

关于《东方财富证券双享FOF集合资产管理计划资产管理合同》变更 委托人征询及临时开放期的公告

东方财富证券双享FOF集合资产管理计划(以下简称“本计划”)已成立,为了更好的服务客户,东方财富证券股份有限公司(以下简称“我司”)经与本计划托管人宁波银行股份有限公司协商一致,根据本计划《东方财富证券双享FOF集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“资产管理合同”)的约定,拟对《资产管理合同》项下开放参与日条款进行变更,本次《资产管理合同》变更的具体内容详见本公告附件(关于估值方法的调整已于2021年12月31日进行了相关征询公告后生效,本次合同变更将同步体现已生效的最新估值方法)。

根据《资产管理合同》第34部分第2条的约定:“由于其他原因需要变更合同的,以及本计划改变投向和比例的,由管理人、委托人和托管人协商一致进行合同变更,变更程序包括:管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人应及时通过管理人网站向委托人发出合同变更及征询公告。如果委托人未在合同变更及征询公告后的3个工作日内提出异议的,应视为其同意进行合同变更。若委托人不同意变更的,管理人保障其退出集合计划的权利。不同意合同变更的委托人可在公告日起至合同变更生效日内的开放期退出本集合计划;如在公告日起至合同变更生效日内无开放期,则管理人将合同变更生效日前一工作日设置为临时开放期,不同意合同变更的委托人可在管理人设置的临时开放期内退出本集合计划,合同变更生效日以管理人公告为准。未在前述时间回复意见,以及未在开放期或临时开放期内退出的委托人,均视为同意本合同变更。”。

管理人现通过公告方式向委托人征询本次合同变更意见,本次合同变更生效日拟定为2022年2月21日,管理人将合同变更生效日前一工作日设置为临时开放期。

委托人可通过本公司官网(www.18.cn)或本集合计划推广营业部网点了解本次公告情况。如有任何疑问,请咨询本集合计划推广机构网点工作人员。

衷心感谢您一直以来对我司产品的大力支持。

特此公告。



东方财富证券股份有限公司

2022年2月15日

- 附件1：东方财富证券双享FOF集合资产管理计划资产管理合同变更对照表
- 附件2：东方财富证券双享FOF集合资产管理计划资产管理合同（第二版）



东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划

资产管理合同变更对照表

《东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“资产管理合同”)本次变更的主要内容包括:

1. 对《资产管理合同》项下第 5 部分第 (十三) 款“封闭期、锁定期及流动性安排”第 2 条作如下变更:

原条款	现条款
(2) 开放期: 本集合计划成立满 6 个月后, 每月的 20 日、21 日、22 日、23 日为参与开放日, 开放申购, 如遇法定节假日则依次顺延。本集合计划成立满 6 个月后每自然季度 (2、5、8、11 月) 的 23 日为退出开放日。如遇法定节假日按合同顺延至该日之后最近一个交易日。管理人有权拒绝委托人对于处于锁定期内份额的退出申请。	(2) 开放期: 本集合计划成立后, 每月的 20 日、21 日、22 日、23 日为参与开放日, 开放申购, 如遇法定节假日则依次顺延。本集合计划成立后每自然季度 (2、5、8、11 月) 的 23 日为退出开放日。如遇法定节假日按合同顺延至该日之后最近一个交易日。管理人有权拒绝委托人对于处于锁定期内份额的退出申请。

2. 对《资产管理合同》项下第 8 部分第 (一) 款“集合计划的参与”第 1 条“参与的场所及办理时间”第 (3) 项“存续期参与”作如下变更:

原条款	现条款
(3) 存续期参与 本集合计划存续期间, 投资者可在参与开放期办理参与事宜。 本计划成立后 6 个月后每月的 20 日、21 日、22 日、23 日为参与开放日, 如遇法定节假日则依次顺延。委托人每笔份额持有时间不得少于 180 个自然日, 但本合同另有约定的除外。委托人可在参与开放期依法参与本计划。	(3) 存续期参与 本集合计划存续期间, 投资者可在参与开放期办理参与事宜。 本计划成立后每月的 20 日、21 日、22 日、23 日为参与开放日, 如遇法定节假日则依次顺延。委托人每笔份额持有时间不得少于 180 个自然日, 但本合同另有约定的除外。委托人可在参与开放期依法参与本计划。

3. 对《资产管理合同》项下第 13 部分第 (八) 款“投资策略”第 4 条“投资策略的变更”作如下变更:

原条款	现条款
4、投资策略的变更 经委托人、管理人之间协商一致可对投资政策进行变更, 变更投资政策应以书面形式做出并通知托管人。投资政策变更应为调	4、投资策略的变更 经委托人、管理人、托管人三方协商一致并履行合同变更程序后, 可对投资政策进行变更。投资政策变更应为调整投资组合留

整投资组合留出必要的时间。	出必要的时间。
---------------	---------

根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）等规定及管理人于2021年12月31日发布的《关于东方财富证券双享FOF集合资产管理计划估值方法调整的提示性公告》，已调整的估值相关修改内容将同步体现于《资产管理合同》项下第23部分第（七）款第1条“固定收益品种的估值方法”、第3条“投资证券投资基金的估值方法”：

原条款	现条款
<p>1、固定收益品种的估值方法</p> <p>（1）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>（2）在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>（3）在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>（4）首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。</p> <p>（5）在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格。</p> <p>（6）中小企业私募债按照成本估值。</p> <p>（7）在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（6）小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项</p>	<p>1、固定收益品种的估值方法</p> <p>（1）同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>（2）在证券交易所市场挂牌交易的债券，采用第三方估值机构（中证）提供的价格数据确定公允价值并进行估值。</p> <p>（3）首次发行未上市债券，采用第三方估值机构（中证）提供的价格数据确定公允价值并进行估值，在第三方估值机构未能提供价格数据的情况下，采用估值技术确定的公允价值进行估值。</p> <p>（4）银行间市场的固定收益品种，采用第三方估值机构（中债）提供的价格数据确定公允价值并进行估值。</p> <p>（5）在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）—（4）小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）—（4）小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>

原条款	现条款
<p>第（1）－（6）小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>	
<p>3、投资证券投资基金的估值方法</p> <p>持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）、创新型分级基金等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；</p> <p>持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；</p> <p>持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；</p> <p>场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照第（1）条规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照第（2）条规定的方法估值。</p> <p>持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。</p> <p>在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）－（5）项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）－（5）项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>	<p>3、投资证券投资基金的估值方法</p> <p>（1）持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）、创新型分级基金等），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> <p>（2）持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日的基金份额净值估值；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值。</p> <p>（3）持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日的每万份收益计提红利。</p> <p>（4）场内持有的分级基金的母基金，按照取得成本确认成本。母基金能够在交易所交易的，按照第（1）条规定的方法估值；不能在交易所交易的，按照第（2）条规定的方法估值。</p> <p>（5）持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值。</p> <p>在任何情况下，资产管理人如采用本项第（1）－（5）项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第（1）－（5）项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>



附件：《关于东方财富证券双享 FOF 集合资产管理计划估值方法调整的提示性公告》