

关于东海证券添宁双月盈 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

尊敬的东海证券添宁双月盈 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，我司作为东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划的管理人，拟变更《东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）、《东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“说明书”）、《东海证券添宁双月盈 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》“第二十五部分 资产管理合同的变更、终止与财产清算”对合同的变更程序做出了明确约定。

二、合同变更内容

本次变更的主要内容如下表所示：

	变更前	变更后
管理人以自有资金参与本计划	<p>（一）自有资金参与的条件</p> <p>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。</p> <p>（二）自有资金的参与方式</p> <p>管理人在推广期和存续</p>	<p>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：</p> <p>1、自有资金参与的金额和比例</p> <p>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。</p> <p>2、自有资金的承担方式与收益分配</p> <p>管理人及其子公司（孙公司）自有资</p>

	<p>期内可以以自有资金参与本计划。</p> <p>（三）自有资金参与的份额比例</p> <p>自有资金参与的份额不得超过本计划总份额的10%，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。</p> <p>（四）自有资金的收益分配</p> <p>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。</p> <p>（五）自有资金的责任承担</p> <p>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</p>	<p>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。</p> <p>3、自有资金的参与、退出</p> <p>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书面方式告知托管人，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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	---

	<p>权利和义务。</p> <p>(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。</p> <p>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,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。</p> <p>(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。</p>	<p>述限制,但需事后及时告知投资者和托管人。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>参与和退出的金额</p>	<p>投资者在本计划存续期开放日购买本计划份额</p>	<p>投资者在本计划存续期开放日购买本计划份额的,投资者应符合合格投资</p>

限制	<p>的,投资者应符合合格投资者标准,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。</p>	<p>者标准,且参与金额应不低于 30 万元人民币,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。</p>
投资限制	<p>为维护投资者的合法权益,本集合计划的投资限制为:</p> <p>1、本集合计划的总资产不超过净资产的 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。</p> <p>2、本集合计划投资于同一资产的资金,不超过本集合计划资产净值的 25%; 银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>3、管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金,不超过该资产的 25% (银行活期存款、国债、中央银行票</p>	<p>为维护投资者的合法权益,本集合计划的投资限制为:</p> <p>1、本集合计划的总资产不超过净资产的 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。</p> <p>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;</p> <p>3、本集合计划投资于同一资产的资金,不超过本集合计划资产净值的 25%; 银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>4、管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金,不超过该资产的 25% (银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方</p>

	<p>据、政策性金融债、地方政府债等中国证监会认可的投资品种除外), 投资于定制的私募资管产品(即本集合计划持有一个或多个私募资产管理产品全部份额)的情况, 可豁免此限制。</p> <p>4、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。</p> <p>5、本计划投资的资产管理产品, 不得投资非标准化资产。</p> <p>6、法律、行政法规、金融监管部门对上述投资限制另有规定的, 从其规定。</p> <p>投资者在此同意, 本资产管理计划可以投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理产品。</p>	<p>政府债等中国证监会认可的投资品种除外), 投资于定制的私募资管产品(即本集合计划持有一个或多个私募资产管理产品全部份额)的情况, 可豁免此限制。</p> <p>5、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。</p> <p>6、本计划投资的资产管理产品, 不得投资非标准化资产。</p> <p>7、法律、行政法规、金融监管部门对上述投资限制另有规定的, 从其规定。</p>
<p>利益冲突及关联交易</p>	<p>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</p>	<p>一、利益冲突情形</p> <p>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:</p> <p>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</p>

<p>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。</p> <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,保护客户合法权益。</p>	<p>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;</p> <p>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;</p> <p>3、管理人及其子公司(孙公司)自有资金参与和退出本计划;</p> <p>4、法律、行政法规规定或者中国证监会认定的其他情形。</p> <p>二、利益冲突的处理</p> <p>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。</p> <p>对于开展重大关联交易,管理人应当</p>
---	--

<p>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。</p> <p>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</p> <p>(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。</p> <p>(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</p>	<p>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。</p> <p>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:</p> <p>(1) 关联交易的范围</p> <p>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。</p> <p>(2) 关联方范围及披露方式</p> <p>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。</p> <p>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</p>
---	---

	<p>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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p>	<p>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</p> <p>（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。</p> <p>（3）一般关联交易、重大关联交易的区分标准</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	---	--

		<p>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“二十五、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“二十五、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。</p> <p>(4)管理人对关联方交易的内部管控机制</p> <p>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> <p>1) 禁止以下关联交易</p> <p>A、利用资产管理产品资产向管理人、托管人出资；</p> <p>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</p>
--	--	---

		<p>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;</p> <p>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;</p> <p>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。</p> <p>2) 在投资决策方面</p> <p>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:</p> <p>A、董事会授权经营管理层审议批准以下关联交易:</p> <p>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;</p> <p>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。</p> <p>B、管理人董事会审议批准以下关联交</p>
--	--	---

		<p>易：</p> <p>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。</p> <p>C、管理人股东大会审议批准以下关联交易：</p> <p>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。</p> <p>3) 在交易定价机制方面</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>
--	--	---

		<p>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。</p> <p>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。</p>
固定管理费	<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 1.00% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 1.00\% \div 365$ H 为每日应计提的管理费 E 为前一日的集合计划资产净值（产品成立首日按推广期参与资金及其推广期内产生的利息的总额计算）。</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 0.80% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.80\% \div 365$ H 为每日应计提的管理费 E 为前一日的集合计划资产净值（产品成立首日按推广期参与资金及其推广期内产生的利息的总额计算）。</p> <p>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。</p>
业绩报酬计提基准	<p>本集合计划业绩报酬计提基准 F 为 5.8%/年。</p>	<p>本集合计划业绩报酬计提基准 F 为 5.20%/年。</p>
收益分配原则	<p>本计划存续期内，管理人可以对计划份额进行收益分配，具体收益分配次数、分配比例、分配时间届时见管理人公告。</p>	<p>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。</p>

《合同》、《说明书》以及《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”，“委托资金”变更为“受托资金”，“委托人”变更为“投资者”。

详细修改内容以《合同》（第二版）为准，《说明书》、《风险揭示书》作相应变更。

《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、4】日设立临时开放期，并按照《东海证券添宁双月盈 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》“第二十五部分 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、对于临时开放期时处于持有期的份额的退出申请，将由管理人办理强制退出计划。

2、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。

3、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【4】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）。

4、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【5】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“东海证券添宁双月盈 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