

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4月7日生效；资产委托人不同意变更的，本管理人将于4月6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



附件 1:《东海期货龙鼎 3 号集合资产管理计划资产管理合同》修订对照表

| 章节                | 原合同内容                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | 变更后合同内容                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 八、资产管理计划的参与、退出与转让 | <p>(十三) 管理人的自有资金参与资产管理计划</p> <p>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。</p> <p>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。</p> | <p>(十三) 管理人的自有资金参与资产管理计划</p> <p>(1) 证券期货经营机构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权益,承担同等风险。</p> <p>(2) 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本计划的持有期限不得少于 6 个月且同时受封闭运作周期限制(详见“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“(二)参与和退出的固定开放日和时间”下条款)。存续期内,证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、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,并书面征求其意见。委托人如未在载明的回复截止日按指定的形式回复意见或回复意见不明确的,视为同意本次自有资金参与或退出。管理人应当于征求意见期满后安排临时开放</p> |



|  |                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>为应对本计划巨额赎回（如有），解决流动性风险，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。</p> <p>本计划管理人按上述约定以自有资金参与本计划的份额，自有资金参与部分不能构成对委托人本金及收益的保证，也不能保证委托人份额本金不受损失。</p> | <p>日，对于明确答复不同意但未申请退出本计划的委托人，管理人将统一在征询期结束后的临时开放日做强制退出处理，或供不同意的委托人自行退出本计划（该退出不受本合同第八节“资产管理计划份额的参与、退出与转让”中关于本计划赎回的期限限制）。</p> <p>（3）证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与其自身或其子公司管理的单个集合资产管理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。本合同当事人一致同意，该条款由资产管理人自行监控。</p> <p>（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，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集合资产管理计划可不受前述第（2）项和第（3）项规定的限制，但应当及时告知投资者和托管人，</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                         | <p>并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>本计划管理人按上述约定以自有资金参与本计划的份额，自有资金参与部分不能构成对委托人本金及收益的保证，也不能保证委托人份额本金不受损失。</p>                                                                                                                                                                                      |
| <p><b>十四、利益冲突及关联交易</b></p> | <p>(一)本计划存在的或可能存在利益冲突的情形及处理方式：</p> <p>1、资产管理人将本计划财产投资于资产管理人、资产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发行的证券或者承销期内承销的证券，应当遵循资产委托人利益优先原则，防范利益冲突，保护资产委托人合法权益。</p> <p>2、除前款规定外，资产管理人不得将本计划直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为资产管理人、资产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。全部资产委托人均符合中国证监会规定的专业投资者且投资金额不低于1000万元，并且事先取得资产委托人同意的除外。</p> | <p>(一) 本计划存在的或可能存在利益冲突的情形及处理方式</p> <p>1、本资产管理计划可能投资于管理人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行或者在承销期内承销的证券；</p> <p>2、本资产管理计划可能投资于资产管理人及资产管理人关联方发行的其他金融产品；</p> <p>3、本资产管理计划可能投资于托管人或投资顾问（如有）及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司等关联方发行的证券或承销期内承销的证券、直接或间接管理的、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、或者从事其他重大关联交易的；</p> |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>3、在符合本计划投资范围及中国证监会监管要求的前提下，资产管理人可运用本计划财产买卖资产管理人、资产托管人及其关联方或者与前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。但需要遵循资产委托人利益优先的原则、防范利益冲突。</p> <p>（二）本计划存在利益冲突的信息披露</p> <p>1、披露方式</p> <p>资产管理人应当通过邮递、传真、电话、短信、电子邮件、官网公告、微信、QQ、定期报告等本合同约定的方式之一向资产委托人、资产托管人进行信息披露。</p> <p>2、披露内容</p> <p>资产管理人应当将本计划当期涉及的关联交易内容、关联方、处理方式等进行披露。</p> <p>3、披露频率</p> <p>资产管理人应当至少每季度对关联交易的相关情况进行一次披露。</p> | <p>4、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，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险；</p> <p>5、其他依据法律法规、监管规定可能存在利益冲突的情形。</p> <p>（二）资管计划的关联方范围</p> <p>本计划的关联方范围包括但不限于以下主体：</p> <p>1、《企业会计准则第 36 号-关联方披露》规定的以下管理人的关联方，包括：管理人的主要股东（即持有期货公司 5%以上股权的股东）；管理人的受益所有人；管理人的子公司及子公司的全资子公司；管理人的董事、监事、高级管理人员及其配偶。</p> <p>2、视为关联方进行管理的自然人、法人及公司资产管理计划，包括：资管计划管理人；管理人的从业人员及其配偶；资管计划托管人及其关联方（以托管人向公司披露的关联方名单为准）；管理人管理的其他资管计划；管理人以自有资金投资的其他资产管理计划；</p> |
|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>(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。</p> <p>资产委托人签署本合同即表明其已经知晓并同意本计划可进行上述关联交易。资产委托人不得因本计划投资收益劣于管理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。</p> | <p>3、根据实质重于形式的原则认定的其他与管理人有特殊关系, 可能造成管理人对其利益倾斜或导致利益转移的自然人、法人或其他组织。</p> <p>4、其他依据《企业会计准则》或者相关法律法规认定为关联方的情形。</p> <p>(三) 利益冲突和关联交易处理方式</p> <p>委托人在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形、关联方等内容表示知悉, 其中, 涉及关联交易的, 按以下约定进行处理:</p> <p>委托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, 管理人无需就具体的一般关联交易分别取得委托人的个别授权, 但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与。管理人运用受托资产从事一般关联交易的, 应遵循客户利益优先的原则, 事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人应通过管理人网站或者本合同约定的联系方式, 在事项发生之日起五日内告知委托人和托管人。</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应事先采取逐笔征求意见取得委托人同意，并有充分证据证明未损害委托人利益，事后及时、全面、客观的向委托人和托管人进行披露。管理人应通过管理人网站或者本合同约定一种或多种联系方式，在事项发生之日起五日内告知委托人和托管人，并按照资产管理合同的约定在资产管理计划年度报告和季度报告中予以披露，同时向监管机构报备（如需）。</p> <p>其中一般关联交易与重大关联交易的认定标准如下：</p> <p>1. 本计划投资于关联方发行的证券或者承销期内承销的证券或资产管理计划；</p> <p>2. 根据实质重于形式原则认定的其他应当属于关联交易的情形。</p> <p>与关联方开展的单笔交易金额超过人民币 1500 万元且占该资产管理计划资产净值 15%以上（不含 15%）的，属于重大关联交易；其他交易属于一般关联交易。</p> <p>上述标准如因法律法规或监管机构要求发生变化或与法律法规、监管要求不一致的，以法律法规规定及监管机构</p> |
|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>的最新要求为准。</p> <p>（四）资管计划的关联交易审批与内控机制</p> <p>本资产管理计划从事一般关联交易的，由资管业务部门发起、提交合规风控人员审核；从事重大关联交易，由管理人的资产管理部门就该重大关联交易向资产管理业务投资决策委员会（以下简称投决会）提交专项报告（包括但不限于：关联方基本情况、交易类型、交易金额及标的、交易价格及定价方式、交易收益与损失、委托人对关联交易的初步意向等），投决会在评审关联交易事项时，应当对关联交易的必要性、公平性、真实意图、是否存在对其他委托人的不利影响等进行审查和判断，特别关注交易的定价政策及定价依据，包括估值的公允性、交易标的成交价格与账面值或评估值之间的关系等，关联交易需经投决会全体成员表决通过。</p> <p>特别提示：资产委托人知晓并同意本计划的投资对象可能包括资产管理人管理的货币市场基金或者与资产管理人、资产托管人、资产委托人或其关联方进行交易。本计划销售</p> |
|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                      |
|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>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。虽然管理人积极遵循委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定操作、积极防范利益冲突，但依然不能避免未来可能发生的关联交易风险，进而影响收益甚至发生亏损。投资者签署本合同即代表明确知悉且自愿承担该类风险。提醒投资者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。</p> |
|--|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

资产托管业务专用章  
2023年3月29日