

# 关于东海证券海阳3号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的东海证券海阳3号集合资产管理计划投资者：

2023年1月13日，中国证券监督管理委员会公布了修订后的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（中国证券监督管理委员会令第203号修订）和《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2023〕2号），为了更好地服务广大投资者，我司作为东海证券海阳3号集合资产管理计划的管理人，拟变更《东海证券海阳3号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）、《东海证券海阳3号集合资产管理计划说明书》（以下简称“说明书”）、《东海证券海阳3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》“二十三、集合计划合同的变更、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）“二、释义”中，“《管理办法》：指2018年10月22日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第151号]）；

《运作规定》：指2018年10月22日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31号）；”

变更为：“《管理办法》：指2023年1月13日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第203号]）；

《运作规定》：指2023年1月13日中国证监会发布并施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2023]2号）；”

（二）“四、当事人及权利义务”中，“（六）管理人的义务”中，“17、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；”变更为：“17、保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户；

18、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；”

(三) “五、集合资产管理计划的基本情况”中,“(五)集合计划的投资目标、主要投资方向、投资比例”中,“3、资产配置比例”中,“因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合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15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,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。每个开放期的前、后15个交易日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。”

变更为:

“因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素导致集合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20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,管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。每个开放期的前、后20个交易日以及开放期期间不受前述投资组合比例的限制。”

(四) “八、集合计划存续期的参与、退出和转让”中,“(二十二)管理人自有资金参与集合计划”中,“1、自有资金参与的条件、方式

管理人在募集期和存续期均可以以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,应符合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。

#### 2、自有资金参与的金额和比例

在集合计划存续期内,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16%。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过集合计划总份额的50%。

#### 3、自有资金的责任承担方式与收益分配

管理人自有资金所持的集合计划份额与投资者持有的集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。

#### 4、自有资金的退出

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个工作日以网站公告的形式告知托管人和集合计划持有人。

集合计划存续期间，管理人有权部分或全部退出自有资金持有份额。

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、法规规定比例的，管理人在合理期限内安排自有资金的退出，可不受上述限制。

5、为应对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本合同约定的前提下**，管理人参与的自有资金参与、退出可不受**第 2 条、第 4 条**的限制，但需事后及时告知投资者和托管人，并向相关中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。”

变更为：

#### “1、自有资金参与的金额和比例

在集合计划存续期内，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 16%。管理人及其**子公司**以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过集合计划总份额的 50%。

#### 2、自有资金的责任承担方式与收益分配

管理人自有资金所持的集合计划份额与投资者持有的集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。管理人自有资金不对投资者的本金和收益进行赔付。

#### 3、自有资金的参与、退出

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 个工作日以网站公告的形式告知**全体投资者和托管人**。投资者应在公告指定的日期内按指定的形式回复意见，逾期未做答复的，视为投资者同意自有资金参与、退出事项。投资者向管理人答复不同意自有资金参与、退出事项的，则**管理人不得以自有资金参与、退出本集合计划**。

集合计划存续期间，管理人有权部分或全部退出自有资金持有份额。

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、法规规定比例的，**管理人按照中国证监会规定及时安排自有资金的退出**，可不受上述限制。

4、为应对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本合同约定的前提下**，管理人参与的自有资金参与、退出可不受**本条第 1 款、第 3 款**的限制，但需事后及时告知投资者和托管人，并向相关中国证监会派出机构报告。”

（五）“十一、集合计划的投资”中，“（二）投资范围及比例”中，“2、资产配置比例”中，新增“资产管理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其净资产 50%的，该计划的总资产不得超过其净资产的 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。”

（六）“十一、集合计划的投资”中，“（三）投资比例超限的处理方式及流程”中，“因证券期货市场波动、证券发行人合并、本集合计划规模变动等管理人之外的因素导致本集合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 15 个工作日内调整至符合要求。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和证券投资基金业协会报告。”

变更为：

“因证券期货市场波动、证券发行人合并、本集合计划规模变动等管理人之外的因素导致本集合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 20 个工作日内调整至符合要求。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）“十一、集合计划的投资”中，“（八）投资限制”中，新增“10、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，违规为管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

11、为管理人、托管人、投资顾问（如有）及相关从业人员或他人违规持有金融机构股权提供便利；”

（八）“十一、集合计划的投资”中，“（十）投资的资产组合的流动性”中，“7 个工作日可变现资产包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。”变更为“7 个工作日可变现资产包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及标准化期权合约和同业存单，7

个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。”

（九）“十二、利益冲突及关联交易”中，“（一）利益冲突情形”中，“1、管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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，或者从事其他重大关联交易；”变更为“1、管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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，或者从事其他关联交易；”

（十）“十二、利益冲突及关联交易”中，“（二）利益冲突的处理”中，“1、若管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、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，或者从事其他重大关联交易。管理人应在交易完成后10个工作日内告知投资者和托管人，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构及自律组织报告。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。

2、若管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划；管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构及自律组织报告。

### 3、管理人以自有资金参与本集合计划。

管理人在募集期和存续期均可以以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，应符合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。管理人不得将集合计划资产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。

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前文已经明确列明的关联交易情形，管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得投资者的授权，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。对于集合计划在投资运作过程中从事除前述列明情形以外的其他关联交易的，事后应当及时、全面、客观的向投资者和托

管人进行披露；若该等关联交易构成重大关联交易的，则应当事先取得投资者的同意，并应当提供充分证据证明未损害投资者利益。”

变更为：

“1、若管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人的控股股东、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，或者从事其他关联交易。管理人应在交易完成后 10 个工作日内告知投资者和托管人，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构报告。

2、若管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划；管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并按照现行法律法规、自律规则向监管机构报告。

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前文已经明确列明的关联交易情形，管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得投资者的授权，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。对于集合计划在投资运作过程中从事除前述列明情形以外的其他关联交易的，则应当事先取得投资者的同意，并应当提供充分证据证明未损害投资者利益。

**3、管理人以自有资金参与本集合计划。**

管理人在募集期和存续期均可以以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，应符合法律法规、监管规定和本合同的相关规定。管理人不得将集合计划资产直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。”

（十一）“十六、越权交易”中，“（二）越权交易的处理程序”中，“3、因证券期货市场波动、证券发行人合并、本集合计划规模变动等管理人之外的因素导致本集合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 15 个工作日内调整至符合要求。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和证券投资基金业协会报告。”变更为“3、因证券期货市场波动、证券发行人合并、本集合计划规模变动等管理人之外的因素导致本集合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 20 个交易日内调整至符合要求。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。”

（十二）“十七、集合计划的估值和会计核算”中，“（九）估值错误的处理”中，“5、若被诉人为托管人，管理人应当为托管人提供估值方法合理性的说明和支持。若托管人因此承担赔偿责任，应由管理人先行对投资者或者集合计划支付赔偿金，在管理人赔偿后，管理人有权按上述条款就托管人承担责任的部分向托管人追索；若被诉人为管理人，托管人应当为管理人提供必要的支持。若管理人因此承担赔偿责任，管理人有权按上述条款就托管人承担责任的部分向托管人追索。”变更为“5、若被诉人为托管人，管理人应当为托管人提供估值方法合理性的说明和支持。若被诉人为管理人，托管人应当为管理人提供必要的支持。”

（十三）“二十一、集合计划的信息披露”中，“（四）重大事项临时报告 9、以本集合计划资产从事重大关联交易；”变更为“（四）重大事项临时报告 9、以本集合计划资产从事关联交易；”

（十四）“二十二、风险揭示”中，“4、本集合计划委托募集所涉风险 管理人可以委托在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为证券投资基金业协会会员的机构代销本集合计划，销售机构可能存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致投资者合法权益受损的风险。”变更为“4、本集合计划委托募集所涉风险 管理人可以委托在中国证监会注册取得公募基金销售业务资格并已成为证券投资基金业协会会员的机构代销本集合计划，销售机构可能存在违法违规地公开宣传、虚假宣传、以保本保收益引诱投资者购买、未能履行投资者适当性审查工作等行为导致投资者合法权益受损的风险。”

（十五）“二十二、风险揭示”中，“7、参与网下新股申购的风险”中，“新股网下申购不保证能够参与及获配，客户需承担由于本计划未满足交易所或承销商的相关要求、未通过承销商的资料核查、新股报价无效、新股申购阶段被剔除、缴款不成功等风险；新股网下申购不保证收益，客户需承担市场波动的风险。”变更为“新股网下申购不保证能够参与及获配，本资管计划需承担由于本计划未满足交易所或承销商的相关要求、未通过承销商的资料核查、新股报价无

效、新股申购阶段被剔除、缴款不成功等风险；新股网下申购不保证收益，**本资管计划**需承担市场波动的风险。”

(十六) “二十二、风险揭示”中，“9、其他风险

(1) 关联交易的风险

管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、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。事后管理人将及时以公告的方式向托管人和投资者披露，涉及**重大**关联交易的需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。

管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及管理人关联方设立的资产管理产品，事后管理人将以临时公告的方式进行披露。”

变更为：

“9、其他风险

(1) 关联交易的风险

管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、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，**或者从事其他关联交易；管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方可以参与管理人设立的集合计划。**事后管理人将及时以公告的方式向托管人和投资者披露，涉及关联交易的需向中国证监会相关派出机构报告。”

(十七) “二十三、集合计划合同的变更、终止与财产清算”中，“(四)本集合计划终止的情形，包括但不限于下列事项：管理人应当自本集合计划终止之日起5个工作日内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，前述第7项约定的情形除外。”变更为“管理人应当自本集合计划终止之日起5个工作日内报证券投资基金业协会备案，前述第7项约定的情形除外。”

“(五)本集合计划在发生终止情形之日起五个工作日内开始组织清算本集合计划资产，以及财产清算的有关事项：”中，“6、清算的报告

清算结束后5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。清算结束后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。”变更为“6、清算的报告



管理人在资产管理计划清算结束后五个工作日内将清算报告报证券投资基金业协会。清算结束后 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。”

(十八) “二十五、争议的处理”中,“(一)向上海国际经济贸易仲裁委员会申请仲裁,以该会当时有效的仲裁规则为准,仲裁裁决是终局性的,并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担;”变更为“(一)向上海仲裁委员会申请仲裁,以该会当时有效的仲裁规则为准,仲裁裁决是终局性的,并对各方当事人具有约束力,仲裁费由败诉方承担;”

《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 2023 年 2 月 28 日至 2023 年 3 月 3 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,我司于 2023 年 2 月 27 日至 2023 年 3 月 3 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 2023 年 3 月 6 日生效。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