

关于东海证券海汇添益 FOF1 号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的投资者：

鉴于中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于 2023 年 1 月 12 日发布了《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）、《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）（以下合称“私募资管新规”），为确保管理人旗下的东海证券海汇添益 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）在存续期合规运作，管理人拟变更《东海证券海汇添益 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）、《东海证券海汇添益 FOF1 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“说明书”）、《东海证券海汇添益 FOF1 号集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称“风险揭示书”）的关联交易和风险揭示的部分条款。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”对合同的变更程序作出了明确约定。

二、合同变更内容

（一）第十四部分 利益冲突及关联交易

“一、在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，本产品可能投资于投资者、管理人、托管人及其关联方所发行、管理、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，但投资者或托管人各自就其自身或其关联方另有限制并书面通知管理人的除外。本计划还存在的或可能存在利益冲突情况，包括但不限于：管理人可以以自有资金参与和退出本计划；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；法律、行政法规规定或者中国证监会认定的其他情形。

二、资产管理计划从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定，按照重要性原则进行分层管理。

一般关联交易：资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事一般关联交易，资产管理人无需就签署具体关联交易再行分别取得资产委托人的授权，

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，事后管理人将定期统一披露及报告。

重大关联交易：管理人事前以书面方式向投资者发送征询意见，逐笔取得投资者同意，重大关联交易事项发生后 5 个工作日内告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

本计划关联方包括管理人、托管人及其控股股东、实际控制人及与其存在重大利害关系的机构，与本计划存在重大利益关系的其他关联方等。

重大关联交易包括本计划资产投资于管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或其他重大关联交易等情形，除重大关联交易以外的关联交易属于一般关联交易。若证监会、基金业协会等监管机构制定的规则有明确规定的，参照外规进行管理。

证券期货经营机构私募资产管理业务相关法律法规、中国证券投资基金业协会自律规范对关联交易另有规定的，从其规定，届时以管理人公告为准。无需按第二十五节进行合同变更。

三、本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率

（一）管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，公平对待全体投资者，实现在公司、股东和员工个人的利益与投资者的利益发生冲突时，优先保障投资者的利益，不同投资者之间的利益发生冲突时，公平对待不同投资者。

（二）公司按照内外部管控要求识别、报告、评估、解决利益冲突事项，包括采取相应的措施防止产生利益冲突；采取相应措施以确保公司、公司关联方以及员工不得因自己的利益导致投资者损失或使投资者处于不利地位；对于法律法规、监管规定允许的冲突事项，公司以符合法律法规、监管规定或相关合同约定的方式向投资者披露、揭示或者报告。

（三）针对管理人自有资金参与和退出本计划的情形，参见本合同第八条第（十四）款进行处理。

（四）若管理人的董事、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，管理人应向投资者充分披露。”

变更为：

“一、利益冲突情形

本集合资产管理计划存在的或可能存在利益冲突情形，包括但不限于：

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，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行银行间市场的交易，向前述机构支付报酬，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项；

2、管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与和退出本计划；

3、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；

4、法律、行政法规规定或者中国证监会认定的其他情形。

二、利益冲突的处理

1、全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将本合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署本合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以本合同为依据进行上述关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。

对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利，对于书面答复管理人不同意但未退出的投资者，管理人对该部分投资者在关联交易发生之日办理强制退出，投资者未回复意见且未退出的，视为投资者同意，事后单独进行信息披露和报告。

本集合资产管理计划的关联交易的范围、关联方范围及披露方式、一般关联交易与重大关联交易的区分标准、管理人对关联方交易的内部管控机制以及关联交易的处理方式等内容如下：

（1）关联交易的范围

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，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行银行间市场的交易，向前述机构支付报酬，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项。

（2）关联方范围及披露方式

本集合资产管理计划的关联方包括管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人及与其存在重大利害关系的机构，与本计划存在重大利益关系的其他关联方

等。

托管人的关联方认定将以托管人提供的关联方名单为依据，并由管理人及托管人共同认定为准，若托管人未及时提供或更新其关联方名单，管理人将根据托管人公布的年度报告或其他定期报告的披露信息进行控制。管理人的关联方名单以年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准，将于管理人网站披露 (<https://www.longone.com.cn/>)，托管人的关联方名单以托管人公布的年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准 (<https://www.cib.com.cn/cn/index.html#>)，投资者可按上述路径进行查阅。

(3) 一般关联交易、重大关联交易的区分标准

资产管理计划从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定，按照重要性原则进行分层管理。

重大关联交易包括本计划资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；单笔交易金额超过资产管理产品资产净值 10%的关联交易或其他重大关联交易等情形，除重大关联交易以外的关联交易属于一般关联交易。

(4) 管理人对关联方交易的内部管控机制

管理人制定并实施了《东海证券股份有限公司资产管理业务关联交易管理办法》，规定关联交易的审议程序、定价、信息披露等。管理人按资产管理合同约定及管理人制度履行对关联方交易的审批、披露、报告等程序。

1) 禁止以下关联交易

A、利用资产管理产品资产向管理人、托管人出资；

B、利用私募资产管理产品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、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。全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元，并且事先取得投资者同意的资产管理计划除外；

C、利用资产管理产品资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向管理人注资等；

D、利用资产管理产品资产从事法律法规、监管机构及产品合同禁止的其他关联交易。

2) 在投资决策方面

资产管理产品的关联交易根据交易金额大小和交易性质不同分别履行股东大会、董事会或其授权机构审批。

3) 在交易定价机制方面

资产管理产品关联交易应当遵循产品份额持有人利益优先原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，按照市场公平合理价格执行，保护产品份额持有人合法权益。

管理人有权调整上述内容并在调整后公告披露调整情况。若后续中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织对私募资产管理产品关联交易另有规定的，管理人届时将另行公告，并按届时有效的规定执行。投资者应当及时查阅上述公告信息。

2、针对管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与和退出本计划的情形，参见本合同第八条第（十四）款进行处理。

3、若管理人的董事、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，管理人应向投资者充分披露，对该计划账户进行监控，并向中国证监会相关派出机构报告。

三、管理人根据法律法规、监管规定、本合同约定履行关联交易的信息披露义务。”

（二）第二十四部分 风险揭示

“10、关联交易的风险

资产管理计划从事关联交易的，应当遵守法律、行政法规、中国证监会的规定，按照重要性原则进行分层管理。一般关联交易：资产委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意资产管理人从事一般关联交易，资产管理人无需就签署具体关联交易再行分别取得资产委托人的授权，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，事后管理人将定期统一披露及报告。重大关联交易：应采取逐笔征求意见或公告确认等方式取得投资者同意，事后应单独披露、报告。

本计划可能因上述关联交易造成损失。”

变更为：

“10、关联交易的风险

（1）关联交易的特别风险提示

管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据私募资产管理产品资产管理合同的约定，在实际投资操作中可能会参与投资于管理人、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，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行银行间市场的交易，向前述机构支付报酬，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项。

尽管管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险，管理人也无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响投资者的利益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。

（2）一般关联交易特定风险揭示

全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将本合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署本合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以本合同为依据进行上述关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。

根据本合同的约定，管理人以本计划资产从事一般关联交易的，无需就具体关联交易再行分别、逐笔取得投资者的同意，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该等关联交易，管理人仅需要事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告，故存在投资者在一般关联交易完成前未充分知晓具体交易情况的风险。

（3）重大关联交易特定风险揭示

对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利，对于书面答复管理人不同意但未退出的投资者，管理人对该部分投资者在关联交易发生之日办理强制退出，投资者未回复意见且未退出的，视为投资者同意，事后单独进行信息披露和报告。

本集合计划进行重大关联交易时，管理人应遵守法律法规、监管规定、行业自律组织要求、合同约定及管理人相关内控制度，保护投资者的合法权益，但投资者仍有可能面临重大关联交易存在相关投资风险等情况，导致投资者利益受到损害的风险。

投资者应充分知悉本合同条款关于重大关联交易的各项机制安排和所涉风险，关注管理人相关公告并及时做出相应安排。”

《说明书》、《风险揭示书》根据上述内容做相应变更。

三、合同变更的公告与生效

为充分保障委托人的知情权，我司将于 2023 年【6】月【27】日至 2023 年【7】月【3】日在管理人网站（www.longone.com.cn）公告本次合同变更的详细内容。

为保障不同意本次合同变更的委托人退出的权利，我司于 2023 年【7】月【4】日至 2023 年【7】月【4】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。

不同意变更的投资者有权在特别开放期（2023 年【7】月【4】日至 2023 年【7】月【4】日）申请退出。委托人未在特别开放期申请退出的，视为委托人同意本合同变更，管理人不再另行通知。

合同变更内容将于特别开放期结束后首个工作日即 2022 年【7】月【5】日生效，具体时间见管理人网站。本合同变更生效之日起，变更公告的内容即成为本合同组成部分。合同变更后，委托人、管理人和托管人都应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

特此公告。

东海证券股份有限公司

2023 年 6 月 26 日