

关于东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理合同变更的征询意见函及临时开放期设置公告

尊敬的投资者：

因中国证券监督管理委员会修订《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》，东海期货龙鼎3号集合资产管理计划将根据修订内容变更合同部分内容（具体变更内容详见附件一），本管理人、托管人已就资管合同拟变更事项达成一致（托管人回函详见附件二），现向本计划全体委托人征询意见。

资产委托人同意变更的，变更内容于2023年3月13日生效；资产委托人不同意变更的，本管理人将于2023年3月10日（9:00至15:00）增设临时开放日，合理保障投资者的退出权利。资产委托人未在管理人本次增设的临时开放日内申请退出本计划的，视为资产委托人同意本次资管合同变更。

本征询意见函、相关附件构成变更后合同的组成部分。

如有疑问，请拨打客服热线：95531

东海期货有限责任公司

2023年3月2日

附件一：《东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理合同》修订前后对照表

章节	变更前的条款	变更后的条款
全文	“商品及金融衍生品类”	“期货和衍生品类”
东海期货龙鼎3号集合资产管理计划风险揭示书	风险揭示 （二）一般风险揭示 7、投资标的风险 （4）金融衍生品投资风险（如有） a) 本计划若投资于在证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化商品及金融衍生品类资产，无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，对金融衍生品的投资无论在任何情况下均具有较高的风险。 	风险揭示 （二）一般风险揭示 7、投资标的风险 （4）金融衍生品投资风险（如有） a) 本计划若投资于在证券期货交易所等依法设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化期货和衍生品类资产，无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，对金融衍生品的投资无论在任何情况下均具有较高的风险。

一、前言	(一) 合同订立依据、目的和原则 1、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《期货交易管理条例》、《期货公司监督管理办法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》和其他法律、行政法规以及中国证监会、中国期货业协会(以下简称“期货业协会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“证券投资基金业协会”)等有关规定。 3、订立本资产管理合同的原则是平等自愿、诚实信用、公平、充分保护本合同各方当事人的合法	(一) 合同订立依据、目的和原则 1、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国民法典》《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《中华人民共和国期货和衍生品法》《期货交易管理条例》《期货公司监督管理办法》《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》和其他法律、行政法规以及中国证监会、中国期货业协会(以下简称“期货业协会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“证券投资基金业协会”)等有关规定。 3、订立本资产管理合同的原则是平等自愿、诚实信用、公平、充分保护本合同各方当事人的
-------------	---	---

	权益。 管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。	合法权益。 管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向证券投资基金业协会进行备案。
--	---	--

二、释义	32、代理销售机构：指取得基金销售资格并与管理人签署相关协议的代理销售机构。	32、代理销售机构：指取得 公开募集证券投资基金 销售资格并与管理人签署相关协议的机构。
四、当事人及权利义务	(二) 管理人 2、管理人的权利 (4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对委托资产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；— 3、管理人的义务 (21) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计； (23) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向证券投资基金业协会备案，并抄报证监会相关派出机构，按照约定向委托人提供与资产管理相关的其他业务报告； (三) 托管人 3、托管人的义务 (7) 监督管理人的投资运作，发	(二) 管理人 2、管理人的权利 (4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定的行为，对委托资产及其他当事人的利益造成重大损失的，应及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构； 3、管理人的义务 (21) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计； (23) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，并报送证监会相关派出机构，按照约定向委托人提供与资产管理相关的其他业务报告； (三) 托管人 3、托管人的义务 (7) 监督管理人的投资运作，

	现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会； （10）编制资产管理计划的年度托管报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构； （16）在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人； （17）法律法规、中国证监会规定及证券投资基金业协会规定的和合同约定的其他义务。	发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构； （10）编制资产管理计划的年度托管报告，报送中国证监会相关派出机构； （16）在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人； （17）不得利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资； （18）不得为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利； （19）法律法规、中国证监会规定及证券投资基金业协会规定的和合同约定的其他义务。
八、资产管理计划的参与、退出与转让	（十三）管理人的自有资金参与资产管理计划 管理人有权以自有资金参与本资管计划，与本资管计划其他客户份额享有同等权益，承担同等风	（十三）管理人的自有资金参与资产管理计划 管理人及其子公司有权以自有资金参与本资管计划，与本资管计划其他客户份额享有同等

险；若以自有资金参与，则参与本资管计划的自有资金，不得超过监管机构规定的对自有资金参与资管计划规定的上限，因本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标的，不视为管理人违反此项规定，但在客观条件允许的情况下，管理人应当在超标情况发生后的15个工作日内调整自有资金参与份额，以符合前述规定。管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。存续期内，管理人自有资金参与、退出本计划时，应当提前5个工作日通过管理人网站公告，告知委托人和托管人，并按照法律法规的规定备案。

.....

为应对本计划巨额赎回（如有），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，管理人以自有资金参与及其后续退出本计划可不受前款两款规定限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。自有资金参与资管计划的比例由管理人负责进行监控。

权益，承担同等风险；若以自有资金参与，则参与本资管计划的自有资金，不得超过监管机构对自有资金参与资管计划规定的上限，因本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标的，不视为管理人违反此项规定，但在客观条件允许的情况下，管理人应当在超标情况发生后的15个交易日内调整自有资金参与份额，以符合前述规定。

管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。存续期内，管理人自有资金参与、退出本计划的，应当提前5个工作日告知全体资产委托人和托管人，并取得其同意。

.....

为应对本计划巨额赎回（如有），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，管理人以自有资金参与及其后续退出本计划可不受前款两款规定限制，但应当及时告知投资者和托管人，并向相关派出机构报告。自有资金参与资管计划的比例由管

		理人负责进行监控。
十一、资产管理计划的投资	(二) 投资范围及比例 1、投资范围 (3) 在证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化商品及金融衍生品类资产（包括股指期货和国债期货，商品期货（含特定品种），商品及股指期货，股票期权，利率期权）； (三) 投资比例超限的处理方式及流程 资产管理计划存续期间，管理人应当严格按照法律、行政法规、中国证监会规定以及合同约定的投向和比例进行资产管理计划的投资运作。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。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证券期货经营机构之外的因素导致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的投资比例的，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十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事	(二) 投资范围及比例 1、投资范围 (3) 在证券期货交易所等依法设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化期货和衍生品类资产（包括股指期货和国债期货，商品期货（含特定品种），商品及股指期货，股票期权，利率期权）； (三) 投资比例超限的处理方式及流程 资产管理计划存续期间，管理人应当严格按照法律、行政法规、中国证监会规定以及合同约定的投向和比例进行资产管理计划的投资运作。资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得投资者同意，并按规定履行合同变更程序。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证券期货经营机构之外的因素导致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的投资比例的，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二十个交易

	由未能在规定时间内完成调整的，管理人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。 (七) 投资限制 1、本计划存续期内，计划总资产与净资产的比例不得超过 150%；计算计划的总资产按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产； (八) 投资禁止行为 7、不得投资《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产；	日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。 (七) 投资限制 1、本资产管理计划资产总值不得超过资产净值的 150%；如投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过本计划资产净值的 50%的，本计划资产总值不得超过资产净值的 120%。资产管理计划投资于国债、中央银行票据、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不受前述规定限制。 (八) 投资禁止行为 7、不得投资《管理办法》第三十八条第（五）项规定资产；
十四、利益冲突及关联交易	(三) 资产管理人运用本计划财产从事关联交易的，事后通过管理人以上披露方式之一及时、全面、客观的向资产委托人和资产托管人进行披露。资产管理人运用本计划财产从事重大关联交易的，应事先取得资产委托人同意，事后按照相关法律法规、证监会	(三) 资产管理人运用本计划财产从事关联交易的，事先取得资产委托人的同意，事后以本合同约定的披露方式及时告知资产委托人和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

	规定及本合同的约定，及时向投资者和托管人进行披露，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。	
--	--	--

十八、越权交易处理	(二) 对越权交易的处理程序 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为。 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管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合投资比例要求的，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十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，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。 (三) 托管人对管理人投资运作的监督 1、3) 在证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化商品及金融衍生品类资产（包括股指期货和国债期货，商品期货（含特定品种），商品及股指期货，股票期权，利率期权）；	(二) 对越权交易的处理程序 1、违反本合同投资范围和投资比例限制规定进行的投资交易行为。 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管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合投资比例要求的，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二十个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，应当及时向中国证监会相关派出机构报告。 (三) 托管人对管理人投资运作的监督 1、(1) 3) 在证券期货交易所等依法设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化期货和衍生品类资产（包括股指期货和国债期货，商品期货（含特定品种），商品及股指期货，股票期权，利率期权）；
二十、资产管理业务的费用与税收	(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式	(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

	4、管理人的业绩报酬	4、管理人的业绩报酬（计入管理费）
二十三、风险揭示	（二）一般风险揭示 7、投资标的风险 （4）金融衍生品投资风险（如有） a）本计划若投资于在证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化商品及金融衍生品类资产，无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，对金融衍生品的投资无论在任何情况下均具有较高的风险。 	（二）一般风险揭示 7、投资标的风险 （4）金融衍生品投资风险（如有） a）本计划若投资于在证券期货交易所等依法设立的交易场所集中交易清算的期货及期权合约等标准化期货和衍生品类资产，无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，对金融衍生品的投资无论在任何情况下均具有较高的风险。
二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算	（一）资产管理合同的变更 6、本合同发生变更的，资产管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。 （三）资产管理合同终止 1、资产管理合同终止的情形包括下列事项 管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券投资	（一）资产管理合同的变更 6、本合同发生变更的，资产管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向证券投资基金业协会备案。 （三）资产管理合同终止 1、资产管理合同终止的情形包括下列事项 管理人应当自资产管理计划终止之日起五个工作日内报证券

基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第6款约定的情形除外。 （四）资产管理计划财产的清算 2、清算程序 （7）将清算报告报证券投资基金业协会、中期协或中国证监会备案并披露给资产委托人。 5、延期清算 若本计划在终止之日有未能流通变现的部分投资标的，清算小组将本计划届时已完成变现的部分资产按照本合同的约定进行清算。对于其余未能变现的资产，管理人有义务继续变现，变现完成后，管理人进行二次清算并分配。管理人应制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并按照清算报告的披露程序向资产委托人进行披露。资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应按照相关约定及时向中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告。二次清算流程同一次清算。在清算期间不提取管理费、托管费、运营服务费等相关费用。该部分计划财产	投资基金业协会备案，前述第6款约定的情形除外。 （四）资产管理计划财产的清算 2、清算程序 （7）将清算报告报证券投资基金业协会并披露给资产委托人。 5、延期清算 若本计划在终止之日有未能流通变现的部分投资标的，清算小组将本计划届时已完成变现的部分资产按照本合同的约定进行清算。对于其余未能变现的资产，管理人有义务继续变现，变现完成后，管理人进行二次清算并分配。管理人应制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并按照清算报告的披露程序向资产委托人进行披露。资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应按照相关约定及时向中国证监会派出机构报告。二次清算流程同一次清算。在清算期间不提取管理费、托管费、运营服务费等相关费用。
---	---

变现并扣除相关费用后按资产委托人持有的计划份额比例进行分配，同时可收取业绩报酬（如本合同已明确约定业绩报酬的收取）。 本计划持有多个未能按期变现投资标的的，管理人可按本条款约定进行多次变现及清算。 6、资产管理计划财产清算报告的告知安排 资产管理人编制清算报告交资产托管人复核后，资产管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。 资产管理人应在清算结束后5个工作日内向委托人披露清算结果。	该部分计划财产变现并扣除相关费用后按资产委托人持有的计划份额比例进行分配，同时可收取业绩报酬（如本合同已明确约定业绩报酬的收取）。 本计划持有多个未能按期变现投资标的的，管理人可按本条款约定进行多次变现及清算。 6、资产管理计划财产清算报告的告知安排 资产管理人编制清算报告交资产托管人复核后，资产管理人应当在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算结果报证券投资基金业协会备案。 资产管理人应在清算结束后5个工作日内向委托人披露清算结果。
--	--

附件二：

《关于东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理合同变更的

征询意见函及临时开放期设置公告》的回函

东海期货有限责任公司：

贵司《关于东海期货龙鼎3号集合资产管理计划资产管理合同变更的征询意见函及临时开放期设置公告》我司已知悉。经研究，我司对本次变更无异议。请贵司依据法律法规履行相关的报备和信息披露义务。

特此函复。

托管人：华泰证券股份有限公司

