# 关于《东方财富证券稳选1号F0F集合资产管理计划资产管理合同》

#### 变更的公告

东方财富证券稳选1号FOF集合资产管理计划(以下简称"本计划")自成立以来,坚持规范运作,稳健运营。为了更好地服务客户,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《资产管理合同》的约定, 拟对《资产管理合同》项下参与退出及流动性安排、追加金额、退出费等进行变更,具体内 容见附件。

根据《资产管理合同》第31部分第2条约定: "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。另外,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。"本次《资产管理合同》变更管理人与托管人已达成一致, 详见附件《关于〈东方财富证券稳选1号FOF集合资产管理计划资产管理合同>变更的托管人征 询意见函》。管理人现通过官网公告本次变更,并将在公告后1个工作日内通过管理人网站向 委托人发送合同变更征询意见。

特此公告。



附件: 东方财富证券稳选1号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更对照表

## 东方财富证券稳选1号F0F集合资产管理计划

## 资产管理合同变更对照表

#### 一、本次《资产管理合同》的变更对比

1、《资产管理合同》项下第5部分第(七)条"封闭期、锁定期及流动性安排"

变更前	变更后
2、固定开放期:本集合计划成立满12个月 后 <b>每月的前2个交易日为固定开放期。开放</b> 期内投资者可办理参与和/或退出申请。	2、固定开放期:本集合计划成立满12个月 后,每周第一个交易日为参与开放日,开放 申购;每月的最后一个交易日为退出开放 日,开放赎回。本计划开放赎回采用预约机 制,退出开放日当天不接受赎回申请。委托 人应按照本计划合同约定的退出程序,在退 出开放日前三个交易日之前提前申请退出。

2、《资产管理合同》项下第5部分第(九)条"参与本集合计划的最低金额"

变更前	变更后
单个委托人首次参与的最低金额为40万元。 对于已经是本集合计划的持有人,其追加参 与资金金额最低为人民币1元;将红利再投 资本集合计划的份额不受上述限制。 在推广期或开放期内,委托人可多次参与, 参与一经受理不得撤销。委托人参与本集合 计划采取全额缴款的方式。	单个委托人首次参与的最低金额为 40 万元 (不含认购/申购费)。对于已经是本集合计 划的持有人,其追加参与资金金额最低为人 民币1万元(不含认购/申购费);将红利再 投资本集合计划的份额不受上述限制。 在推广期或开放期内,委托人可多次参与, 参与一经受理不得撤销。委托人参与本集合 计划采取全额缴款的方式。

3、《资产管理合同》项下第6部分第(一)条第1款"参与的场所及办理时间"

变更前	变更后
(3)存续期参与	(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。
本集合计划成立满 12 个月后每月的前 2 个 交易日为固定开放期。开放期内投资者可办 理参与和/或退出申请。	本集合计划成立满 12 个月后,每周第一个 交易日为参与开放日,开放申购。委托人可 在参与开放期依法参与本计划。

4、《资产管理合同》项下第6部分第(五)条第1款"退出的场所及办理时间"

变更前	变更后
1、退出的办理时间 退出在开放期或临时开放期办理。	<ol> <li>1、退出的场所及办理时间</li> <li>本集合计划的退出将通过销售机构进行。投资者应当在销售机构办理集合计划销售业</li> <li>务的营业场所或按销售机构提供的其他方</li> <li>式办理集合计划份额的参与和退出。</li> <li>本计划委托人参与的份额,可按本合同约定</li> </ol>

王王

	在退出开放期申请办理退出。自本计划成立
	后,每月的最后一个交易日为退出开放日,
Res	开放赎回。但委托人因不同意合同变更(或
12 the - 1 17	展期)或管理人因自有资金参与比例超标在
and the second	临时开放期退出集合计划的,不受该限制,
	临时开放期的具体安排以管理人届时公告
	为准。

5、《资产管理合同》项下第6部分第(五)条第3款"退出的程序和确认"

变更前	变更后
(1)退出申请的提出	(1)退出申请的提出
集合计划委托人必须根据集合计划推广机	集合计划委托人必须根据集合计划销售机
构规定的手续,向集合计划推广机构提出退	构规定的手续,向集合计划销售机构提出退
出的申请。	出的申请。每个退出开放日的前三个交易日
	之前为预约赎回期,委托人可以在预约赎回
	期内提出赎回申请。集合计划委托人拟在退
	出开放日(T日)赎回本计划份额的,应于
	T-3日前提交赎回申请。管理人在退出开放
	日(T日)依据提前收到的赎回申请处理赎
	回。未在 T-3 日前提交赎回申请的, 管理人
	有权拒绝处理该笔份额在本退出开放日的
人民政策的关系是基本的任此人的任何的	赎回。

6、《资产管理合同》项下第6部分第(五)条第4款"退出费及退出金额的计算"

变更前		变更后	
(1)退出费用		(1) 退出费用	
自本计划《东方财富证券稳选1号 FOF 集合		申请退出本集合计划时须按	退出份额的持有
资产管理合同》生效后参与的投资者,申请		期限缴纳退出费,具体退出势	
退出本集合计划时须按退出他		份额持有期限(D)	退出费率
缴纳退出费,具体退出费率如	1下:	0≤D<180个自然日	0.50%
份额持有期限 (D)	退出费率	D≥180个自然日	0%
0≤D<60个自然日	0. 50%	退出费用计入资产管理计划则	才产。
60≤D<180个自然日	0. 30%	特别地,在本计划《东方财	
D≥180个自然日	0%	FOF 集合资产管理合同(第二	
在本计划《东方财富证券稳选1号FOF集合资产管理合同》生效前参与的投资者,其在本计划《东方财富证券稳选1号FOF集合资产管理合同》生效前所持份额可免除退出费,		认的投资者份额,经投资者:	
		可依照原《东方财富证券稳述	
		资产管理合同》退出费用规则	
		件的投资者应当在申请退出	
符合条件的投资者应当在申请	青退出前通知管	未在上述时间通知管理人的,	视为放弃; 在
理人, 未在上述时间通知管理	里人的,视为放	本计划《东方财富证券稳选	
弃退出费折扣;其在本计划《东方财富证券		产管理合同(第二版)》生效)	
稳选1号FOF集合资产管理合同》生效后追		份额,退出费率依照本计划	
加购买本计划的份额,退出费率依照本计划		稳选1号FOF集合资产管理台	
《东方财富证券稳选1号 FOF 集合资产管理		执行。	
合同》执行。			

7、《资产管理合同》项下第20部分第(七)条"投资资产组合的流动性与参与、退出

安排相匹配"

变更前	变更后
本计划将选择开放退出频率不低于本计划	本计划拟投资的子产品有较好的流动性,并
提取频率的子产品,子产品的开放期安排与	进行以下安排确保本计划投资的子产品组
本计划的追加提取安排相匹配。在确定总体	合与本计划的开放期安排相匹配:
流动性要求的基础上,结合不同类型货币市	1、为保障客户资金的流动性,管理人在开
场工具的流动性和货币市场预期收益水平、	放期内确保本集合计划资产组合中7个工
银行存款的期限来确定现金类资产的配置,	作日可变现资产的价值,不低于本计划资产
定期对现金类资产组合平均剩余期限以及	净值的10%。
投资品种比例进行适当调整,以保证计划资	2、本计划全部资产投资于标准化资产、主
产的流动性。	动投资流动性受限资产的市值在开放退出
因委托资产流动性受限或无法变现等原因	期内合计不得超过资产管理计划资产净值
造成委托人无法足额提取现金委托资产的,	的 20%。
管理人可以全部或部分拒绝委托人的提取	3、本计划将在确定总体流动性要求的基础
申请,无须承担任何责任。如遇特殊情况,	上,结合不同类型货币市场工具的流动性和
委托人与管理人、托管人协商一致,可另行	货币市场预期收益水平、银行存款的期限来
处理,但不得违反法律、法规的相关规定。	确定现金类资产的配置,定期对现金类资产
的复数形式 化化化化化化化化化化化化化化化	组合平均剩余期限以及投资品种比例进行
医保持和原外在自己外侧 不同所用还有	适当调整,以保证集合计划在开放期内资产
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	的流动性。
二氯氯六 网络加克克西德斯拉拉马尔	因委托资产流动性受限或无法变现等原因
	造成委托人无法足额提取现金委托资产的,
	管理人可以全部或部分拒绝委托人的提取
	申请,无须承担任何责任。如遇特殊情况,
	委托人与管理人、托管人协商一致,可另行
· · · · · · · · · · · · · · · · · · ·	处理,但不得违反法律、法规的相关规定。

記券

101

8、《资产管理合同》项下第29部分第(二)条第12款"其他风险"

变更前	变更后
(4) 关联交易风险	(4) 关联交易风险
本计划可以将集合计划的资产投资于管理	本计划可以将集合计划的资产投资于管理
人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、	人、托管人及与管理人、托管人的控股股东、
实际控制人或其关联方发行的证券或者承销	实际控制人或其关联方发行的证券或者承销
期内承销的证券,也可以投资于管理人及管	期内承销的证券,也可以投资于管理人及管
理人关联方所设立的资产管理产品。此种投	理人关联方所设立的资产管理产品。此种投
资、交易行为构成关联交易,存在被监管层	资、交易行为构成关联交易,存在被监管层
否定的政策风险和相应的关联交易风险。若	否定的政策风险和相应的关联交易风险。若
本计划投资运作中发生此类关联交易,管理	本计划投资运作中发生此类关联交易,管理
人将事后及时以公告或季度管理报告的方式	人应于交易完成后 5 个工作日内通过管理人
向投资者披露。	网站以公告方式告知投资者和托管人,并及
	时将关联交易结果向中国证监会相关派出机
	构和证券投资基金业协会报告,投资于证券
	期货的关联交易还应当向证券期货交易所报

告。

## 二、本次《资产管理合同》纳入前期已变更生效的最新估值方法

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 30 日发布的《关于东方财富证券稳选 1 号 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 17 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":

变更前	变更后
1、固定收益品种的估值方法	1、固定收益品种的估值方法
(1) 同一债券同时在两个或两个以上市场交	(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。	易的,按债券所处的市场分别估值。
(2) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交	(2)在证券交易所市场挂牌交易的债券,采
易的债券按估值日收盘价估值;估值日无交	用第三方估值机构(中证)提供的价格数据
易的,且最近交易日后经济环境未发生重大	确定公允价值并进行估值。
变化,按最近交易日的收盘价估值;如果估	(3) 首次发行未上市债券,采用第三方估值
值日无交易,且最近交易日后经济环境发生	机构(中证)提供的价格数据确定公允价值
了重大变化的,可参考监管机构和行业协会	并进行估值,在第三方估值机构未能提供价
估值意见,或者参考类似投资品种的现行市	格数据的情况下,采用估值技术确定的公允
价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,	价值进行估值。
确定公允价值进行估值。	(4)银行间市场的固定收益品种,采用第三
(3) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价	方估值机构(中债)提供的价格数据确定公
交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券	允价值并进行估值。
应收利息得到的净价进行估值; 估值日无交	(5)在任何情况下,资产管理人如采用本项
易的,且最近交易日后经济环境未发生重大	第(1)-(4)小项规定的方法对计划资产
变化,按最近交易日债券收盘价减去所含的	进行估值,均应被认为采用了适当的估值方
债券应收利息得到的净价估值;如果估值日	法。但是,如果资产管理人认为按本项第(1)
无交易,且最近交易日后经济环境发生了重	一(4)小项规定的方法对计划资产进行估值
大变化的,可参考监管机构和行业协会估值	不能客观反映其公允价值的,资产管理人在
意见,或者类似投资品种的现行市价及重大	综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、
变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公	收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估
允价值进行估值。	值,资产管理人可根据具体情况与资产托管
(4) 首次发行未上市债券采用估值技术确定	人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。
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。	SHARES STORESHOW AND ST
(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	RY ADDARS STUDIES AND SHIT
率曲线及估值价格。	方式由于新期型资源方参会10MK-10K-84
(6) 中小企业私募债按照成本估值。	
(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。	
3、投资证券投资基金的估值方法	3、投资证券投资基金的估值方法
(1) 持有的交易所上市基金(包括封闭式基	(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、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	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	估值;估值日无交易的,以最近交易日的收益
盘价估值;如果估值日无交易,且最近交易	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	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	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	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:	交易日收盘价,确定公允价值进行估值。
(2) 持有的场外基金(包括托管在场外的上	(2)持有的场外基金(包括托管在场外的上
市开放式基金(LOF)),按估值日前一交易日	
的基金份额净值估值;估值日前一交易日基	市开放式基金(LOF)),按估值日的基金份额
金份额净值无公布的,按此前最近交易日的	净值估值;估值日基金份额净值无公布的,
基金份额净值估值;	按此前最近交易日的基金份额净值估值。
(3) 持有的货币市场基金,按基金管理公司	(3) 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	公布的估值日的每万份收益计提红利。
红利:	(4)场内持有的分级基金的母基金,按照取
(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
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
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
交易所交易的,按照第(2)条规定的方法估	
值。	(5) 持有的基金处于封闭期的,按照最新公
四。 (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。
布的份额净值估值;没有公布份额净值的,	(6) 在任何情况下,资产管理人如采用本项
按照成本估值。	第(1)-(5)项规定的方法对委托财产进行
(6) 在任何情况下,资产管理人如采用本项	估值,均应被认为采用了适当的估值方法。
第(1)-(5)项规定的方法对委托财产进行	但是,如果资产管理人认为按本项第(1)-
估值,均应被认为采用了适当的估值方法。	(5)项规定的方法对委托财产进行估值不能
但是,如果资产管理人认为按本项第(1)-	客观反映其公允价值的,资产管理人可根据
(5)项规定的方法对委托财产进行估值不能	具体情况,并与资产托管人商定后,按最能
(5)项规定的方法为安托财产进行佔值不能 客观反映其公允价值的,资产管理人可根据	反映公允价值的价格估值。
具体情况,并与资产托管人商定后,按最能 反映公众价值的价格件值	
反映公允价值的价格估值。	

奈 成頭公、

•

,