

关于“东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划”变更为“东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划”及法律文件变更的征询意见函

尊敬的投资者：

本公司根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）等规定及中国证监会《关于准予东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2021〕956号），作为东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划（以下简称“飞龙2号”）的管理人，经与托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，拟将飞龙2号变更为“东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划”（以下简称“海睿致远”），并按照《东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划合同》有关约定履行资产管理合同等法律文件变更程序。

飞龙2号变更为海睿致远涉及法律文件全文变更，即由原飞龙2号法律文件变更为海睿致远的法律文件，包括《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《集合计划合同》”）、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划托管协议》《东海

证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）等，上述法律文件已同步在管理人网站披露，敬请投资者仔细阅读。本次飞龙2号变更为海睿致远涉及的主要变更和具体流程说明如下：

一、主要变更

（一）变更产品名称

产品名称由“东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划”变更为“东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划”。

（二）变更产品类型

产品类型由“非限定性集合资产管理计划”变更为“混合型集合资产管理计划”。

（三）变更产品运作方式

变更前后产品运作方式对照如下：

飞龙2号	海睿致远
<p>自管理人聘请上海朱雀股权投资管理股份有限公司为原集合计划提供投资决策相关专业服务的第三方机构之后（2015年12月22日）的特别开放期结束后，设定6个月的退出封闭期。在退出封闭期内委托人不得申请退出。之后的开放期为每周第一个工作日，委托人可申请参与和退出（退出封闭期除外）。</p> <p>此外，管理人变更管理合同及其它必要情况时，管理人有权设定特别开放期，为委托人办理集合计划的参与、退出业务。</p>	<p>契约型、开放式</p> <p>投资人在开放日申请办理集合计划份额的申购和赎回，具体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，但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>集合计划合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货市场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，但应在实施日前依照《公开募集证券投资基金信息披露管理</p>

	办法》(以下简称《信息披露办法》)的有关规定在规定媒介上公告。
--	---------------------------------

(四) 调整管理期限条款

变更前后管理期限条款对照如下:

飞龙2号	海睿致远
原集合计划不设固定管理期限,无固定存续期,在满足本集合计划终止条件时,管理人有权终止集合计划。	本集合计划存续期限自《东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划合同》生效至《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》终止之间的期限。中国证监会另有规定的,按规定执行。

(五) 调整申购相关条款

1、 申购费率

变更前后申购费对照如下:

飞龙2号	海睿致远
参与金额 N N < 100 万为 0.8% N ≥ 100 万为 0.5%	单笔申购金额 (含申购费) M M < 100 万元为 1.50% 100 万元 ≤ M < 300 万元为 1.20% 300 万元 ≤ M < 500 万元为 0.80% M ≥ 500 万元为 1,000 元/笔

管理人可以在海睿致远合同约定的范围内调整申购费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

2、 调整申购份额的计算方法

主要条款对照如下:

飞龙2号	海睿致远
开放期参与: 参与净金额 = 参与金额 / (1 + 集合计划参与费率) 参与份额 = 参与净金额 / 参与申	申购费用适用比例费率时,申购份额的计算方法如下: 净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)

<p>请日的集合计划份额净值参与份数的计算结果按照四舍五入方法，保留小数点后两位。</p>	<p>申购费用 = 申购金额 - 净申购金额 申购份额 = 净申购金额 / T 日集合计划份额净值 申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下： 申购费用 = 固定金额 净申购金额 = 申购金额 - 申购费用 申购份额 = 净申购金额 / T 日集合计划份额净值</p>
---	---

3、调整最低申购金额

飞龙 2 号	海睿致远
<p>投资者首次参与的最低金额为 100,000 元，追加参与的最低金额为 1,000 元。</p>	<p>投资者首次申购的单笔最低金额为人民币 1000 元（含申购费），追加申购的单笔最低金额为人民币 1 元（含申购费）。各销售机构对最低申购限额或交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准，但通常不得低于上述下限。管理人可根据有关法律法规的规定和市场情况，调整投资者首次申购和追加申购本集合计划的最低金额或累计申购金额限制。</p>

（六）调整赎回相关条款

调整赎回费率，变更前后赎回费对照如下：

飞龙 2 号	海睿致远
<p>持有期限 T T < 1 年为 0.5% T ≥ 1 年为 0</p>	<p>持有期限 N N < 7 日为 1.50% 7 日 ≤ N < 30 日为 0.75% 30 日 ≤ N < 180 天为 0.50% N ≥ 180 天为 0</p>

海睿致远对持续持有期少于 30 日的投资人收取的赎回费，将全额计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 30

日但少于 90 日的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 75% 计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 90 日但少于 180 日的投资者收取的赎回费，将不低于赎回费总额的 50% 计入集合计划财产；对持续持有期长于或等于 180 日的投资人，将不低于赎回费总额的 25% 归入集合计划财产。未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

注：原东海证券飞龙 2 号-朱雀集合资产管理计划份额的持有时间从登记机构确认投资人持有该份额之日起连续计算。

（七）调整投资相关条款

在投资范围上，根据公募基金相关规定调整原飞龙 2 号的投资范围，删除了证券投资基金、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、股票质押式回购、融资融券转融通等不符合要求的投资标的，细化了债券类和股票类投资标的。

在投资比例上，根据变更后的产品类型调整权益类资产的投资比例限制；为符合公募基金相关规定，删除原飞龙 2 号对固定收益类资产的比例、现金类资产的比例。

在投资限制上，根据公募基金相关规定调整投资限制，增加股票资产、资金资产的比例限制，增加资产支持证券、参与股票发行申购、投资流通受限资产的相关投资限制，增加与私募产品开展逆回购交易，与集合计划合同约定的投资范围一致的要求，调整参与股指期货和国债期货的相关限制。

在投资策略上，结合管理人目前的投资逻辑和公募基金

相关法规调整了股票投资策略、债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略，删除基金投资策略、可转债债券投资策略、ETF 投资策略、逆回购投资策略、股票质押式回购投资策略，新增资产支持证券投资策略。

增加业绩比较基准条款。

主要条款对照如下：

	飞龙 2 号	海睿致远
投资目标	在控制风险和本金安全的基础上，在以资产安全性和流动性为优先考虑的前提下，追求较高的当期收益和总回报。	在严格控制风险并保持良好流动性的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资回报，谋求集合计划资产的长期增值。
投资范围	<p>投资于股票、股指期货、国债期货、国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、债券逆回购、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券、资产支持证券、证券投资基金、银行存款、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划及其他中国证监会允许投资的固定收益证券品种。</p> <p>本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。</p> <p>本集合计划投资国债期货的，不允许进行实物债券的交割。</p> <p>本集合计划可参与债券正回购业务。</p> <p>本集合计划可投资于股票质押式回购交易，质权人登记为管理人。</p> <p>委托人签东海证券飞龙 2 号-朱雀集合资产管理计划合同，签署本合同即代表同意以上约定，本集合计划参与股票质押式回购交易无需征询委托人同意。</p>	<p>本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（含公司债、企业债、国债、金融债、央行票据、中期票据、短期融资券、可转换公司债券、可分离交易债券、可交换债券）、债券回购、资产支持证券、股指期货、国债期货等各类金融工具、银行存款及其他中国证监会允许投资的金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
投资	(1) 权益类资产，包括股票、股	集合计划的投资组合比例为：股票

比例	<p>票型和混合型证券投资基金以及买入股指期货合约价值总额占集合计划资产净值的比例为：0-95%。</p> <p>(2) 国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、中期票据、短期融资券、债券逆回购、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券、资产支持证券、货币市场基金、债券型基金、分级基金优先份额、银行存款、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划等，占集合资产管理计划资产总值的比例为：0-95%。</p> <p>(3) 在计划开放期间，银行存款、货币市场基金、一年内到期的国债和央行票据以及政策性金融债、7天期以内（含7天期）的债券逆回购等现金类金融产品不低于计划资产总值的10%；在计划封闭期间不低于计划资产总值的5%。</p> <p>(4) 债券正回购：参与债券正回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的40%。</p> <p>(5) 股票质押式回购交易：占集合计划资产净值的比例为：0-100%。委托人在此同意并授权管理人可以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，但其投资比例不得超过资产净值的7%。（投资于指数基金可以不受上述限制）。交易完成5个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。</p>	<p>资产占集合计划资产的比例为0%-95%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或到期日在1年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
投资限制	<p>(一) 投资限制</p> <p>为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>1、将集合计划资产投资于一家公</p>	<p>1、组合限制</p> <p>集合计划的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 股票资产占集合计划资产的</p>

<p>司发行的证券超过集合计划资产净值的 10%；投资于指数基金除外；</p> <p>2、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%；</p> <p>3、将集合计划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，投资比例超过资产净值的 7%；投资于指数基金可以不受上述限制；</p> <p>4、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%，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>5、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>6、股指期货和国债期货投资仅以套期保值为目的；</p> <p>7、在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 10%；持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 15%；</p> <p>8、在任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的 95%。其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>9、在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%；持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的</p>	<p>比例为 0%-95%；</p> <p>（2）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>（3）本集合计划持有一家发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；</p> <p>（4）本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家发行的证券，不超过该证券的 10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制；</p> <p>（5）本集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的 10%；</p> <p>（6）本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的 20%；</p> <p>（7）本集合计划持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>（8）本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>（9）本集合计划应投资于信用评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下</p>
--	--

<p>30%;</p> <p>10、在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 30%；</p> <p>11、每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券；</p> <p>12、若集合计划份额净值下降，则管理人将降低集合计划持有的权益类资产的配置比例，具体如下：在存续期内，当集合计划份额净值于 T 日低于【0.95 元】时，自 T+1 日起集合计划持有的权益类资产占集合计划资产净值的比例不高于 70%，直至集合计划份额净值高于【0.95 元】。</p> <p>当集合计划单位净值于 T 日低于【0.90 元】时，集合计划持有的权益类资产占集合计划资产净值的比例不高于 50%，直至集合计划份额净值高于【0.90 元】。</p> <p>当集合计划单位净值于 T 日低于【0.85 元】时，集合计划持有的权益类资产占集合计划资产净值的比例不高于 30%，直至集合计划份额净值高于【0.85 元】。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定，则本集合计划不受上述限制。</p> <p>（二）禁止行为</p>	<p>降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>（10）集合计划财产参与股票发行申购，本集合计划所申报的金额不超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>（11）本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>（12）本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合资产管理计划（包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；</p> <p>（13）本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p>
---	---

<p>本集合计划的禁止行为包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、违规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； 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资； 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺； 4、挪用集合计划资产； 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营； 6、募集资金超过计划说明书约定的规模； 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额； 8、使用集合计划资产进行不必要的交易； 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为； 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。 	<p>(14) 本集合计划与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与集合计划合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>(15) 本集合计划参与股指期货、国债期货投资，应遵循下列限制：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 10%； 2) 集合计划在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%； 3) 集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%；集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合集合计划合同关于股票投资比例的有关约定； 4) 集合计划在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 15%； 5) 集合计划在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的 30%； 6) 集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 30%；集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合集合计划合同关于
--	--

	<p>债券投资比例的有关约定;</p> <p>7) 任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约和股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过集合计划资产净值的 95%, 其中, 有价证券指股票、债券 (不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产 (不含质押式回购) 等;</p> <p>(16) 本集合计划资产总值不得超过集合计划资产净值的 140%;</p> <p>(17) 法律法规及中国证监会规定的和《集合计划合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述 (2)、(9)、(13)、(14) 情形之外, 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的, 管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。</p> <p>2、禁止行为</p> <p>为维护集合计划份额持有人的合法权益, 集合计划财产不得用于下列投资或者活动:</p> <p>(1) 承销证券;</p> <p>(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;</p> <p>(3) 从事承担无限责任的投资;</p> <p>(4) 买卖其他集合计划份额或基金份额, 但是中国证监会另有规定的除外;</p> <p>(5) 向管理人、托管人出资;</p> <p>(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;</p> <p>(7) 法律、行政法规和中国证监</p>
--	---

业绩比较基准		<p>会规定禁止的其他活动。</p> <p>中证 800 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%</p> <p>中证 800 指数由中证 500 指数和沪深 300 指数成份股组成，综合反映中国 A 股市场大中小市值公司的股票价格表现，具有良好的市场代表性。</p> <p>中国债券总指数的成分券由在境内公开发行且上市流通的记账式国债、央行票据和政策性银行债组成，是一个反映境内利率类债券整体价格走势情况的分类指数。</p> <p>本集合计划为混合型集合资产管理计划，投资于股票资产占集合计划资产的比例范围为 0-95%，因此上述业绩比较基准目前能够较好地反映本集合计划的投资风格及风险收益特征。</p>
--------	--	---

(八) 调整估值方法

在估值核算上，根据公募基金相关规定调整原飞龙 2 号的投资范围，相应删除了不符合公募基金要求的资产的估值方法，包括证券投资基金、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、股票质押式回购、融资融券转融通等不符合要求的投资标的估值方法；

同时根据《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的要求，更新了原飞龙 2 号合同中对于通过非公开发行等其他方式获取且有明确锁定期的股票的估值方法。

主要条款对照如下：

飞龙 2 号	海睿致远
<p>除投资管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外,本计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。如国内证券投资会计原则及方法发生变化,由管理人与托管人另行协商确定估值方法,并以签署托管协议补充协议的方式确定有关内容。</p> <p>1、股票估值方法</p> <p>(1) 上市流通股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,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;上市流通股估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或者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资产净值的影响在 0.5% 以上的,可参考停牌股票的估值方法,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。</p> <p>(2) 未上市股票的估值</p> <p>①首次发行未上市的股票,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,按成本价估值。</p> <p>②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一股票的收盘价进行估值。</p> <p>③首次公开发行有明确锁定期的股票,同一股票在交易所上市后,按估值日在证券交易所上市的一股票的收盘价进行估值。</p> <p>④非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票,按以下方法估值:</p> <p>a)估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价低于非公开发行股票初始取得成本时,采用在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价作为估值日该非公开发行股票的价值;</p> <p>b)估值日在证券交易所上市交易的同一股票的收盘价高于非公开发行股票初始取得成本时,可按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值:</p> $FC = C + (P - C) \times \frac{D_t - D_r}{D_t}$	<p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1)交易所上市的有价证券(包括股票),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,且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,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或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的,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)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;</p> <p>(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;</p> <p>(4)交易所上市交易的可转换债券、可交换债券以每日收盘价作为估值全价;</p> <p>(5)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用</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收盘价；DI 为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr 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）。

股票的锁定期起始日及估值起始日为上市公司发布公告日。（3）在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）至（2）小项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）至（2）小项规定的方法对委托财产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，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

2、债券估值方法

（1）在证券交易所市场挂牌交易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，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（2）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去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所含的债券应收利息得到的净价估值；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，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

（3）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。

（4）交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，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，按成本进行后续计量。

估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，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；

（6）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估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（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估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行未上市的股票和债券，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；

（3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、

(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, 按照成本估值。

(6) 在对银行间市场的固定收益品种估值时, 应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格进行估值。

(7) 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。

(8) 在任何情况下, 资产管理人如采用本项第(1) - (7) 小项规定的方法对计划资产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果资产管理人认为按本项第(1) - (7) 小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的, 资产管理人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形成的债券估值, 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。

3、证券投资基金估值方法

(1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、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, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值;

(2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF)), 按估值日前一交易日的基金份额净值估值; 估值日前一交易日基金份额净值无公布的, 按此前最近交易日的基金份额净值估值;

(3) 持有的货币市场基金, 按估值日前一交易日基金管理公司的每万份收益计算;

(4) 认购的新发行的未上市交易的交易所基金按成本估值, 基金公司公布净值的按照净值估值;

(5) 在任何情况下, 资产管理人如采用本项第(1) - (4) 项规定的方法对委托财产进行估值, 均应被认为采用了适当的估值方法。但是, 如果资产管理人认为按本项第(1) - (4) 项规定的方法对委托财产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, 并与资产托管人商定后, 按最

首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等, 不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票, 按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

3、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。

4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券或股票所处的市场分别估值。

5、投资证券衍生品的估值方法

股指期货合约、国债期货合约, 一般以估值当日结

<p>能反映公允价值的价格估值。</p> <p>4、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。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。</p> <p>5、保证收益商业银行理财计划按成本估值，按收益率每日确认收益。保本浮动收益商业银行理财计划按成本估值，到期确认收益。</p> <p>6、逆回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>7、股票质押回购的估值方法</p> <p>(1) 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>(2) 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，不影响集合计划估值。</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，直至延期购回到期日。 融入方自发起初始交易指令至发出延期购回指令的期间，因原股票质押回购交易商定利率与延期购回利率所产生的应付资金差额，自发出延期购回指令当日起，在延期期间每日按照直线法摊余估值。</p> <p>③股票质押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>8、金融期货的估值办法国债期货、股指期货以估值日金融期货交易所公布的当日该合约结算价为准进行估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。</p> <p>9、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集</p>	<p>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>6、存款的估值方法 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>7、同业存单的估值方法 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。</p> <p>8、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，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>9、当集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。 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。 如管理人或托管人发现集合计划估值违反集合计划合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护集合计划份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明</p>
--	---

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。

10、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。

11、当市场发生极端的流动性不足或者证券被停牌，合同终止无法变现的资产处理由合同各方根据相关法律法规，视具体情况就资产变现、估值等事宜协商解决。

如管理人或托管人发现集合估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。

原因，双方协商解决。

根据《基金法》，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。托管人复核、审查管理人计算的集合计划资产净值。本集合计划的集合计划会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。

(九) 调整管理费、业绩报酬条款

1、调低管理费率

原飞龙 2 号管理费率为 2.5%/年；变更后海睿致远的管理费率为 1.2%/年。

2、取消计提业绩报酬

原飞龙 2 号在集合计划分红权益登记日、委托人退出日和集合计划终止日，根据集合计划年化收益率分级提取业绩报酬，具体计算方法如下：

年化收益率 (R)	计提比例
$R \leq 6\%$	0
$6\% < R \leq 15\%$	20%
$R > 15\%$	25%

海睿致远不计提业绩报酬。

(十) 调整收益分配条款

主要条款对照如下:

飞龙2号	海睿致远
<p>1、在每自然季度的最后一个工作日，在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，管理人可以对集合计划进行收益分配，具体时间由管理人决定；</p> <p>2、若上一分红权益登记日至本季度最后一个工作日期间的年化收益率达到15%，则管理人可以对集合计划进行收益分配。</p> <p>年化收益率计算方法为：</p> $Y = \frac{C_T^* - C_0^*}{C_0} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p>Y: 指上一分红权益登记日至本季度最后一个工作日期间的年化收益率；</p> <p>C_T^*: 指本季度最后一个工作日的累计份额净值；</p> <p>C_0^*: 指上一分红权益登记日的累计份额净值；</p> <p>C_0: 指上一分红权益登记日的份额净值；</p> <p>T: 指集合计划上一分红权益登记日至本季度最后一个工作日的自然天数。</p> <p>3、分红权益登记日收益分配前的计划份额净值减去每一份额分红金额后不能低于集合计划份额面值。</p> <p>4、分红权益登记日登记在册的每份集合计划份额享有同等分配权。</p> <p>5、当期收益分配金额由管理人根据实际情况确定。</p> <p>6、法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。</p>	<p>1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；</p> <p>2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；</p> <p>3、集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>4、每一集合计划份额享有同等分配权；</p> <p>5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>

(十一) 调整信息披露条款

主要条款对照如下:

飞龙2号	海睿致远
<p>集合计划的信息披露</p> <p>(一) 定期报告</p> <p>定期报告包括集合计划的份额净值报告、资产管理季度</p>	<p>公开披露的集合计划信息</p> <p>(一) 招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、产品资料概要</p> <p>1、《集合计划合同》是界定《集合计划合同》</p>

(年度)报告、托管季度(年度)报告、年度审计报告和对账单。

1、集合计划份额净值报告

管理人在每个工作日(若遇节假日,则顺延至下一个工作日)通过管理人网站披露经过托管人复核的上一个工作日的集合计划份额净值、累计份额净值,供投资者参考。

2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告和托管季度报告,对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后15个工作日内通过管理人网站通告。

3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的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、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后3个月内通过管理人网站通告。

管理人将按照《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》的相关规定,在资产管理报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货、国债期货交易的有关情况,包括投资

当事人的各项权利、义务关系,明确集合计划份额持有人大会召开的规则及具体程序,说明集合计划产品的特性等涉及集合计划投资者重大利益的事项的法律文件。

2、招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项,说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划产品特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务等内容。《集合计划合同》生效后,招募说明书的信息发生重大变更的,管理人应当在三个工作日内,更新招募说明书并登载在指定网站上;招募说明书其他信息发生变更的,管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的,管理人不再更新招募说明书。

3、托管协议是界定托管人和管理人在集合计划财产保管及集合计划运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。

4、产品资料概要是招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。《集合计划合同》生效后,产品资料概要的信息发生重大变更的,管理人应当在三个工作日内,更新产品资料概要,并登载在指定网站及集合计划销售机构网站或营业网点;产品资料概要其他信息发生变更的,管理人至少每年更新一次。集合计划终止运作的,管理人不再更新产品资料概要。

本集合计划变更经中国证监会批准后,管理人应将招募说明书提示性公告、《集合计划合同》提示性公告登载在指定报刊上,将招募说明书、产品资料概要、《集合计划合同》和托管协议登载在指定网站上,并将产品资料概要登载在集合计划销售机构网站或营业网点;托管人应当同时将《集合计划合同》、托管协议登载在网站上。

(二)《集合计划合同》生效公告

管理人应当在收到中国证监会批准文件后,将在指定媒介上登载《集合计划合同》生效公告。

(三)集合计划净值信息

<p>目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货、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，并在年度报告中披露相应内容。</p> <p>4、年度审计报告 管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起3个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。</p> <p>5、对账单 管理人应当在每季度结束后的15个工作日内以书面或电子邮件方式向委托人寄送对账单，对账单内容应包括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。</p>	<p>《集合计划合同》生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，管理人应当至少每周在规定网站披露一次集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或者营业网点披露开放日的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>（四）集合计划份额申购、赎回价格 管理人应当在《集合计划合同》、招募说明书等信息披露文件上载明集合计划份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在集合计划销售机构网站或者营业网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>（五）定期报告，包括年度报告、中期报告和季度报告 管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成年度报告，将年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>管理人应当在季度结束之日起15个工作日内，编制完成季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>如报告期内出现单一投资者持有集合计划份额</p>
--	---

	<p>达到或超过集合计划总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本集合计划的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。管理人应当在年度报告和中期报告中披露集合计划组合资产情况及其流动性风险分析等。</p>
<p>(二) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人网站公告方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：</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；</p> <p>(2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>(3) 集合计划终止和清算；</p> <p>(4) 合同的补充、修改与变更；</p> <p>(5) 调整本计划的风险等级；</p> <p>(6) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(7) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；</p> <p>(8) 集合计划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；</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、</p>	<p>(六) 临时报告</p> <p>本集合计划发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在指定报刊和规定网站上。</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划份额持有人大会的召开及决定的事项； 2、《集合计划合同》终止、集合计划清算； 3、转换集合计划运作方式、集合计划合并； 4、更换管理人、托管人、集合计划份额登记机构，集合计划改聘会计师事务所； 5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项； 6、管理人、托管人的法定名称、住所发生变更； 7、管理人变更持有百分之五以上股权的股东、管理人的实际控制人变更； 8、管理人分管资产管理业务的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动； 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十； 10、涉及集合计划财产、集合资产管理计划管理业务、托管业务的诉讼或仲裁； 11、管理人或其高级管理人员、投资经理因集

<p>破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>(11)其他管理人认为的重大事项。</p>	<p>合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；</p> <p>12、管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；</p> <p>13、集合计划收益分配事项；</p> <p>14、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>15、集合计划份额净值估值错误达集合计划份额净值百分之零点五；</p> <p>16、本集合计划开始办理申购、赎回；</p> <p>17、本集合计划发生巨额赎回并延期办理；</p> <p>18、本集合计划连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；</p> <p>19、本集合计划暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；</p> <p>20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；</p> <p>21、管理人采用摆动定价机制进行估值；</p> <p>22、本集合计划调整份额类别设置；</p> <p>23、集合计划信息披露义务人认为可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。</p> <p>(七)澄清公告</p> <p>在《集合计划合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害集合计划份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> <p>(八)集合计划份额持有人大会决议</p> <p>集合计划份额持有人大会决定的事项，应当依</p>
---	---

	<p>法报中国证监会备案，并予以公告。</p> <p>(九) 投资资产支持证券信息披露 管理人应在年度报告、中期报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。 管理人应在季度报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。</p> <p>(十) 投资股指期货和国债期货信息披露 管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货和国债期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货和国债期货交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。</p> <p>(十一) 实施侧袋机制期间的信息披露 本集合计划实施侧袋机制的,相关信息披露义务人应当根据法律法规、本合同和招募说明书的规定进行信息披露,详见招募说明书的规定。</p> <p>(十二) 中国证监会规定的其他信息。</p>
--	--

(十二) 调整合同变更条款

主要条款对照如下:

飞龙2号	海睿致远
<p>1、本合同签署后,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等交易规则修订,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5个工作日后开始生效。委托人对更新或修改的内容有异议,</p>	<p>1、变更集合计划合同涉及法律法规规定或本合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的,应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和集合计划合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项,</p>

<p>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。</p> <p>2、除调低管理费率、托管费率，以及调低风险等级事宜外，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个工作日内以书面或者管理人网站公告方式向委托人发送合同变更征询意见。合同变更内容在征询意见发出后的最近一个开放期或特别开放期（以管理人网站公告为准）生效。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：管理人有权设定特别开放期，为不同意合同变更的委托人办理退出业务。逾期未退出或未有意见答复的，视同委托人同意本合同变更。自合同变更生效之日起，公告内容即成为本合同组成部分。</p> <p>3、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>4、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。</p>	<p>由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。</p> <p>2、关于《集合计划合同》变更的集合计划份额持有人大会决议自生效后方可执行，自决议生效后两日内在规定媒介公告。</p>
--	--

（十三）调整合同终止条款

主要条款对照如下：

飞龙2号	海睿致远
<p>有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>1、集合计划存续期间，客户少于2人；</p> <p>2、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的；</p> <p>3、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管理人未在30个工作日内与新的托管人签订托管协议的；</p> <p>4、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；</p> <p>5、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责时，管理人未在30个工作日内与新的托管人签订托管协议的；</p> <p>6、战争、自然灾害等不可抗力力的发生导致</p>	<p>有下列情形之一的，经履行相关程序后，《集合计划合同》应当终止：</p> <p>1、集合计划份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、管理人、托管人职责终止，在6个月内没有新管理人、新托管人承接的；</p> <p>3、《集合计划合同》约定的其他情形；</p> <p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>

本集合计划不能存续的; 7、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。	
--	--

(十四) 增加侧袋机制

根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的规定，在海睿致远《集合计划合同》、《招募说明书》中设置侧袋机制，约定侧袋机制的实施条件；明确实施侧袋机制期间，集合计划份额的申购与赎回、投资、估值、收益分配、费用；实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定；明确侧袋账户中特定资产的处置变现和支付；侧袋机制的信息披露。

(十五) 增加集合计划份额持有人大会

根据《基金法》和《运作办法》的规定，在海睿致远《集合计划合同》中设置集合计划份额持有人大会机制，约定须召开集合计划份额持有人大会的事项，并明确持有人大会会议召集人、召集方式；召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式；集合计划份额持有人出席会议的方式；议事内容与程序；表决和计票规则等。

二、相关流程安排

《关于东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划变更为东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划及法律文件变更的公告》（以下简称“《变更公告》”）已于2021年7月5日在管理人网站 www.longone.com.cn 公布，敬请查阅。

为保障不同意本次合同变更的投资者退出的权利，管理人于2021年7月12日至2021年7月16日设置特别开放期。

特别开放期仅办理退出业务，不办理参与业务。

投资者应在《变更公告》发布后的5个工作日内（即2021年7月5日至2021年7月9日）回复意见。

1、投资者回复同意变更的，将继续持有集合计划份额，并在海睿致远《集合计划合同》生效后变更为海睿致远集合计划份额。原飞龙2号份额变更为海睿致远份额不收取申购费和赎回费等费用，投资者无需自行操作。投资者持有海睿致远份额的持有时间从登记机构确认投资者持有原飞龙2号份额之日起连续计算。

2、投资者不同意变更的，我司对其采取如下权利保障措施及后续安排：不同意变更的投资者有权在特别开放期（2021年7月12日至2021年7月16日）申请退出原飞龙2号份额，我司将受理投资者的退出申请，并为投资者办理退出业务，我司保障其退出原飞龙2号的权利；对于明确回复不同意变更但未在特别开放期申请退出飞龙2号的投资者，我司将统一在特别开放期最后一个开放日（即2021年7月16日）做强制退出处理（退出价格为退出当日的份额净值）。退出的份额将按照原《东海证券飞龙2号-朱雀集合资产管理计划合同》收取赎回费、业绩报酬（如有）等费用。

3、投资者未在前述时间回复意见也未在特别开放期申请退出飞龙2号的，视为投资者同意此次变更，将继续持有集合计划份额，原飞龙2号份额变更为海睿致远份额不收取申购费和赎回费等费用，投资者无需自行操作。投资者持有海睿致远份额持有时间从登记机构确认投资者持有原飞龙2

号份额之日起连续计算。

本次变更将于特别开放期结束后首个工作日即 2021 年 7 月 19 日生效，具体见管理人网站公告，《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起生效，原《东海证券飞龙 2 号-朱雀集合资产管理计划合同》同日起失效，投资者将按照《基金法》、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关法律法规享有权利、承担义务。

三、回复方式

投资者可以在《变更公告》发布后的 5 个工作日内（即 2021 年 7 月 5 日~7 月 9 日）选择以下方式回复：

方式一、纸质回复

投资者在《回执》上填写回复意见及相关信息并签字后，邮寄至：上海市浦东新区 1928 号东海证券大厦 4 楼资产管理部收（邮编：200125）。

方式二、电子邮件回复

投资者在《回执》上填写回复意见及相关信息并签字后，将《回执》扫描件发送电子邮件至：dhdjh@longone.com.cn

方式三、电话回复

拨打热线电话 95531。

特别提示：投资者未在前述时间回复意见也未退出飞龙 2 号的，视为投资者同意本次合同变更。投资者持有的原飞龙 2 号份额将在《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为海睿致远集合计划

份额。

四、重要提示

1、敬请投资者仔细阅读变更后的《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件。

2、集合计划管理人自《东海证券海睿致远灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日起不超过3个月内开始办理海睿致远集合计划份额的申购业务，具体业务办理时间和办理规则另行公告。

3、如您需更详细了解飞龙2号变更为海睿致远集合计划的相关事宜，请登录管理人网站 www.longone.com.cn 查阅或致电 95531 咨询。

4、本征询意见函的回执一式贰份，管理人、投资者各保留壹份。

特此告知。

感谢您一直以来给予东海证券资产管理团队的关注和支持，祝您投资顺利、生活顺心！

