

# 关于东海证券海融 5 号集合资产管理计划 资产管理合同、说明书、风险揭示书等文件 变更的征询意见函

尊敬的东海证券海融 5 号集合资产管理计划委托人：

为了更好地服务广大投资者，我司作为东海证券海融 5 号集合资产管理计划的管理人，拟变更《东海证券海融 5 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）、《东海证券海融 5 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“说明书”）、《东海证券海融 5 号集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称“风险揭示书”）的部分条款。本次变更方案如下：

## 一、合同变更的相关约定

《合同》“第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”对合同的变更程序做出了明确约定。

## 二、《合同》变更内容

（一）“第二部分 释义”中，删除“18、封闭期：本计划的首个封闭期为自本合同生效日起至第一个开放日（不含该日）之间的期间，之后的封闭期为每相邻两个开放日之间的期间（不含开放日）。”和“20、开放期：指销售机构办理本计划参与、退出等业务的期间。”

新增：

“19、参与开放期：指接受委托人参与本计划或其他业务申请的日期，本集合计划参与开放期为每周二、周五（如遇非工作日不开放、不顺延），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参与时除外。

20、运作期起始日：对于推广期参与的集合计划份额，运作期起始日为集合计划成立日；对于参与开放期参与的集合计划份额，运作期起始日为该集合计划份额参与确认日。

21、运作期到期日：为集合计划份额参与申请日每满5个月对应的月度对日，如为推广期参与的集合计划份额，则运作期到期日为集合计划成立日每满5个月对应的月度对日。

22、月度对日：指某一特定日期在后续日历月中的对应日期，如没有对应日期或该日为非工作日的，则顺延至下一工作日。”

(二)“第四部分 当事人及权利义务”中，“一、合同当事人”中，“(三) 托管人”中“法定代表人：陶以平(代为履行法定代表人职权)”变更为“法定代表人：吕家进”。

(三)“第五部分 本计划的基本情况”中，“(四) 封闭期、开放期

1、封闭期：开放期以外的期间，均为本集合计划的封闭期。封闭期内不办理参与、退出业务。

2、开放期：本计划的开放期为每年年末倒数第10个工作日起至下一年年年初第10个工作日止，具体时间由管理人在每一开放期前在管理人网站上予以公告。开放期内，投资者可以根据本合同约定办理参与或退出业务。管理人有权提前结束或延长开放期，届时以管理人公告为准。

临时开放期：若因本计划管理人决定展期、变更合同或变更投资经理的，管理人将通过网站公告的形式征询投资者的意见。投资者不同意的，管理人将为不同意的投资者设置临时开放期。”

变更为：

“本集合计划采取5个月滚动持有的运作方式。

本计划每周二、周五(如遇非工作日不开放、不顺延)为参与开放期，投资者可在参与开放期内办理参与业务。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参与时除外。

每个运作期到期日前，委托人不能提出退出申请。第一个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满5个月对应的月度对日(如为推广期参与的集合计划份额，则第一个运作期到期日为集合计划成立日满5个月对应的月度对日，下同)；第二个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满10个月对应的月度对日；第三个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满15个月对应的月度对日，以此类推。

每个运作期到期日，委托人可提出退出申请。如果委托人在当期运作期到期日未申请退出，则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。

临时开放期：若因本计划管理人决定展期、变更合同、变更投资经理或调低业绩报酬计提基准的，管理人将通过网站公告的形式征询投资者的意见。投资者不同意的，管理人将为不同意的投资者设置临时开放期。”

（四）“第五部分 本计划的基本情况”中，“（六）本计划的投资目标”中，由“本资产管理计划投资目标是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。”变更为“通过分析影响债券市场的各类要素，对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置，力争为投资人提供长期稳定的投资回报。”

（五）“第五部分 本计划的基本情况”中，“（十）本计划的存续期限”中，删除“根据合同约定，本计划可提前终止。提前终止情形详见本合同第二十五部分约定。”

（六）“第八部分 本计划的参与、退出与转让”中，删除“一、本计划运作期间的开放期内，投资者可办理参与和退出业务。”

（七）“第八部分 本计划的参与、退出与转让”中，“三、参与和退出的开放日和时间”中，“封闭期：本集合计划除开放期以外的时间，均为封闭期；封闭期内不办理参与业务和退出业务。”

开放期：本计划的开放期为每年年末倒数第 10 个工作日起至下一年年年初第 10 个工作日止，具体时间由管理人在每一开放期前在管理人网站上予以公告。开放期内，投资者可以根据本合同约定办理参与或退出业务。管理人有权提前结束或延长开放期，届时以管理人公告为准。”

变更为：

“本集合计划采取 5 个月滚动持有的运作方式。

本计划每周二、周五（如遇非工作日不开放、不顺延）为参与开放期，投资者可在参与开放期内办理参与业务。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参与时除外。

每个运作期到期日前，委托人不能提出退出申请。第一个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满 5 个月对应的月度对日（如为推广期参与的集合计划份额，则第一个运作期到期日为集合计划成立日满 5 个月对应的月度对日，下同）；第二个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满 10 个月对应的月度对日；第三个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满 15 个月对应的月度对日，以此类推。

每个运作期到期日，委托人可提出退出申请。如果委托人在当期运作期到期日未申请退出，则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。

委托人在运作期到期日申请退出的，管理人按照本合同和说明书的约定为委托人办理退出事宜。”

（八）“第八部分 本计划的参与、退出与转让”中，“三、临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排”中，“当发生合同变更、展期、变更投资经理或监管规定等需要临时开放的情况时，管理人可公告临时开放期，”

变更为：

“当发生合同变更、展期、变更投资经理、**调低业绩报酬计提基准**或监管规定等需要临时开放的情况时，管理人可公告临时开放期，”

（九）“第八部分 本计划的参与、退出与转让”中，“四、参与和退出的方式、价格、程序及确认”中，“当日（T 日）在交易时间内提交的参与/退出申请，管理人及注册登记机构在收到投资者退出/参与申请的 T+2 日对该交易的有效性进行确认，” 变更为：

“当日（T 日）在交易时间内提交的参与/退出申请，管理人及注册登记机构在收到投资者退出/参与申请的 T+2 日**内**对该交易的有效性进行确认，”

（十）“第八部分 本计划的参与、退出与转让”中，新增“**九、大额退出的通知**

任一委托人在申请退出金额超过人民币 1000 万元的，应当提前 5 个工作日书面通知管理人。管理人未收到该等通知的，管理人有权拒绝该委托人的退出。”

（十一）“第八部分 本计划的参与、退出与转让”中，“十、巨额退出和连续巨额退出”中，“（二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付”中，“已

经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过【20】个工作日，并应当及时告知投资者。”变更为：

“已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过【20】个工作日，并在管理人指定网站上进行公告。”

（十二）“第二十部分 资产管理计划财产的估值和会计核算”中，“五、估值程序”中，“（二）管理人在每个交易日对计划财产进行估值，T+1日完成T日估值。”变更为“（二）管理人在每个交易日对计划财产进行估值，”

（十三）“第二十一部分 资产管理计划的费用与税收”中，“二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式”中，“（一）资产管理人的管理费”中，“1、固定管理费

集合计划管理人的管理费按前一日集合计划资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \div 365$$
变更为：

“1、固定管理费

集合计划管理人的管理费按前一日集合计划资产净值的0.4%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div 365$$

（十四）“第二十一部分 资产管理计划的费用与税收”中，“二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式”中，“（一）资产管理人的管理费”中，“2、业绩报酬：”中，“（2）业绩报酬的计提方法：”中，“本集合计划首个封闭期业绩报酬计提基准 F 为 4.1%/年，管理人于每个开放期前公告下个封闭期的业绩报酬计提基准 F。”变更为：“**本集合计划业绩报酬计提基准 F 为 4.2%/年。管理人根据投资运作情况可调整业绩报酬计提基准，届时以管理人公告为准。若调低业绩报酬计提基准，管理人将设置临时开放期，有异议的投资者可在临时开放期退出本计划。**”

（十五）“第二十三部分 信息披露与报告”中，“二、资产管理计划运作期间，管理人应向投资者披露以下信息：”中，“（一）净值报告”中，“本计划每工作日向投资者披露前一工作日经托管人复核的计划份额净值。”变更为“本计划每个工作日向投资者披露经托管人复核的计划份额净值。”

(十六) “第二十三部分 信息披露与报告”中, “三、临时报告”中, “临时报告的情形包括但不限于:”中, 新增“(9)管理人调整业绩报酬计提基准;”

(十七) “第二十四部分 风险揭示”中, “(二)特定风险揭示”中, 新增“9、运作期内无法退出风险

本集合计划采取5个月滚动持有的运作方式, 持有期长度为5个月, 委托人只能在运作期到期日才能提出退出申请。

本计划每周二、周五(如遇非工作日不开放、不顺延)为参与开放期, 投资者可在参与开放期内办理参与业务。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参与时除外。

每个运作期到期日前, 委托人不能提出退出申请。第一个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满5个月对应的月度对日(如为推广期参与的集合计划份额, 则第一个运作期到期日为集合计划成立日满5个月对应的月度对日, 下同); 第二个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满10个月对应的月度对日; 第三个运作期到期日为集合计划份额参与申请日满15个月对应的月度对日, 以此类推。

每个运作期到期日, 委托人可提出退出申请。如果委托人在当期运作期到期日未申请退出, 则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。投资者需注意运作期到期前面临无法退出的风险。

#### 10、调整业绩报酬计提基准的风险

本集合计划业绩报酬计提基准F为4.2%/年。管理人可以根据投资运作情况可调整业绩报酬计提基准, 届时以管理人公告为准。若调低业绩报酬计提基准, 管理人计提的业绩报酬可能会增加, 投资者可能面临提取业绩报酬后的收益减少的风险, 因此管理人将设置临时开放期, 有异议的投资者可在临时开放期退出本计划。”

《说明书》、《风险揭示书》根据上述内容做相应变更。

### 三、退出方案的安排

管理人于2021年10月28日设立临时开放期, 对变更内容有异议的委托人有权选择在临时开放期申请退出本集合计划份额, 我司将受理委托人的退出申请,

并为委托人办理退出业务。

#### 四、合同变更的公告和生效

在获得托管行对于本次合同变更的书面许可后,为充分保障委托人的知情权,我司拟提前在临时开放期之前即 2021 年 10 月 25 日至 2021 年 10 月 27 日在管理人网站 (www. longone. com. cn) 公告相关内容。本次合同变更将在临时开放期后的第一个工作日,即 2021 年 10 月 29 日生效。若在临时开放期前管理人已收到全体委托人对本次合同变更的书面同意,则于收到全体委托人的书面同意当日合同变更生效。具体时间见管理人网站。

#### 五、委托人对本次合同变更的意见

请您将对本次合同变更的意见填写在下表当中。

意见类型	您的意见 (请填写“同意”或“不同意”)
是否同意合同变更	

六、本征询意见函一式贰份,管理人、委托人各保留壹份。

管理人:

委托人:

东海证券股份有限公司

自然人(签字):

或法人或其他组织(盖章):

法定代表人/执行事务合伙人或授权代表

(签字或盖章):

时间: 年 月 日

时间: 年 月 日