

关于东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划 资产管理合同等文件变更的征询意见函

尊敬的东海证券海汇周周利 FOF1 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汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划的管理人，拟变更《东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）、《东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“说明书”）、《东海证券海汇周周利 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》“二十四、资产管理合同的变更、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）合同、说明书、风险揭示书中相关文字替换，具体为：“委托财产”变更为“受托资产”，“委托资产”变更为“受托资产”，“委托人”变更为“投资者”。

（二）“二、释义”中“《管理办法》：指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会发布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；《运作规定》：指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会发布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》”变更为：

“《管理办法》：指 2023 年 1 月 12 日经中国证券监督管理委员会发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》；《运作规定》：指 2023 年 1 月 12 日经中国证券监督管理委员会发布的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》”

“二、释义”中，新增“收益分配、分红：指资产管理计划将可供分配利润按计划份额分配给投资者的行为；收益分配基准日：指管理人计算每份额分红金额的日期。管理人以收益分配基准日当日的单位净值作为计算每份额分红金额的基准；分红权益登记日：指登记可分配收益的集合计划份额的日期。分红权益登记日登记在册的集合计划份额可分配收益。”

（三）“四、当事人及权利与义务”中“（二）管理人”中，“法定代表人：钱俊文”变更为：

“法定代表人：王文本”

“(三) 托管人”中，“通信地址：北京市西城区菜市口大街1号院2号楼信托大厦11层 负责人或授权代表：尹兆君”变更为：

“通信地址：北京市西城区金融大街15号鑫茂大厦北楼4层 负责人或授权代表：王凯”

(四)“四、当事人及权利与义务”中“投资者的权利和义务”中“2、投资者的义务”中，删除“(5) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；”

“管理人的权利与义务”中“2、管理人的义务”中，“(19) 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“(19) **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；**

(20) 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；”

(五)“五、资产管理计划的基本情况”中“(六) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级”中“3、资产投资比例”中，删除“投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于本机构、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。交易完成10个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者。”

(六)“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“(四) 参与的方式、价格、程序及确认”中，“1、参与的原则 (3)投资者首次参与的最低净参与金额为人民币 300,000 元，超过最低认购金额的部分需为人民币 1,000 元的整数倍。存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足资产管理计划最低参与金额限制（人民币 300,000 元），已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的每次追加参与的最低金额为人民币 1,000 元。”变更为：

“1、参与的原则 (3) 投资者首次参与的最低净参与金额为人民币 300,000 元，超过最低参与金额的部分需为人民币 1,000 元的整数倍。存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足资产管理计划最低参与金额限制（人民币 300,000 元），已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的每次追加参与的最低金额为人民币 1,000 元的**整数倍。**”

(七)“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“(四)参与的方式、价格、程序及确认”中,“5、参与的金额限制 投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的,投资者应符合合格投资者标准,且参与金额应不低于 300,000 元(不含参与费用),已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。”变更为:

“5、参与的金额限制 投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的,投资者应符合合格投资者标准,且参与金额应不低于 300,000 元(不含参与费用),**超过最低参与金额的部分需为人民币 1,000 元的整数倍。**已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。”

(八)“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“(五)退出的方式、价格、程序及确认”中“2、退出的程序和确认”中,新增“(4)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。**”

(九)“八、资产管理计划的参与、退出与转让”中“(五)管理人自有资金参与集合计划

管理人可以以自有资金参与东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划。

1、自有资金参与的条件:管理人以自有资金参与本集合计划,应符合《管理办法》、《运作规定》、《业务规范》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。

2、自有资金的参与方式:存续期间,管理人可以参与本集合计划。

3、自有资金参与的比例或金额:管理人自有资金参与本集合计划的份额不超过集合计划总份额的 10%。

存续期间,因集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超限的,管理人应在 10 个工作日内(T+10 日内)安排特殊开放期,办理前述资金退出业务。

4、自有资金的收益分配:管理人自有资金参与份额与投资者持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。

5、自有资金责任承担方式和金额:管理人自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任,不承担附加责任。

6、自有资金退出的条件:管理人自有资金参与部分在符合法律、行政法规等关于自有资金退出规定的情况下,可以与其他份额投资者同样办理退出业务。

7、集合计划存续期间，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，管理人可以根据合同约定，参与集合计划；但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，而导致管理人自有资金退出的可以不受本条前述约定限制。

8、为应对巨额退出，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，管理人参与的自有资金参与、退出可不受上述限制，但需事后及时告知投资者和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告。

9、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限时的处理原则及处理措施：管理人在 10 个工作日内使自有资金占比满足监管要求，并及时在管理人指定网站公告自有资金参与集合计划被动超限情况，包括超限比例、超限原因、处理方案等。

10、风险揭示：管理人以自有资金参与本集合计划并不代表管理人对本集合计划的风险和收益水平作出任何形式的判断。管理人自有资金参与份额与其他投资者持有计划同类份额享有同等权利并承担相同责任，并不对同类份额本金或收益提供任何形式的保障。

11、信息披露：自有资金参与份额变动情况，应当在参与和退出发生后 5 个工作日内在管理人网站发布公告，向投资者和资产托管机构进行披露。” 变更为：

“（六）管理人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%且符合相关法律法规的规定。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。

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 个工作日以邮件或其他方式告知托管人，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。

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。

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。

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。”

（十）“十一、资产管理计划的投资”中“（二）投资范围与投资比例”中“2、资产投资比例”中，删除“投资者在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于本机构、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。交易完成 10 个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知投资者。”

（十一）“十一、资产管理计划的投资”中，“（三）投资比例超限的处理方式及流程 如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 15 个交易日内将投资比例降至许可范围内。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”变更为：

“（三）投资比例超限的处理方式及流程

如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。”

(十二) “十一、资产管理计划的投资”中，“(八) 投资限制”中“1. 投资限制”中，新增“(2) 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本计划净资产 50%的，该计划的总资产不得超过净资产的 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；”

删除“(4) 本计划不投资于管理人或管理人关联方所设立的资产管理产品；”

(十三) “十一、资产管理计划的投资”中，“(八) 投资限制”中“2. 禁止行为”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；”

(十四) “十四、利益冲突及关联交易”中“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、保荐、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，或者与该等金融产品以公平合理的价格进行交易，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。

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，保护客户合法权益。

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）公司制定了利益冲突管理制度，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、监管规定允许的利益冲突事项，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。”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。

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，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管理人提供的关联人名单或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总行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。

（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。

投资者、托管人在此同意，如监管部门、行业协会对一般关联交易和重大关联交易的区分标准另有规定的，管理人将根据前述规定重新划分，并以公告形式告知投资者，书面告知托管人。如因管理人内部制度调整原因，对一般关联交易和重大关联交易的区分标准进行调整的，如属于调低关联交易认定标准或增加关联交易认定情形，则管理人以公告形式告知投资者，并书面通知托管人，无需按照本合同“二十四、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；如涉及调高关联交易认定标准或减少关联交易认定情形，管理人应当按照本合同“二十四、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。

（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下列审议程序：

A、董事会授权经营管理层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》规定由经营管理层审议批准的关联交易，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公告信息。

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。

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。”

(十五)“二十、资产管理计划的费用与税收”中，“(一)集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”中“1、管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提。管理费的年费率为1.00%。”变更为：

“1、管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划的资产净值计提。管理费的年费率为0.80%。”

新增“本计划投资于本计划管理人所管理的资产管理计划部分不收取固定管理费。”

(十六)“二十、资产管理计划的费用与税收”中，“(三)管理人的业绩报酬”中“(1)管理人收取业绩报酬的原则：

①同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；

②符合业绩报酬计提条件时，在投资者退出和资产管理计划终止时计提业绩报酬；

③在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

④投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或资产管理计划终止时持有份额计算；

⑤投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

⑥业绩报酬的提取频率不超过每6个月一次。因投资者退出本资产管理计划，管理人按照本合同的约定在投资者退出时提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

(2)业绩报酬的计提方法：

以投资者的参与日（初始募集期参与的为资产管理计划成立日，存续期参与的为参与日）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。其中业绩报酬计提日即为资产管理计划投资者退出日和资产管理计划终止日。年化收益率计算方法为：

$$R = \frac{S_T^* - S_0^*}{S_0^*} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

R: 指投资者的参与日至本次业绩报酬计提日的年化收益率;

S_T^* : 指本次业绩报酬计提日的累计单位净值;

S_0^* : 指投资者的参与日的累计单位净值;

S_0 : 指投资者的参与日的单位净值 (即投资者参与资产管理计划的参与价格);

T: 指投资者的参与日至本次业绩报酬计提日的自然天数。

管理人按如下标准和方法提取业绩报酬:

①当 $R \leq 6.25\%$ 时, 管理人不收取业绩报酬;

②当 $R > 6.25\%$ 时, 业绩报酬 = $M \times S_0 \times (R - 6.25\%) \times 20\% \times T / 365$

其中业绩比较基准和业绩报酬计提比例可根据市场利率情况进行调整, 届时以管理人公告为准。” 变更为:

“(1) 管理人收取业绩报酬的原则:

①同一投资者不同时间多次参与的, 对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬;

②符合业绩报酬计提条件时, 在**资产管理计划分红**、投资者退出和资产管理计划终止时计提业绩报酬;

③**资产管理计划分红时提取业绩报酬的, 业绩报酬从分红资金中扣除;**

④在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的, 业绩报酬从退出资金中扣除;

⑤投资者退出或计划终止时, 业绩报酬按投资者退出份额或资产管理计划终止时持有份额计算;

⑥投资者申请退出时, 管理人按“先进先出”的原则, 即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额, 计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

⑦业绩报酬的提取频率不超过每 6 个月一次。因投资者退出本资产管理计划, 管理人按照本合同的约定在投资者退出时提取业绩报酬的, 不受前述提取频率的限制。

(2) 业绩报酬的计提方法:

以上一**业绩报酬计提日** (如上一**业绩报酬计提日不存在**, 则初始募集期参与的为资产管理计划成立日, 存续期参与的为参与日, 下同) 到本次业绩报酬计提日的年化收益率, 作为计提业绩报酬的基准。其中业绩报酬计提日即为**资产管理计划分红权益登记日**、资产管理计划投资者退出日和资产管理计划终止日。年化收益率计算方法为:

$$R = \frac{S_T^* - S_0^*}{S_0} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

R: 指上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的年化收益率;

S_T^* : 指本次业绩报酬计提日的累计单位净值;

S_0^* : 指上一业绩报酬计提日的累计单位净值;

S_0 : 指上一业绩报酬计提日的单位净值(如上一业绩报酬计提日不存在,则为投资者参与资产管理计划的参与价格);

T: 指上一业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然天数。

管理人按如下标准和方法提取业绩报酬:

①当 $R \leq 5.00\%$ 时, 管理人不收取业绩报酬;

②当 $R > 5.00\%$ 时, 业绩报酬 = $M \times S_0 \times (R - 5.00\%) \times 20\% \times T / 365$

其中业绩比较基准和业绩报酬计提比例可根据市场利率情况进行调整,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。”

(十七)“二十一、资产管理计划的收益分配”中“本集合计划不进行收益分配。”变更为:

“ (一) 收益的构成

收益包括:集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券价差、银行存款利息及其他合法收入。集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。

(二) 可供分配利润

指截至收益分配基准日资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

(三) 收益分配原则

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下,每个自然年度管理人可对计划份额进行收益分配不超过2次;具体时间以及分配方案由管理人根据本集合计划收益情况拟定,并在管理人指定网站上披露;

2、每一集合计划份额享有同等分配权;

3、收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值;

4、收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担，与收益分配、退出集合计划的相关税负由投资者自行承担；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

（四）收益分配方案的确定与披露

收益分配方案须载明收益范围、分配对象、分配原则、分配时间、分配方式等内容。

本集合计划收益分配方案由集合计划管理人拟定，由托管人复核，由管理人通知投资者。

（五）收益分配方式

本集合计划的分红方式分为两种：现金分红与红利再投资。若投资者不选择收益分配方式，本计划默认为现金分红方式。投资者选择现金分红方式的，管理人将现金红利款划往销售机构账户，再由销售机构划入投资者账户，现金红利款自款项从集合计划资金账户划出之日起7个工作日内到达投资者账户。投资者选择采取红利再投资收益分配方式的，分红资金将按分红权益登记日的集合计划单位净值转成相应的集合计划份额，且红利再投资增加的集合计划份额计入集合计划份额规模。

投资者获得的现金分红或红利再投资份额保留小数点后两位，第三位四舍五入。

除分红权益登记日外，投资者可在计划存续期内选择变更收益分配的方式。投资者在不同募集机构参与的计划份额可以申请采取不同的收益分配方式，但投资者在某一募集机构参与的计划份额只能选择一种分红方式，且在某一募集机构申请变更收益分配方式的计划份额只能是在该募集机构参与的计划份额。”

（十八）“二十二、信息披露与报告”中“（二）临时报告”中，“（6）管理人以自有资金参与和退出；”变更为“（6）管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与和退出；”

（十九）“二十三、风险揭示”中“（二）本集合特有风险”中，新增“8、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

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资产管理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或其他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，事后单独进行信息披露和报告。若投资者不同意并退出，可能导致本计划提前终止。

本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。

（4）底层资产管理产品关联交易的特别风险揭示

由于本产品投资策略包含资产管理产品投资策略，本集合计划管理人根据宏观经济情况确定资产配置方向，选择相应策略和风格的管理人、资产管理产品进行投资，底层资产管理产品信息透明度普遍不高，一般不公开其投资组合情况，可能存在底层资产管理产品发生一般关联交易、重大关联交易而本基金管理人无法识别进而导致未能提前公

告或事后披露的风险。”

(二十)“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”中，“(一) 合同的变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会、中国证券业协会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可以在管理人安排的开放日申请退出集合计划。

2、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。投资者不同意变更的，应在公告指定的时间内提出退出本集合计划的申请；投资者未将其持有的全部集合计划退出的，视为投资者同意合同变更。变更事项自公告指定的时间开始生效，对合同各方均具有法律效力。

3、管理人应当自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并按照监管要求报送中国证监会相关派出机构。”变更为：

“(一) 合同的变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会、中国证券业协会、**证券投资基金业协会**的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。投资者特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。投资者对更新或修改的内容有异议，可以在管理人安排的开放日申请退出集合计划。

2、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5个工作日内以通过管理人网站公告或书面及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：

(1) 投资者不同意变更的，管理人保障其退出权利，投资者应在征询意见函或公告发出后的最近一个开放退出期或管理人设立的临时开放期，按照管理人公告内容的安

排提出退出本集合计划的申请；

(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；

(3) 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。如有改变资产管理计划的投资范围，除高风险类型的产品超出比例范围投资较低风险资产外，应当先行取得投资者同意；若投资者未回复意见且逾期未退出的，视同投资者不同意本合同变更，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计划(退出价格为退出申请当日资产管理计划当日净值)；

(4) 投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意变更，按照上述(1)-(2)项处理。

自合同变更生效之日起，公告内容即成为本合同组成部分。

3、管理人应当自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案。”

(二十一)“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”中，“(二)合同的终止”中，新增“6、特别的，本集合计划存续期内因投资者申请退出导致集合计划当日户数低于2户时，当日投资者的退出申请管理人有权做失败处理，本集合计划进入清算程序；10、集合计划份额净值触及止损线的情形；11、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；”

“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基金业协会备案，并按照监管要求报送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“管理人应当自资产管理计划终止之日起五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。”

(二十二)“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”中“(四)财产清算”，“6、资产管理计划财产清算报告的告知安排 清算结束后5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，将清算结果报证券投资基金业协会备案，并按照监管要求报送中国证监会相关派出机构。”变更为：

“6、资产管理计划财产清算报告的告知安排 清算结束后5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，将清算结果报证券投资基金业协会备案。”

(二十三)“二十六、争议的处理”中“(二)本合同的任何争议均应通过友好协商

解决，协商不成的，采取以下方式解决：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，仲裁费用由败诉方承担。”变更为：“（二）本合同的任何争议均应通过友好协商解决，协商不成的，采取以下方式解决：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，仲裁费用由败诉方承担。”

《说明书》、《风险揭示书》根据上述内容做相应变更。

三、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【2025】年【2】月【20】日至【2025】年【2】月【28】日在管理人网站（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【2025】年【3】月【3】日设立临时开放期，并按照《东海证券海汇周周利 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”处理投资者申请。投资者不同意变更的，应在公告指定的时间内提出退出本集合计划的申请；投资者未回复意见或未将其持有的全部集合计划退出的，视为投资者同意合同变更。具体操作如下：

1、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。

2、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（【2025】年【3】月【3】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）。

3、投资者未回复意见或未将其持有的全部集合计划退出的，视为投资者同意合同变更。

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【2025】年【3】月【4】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【2025】年【2】月【20】日起至【2025】年【2】月【28】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“东海证券海汇周周利 FOF1 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（或委托代理人）（签字或盖章）：

时间： 年 月 日 时间： 年 月 日