

## 关于东海证券海融 6 号集合资产管理计划资产管理合同等法律文件变更的征询意见函

尊敬的东海证券海融 6 号集合资产管理计划投资者：

为了更好地服务广大投资者，我司作为东海证券海融 6 号集合资产管理计划的管理人，拟变更《东海证券海融 6 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 6 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 6 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》第二十五条“集合计划合同的变更、终止与财产清算”第一款“一、资产管理合同的变更”中第 2 项对本次变更情形下的合同变更程序做出了明确约定。

### 二、《合同》变更内容

章节	原合同条款	变更后合同条款
全文	资产委托人、委托人	投资者
全文	委托资产、委托财产	受托资产、受托财产
第一部分	（一）订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）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	（一）订立本资产管理合同（以下简称“本合同”）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

<p><b>前言</b></p>	<p>简称《基金法》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(银发[2018]106号,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》(<del>证监会令[第151号]</del>,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》(<del>证监会公告(2018)31号</del>)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》、《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引(试行)》、《中国银行业协会商业银行资产托管业务指引》及其他有关法律法规的规定。</p>	<p>简称《基金法》)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(银发[2018]106号,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》、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》、《资产管理计划风险揭示书内容与格式指引》、《中国银行业协会商业银行资产托管业务指引》及其他有关法律法规的规定。</p>
<p><b>第二部分</b> <b>释义</b></p>	<p>8、《管理办法》:指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《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))。</p> <p>9、《运作规定》:指中国证监会于2018年10月22日发布并施行的《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)。</p>	<p>8、《管理办法》:指中国证监会于2023年1月13日发布并施行的《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))。</p> <p>9、《运作规定》:指中国证监会于2023年1月13日发布并施行的《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)。</p>
<p><b>第四部分</b> <b>当事人及</b> <b>权利义务</b></p>	<p>一、合同当事人</p> <p>(二)管理人</p> <p>法定代表人:钱俊文</p> <p>联系人:王恩君</p>	<p>一、合同当事人</p> <p>(二)管理人</p> <p>法定代表人:王文科</p> <p>联系人:陈秋伊</p>

<p>六、管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(十七) 聘请具有<u>证券相关业务资格</u>的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>八、托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(二) <del>除依据法律法规规定和本合同约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管本计划财产；</del></p> <p>(九) 编制私募资产管理业务托管年度报告，并向<u>证券投资基金业协会备案(如需)</u>，抄报中国证监会相关派出机构(如需)；</p> <p>(十一) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；</p> <p>(十三) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的规定或本合同约定的，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</p>	<p>六、管理人的义务包括但不限于：</p> <p>(十七) <u>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；</u></p> <p>(十八) 聘请符合《<u>证券法</u>》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(二十六) 管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务；</p> <p>八、托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(二) 不得为托管人<u>以及任何第三人</u>输送利益，不得委托第三人托管<u>资产管理计划</u>财产；</p> <p>(九) 编制私募资产管理业务托管年度报告，<u>报送</u>中国证监会相关派出机构；</p> <p>(十一) 保守商业秘密，<u>不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；</u></p> <p>(十三) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的规定或本合同约定的，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；</p>
---	--

	<p>投资基金业协会 (如需):</p>	<p><u>(十四) 定期向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方, 以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息;</u></p>
<p><b>第五部分 本计划的基本情况</b></p>	<p>(三) 本计划的运作方式: 本集合计划为开放式运作。</p> <p>2、开放期: 本集合计划每周二 (如遇非工作日, 顺延至下一工作日) 为参与开放期, 每月 20 日为退出开放期 (如遇非工作日, 顺延至下一工作日), 开放期内可以办理参与、退出业务, 管理人无需另行公告。</p> <p>4、临时开放期: 若因本计划管理人决定展期、变更合同的, 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, 临时开放期内投资者仅可退出本计划, 不可参与本计划份额。</p> <p>(七) 本计划的投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债 (包括二级资本债、资本补充债、混合资本债等)、政策性金融债、企业债、公司债 (含非公开发行的公司债)、可转换债券、<del>可交换债券</del>、短期融资券、超级短期融资券、中期票</p>	<p>(三) 本计划的运作方式: 本集合计划为开放式运作。</p> <p>2、开放期: 本集合计划每周二及每月 20 日为参与开放期 (如遇非工作日, 顺延至下一工作日), <u>可以办理参与业务;</u> 每月 20 日为退出开放期 (如遇非工作日, 顺延至下一工作日), 可以办理退出业务。管理人无需另行公告。</p> <p>4、临时开放期: 若因本计划管理人决定展期、变更合同的, 管理人将通过网站公告及<u>发送征询意见函</u>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, 临时开放期内投资者仅可退出本计划, 不可参与本计划份额。</p> <p>(七) 本计划的投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债 (包括二级资本债、资本补充债、混合资本债等)、政策性金融债、企业债、公司债 (含非公开发行的公司债)、可转换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证</p>

据、资产支持证券、资产支持票据、非金融企业债务融资工具、项目收益债、次级债、~~债券正回购、债券逆回购~~、公募债券型基金、~~经证监会认可的比照公募基金管理的债券型资产管理产品、~~证券公司及其子公司的资产管理计划、基金公司及其子公司的资产管理计划、保险公司及其子公司的资产管理计划、~~银行理财计划~~、货币市场基金、银行存款、协议存款、~~结构性存款~~、同业存款、同业存单、通知存款、~~大额可转让存单~~、现金、~~国债期货~~。

(八) 本计划的投资比例

~~(1) 固定收益类资产：按照穿透合并计算的市值合计不低于本集合计划总资产的 80%。所投资标的产品持仓的各类资产市值以相应产品的信息披露义务人（投资标的产品的管理人、管理人委托的第三方服务机构或托管人，下同）提供的最近定期报告为准。~~

~~(2) 国债期货：持仓合约价值合计不超过总资产的 10%。~~

本集合计划建仓期为 6 个月。除变现期外，在建仓期结束后，本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。资产管理计划改变投向和比例的，将事先取得投资者的同意，并按规定履行合同变更流程。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

券、资产支持票据、非金融企业债务融资工具、项目收益债、债券逆回购、公募债券型基金、货币市场基金、银行存款、协议存款、同业存款、同业存单、通知存款、现金。

本计划可参与债券正回购。

(八) 本计划的投资比例

固定收益类资产：按照穿透合并计算的市值合计不低于本集合计划总资产的 80%。所投资标的产品持仓的各类资产市值以相应产品的信息披露义务人（投资标的产品的管理人、管理人委托的第三方服务机构或托管人，下同）提供的最近定期报告为准。

本集合计划建仓期为 6 个月。除变现期外，在建仓期结束后，本资产管理计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。资产管理计划改变投向和比例的，将事先取得投资者的同意，并按规定履行合同变更流程。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（如需）。

（九）本计划的产品风险等级

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R2（中低风险），仅适合向合格投资者中的专业投资者和风险承受能力评估结果为 C2、C3、C4、C5 的普通投资者推广，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

管理人将定期或不定期对本计划的风险等级重新评估。经与托管人书面协商一致后，可根据重新评估的情况对风险等级进行调整。新的风险等级应在管理人网站公告，公告满 5 个工作日后生效。若调低风险等级，全体投资者同意管理人不再按照本合同“第

管理人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（如需）。

（九）本计划的产品风险等级

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R2（中低风险），仅适合向合格投资者中的专业投资者和风险承受能力评估结果为 C2、C3、C4、C5 的普通投资者推广，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

	<p><del>二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定进行合同变更事宜。若调高风险等级，管理人应当按照本合同“第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定进行合同变更事宜。</del></p>	
<p><b>第六部分</b> <b>本计划的</b> <b>募集</b></p>	<p>一、本计划的募集对象</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于 30 万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p>八、本计划的最低认购金额和支付方式</p> <p>首次认购的最低金额为人民币 30 万元，追加认购的最低金额为人民币 1000 元的整数倍。管理人可公告调整本集合计划首次参与和追加参与时的最低参与金额。</p>	<p>一、本计划的募集对象</p> <p>合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于 30 万元且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：</p> <p><u>（四）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</u></p> <p>八、本计划的最低认购金额和支付方式</p> <p>首次认购的最低金额为人民币 30 万元，<u>超过最低认购金额的部分设金额级差为 1000 元的整数倍。</u>追加认购的最低金额为人民币 1000 元的整数倍。管理人可公告调整本集合计划首次参与和追加参与时的最低参与金额。</p>
<p><b>第八部分</b> <b>本计划的</b></p>	<p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>1、开放期：本集合计划<u>每周二</u>（如遇非工作日，顺延至下一工作日）为参与开放期，每月 20 日为退出开放期（如遇非工作日，顺</p>	<p>二、参与和退出的开放日和时间</p> <p>1、开放期：本集合计划<u>每周二及每月 20 日</u>为参与开放期（如遇<u>非工作日，顺延至下一工作日</u>），<u>可以办理参与业务；</u>每月 20 日</p>

<p><b>参与、退出与转让</b></p>	<p>延至下一工作日), 开放期内可以办理参与、退出业务, 管理人无需另行公告。</p> <p>四、参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>(六) 参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式, 若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功, 为无效申请, 已交付的委托款项将退回投资者指定资金账户。投资者退出申请确认后, 管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构, 再由注册登记机构划往各销售机构, 并通过销售机构划往申请退出投资者的指定资金账户, 退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。如集合计划出现《集合资产管理合同》所述暂停估值的情形时, 管理人与托管人协商后, 可以将划拨日期相应顺延。</p> <p>五、参与和退出的金额限制</p> <p>投资者在本计划存续期开放日购买本计划份额的, 投资者应符合</p>	<p>为退出开放期 (如遇非工作日, 顺延至下一工作日), 可以办理退出业务。管理人无需另行公告。</p> <p>四、参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>(六) 参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式, 若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功, 为无效申请, 已交付的<u>受托</u>款项将退回投资者指定资金账户。投资者退出申请确认后, 管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构, 再由注册登记机构划往各销售机构, 并通过销售机构划往申请退出投资者的指定资金账户, 退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出。如集合计划出现《集合资产管理合同》所述暂停估值的情形时, 管理人与托管人协商后, 可以将划拨日期相应顺延。</p> <p><u>(九) 发生全部退出时的特殊处理: 如本集合计划全体投资者申请退出所持有的计划份额, 致使所有计划份额被退出, 且无在途参与申请的, 管理人应当拒绝接受该等退出申请, 按照合同约定终止运作并进行清算。</u></p> <p>五、参与和退出的金额限制</p> <p>投资者在本计划存续期开放日购买本计划份额的, 投资者应符合</p>
------------------------	--	---



合格投资者标准，且参与金额应不低于 30 万元人民币，已持有本计划份额的投资者在本计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。现有投资者在本计划存续期开放期追加购买本计划份额的，单笔追加金额不低于 1000 元的整数倍。

#### 八、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。~~

#### 九、巨额退出和连续巨额退出

##### （二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付

2、部分退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出的总份额不低于当日参与申请总份额的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请。投资者选择延期退出的，管理人对当日未办理的退出申请份额，延迟至下一工作日办理，转入

合格投资者标准，且参与金额应不低于 30 万元人民币，超过部分设置金额级差为 1000 元的整数倍。已持有本计划份额的投资者在本计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。现有投资者在本计划存续期开放期追加购买本计划份额的，单笔追加金额不低于 1000 元的整数倍。

#### 八、大额退出的通知

任一投资者在申请退出金额超过人民币 5000 万元的，应当提前 1 个工作日书面或邮件通知管理人。

#### 九、巨额退出和连续巨额退出

##### （二）退出顺序、退出价格确定和退出款项支付

2、部分退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为因支付投资者的退出申请而进行的财产变现可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出的总份额不低于前一交易日的计划总份额【10%】的前提下，可对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理并接受的退出申请。投资者选择延期退出的，管理人对当日未办理的退出申请份额，延迟至下一工作

下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。因延期退出而导致投资者的份额净值较申请退出日增加或减少的，管理人不承担任何责任。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。

#### 十四、管理人以自有资金参与本计划

##### ~~（一）自有资金参与的条件~~

~~管理人以自有资金参与本计划，应符合法律、行政法规和中国证监会的规定，并按《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得公司相关授权程序的批准。~~

##### ~~（二）自有资金的参与方式~~

~~管理人在推广期和存续期内可以以自有资金参与本计划。~~

##### ~~（三）自有资金参与的份额比例~~

~~自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的16%，具体参与金额以管理人公告为准。管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计不得超过计划总份额的50%。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约定及时调整达标。~~

日办理，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权并以该工作日的计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。因延期退出而导致投资者的份额净值较申请退出日增加或减少的，管理人不承担任何责任。投资者在申请退出时可选择当日未受理部分予以撤销，未进行选择的默认顺延。

#### 十四、管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与集合计划

管理人及其子公司（孙公司）可以以自有资金参与本集合计划的：

##### 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（孙公司）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40%。参与金额和比例以管理人公告为准。

##### 2、自有资金的责任承担方式与收益分配

管理人及其子公司（孙公司）自有资金所持的集合计划份额与其他投资者持有的集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。管理人及其子公司（孙公司）自有资金不对其他投资者的本金和收益进行赔付。

~~（四）自有资金的收益分配~~

~~管理人自有资金所持的集合资产管理计划份额，应当与投资者所持的同类份额享有同等收益分配的权利和义务。~~

~~（五）自有资金的责任承担~~

~~管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他投资者享有同等权利和义务。~~

~~（六）自有资金的退出~~

~~管理人自有资金参与本计划的持有期限不得少于6个月。自有资金参与、退出时，应提前5个工作日告知投资者和托管人。~~

~~为应对本计划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合同约定的前提下，管理人自有资金的参与、退出可不受前述比例和持有期限限制，但应及时告知投资者和托管人，并按相关规定向相关中国证监会派出机构及证券投资基金业协会报告。~~

~~（七）风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本集合计划规模变动情况，控制流动性风险。~~

3、自有资金的参与、退出

管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与集合计划的持有期限不得低于6个月，除管理人及其子公司（孙公司）以自有资金在募集期参与的情况外，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，提前5个工作日书面或邮件告知托管人，并取得其同意。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，可向管理人申请退出本集合计划。

管理人及其子公司（孙公司）以自有资金于募集期参与本集合计划无需另行征求投资者和托管人同意，但需事后及时告知投资者和托管人，投资者和托管人签署本合同即视为已经充分理解并同意上述条款。

集合计划存续期间，管理人及其子公司（孙公司）有权部分或全部退出自有资金持有份额，管理人应按照本条前述款项的要求进行公告。

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，管理人及其子公司（孙公司）按照

		<p><u>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，但需事后及时告知投资者和托管人。</u></p> <p><u>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，管理人及其子公司（孙公司）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。</u></p> <p><u>5、风险揭示：管理人及其子公司（孙公司）自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注计划规模变动情况，控制流动性风险。</u></p>
<p><b>第十一部分 资产管理计划的 投资</b></p>	<p>二、本资产管理计划的投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（包括二级资本债、资本补充债、混合资本债等）、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、可转换债券、<del>可交换债券</del>、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、资产支持票据、非金融企业债务融资工具、项目收益债、次级债、<del>债券正回购</del>、<del>债券逆回购</del>、公募债券型基</p>	<p>二、本资产管理计划的投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（包括二级资本债、资本补充债、混合资本债等）、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、可转换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、资产支持票据、非金融企业债务融资工具、项目收益债、债券逆回购、公募债券型基金、货币市场基金、银行存款、协议存</p>

<p>金、经证监会认可的比照公募基金管理的债券型资产管理产品、<del>证券公司及其子公司的资产管理计划、基金公司及其子公司的资产管理计划、保险公司及其子公司的资产管理计划、银行理财计划</del>、货币市场基金、银行存款、协议存款、结构性存款、<del>同业存款、同业存单、通知存款、大额可转让存单、现金、国债期货。</del></p> <p>2、投资比例</p> <p><del>(1) 固定收益类资产：按照穿透合并计算的市值合计不低于本集合计划总资产的 80%。所投资标的产品持仓的各类资产市值以相应产品的信息披露义务人（投资标的产品的管理人、管理人委托的第三方服务机构或托管人，下同）提供的最近定期报告为准。</del></p> <p><del>(2) 国债期货：持仓合约价值合计不超过总资产的 10%。</del></p> <p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>本计划建仓期为 6 个月。除变现期外，在建仓期结束后，本计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。如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资产管理人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，资产管理人应当在流动性受限资产可出</p>	<p>款、同业存款、同业存单、通知存款、现金。</p> <p><u>本计划可参与债券正回购。</u></p> <p>2、投资比例</p> <p>固定收益类资产：按照穿透合并计算的市值合计不低于本集合计划总资产的 80%。所投资标的产品持仓的各类资产市值以相应产品的信息披露义务人（投资标的产品的管理人、管理人委托的第三方服务机构或托管人，下同）提供的最近定期报告为准。</p> <p>三、投资比例超限的处理方式及流程</p> <p>本计划建仓期为 6 个月。除变现期外，在建仓期结束后，本计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。如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资产管理人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，资产管理人应当在流动性受限资产可出</p>
---	---

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，资产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（如需）。

#### 四、本资产管理计划的风险收益特征

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R2（中低风险），仅适合向合格投资者中的专业投资者和风险承受能力评估结果为 C2、C3、C4、C5 的普通投资者推广，具体以销售机构确认的风险等级为准。

管理人将定期或不定期对本计划的风险等级重新评估。经与托管人书面协商一致后，可根据重新评估的情况对风险等级进行调整。新的风险等级应在管理人网站公告，公告满 5 个工作日后生效。若调低风险等级，全体投资者同意管理人不再按照本合同“第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定进行合同变更事宜。若调高风险等级，管理人应当按照本合同“第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”的规定进行合同变更事宜。

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，资产管理人应当及时向中国证监会相关派出机构报告。

#### 四、本资产管理计划的风险收益特征

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R2（中低风险），仅适合向合格投资者中的专业投资者和风险承受能力评估结果为 C2、C3、C4、C5 的普通投资者推广，具体以销售机构确认的风险等级为准。

<p>五、本资产管理计划的投资策略</p> <p>(三) 投资管理的方法和标准</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>本集合计划投资国债期货的主要目的是套期保值。通过对国债市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p>(1) 风险控制</p> <p>首先，严格控制交易的规模，不得超过管理人有关规定的规模进行交易；其次，管理人将对期货的风险敞口进行监控，不得超过合同约定的范围。</p> <p>(2) 责任承担</p> <p>管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定，因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行为而造成的集合计划资产损失，管理人应赔偿，但管理人不承担委托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失）。对于其他相关方的原因给委托人造成的损失，管理人不承担赔偿责任，但应代表集合计划委托人的</p>	<p>五、本资产管理计划的投资策略</p> <p>(三) 投资管理的方法和标准</p>
---	---

利益向过错方追偿。委托人同意并确认：有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项，以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议为准。

~~(3) 期货保证金的流动性应急处理机制~~

~~① 应急触发条件~~

~~管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。~~

~~② 保证金补充机制~~

~~如出现保证金不足的情况时，管理人将通过及时变现集合计划资产或其他合法合规的方式处理，以最大限度地降低损失。~~

六、投资限制和投资禁止

(一) 投资限制

1、集合计划的总资产不得超过净资产的 ~~150%~~，计算本集合计划总资产，需按照穿透合并计算所投资资产管理产品的总资产；

.....

~~3、本计划投资的资产管理产品，不得再投资于公募基金以外的其他资产管理产品；~~

六、投资限制和投资禁止

(一) 投资限制

1、集合计划的总资产不得超过净资产的 200%，计算本集合计划总资产，需按照穿透合并计算所投资资产管理产品的总资产；

.....

3、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



<p>4、本计划投资的资产管理产品，不得投资非标准化资产；</p> <p>5、本集合计划参与债券、可转换债券、<del>可交换债券</del>等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p>	<p><u>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；</u></p> <p>4、本集合计划参与债券、可转换债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p><u>5、按市值与买入成本孰高计算，投资于任单一发行人（国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券除外，含可转债）的金额不得超过本集合计划资产净值的 10%；</u></p> <p><u>6、投资于单个省（自治区、直辖市）的城投债（以 Wind 数据库为准，下同）持仓市值不超过本集合计划资产净值的 30%；投资于单个地级市及下辖区县的城投债持仓市值不超过本集合计划资产净值的 20%。其中，投资于山东、河南、河北、天津单一城投债市值不超过计划资产净值的 5%，若债项有 AAA 级担保公司担保，则单一城投债市值不高于计划资产净值的 10%。不得投资于黑龙江、吉林、辽宁、内蒙古、宁夏、甘肃、贵州、广西、西藏、宁夏、云南、青海、山东潍坊、江西萍乡的城投债；</u></p> <p><u>7、投资的债券信用等级遵循如下要求：</u></p>
---	---

		<p><u>(1) 买入的地方政府债、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、中期票据、非公开定向债务融资工具、超短期融资券、项目收益票据的主体信用评级（如有）或担保人信用评级（如有）或债项评级（如有）应在 AA（含）以上；</u></p> <p><u>(2) 买入的短期融资券的主体信用评级（如有）应在 AA（含）以上，债项评级（如有）应在 A-1（含）以上；</u></p> <p><u>(3) 买入的同业存单的主体信用评级（如有）应在 AA（含）以上，债项评级（如有）应在 AA（含）以上；</u></p> <p><u>(4) 买入的可转债的主体信用评级（如有）或债项评级（如有）或担保人主体信用评级（如有）应在 AA（含）以上。</u></p> <p><u>上述债券债项评级、主体信用或担保人信用评级均不参考中债资信；</u></p> <p><u>8、按市值与买入成本孰低计算，投资于非公开定向债务融资工具（PPN）、非公开发行公司债券、资产支持证券/票据的金额合计不得超过本集合计划资产净值的 50%；</u></p> <p><u>9、投资于（含新债申购）单一信用债及可转债的金额不得超过该债券存续规模的 10%；</u></p> <p><u>10、所持有的债券协议逆回购的质押券应符合本集合计划的投资</u></p>
--	--	---

		<p><u>范围和投资限制要求，并同时纳入集中度管控；</u></p> <p><u>11、本集合计划投资不得与管理人及管理人的关联方做交易对手方；</u></p> <p><u>12、债券资产组合中：信用债的加权平均久期不超过 3 年，整体组合加权平均久期不超过 4.5 年；</u></p> <p><u>13、本集合计划到期前（不包括提前终止）30 个交易日（含满 30 个交易日当日）内不得参与新债申购；</u></p> <p><u>14、不得投资民营企业和房地产企业发行的债券，仅限投资于国有企业（不包含房地产企业）发行的债券；可投资于民营企业和国有企业发行的可转换债券，不包含房地产企业发行的可转换债券；</u></p> <p><u>15、协议式逆回购余额合计占比不得超过本集合计划资产净值的 20%，且交易对手方只能是券商等持牌金融机构，不得为私募基金管理人；</u></p> <p><u>16、本集合计划投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定，如因证券期货市场环境变化或相关主体经营情况等的因素，导致买入后持仓债券的债项评级、发行人主体评级或担保人评级发生评级下调且低于管理人评级限制的，管理人须</u></p>
--	--	--

	<p>.....</p> <p>本计划投资于其他资产管理产品的，计算本计划总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。本计划投资于其他私募资产管理产品的，计算同一资产时，除对资产管理产品的直接投资比例进行监控外，还应按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一资产的金额，并符合中国证监会的相关规定。</p> <p>（二）禁止行为</p> <p>本集合计划的禁止行为包括：</p>	<p><u>于 10 个交易日内对该债券风险作出补充评估并及时调整，管理人应在季度报告中进行相应披露；</u></p> <p><u>17、按市值与买入成本孰高计算，本集合计划投资于可转债的金额不超过本集合计划净资产的 20%，且不得主动转股；</u></p> <p><u>18、本计划投资于产业债的，债券持仓市值不超过本集合计划资产净值的 10%；</u></p> <p><u>19、本集合计划不得投资于资产支持证券等证券化资产的非优先级份额；</u></p> <p>.....</p> <p>本计划投资于其他资产管理产品的，计算本计划总资产时应当按照穿透原则合并计算所投资资产管理产品的总资产。</p> <p>（二）禁止行为</p> <p>本集合计划的禁止行为包括：</p> <p><u>13、利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品</u></p>
--	---	--

	<p>八、本计划投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配</p> <p>1、管理人对本计划的流动性进行安排，本计划在开放期内投资的7个工作日可变现资产的价值不得低于本计划资产净值的10%。</p> <p>2、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放期内不得超过本集合计划资产净值的20%。</p>	<p><u>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；</u></p> <p><u>14、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；</u></p> <p>八、本计划投资的资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配</p> <p>1、管理人对本计划的流动性进行安排，本计划在<u>退出</u>开放期内投资的7个工作日可变现资产的价值不得低于本计划资产净值的10%。</p> <p>2、本计划主动投资于流动性受限资产的市值在<u>退出</u>开放期内不得超过本集合计划资产净值的20%。</p>
<p><b>第十四部分 利益冲突及关联交易</b></p>	<p><del>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。投资者知悉并同意本计划从事上述关联交易。</del></p>	<p><u>一、利益冲突情形</u></p> <p><u>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：</u></p> <p><u>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</u></p>

~~二、投资者同意并授权管理人可将集合计划的资产投资于管理人、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或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易。交易完成 5 个工作日内，管理人应通过管理人指定网站公告告知投资者和托管人，并向证券交易所、证券投资基金业协会以及中国证监会相关派出机构报告。并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益。~~

~~三、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。~~

~~四、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，实现在管理人、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~~

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；

3、管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与和退出本计划；

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。

不同投资者。

~~（二）管理人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管理人、管理人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~~利益冲突事项~~，管理人以符合法律法规、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。~~

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。

管理人的关联方名单以管理人提供的关联人名单或年度报告以及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/>）。托管人向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发

行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以托管人面向公开市场披露的主体信息和证券信息为准。

(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。

虽有上述约定，如监管部门、行业协会、管理人内部制度对一般关联交易和重大关联交易的区分标准另有规定的，管理人将根据规定重新划分，并以管理人公告形式告知投资者。

(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。



		<p><u>1) 禁止以下关联交易</u></p> <p><u>A、利用资产管理产品资产向管理人、托管人出资；</u></p> <p><u>B、利用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</u> <u>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；</u></p> <p><u>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；</u></p> <p><u>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。</u></p> <p><u>2) 在投资决策方面</u></p> <p><u>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</u> <u>分别履行下列审议程序：</u></p> <p><u>A、董事会授权经营管理层审议批准以下关联交易：</u></p> <p><u>资产管理产品与管理人关联方进行的、《东海证券股份有限公司关联交易管理制度》规定由经营管理层审议批准的关联交易，</u></p>
--	--	---

以及资产管理产品与其他关联方之间进行的关联交易：

根据已经监管机构批准或向自律组织备案的产品法律文件约定的费率、计提方法和支付方式等，资产管理产品向其他关联方支付管理费、托管费、业绩报酬等费用。

B、管理人董事会审议批准以下关联交易：

资产管理产品与管理人关联方进行的、《东海证券股份有限公司关联交易管理制度》规定由董事会审议批准的关联交易。

C、管理人股东大会审议批准以下关联交易：

资产管理产品与管理人关联方进行的、《东海证券股份有限公司关联交易管理制度》规定由股东大会审议批准的关联交易。

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

		<p><u>公告信息。</u></p> <p><u>2、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。</u></p> <p><u>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。</u></p>
<p><b>第十五部分 投资经理的指定与变更</b></p>	<p>二、本计划的投资经理的资料如下：  本计划的投资经理由吴琛越女士担任。  <del>投资经理简历：上海财经大学统计学硕士，具有 14 年的证券从业经验。历任东海证券股份有限公司资产管理部交易员、交易主管、研究员、投资经理，具有丰富的证券研究分析、投资交易经历，投资风格稳健经验丰富，在严格控制风险的基础上追求绝对收益。本计划投资经理已具备证券从业与基金从业资格，不曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。</del></p>	<p>二、本计划的投资经理的资料如下：  <u>本计划的投资经理由蔡万科先生担任。</u>  <u>投资经理简历：蔡万科先生，上海财经大学金融学博士，具有 11 年固定收益从业经验，历任光大证券研究所固定收益分析师、太平洋资产固定收益部投资经理助理、徽银理财固定收益投资经理等，现任东海证券资产管理部投资经理。对利率、信用、转债有深入研究，分析上注重主观判断和客观量化相结合，擅长利率债、城投债投资，重视多策略追求利率、信用和流动性风险的平衡。本计划投资经理已具备证券从业与基金从业资格，未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</u></p>

<p><b>第十八部分 越权交易的界定</b></p>	<p>二、越权交易的处理程序</p> <p>(一) 违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为</p> <p>托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会（如需）。</p> <p>托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权报告管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会（如需）。</p> <p>管理人应向托管人主动报告越权交易。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及证券投资基金业协会（如需）。</p> <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督：</p> <p>1、对本计划以下投资范围和投资比例进行监督：</p>	<p>二、越权交易的处理程序</p> <p>(一) 违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为</p> <p>托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告中国证监会派出机构。</p> <p>托管人对于承诺监督的越权交易中，发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律、行政法规和其他规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人并有权报告中国证监会派出机构。</p> <p>管理人应向托管人主动报告越权交易。在限期内，托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告中国证监会派出机构。</p> <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督：</p> <p>1、对本计划以下投资范围和投资比例进行监督：</p>
-----------------------------	--	--

<p>投资范围：</p> <p>本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（包括二级资本债、资本补充债、混合资本债等）、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、可转换债券、<del>可交换债券</del>、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、资产支持票据、非金融企业债务融资工具、项目收益债、次级债、<del>债券正回购</del>、<del>债券逆回购</del>、公募债券型基金、经证监会认可的比照公募基金管理的债券型资产管理产品、<del>证券公司及其子公司的资产管理计划</del>、<del>基金公司及其子公司的资产管理计划</del>、<del>保险公司及其子公司的资产管理计划</del>、<del>银行理财计划</del>、<del>货币市场基金</del>、<del>银行存款</del>、<del>协议存款</del>、<del>结构性存款</del>、<del>同业存款</del>、<del>同业存单</del>、<del>通知存款</del>、<del>大额可转让存单</del>、<del>现金</del>、<del>国债期货</del>。</p> <p>投资比例</p> <p><del>(1)</del>固定收益类资产：按照穿透合并计算的市值合计不低于本集合计划总资产的 80%。所投资标的产品持仓的各类资产市值以相应产品的信息披露义务人（投资标的产品的管理人、管理人委托的第三方服务机构或托管人，下同）提供的最近定期报告为准。</p>	<p>投资范围：</p> <p>本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债（包括二级资本债、资本补充债、混合资本债等）、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、可转换债券、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、资产支持票据、非金融企业债务融资工具、项目收益债、债券逆回购、公募债券型基金、货币市场基金、银行存款、协议存款、同业存款、同业存单、通知存款、现金。</p> <p><u>本计划可参与债券正回购。</u></p> <p>投资比例</p> <p>固定收益类资产：按照穿透合并计算的市值合计不低于本集合计划总资产的 80%。所投资标的产品持仓的各类资产市值以相应产品的信息披露义务人（投资标的产品的管理人、管理人委托的第三方服务机构或托管人，下同）提供的最近定期报告为准。</p>
--	---

	<p><del>(2) 国债期货：持仓合约价值合计不超过总资产的 10%。</del></p> <p>2、对本计划以下投资限制进行监督：</p> <p>(1) 集合计划的总资产不得超过净资产的 <del>200%</del>；</p> <p>.....</p> <p>(5) 本集合计划参与债券、可转换债券、<del>可交换债券</del>等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p>	<p>2、对本计划以下投资限制进行监督：</p> <p>(1) 集合计划的总资产不得超过净资产的 <u>150%</u>，<u>计算本集合计划总资产，需按照穿透合并计算所投资资产管理产品的总资产</u>；</p> <p>.....</p> <p><u>(3) 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；</u></p> <p>(4) 本集合计划参与债券、可转换债券等证券发行申购时，所申报的金额不得超过本集合计划的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p><u>(5) 按市值与买入成本孰高计算，投资于任单一发行人（国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券除外，含可转债）的金额不得超过本集合计划资产净值的 10%；</u></p> <p><u>(6) 投资于单个省（自治区、直辖市）的城投债（以 Wind</u></p>
--	--	--

		<p><u>数据库为准，下同）持仓市值不超过本集合计划资产净值的30%；投资于单个地级市及下辖区县的城投债持仓市值不超过本集合计划资产净值的20%。其中，投资于山东、河南、河北、天津单一城投债市值不超过计划资产净值的5%，若债项有AAA级担保公司担保，则单一城投债市值不高于计划资产净值的10%。不得投资于黑龙江、吉林、辽宁、内蒙古、宁夏、甘肃、贵州、广西、西藏、宁夏、云南、青海、山东潍坊、江西萍乡的城投债；</u></p> <p><u>（7）投资的债券信用等级遵循如下要求：</u></p> <p><u>1）买入的地方政府债、金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、中期票据、非公开定向债务融资工具、超短期融资券、项目收益票据的主体信用评级（如有）或担保人信用评级（如有）或债项评级（如有）应在AA（含）以上；</u></p> <p><u>2）买入的短期融资券的主体信用评级（如有）应在AA（含）以上，债项评级（如有）应在A-1（含）以上；</u></p> <p><u>3）买入的同业存单的主体信用评级（如有）应在AA（含）以上，债项评级（如有）应在AA（含）以上；</u></p> <p><u>4）买入的可转债的主体信用评级（如有）或债项评级（如有）或担保人主体信用评级（如有）应在AA（含）以上。</u></p>
--	--	---

		<p><u>上述债券债项评级、主体信用或担保人信用评级均不参考中债资信；</u></p> <p><u>(8) 按市值与买入成本孰低计算，投资于非公开定向债务融资工具（PPN）、非公开发行公司债券、资产支持证券/票据的金额合计不得超过本集合计划资产净值的 50%；</u></p> <p><u>(9) 投资于（含新债申购）单一信用债及可转债的金额不得超过该债券存续规模的 10%；</u></p> <p><u>(10) 所持有的债券协议逆回购的质押券应符合本集合计划的投资范围和投资限制要求，并同时纳入集中度管控；</u></p> <p><u>(11) 本集合计划投资不得与管理人及管理人的关联方做交易对手方；</u></p> <p><u>(12) 债券资产组合中：信用债的加权平均久期不超过 3 年，整体组合加权平均久期不超过 4.5 年；</u></p> <p><u>(13) 本集合计划到期前（不包括提前终止）30 个交易日（含满 30 个交易日当日）内不得参与新债申购；</u></p> <p><u>(14) 不得投资民营企业和房地产企业发行的债券，仅限投资于国有企业（不包含房地产企业）发行的债券；可投资于民营企业 and 国有企业发行的可转换债券，不包含房地产企业发行的可</u></p>
--	--	---



	<p>(二) 托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内, 对本计划的直接投</p>	<p><u>转换债券:</u></p> <p><u>(15) 协议式逆回购余额合计占比不得超过本集合计划资产净值的 20%, 且交易对手方只能是券商等持牌金融机构, 不得为私募基金管理人;</u></p> <p><u>(16) 本集合计划投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定, 如因证券期货市场变化或相关主体经营情况等的因素, 导致买入后持仓债券的债项评级、发行人主体评级或担保人评级发生评级下调且低于管理人评级限制的, 管理人须于 10 个交易日内对该债券风险作出补充评估并及时调整, 管理人应在季度报告中进行相应披露;</u></p> <p><u>(17) 按市值与买入成本孰高计算, 本集合计划投资于可转债的金额不超过本集合计划净资产的 20%, 且不得主动转股;</u></p> <p><u>(18) 本计划投资于产业债的, 债券持仓市值不超过本集合计划资产净值的 10%;</u></p> <p><u>(19) 本集合计划不得投资于资产支持证券等证券化资产的非优先级份额;</u></p> <p>(二) 托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内, 对本计划的投资履</p>
--	---	---

资履行监督职能。

（四）如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，由过错方承担相应责任。

行监督职能。其中，托管人因技术、手段等原因无法对投资限制的第（6）、（10）、（11）、（12）、（14）、（15）条进行监督，上述条款由管理人进行监督。

（四）如需托管人对本计划关联交易进行监督的，管理人应于合同生效前提供关联方名单，并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。托管人仅根据管理人提供的名单对资产管理计划买卖关联方发行的或者承销期内承销的证券进行关联交易监督。若管理人没有及时提供关联方信息，导致托管人无法及时对关联方证券进行监督，由过错方承担相应责任。托管人向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以托管人面向公开市场披露的主体信息和证券信息为准。

（六）管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由管理人承担相应的责任。

（七）投资监督事项涉及穿透核查或穿透计算的，管理人应当定期向托管人提供穿透所需的相关材料、数据及计算底稿，托管人仅凭管理人提供的材料进行事后核查监督，托管人核查监督

		<p><u>的及时性、准确性受限于管理人提供信息的频率和信息的完整性、准确性，最终投资责任在管理人。除因管理人提供材料不及时、不准确、不真实、不完整等非托管人过错导致的情形，资产托管人需承担相应的监督责任。</u></p>
<p><b>第十九部分 交易及清算交收安排</b></p>	<p>二、投资证券后的清算交收安排</p> <p>(一) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</p> <p>7、资产管理人知晓并确认，资产管理人管理资产中用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，中国结算公司依法对质押券进行处置。资产管理人应就债券回购交收违约后结算公司对质押券的处置以及<u>委托人</u>或受托人所应承担的委托债券投资风险，预先书面告知<u>委托人</u>或受托人，并由<u>委托人</u>或受托人签字确认。</p>	<p>二、投资证券后的清算交收安排</p> <p>(一) 关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务：</p> <p>7、资产管理人知晓并确认，资产管理人管理资产中用于融资回购的债券将作为资产托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券，若资产管理人债券回购交收违约，中国结算公司依法对质押券进行处置。资产管理人应就债券回购交收违约后结算公司对质押券的处置以及<u>投资者</u>或受托人所应承担的<u>受托</u>债券投资风险，预先书面告知<u>投资者</u>或受托人，并由<u>投资者</u>或受托人签字确认。</p>
<p><b>第二十分 资产管理计划财</b></p>	<p>三、估值方法</p> <p>(一) 证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>3、交易所上市交易的可转换债券、<del>可交换债券</del>，选取每日收盘价作为估值价进行估值；</p>	<p>三、估值方法</p> <p>(一) 证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>3、交易所上市交易的可转换债券，选取每日收盘价作为估值价进行估值；</p>

<p>产的估值和会计核算</p>	<p><del>（五）投资证券衍生品的估值方法</del></p> <p><del>国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</del></p> <p><del>（七）银行存款、协议存款、结构性存款、回购等固定收益工具按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。</del></p> <p><del>（九）证券公司及其子公司的资产管理计划、基金公司及其子公司的资产管理计划、保险公司及其子公司的资产管理计划、银行理财计划按照估值日前一交易日的单位净值/份额净值估值，估值日前一交易日未公布份额净值的，以前最近一次公布的单位净值/份额净值计算。管理人需向托管人提供单位净值，托管人据此进行估值。</del></p>	<p>（七）银行存款、协议存款、回购等固定收益工具按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息，在利息到账日以实收利息入账。</p>
<p>第二十一部分 资产管理计划的费用与</p>	<p>二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式</p> <p>（一）资产管理人的管理费</p> <p>1、固定管理费</p> <p>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：</p>	<p>二、资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式</p> <p>（一）资产管理人的管理费</p> <p>1、固定管理费</p> <p>集合计划管理人的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.2% 年费率计提。计算方法如下：</p>

<p>税收</p>	<p><math>H = E \times 0.4\% \div 365</math></p> <p>2、业绩报酬：</p> <p>(2) 业绩报酬的计提方法：</p> <p>本集合计划业绩报酬计提基准 F 为 <del>4.6%</del>/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。</p> <p>在业绩报酬计提日，若投资者在该期间的实际年化收益率 R 小于或等于业绩报酬计提基准 F，管理人不计提业绩报酬；若在该期间的实际年化收益率 R 大于业绩报酬计提基准 F，管理人将对超过部分收益的 <del>60%</del> 计提业绩报酬，剩余部分归投资者所有。</p> <p>管理人按如下标准和方法提取业绩报酬：</p> <p>①当 <math>R \leq F</math> 时，管理人不收取业绩报酬；</p> <p>②当 <math>R &gt; F</math> 时，业绩报酬 = <math>M \times S_0 \times (R - F) \times \del{60\%} \times T / 365</math></p>	<p><math>H = E \times 0.2\% \div 365</math></p> <p>2、业绩报酬：</p> <p>(2) 业绩报酬的计提方法：</p> <p>本集合计划业绩报酬计提基准 F 为 <u>5.4%</u>/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，<u>管理人应至少提前 10 个工作日公告</u>。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。</p> <p>在业绩报酬计提日，若投资者在该期间的实际年化收益率 R 小于或等于业绩报酬计提基准 F，管理人不计提业绩报酬；若在该期间的实际年化收益率 R 大于业绩报酬计提基准 F，管理人将对超过部分收益的 <u>40%</u> 计提业绩报酬，剩余部分归投资者所有。</p> <p>管理人按如下标准和方法提取业绩报酬：</p> <p>①当 <math>R \leq F</math> 时，管理人不收取业绩报酬；</p> <p>②当 <math>R &gt; F</math> 时，业绩报酬 = <math>M \times S_0 \times (R - F) \times \u{40\%} \times T / 365</math></p>
<p>第二十三</p>	<p>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：</p>	<p>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：</p>

<p>部分 信息 披露与报 告</p>	<p>(二) 季度报告和年度报告</p> <p>5、本集合计划投资国债期货的，管理人应当在资产管理季度报告/年度报告中充分披露集合资产管理计划参与国债期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。</p> <p>四、向投资者提供报告及投资者信息查询的具体方式</p> <p>(二) 投资者向管理人查询信息的方式</p> <p>3、传真或电子邮件</p> <p>如投资者留有传真号、电子邮箱等联系方式的，管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将本合同约定披露的信息资料告知投资者。</p> <p>七、信息披露文件的存放及查阅</p> <p>管理人和托管人应当妥善保存投资者开户资料、委托记录、交易记录和与内部管理、业务经营有关的各项资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。</p>	<p>(二) 季度报告和年度报告</p> <p>四、向投资者提供报告及投资者信息查询的具体方式</p> <p>(二) 投资者向管理人查询信息的方式</p> <p>3、传真或电子邮件</p> <p>如投资者留有传真号、电子邮箱等联系方式的，管理人也可通过传真、电子邮件、电报等方式将本合同约定披露的信息资料告知投资者。管理人进行上述信息披露的专用邮箱为： <a href="mailto:dhzgmarket@longone.com.cn">dhzgmarket@longone.com.cn</a>。</p> <p>七、信息披露文件的存放及查阅</p> <p>管理人和托管人应当妥善保存投资者开户资料、受托记录、交易记录和与内部管理、业务经营有关的各项资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。</p>
-----------------------------	---	---

<p>第二十四 部分 风险 揭示</p>	<p>(二) 特定风险揭示</p> <p>4、投资于资产管理产品的相关风险</p> <p><del>—(1) 本集合计划管理人通过定性及定量相结合的方式筛选资产管理产品及资产管理产品受托管理人，因此存在资产管理产品受托管理人的选择风险。</del></p> <p><del>—(2) 由于投资的私募资产管理产品份额净值当日开市时不能实时获取数据，只能参考前一交易日的份额净值，无法做到盘中实时风控，只能事后风控，存在风控滞后的风险。</del></p> <p><del>—(3) 本集合计划所投资的资产管理产品的净值情况直接影响本集合计划的产品净值。由于估值日所投资的私募资产管理产品份额净值无法实时获取当日份额净值数据，只能依据前一交易日的份额净值进行估值，因此本集合计划可能存在无法及时反映当日底层资产波动的风险。</del></p> <p>5、锁定持有期无法退出的风险</p> <p>本集合计划每周三（如遇非工作日，顺延至下一工作日）为参与开放期，每月 20 日为退出开放期（如遇非工作日，顺延至下一工作日），<del>开放期内可以办理参与、退出业务。</del>本集合计划对每笔份额设置 9 个月的锁定期。锁定期起始日为份额参与申请的确</p>	<p>(二) 特定风险揭示</p> <p>4、锁定持有期无法退出的风险</p> <p>本集合计划每周二及每月 20 日为参与开放期（如遇非工作日，顺延至下一工作日），<u>可以办理参与业务</u>；每月 20 日为退出开放期（如遇非工作日，顺延至下一工作日），可以办理退出业务。本集合计划对每笔份额设置 9 个月的锁定期。锁定期起始日</p>
------------------------------	--	---

认日（认购份额从计划成立日起算，参与份额从参与确认日起算）。锁定期到期日为锁定期起始日起9个月的对应日，如无对应日或该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。锁定期期满后（含锁定期到期日当日）投资者可以在退出开放期申请退出，但本合同另有约定的除外。因此存在锁定持有期无法退出的风险。

#### 6、业绩报酬的相关风险

本集合计划业绩报酬计提基准F为~~4.6%/年~~，~~业绩报酬计提基准不是预期收益或者保证收益率，不构成管理人、销售机构、托管人对委托财产收益状况的任何承诺和担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。~~

#### 7、~~国债期货的投资风险~~

~~本集合计划可投资于国债期货，国债期货的投资可能面临市~~

为份额参与申请的确认日（认购份额从计划成立日起算，参与份额从参与确认日起算）。锁定期到期日为锁定期起始日起9个月的对应日，如无对应日或该对应日为非工作日，则顺延至下一工作日。锁定期期满后（含锁定期到期日当日）投资者可以在退出开放期申请退出，但本合同另有约定的除外。因此投资者需注意存在锁定持有期无法退出的风险。投资者还需注意只能在锁定持有期满后的退出开放期申请退出，因此面临锁定持有期满后无法立即退出的风险。

#### 5、业绩报酬的相关风险

本集合计划业绩报酬计提基准F为5.4%/年。管理人可调整业绩报酬计提基准，届时以管理人公告为准，管理人应至少提前10个工作日公告。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。业绩报酬计提基准不是预期收益或者保证收益率，不构成管理人、销售机构、托管人对受托财产收益状况的任何承诺和担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。



	<p>场风险、基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险。基差风险是期货市场的特有风险之一，是指由于期货与现货间的价差的波动，影响套期保值或套利效果，使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类：一类为流通量风险，是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险，此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的；另一类为资金量风险，是指资金量无法满足保证金要求，使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。</p>	
<p><b>第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算</b></p>	<p>一、资产管理合同的变更</p> <p>(二) 除调低管理费率、托管费率，以及调低风险等级事宜外，由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后以通过管理人网站或其他适当方式向投资者发送合同变更征询意见，并采取如下权利保障措施及安排：</p> <p>.....</p> <p>2、投资者不同意变更且逾期未退出的，则管理人有权在征询意见函或公告中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出</p>	<p>一、资产管理合同的变更</p> <p>(二) 除调低管理费率、托管费率，以及调低风险等级事宜外，由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告，须至少公告 10 个工作日。管理人还须向投资者发送合同变更征询意见函，变更征询意见函载明的意见回复期限应不少于 10 个工作日，并采取如下权利保障措施及安排：</p> <p>.....</p> <p>2、投资者不同意变更且逾期未退出的，则管理人有权在征询意见函中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出计划</p>

	<p>计划（退出价格为退出申请当日资产管理计划当日净值），由此发生的相关税费及或有损失由投资者自行承担；</p> <p>三、资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：</p>	<p>（退出价格为退出申请当日资产管理计划当日净值），由此发生的相关税费及或有损失由投资者自行承担；</p> <p>三、资产管理计划终止的情形，包括但不限于下列事项：</p> <p>（九）<u>本集合计划全体投资者申请退出所持有的集合计划份额，致使所有集合计划份额被退出，且无在途参与申请的；</u></p>
<p>第二十九 部分 其他 事项</p>		<p><u>五、合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息(包括但不限于本产品受益所有人信息所涉及的姓名，联系方式，身份证信息)；托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规，其他方亦已知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的，该方承诺已告知并获得相关个人同意向另一方提供个人信息，且个人已知晓个人信息的使用用途。</u></p>

《说明书》、《风险揭示书》根据上述内容做相应变更。

### 三、合同变更方案的公告

我司已获得托管行对于本次合同变更的书面许可，为充分保障投资者的知情权，我司将于 2024 年 6 月 14 日至 2024 年 6 月 20 日在

管理人网站（[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)）公告本次合同变更的详细内容。

#### 四、合同变更方案的安排

管理人于 2024 年 6 月 19 日至 2024 年 6 月 21 日设立临时开放期，对变更内容有异议的投资者有权选择在临时开放期申请退出本集合计划份额，我司将受理投资者的退出申请，并为投资者办理退出业务，具体操作如下：

- 1、对于临时开放期时锁定期已满的份额的退出申请，管理人将根据投资者的退出申请办理退出业务。
- 2、对于临时开放期时处于锁定持有期的份额的退出申请，将由管理人办理强制退出计划。
- 3、投资者退出确认后剩余存续参与金额不足 30 万元的，管理人将为其强制清退全部剩余份额。
- 4、投资者回复不同意变更且在临时开放期未退出的，则管理人将在临时开放期最后一个开放日（2024 年 6 月 21 日）结束后将相关份额强制退出计划（退出价格为当日资产管理计划单位净值）。

#### 五、合同变更的生效

合同变更内容在临时开放期结束后预计于 2024 年 6 月 24 日生效，管理人将于合同变更生效日在管理人网站发布公告，合同变更生效日以管理人发布的公告为准。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，投资者、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。

#### 六、投资者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	

投资者需将回复自 2024 年 6 月 14 日起至 2024 年 6 月 20 日 17:00 止（以收件人收到征询意见函回函的时间为准）通过专人送交、邮寄送达至以下地址：

收件人：东海证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 4 层

邮政编码：200125

联系人：黄璐

联系电话：021-20333816

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明系用于本集合计划合同变更征询意见之用（如“东海证券海融 6 号集合资产管理计划合同变更专用”）。

投资者未回复意见且逾期未退出，视同投资者同意本合同变更，管理人不再另行通知。

七、本征询意见函一式贰份，管理人、投资者各保留壹份。

管理人：

东海证券股份有限公司

投资者：

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）：