协议之日起成立，或自资产管理人、资产托管人及资产投资人均以电子签名方式签署本协议之日起成立。资产投资人通过电子签名方式签署本协议的，与资产投资人在纸质文件上签名或者盖章具有同等法律效力。资产管理人应确保资产投资人签署本协议所使用的电子签名符合《中华人民共和国电子签名法》等法律法规、监管规定的相关要求。

2、本协议经所有资产投资人、资产管理人、资产托管人全部签署完毕后，由资产管理人将本协议的变更执行日通过《资产管理合同》约定的方式之一通知资产投资人，同时须以书面形式通知资产托管人，本次变更内容自前述资产管理人通知载明的变更执行日起生效并执行。

3、本补充协议约定变更的内容无需追溯既往。

4、资产管理人应及时将签署完毕的协议分别送达至资产投资人和资产托管人归档（托管人办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层）。

5、本补充协议有效期为补充协议生效日至资产管理合同终止日。

五、本协议以纸质文件签署的，一式【三】份，资产投资人、资产管理人、资产托管人各执一份，每份具有同等的法律效力。本协议以电子文件签署的，由资产投资人签署电子签名，资产管理人与资产托管人签署纸质协议，纸质协议原件一式贰份，由资产管理人与资产托管人各执一份，每份协议均具有同等的法律效力，或由资产管理人、资产托管人及资产投资人均以电子签名方式签署。

(以下空白无正文)

(本处为手签) 资产投资人 资产托管人

日 月 年 ; 日 月 年

资产投资人 (盖章) 资产托管人 (盖章)

资产投资人 手签



(本处为手签) 资产投资人 资产托管人

日 月 年 ; 日 月 年

资产投资人 (盖章) 资产托管人 (盖章)

资产投资人 手签

(本处为手签) 资产投资人 资产托管人

日 月 年 ; 日 月 年

公司章

(本页无正文,为申万添宁双周盈1号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议签署页)

资产投资人:

法定代表人或授权代表(签字或盖章):

签署日期: 年 月 日

资产管理人(公章/合同专用章): 申银万国期货有限公司

法定代表人或授权代表(签字或盖章):

签署日期: 2024年 04月 03日

资产托管人(公章/合同专用章): 中信证券股份有限公司

法定代表人或授权代表(签字或盖章):

签署日期: 2024年 4月 3日