

东海证券股份有限公司

关于以通讯方式召开东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划 份额持有人大会的第二次提示性公告

东海证券股份有限公司(以下简称“集合计划管理人”)已于 2025 年 4 月 11 日在《上海证券报》及东海证券股份有限公司网站(www.longone.com.cn)发布了东海证券股份有限公司关于以通讯方式召开东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》。并于 2025 年 4 月 12 日在上述报纸和网站上发布了《东海证券股份有限公司关于以通讯方式召开东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会的第一次提示性公告》。为了使本次集合计划份额持有人大会顺利召开，现发布关于召开本次会议的第二次提示性公告。

一、召开会议基本情况

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)和《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“《集合计划合同》”)的有关规定，东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划(集合计划份额代码：970082，以下简称“本集合计划”)的管理人东海证券股份有限公司(以下简称“集合计划管理人”)经与本集合计划托管人兴业银行股份有限公司(以下简称“集合计划托管人”)协商一致，决定以通讯方式召开本集合计划的集合计划份额持有人大会，审议《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案》，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自 2025 年 4 月 16 日起至 2025 年 5 月 16 日 17:00 止(纸质投票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的，投票表决时间以表决票收件人收到表决票时间为准；电话、短信授权以集合计划管理人相应系统记录时间为准)

3、会议计票日：表决截止日后 2 个工作日内

4、会议纸质表决票的寄达地点：

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：董小燕

联系电话：021-20333819

通过专人送交、邮寄送达的，请在信封背面注明系用于集合计划份额持有人大会表决之用（如“东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决专用”）。

二、会议审议事项

本次会议审议事项为《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案》（见附件一）。

上述议案的说明请参见《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金议案的说明》（见附件四）。

三、权益登记日

本次会议的权益登记日为 2025 年 4 月 15 日，即该日交易时间结束后，在本集合计划登记机构登记在册的本集合计划份额持有人或其授权的代理人均有权参加本次集合计划份额持有人大会并表决。

四、投票方式

（一）纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次持有人大会的纸质表决票见附件二。本集合计划份额持有人可通过剪报、复印或登录集合计划管理人网站（www.longone.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载并打印表决票。

2、本集合计划份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人有效身份证件正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经授权的业务章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门

的批文或登记证书复印件等)；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章(如有)或由授权代表在表决票上签字(如无公章)，并提供该授权代表的有效身份证件正反面、护照或其他身份证明文件的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

(3) 以上各项及本公告全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等文件，以本集合计划管理人的认可为准。

3、集合计划份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2025年4月16日起至2025年5月16日17:00止(以表决票收件人收到表决票的时间为准)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：董小燕

联系电话：021-20333819

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份额持有人大会表决之用(如“东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决专用”)。

(二) 其他投票方式

集合计划管理人可以根据实际需要，增加或调整本次持有人大会的投票方式并在规定媒介上公告。

五、授权

为便于集合计划份额持有人有尽可能多的机会参与本次会议，使集合计划份额持有人在本次会议上充分表达其意志，集合计划份额持有人除可以直接投票外，还可以授权他人代其在集合计划份额持有人大会上投票。根据法律法规的规定及《集合计划合同》的约定，集合计划份额持有人授权他人在集合计划份额持有人大会上表决需符合以下规则：

（一）委托人

本集合计划的集合计划份额持有人可委托他人代理行使本次集合计划份额持有人大会的表决权。

集合计划份额持有人授权他人行使表决权的票数按该集合计划份额持有人在权益登记日所持有的全部集合计划份额数计算，一份集合计划份额代表一票表决权。集合计划份额持有人在权益登记日未持有本集合计划份额的，授权无效。

集合计划份额持有人在权益登记日是否持有集合计划份额以及所持有的集合计划份额的数额以登记机构的登记为准。

（二）受托人（代理人）

集合计划份额持有人可以委托本集合计划管理人以及其他符合法律规定的机构和个人，代为行使本次集合计划份额持有人大会的表决权。

（三）授权方式

本集合计划的集合计划份额持有人可通过纸面、电话和短信的方式授权受托人代为行使表决权。份额持有人通过纸面方式授权的，授权委托书的样本请见本公告附件三。集合计划份额持有人可通过剪报、复印或登录集合计划管理人网站（www.longone.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载并打印等方式获取授权委托书样本。

1、集合计划份额持有人进行纸面授权所需提供的文件：

（1）个人集合计划份额持有人委托他人投票的，应由受托人在表决票上签字或盖章，并提供由委托人填妥并签署的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）、集合计划份额持有人的有效身份证件正反面复印件。如受托人为个人，还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件；如受托人为机构，还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等）。

（2）机构集合计划份额持有人委托他人投票的，应由受托人在表决票上签字或加盖公章，并提供由委托人填妥的授权委托书原件（授权委托书的格式可参考附件三的样本）并在授权委托书上加盖该机构公章、该机构持有人加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事

业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。如受托人为个人,还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。合格境外机构投资者委托他人投票的,应由受托人在表决票上签字或加盖公章,并提供由委托人填妥的授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件三的样本)并在授权委托书上加盖该机构公章(如有)或由授权代表签字(如无公章)、该授权代表的有效身份证件正反面、护照或其他身份证明文件的复印件,该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件,并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。如受托人为个人,还需提供受托人的有效身份证件正反面复印件;如受托人为机构,还需提供该受托人加盖公章的企业法人营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或登记证书复印件等)。

(3) 以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等,以集合计划管理人的认可为准。

(4) 授权文件的送达

份额持有人授权文件的送达方式、送达时间、收件地址、联系方式等与表决票送达要求一致。

2、电话授权(仅适用于个人集合计划份额持有人)

为方便集合计划份额持有人参与集合计划份额持有人大会投票,自2025年4月16日起至2025年5月16日17:00止(以集合计划管理人系统记录时间为准),集合计划份额持有人可拨打集合计划管理人客服电话(95531)并按提示转人工坐席,待确认份额持有人同意参与本次份额持有人大会并授权集合计划管理人进行投票,并以回答集合计划管理人人工坐席提问方式核实身份后,由人工坐席根据集合计划份额持有人意愿进行授权记录从而完成授权。集合计划管理人也可主动与预留联系方式的集合计划份额持有人取得联系,待确认份额持有人同意参与本次份额持有人大会并授权集合计划管理人进行投票,并在通话过程中以回答集

合计划管理人人工坐席提问方式核实集合计划份额持有人身份后,由人工坐席根据集合计划份额持有人意愿进行授权记录从而完成授权。

集合计划管理人核实份额持有人身份的提问包括但不限于份额持有人姓名、身份证号及预留手机号等。

为保护集合计划份额持有人利益,整个通话过程将被录音。集合计划份额持有人通过电话授权的方式仅适用于个人集合计划份额持有人,对机构集合计划份额持有人暂不开通。

3、短信授权(仅适用于个人集合计划份额持有人)

为方便集合计划份额持有人参与集合计划份额持有人大会投票,自2025年4月16日起至2025年5月16日17:00止(以集合计划管理人指定短信平台收到表决票时间为准),集合计划管理人通过指定短信平台向预留手机号码的权益登记日登记在册的个人集合计划份额持有人发送征集授权短信,集合计划份额持有人回复短信表明授权意见。

(1) 短信授权意见内容为“同意授权管理人投票+姓名+身份证件号码+海鑫尊利+同意/反对/弃权”,三种表决意见中必须选择一种且只能选择一种表决意见。例如,集合计划份额持有人同意本议案,则短信授权意见应为“同意授权管理人投票+姓名+身份证件号码+海鑫尊利+同意”。请个人投资者务必按照上述格式要求回复短信。

(2) 对于选择短信授权的集合计划份额持有人,其短信回复的内容不完整或有其他不符合要求的情况下,在投票截止前,集合计划管理人可以选择通过电话回访确认,从而按照公告要求完成电话授权。集合计划份额持有人通过短信授权的方式仅适用于个人持有人,对机构持有人暂不开通。为保护集合计划份额持有人利益,上述所有通话过程将被录音。因运营商原因导致集合计划份额持有人无法获取短信进行授权的情况,请投资者选择集合计划管理人认可的其他方式进行授权。

4、授权效力确定规则

(1) 如果同一集合计划份额存在多次以有效纸面方式授权的,以时间在最后一次送达集合计划管理人的纸面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项,不能确定最后一次纸面授权的,若授权表示一致,以一致的授权表示为准;若授

权表示不一致，视为无效授权；

（2）如果同一集合计划份额存在多次非纸面方式授权的，以时间在最后一次送达集合计划管理人的非纸面授权为准。如最后时间收到的授权委托有多项，不能确定最后一次非纸面授权的，若授权表示一致，以一致的授权表示为准；若授权表示不一致，视为无效授权；

（3）同一委托人存在有效的纸面授权和有效的其他方式授权的，以有效的纸面授权为准。

（4）如委托人既进行委托授权，自身又送达了有效表决票，则以自身有效表决票为准。

（5）份额持有人的授权意见代表份额持有人在权益登记日所持有全部集合计划份额的授权意见。

5、授权时间

上述授权有效期自授权之日起至审议上述事项的份额持有人大会会议结束之日止。若本集合计划重新召开审议相同议案的持有人大会的，除非授权文件另有载明，上述授权继续有效。但如果授权方式发生变化或者份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集份额持有人大会的通知。

六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由本集合计划管理人授权的两名监督员在集合计划托管人（兴业银行股份有限公司）授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。集合计划托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2、权益登记日登记在册的集合计划份额持有人所持有每份集合计划份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下：

（1）表决票通过专人送交或邮寄送达本公告规定的收件人的，表决时间以集合计划管理人收到时间为准。2025年5月16日17:00以后送达集合计划管理人的，为无效表决。

（2）表决票的效力认定：

①纸质表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达集合计划管理人的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

②如表决票上的表决意见未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

③如表决票上签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明集合计划份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达集合计划管理人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

④集合计划份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

A.送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

B.送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票；

C.送达时间按如下原则确定：专人送达的以实际递交时间为准，邮寄的以集合计划管理人收到的时间为准。

七、决议生效的条件

本次会议召开的条件为：本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一（含二分之一）。

本次会议表决的票数要求为：《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案》须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

集合计划份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，集合计划管理

人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。集合计划份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人应当执行生效的集合计划份额持有人大会的决议。生效的集合计划份额持有人大会决议对全体集合计划份额持有人、集合计划管理人、集合计划托管人均有约束力。

八、二次召集集合计划份额持有人大会及二次授权

根据《基金法》及《集合计划合同》的规定，本次持有人大会需要参加大会的集合计划份额持有人或其各自代理人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一（含二分之一），方可召开。如果本次集合计划份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，集合计划管理人可在本次公告的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就同一议案重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会，应当由代表本集合计划在权益登记日集合计划总份额三分之一以上（含三分之一）集合计划份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见。

重新召开集合计划份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次集合计划份额持有人大会授权期间集合计划份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者集合计划份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集集合计划份额持有人大会的通知（如有）。

九、本次持有人大会相关机构

1、召集人：东海证券股份有限公司

联系地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦

联系人：董小燕

客户服务联系电话：95531

传真：021- 50498827

网址：www.longone.com.cn

2、集合计划托管人：兴业银行股份有限公司

联系地址：上海市浦东新区银城路167号

联系电话：021-52629999

网址：www.cib.com.cn

3、公证机关：上海市东方公证处

联系地址：上海市静安区凤阳路660号

联系人：林奇

联系电话：021-62178903

邮政编码：200041

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

联系电话：021-31358666

十、重要提示

1、请集合计划份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票。

2、根据《集合计划合同》的规定，本次集合计划份额持有人大会费用以及会计师费、律师费等相关费用可从集合计划资产列支。

3、本次集合计划份额持有人大会有关公告可通过本集合计划管理人网站（www.longone.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅，投资者如有任何疑问，可致电本集合计划管理人客户服务电话 95531 咨询。

4、本公告的有关内容由东海证券股份有限公司负责解释。

附件一：关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案

附件二：东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决票

附件三：东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会授权委托书

附件四：关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金议案的说明

特此公告。

东海证券股份有限公司

2025 年 4 月 14 日

附件一：

关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划 更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案

东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人：

东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划（集合计划份额代码：970082，以下简称“本集合计划”）经中国证监会2021年9月14日《关于准予东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2021〕2930号）准予，由东海证券“东风2号”集合资产管理计划对标公开募集证券投资基金法律法规的要求整改规范及合同变更而来，本集合计划管理人为东海证券股份有限公司（以下简称“集合计划管理人”、“东海证券”），集合计划托管人为兴业银行股份有限公司。《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）于2021年12月6日生效。

《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39号，以下简称“《操作指引》”）及资产管理合同第四部分“集合计划的基本情况”对本集合计划存续期限的约定“自《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》生效至2025年6月6日。本集合计划自2025年6月6日后，按照中国证监会相关规定执行。”。鉴于以上情况，综合考虑份额持有人需求及本集合计划的长远发展，为充分保护份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《操作指引》等法律法规的规定及资产管理合同的约定，集合计划管理人与集合计划托管人协商一致，提议本集合计划变更注册，将集合计划管理人由东海证券变更为集合计划管理人子公司东海基金管理有限责任公司（以下简称“东海基金”），东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划拟相应变更为东海润兴债券型证券投资基金，并调整相关费率、份额类别设置、估值方法、投资范围、投资策略、投资限制等内容。

本次变更的主要内容包括但不限于：

1、管理人变化：由东海证券变更为东海基金。

2、产品名称变化：由东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划变更为东海润兴债券型证券投资基金。

3、管理费率变化：由0.5%/年变更为0.30%/年。

4、投资范围变化：

由“本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本集合计划不直接买入股票，也不参与新股申购和新股增发，因所持可转换债券转股形成的股票、可交换债券换股形成的股票，本集合计划应在其可交易之日起10个交易日内卖出。”

变更为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券”。

具体修改内容和程序详见《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金议案的说明》（附件四）。

为保证顺利实施本集合计划变更注册的方案，本次持有人大会议案通过后，集合计划管理人将根据相应要求暂停本集合计划的申购、赎回业务，暂停申购、赎回的具体安排以后续公告为准，请投资者注意查看。修改后的基金合同等法律文件自基金管理人东海基金公告的生效之日起生效，后续重新开放申购赎回业务办理时间亦以基金管理人东海基金公告为准，请投资者注意查看并合理安排资金。

对于通过原为本集合计划的销售机构购买、且该销售机构已与东海基金签订

基金销售服务协议（具体机构名称以集合计划管理人届时发布的公告为准）、在赎回选择期末赎回集合计划份额的投资者，截至《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日的前一日其仍然持有的集合计划份额，将在《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日自动变更为东海润兴债券型证券投资基金A类基金份额。基金份额持有人可在《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效后依据《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》的约定，在原销售机构对相应基金份额进行赎回及其他交易。

对于通过原为本集合计划的销售机构购买、但该销售机构未与东海基金签订基金销售服务协议（具体机构名称以集合计划管理人届时发布的公告为准）、在赎回选择期末赎回集合计划份额的投资者，截至《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日的前一日其仍然持有的集合计划份额，将在《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日统一变更为东海润兴债券型证券投资基金A类基金份额，并暂时登记至东海基金在中国证券登记结算有限责任公司开立的临时账户上。投资者在《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日后可通过东海基金或东海基金指定的销售机构（包括东海证券）提交申请进行重新确认和登记，将对应份额确认至投资者的基金账户上。申请确认份额的投资者必须首先在东海基金直销柜台或东海润兴债券型证券投资基金其他销售机构的销售网点（包括东海证券的营业网点）办理基金账户开立手续，具体开立基金账户规则以基金登记机构为准。若投资者在东海基金指定的销售机构已开立过基金账户的，可不再办理。在份额持有人完成份额确认之前，登记在临时账户的份额及其相应的收益分配方式统一为红利再投资，收益分配后的全部份额将继续登记在东海基金开立的临时账户，直至份额持有人办理完成份额确认手续。份额确认完成后，基金份额持有人方可依据《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》的约定，对相应基金份额进行赎回及其他交易。份额确认完成后，基金份额持有人可在东海润兴债券型证券投资基金的销售机构选择基金收益分配方式：现金红利或红利再投资，若持有人不选择，东海润兴债券型证券投资基金默认的收益分配方式为现金分红。

份额确认的具体操作规则请投资者参照东海基金后续发布的相关公告。届时投资者可致电东海基金客户服务电话4009595531或东海基金指定的销售机构客服电话咨询。

为保护集合计划份额持有人的利益，提议授权集合计划管理人根据持有人大会决议对资产管理合同等法律文件进行修改，并办理本次变更注册的相关事宜，包括但不限于根据相关情况，决定采取相关集合计划变更的措施以及确定集合计划变更各项工作的具体时间。

以上议案，请予审议。

附件二：

东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决票			
集合计划份额持有人姓名/名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码）：		基金账户号：	
代理人（受托人）姓名/名称：		代理人（受托人）证件号码（身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码）：	
审议事项	同意	反对	弃权
《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案》			
集合计划份额持有人/代理人（受托人）签名或盖章			
年 月 日			
说明： 请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表集合计划份额持有人所持全部集合计划份额的表决意见。如表决票上的表决意见未填、多填、错填、字迹无法辨认或表决意愿无法判断，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。 “基金账户号”仅指持有本集合计划份额的基金账户号，同一集合计划份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有集合计划份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此集合计划份额持有人所持有的本集合计划所有份额。			

（本表决票可剪报、复印或登录集合计划管理人网站（www.longone.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载并打印，在填写完整并签字或盖章后方为有效）。

附件三：

东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划

份额持有人大会授权委托书

兹全权委托_____先生/女士/单位代表本人/本单位参加以通讯方式召开的投票截止日为____年__月__日的东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。本授权不得转授权。若东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。但如果授权方式发生变化或者份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件类型及证件号码：

委托人基金账户号：

受托人（签字/盖章）：

受托人证件类型及证件号码：

委托日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1、本授权委托书中“基金账户号”，指集合计划份额持有人持有东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额的基金账户号。同一集合计划份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有集合计划份额分别行使表决权的，应当填写多个基金账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此集合计划份额持有人所持有的东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的所有集合计划份额。

2、此授权委托书剪报、复印或登录集合计划管理人网站（www.longone.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。

附件四：

关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人 并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金议案的说明

一、声明

《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（以下简称“《操作指引》”）及资产管理合同第四部分“集合计划的基本情况”对本集合计划存续期限的约定“自《东海证券“东风 2 号”集合资产管理计划合同》生效至2025 年6月6日。本集合计划自 2025 年 6 月 6 日后，按照中国证监会相关规定执行。”。鉴于以上情况，综合考虑集合计划份额持有人需求及本集合计划的长远发展，为充分保护集合计划份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《操作指引》等法律法规的规定及《东海证券海鑫尊利债券型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，经与集合计划托管人兴业银行股份有限公司协商一致，集合计划管理人提议以通讯方式召开集合计划份额持有人大会，审议《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案》（以下简称“议案”），将集合计划管理人由东海证券股份有限公司（以下简称“东海证券”）变更为其子公司东海基金管理有限责任公司（以下简称“东海基金”），东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划拟相应变更为东海润兴债券型证券投资基金，并调整相关费率、份额类别设置、估值方法、投资范围、投资策略、投资限制等内容。

本次议案须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在无法获得集合计划份额持有人大会表决通过的可能。

集合计划持有人大会的决议自表决通过之日起生效，集合计划管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。中国证监会对本次持有人大会决议的备案，不表明其对本次集合计划变更方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、修改方案要点

本次变更的主要内容如下：

1、管理人变化：

由东海证券变更为东海基金。

2、产品名称变化：

由东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划变更为东海润兴债券型证券投资基金。

3、产品类型变化：

由债券型集合资产管理计划变更为债券型证券投资基金。

4、存续期变化：

由“自《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》生效至2025年6月6日。本集合计划自2025年6月6日后，按照中国证监会相关规定执行。”变更为“不定期”。

5、份额类别设置变化：

由原不区分份额类别变更为：

设置A类基金份额、C类基金份额，A类基金份额、C类基金份额开放日常申购与赎回业务，A类基金份额、C类基金份额可在基金开放申购赎回业务后任一开放日办理申购赎回业务。

对于投资者依据原《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》获得的东海证券“东风2号”集合资产管理计划份额，自《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的集合计划份额，自《基金合同》生效之日起将全部自动转换为基金A类基金份额；对于投资者依据《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额，自基金《基金合同》生效之日起亦将全部自动转换为基金A类基金份额。

6、费率变化：

（1）管理费费率变化

由0.5%/年变更为0.30%/年。

（2）申购费费率变化：

原申购费：

投资人申购集合计划份额时，需交纳申购费用，申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体申购费率如下：

单笔申购金额（含申购费）M	申购费率
M<50万元	0.30%
50万元≤M<200万元	0.20%
M≥200万元	按笔收取，1,000元/笔

变更为：

本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，C类基金份额不收取申购费用。

A类基金份额的申购费率，按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，A类基金份额须按每笔申购的A类基金份额所对应的费率档次分别计费。

本基金A类基金份额的具体申购费率如下：

申购金额（M，单位：元）	A类基金份额申购费率
M<100万	0.40%
100万≤M<500万	0.20%
M≥500万	1000元/笔

7、投资范围变化：

由“本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本集合计划不直接买入股票，也不参与新股申购和新股增发，因所持可转换债券转股形成的股票、可交换债券换股形成的股票，本集合计划应在其可交易之日起10个交易日内卖出。”

变更为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券”。

8、投资策略变化：

（1）原“个券精选策略”：

“在个券选择上，本集合计划重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外，对于可转换债券等内嵌期权的债券，还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断，最终确定其投资策略。

本集合计划将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

（1）信用等级高、流动性好；

（2）资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；

（3）在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；

（4）公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债”。

变更为：

“个券精选策略

在个券选择上，本基金重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。

本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

（1）信用等级高、流动性好；

(2) 资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；

(3) 在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券”。

(2) 原“信用债券投资策略”：

“本集合计划通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险及合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

本集合计划依靠内部信用评级体系跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险，管理人设计了定性和定量相结合的内部信用评级框架。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，定量分析主要包括盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析等；定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，是对定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。

本集合计划的内部信用评级体系包含即期评级和跟踪评级。即期评级侧重于评级的准确性，为信用产品的实时交易提供参考；此外，本集合计划会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪评级，以有效规避信用风险，并把握市场变动带来的投资机会。

本集合计划所投资的信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于AA+（含），并将视经济周期、信用周期的变化，动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例，在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。

本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于AA+（含），且应当遵守下列要求：

(1) 本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占全部信用债资产的50%-100%；

(2) 本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资

产的50%。

信用评级参照评级机构（中债资信除外）评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级或担保人评级。”

变更为：

“信用债券投资策略

本基金通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险及合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

本基金依靠内部信用评级体系跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险，基金管理人设计了定性和定量相结合的内部信用评级框架。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，定量分析主要包括盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析等；定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，是对定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。

本基金将视经济周期、信用周期的变化，动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例，在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。

本基金投资信用债（含资产支持证券，下同）评级须在AA+（含AA+）以上，为更好控制投资组合面临的信用风险，本基金的投资遵从以下投资比例限制：

（1）本基金投资于AAA信用评级的信用债的比例占全部信用债资产的50%-100%；

（2）本基金投资于AA+信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的50%。

上述信用评级为债项评级，短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级，本基金投资的信用债若无债项评级的，参照主体信用评级。评级信息参照资信评级机构发布的最新评级结果，评级机构不包含中债资信评估有限责任公司。本基金持有信用债期间，如果其信用评级下

降、基金规模变动、变现信用债券支付赎回款项等使得投资比例不再符合前述标准，应在评级报告发布之日或不再符合前述标准之日起3个月内调整至符合约定。”

（3）删除“可转换债券/可交换债券投资策略”

“可转换债券兼具股票资产与债券资产的特点，具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本集合计划着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究，重点关注盈利能力或成长前景较好的上市公司的转债，确定不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值，同时考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征，选择合适的投资品种，分享正股上涨带来的收益。

本集合计划将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债券的战略结构性投资机遇，适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会，选择最具吸引力标的进行配置。

本集合计划投资于可转换债券和可交换债券的比例合计不超过集合计划资产净值的20%。”

除上述内容的调整需要修改《资产管理合同》以外，集合计划管理人根据法律法规更新、集合计划实际运作情况、集合计划托管人信息更新、变更后的基金特点对《资产管理合同》的其他相关内容进行必要修订，具体修改内容请参见附件《资产管理合同修改前后对照表》。

集合计划管理人将根据修订后的《资产管理合同》相应修订托管协议、招募说明书等法律文件。

三、变更的相关安排

1、管理人提请份额持有人大会授权管理人据此落实变更管理人及集合计划变更注册相关事项，并授权管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况暂停申购、赎回等。具体安排详见管理人届时发布的相关公告。

2、对于通过原为本集合计划的销售机构购买、且该销售机构已与东海基金签订基金销售服务协议（具体机构名称以集合计划管理人届时发布的公告为准）的投资者，截至《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日的前一日其仍

然持有的集合计划份额，将在《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日自动变更为东海润兴债券型证券投资基金A类基金份额。基金份额持有人可在《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效后依据《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》的约定，在原销售机构对相应基金份额进行赎回及其他交易。

对于通过原为本集合计划的销售机构购买、但该销售机构未与东海基金签订基金销售服务协议（具体机构名称以集合计划管理人届时发布的公告为准）的投资者，截至《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日的前一日其仍然持有的集合计划份额，将在《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日统一变更为东海润兴债券型证券投资基金A类基金份额，并暂时登记至东海基金在中国证券登记结算有限责任公司开立的临时账户上。投资者在《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日后可通过东海基金或东海基金指定的销售机构（包括东海证券）提交申请进行重新确认和登记，将对应份额确认至投资者的基金账户上。申请确认份额的投资者必须首先在东海基金直销柜台或东海润兴债券型证券投资基金其他销售机构的销售网点（包括东海证券的营业网点）办理基金账户开立手续，具体开立基金账户规则以基金登记机构为准。若投资者在东海基金指定的销售机构已开立过基金账户的，可不再办理。在份额持有人完成份额确认之前，登记在临时账户的份额及其相应的收益分配方式统一为红利再投资，收益分配后的全部份额将继续登记在东海基金开立的临时账户，直至份额持有人办理完成份额确认手续。份额确认完成后，基金份额持有人方可依据《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》的约定，对相应基金份额进行赎回及其他交易。份额确认完成后，基金份额持有人可在东海润兴债券型证券投资基金的销售机构选择基金收益分配方式：现金红利或红利再投资，若持有人不选择，东海润兴债券型证券投资基金默认的收益分配方式为现金分红。

份额确认的具体操作规则请投资者参照东海基金后续发布的相关公告。届时投资者可致电东海基金客户服务电话4009595531或东海基金指定的销售机构客服电话咨询。

3、本集合计划将于本次集合计划份额持有人大会决议生效后启动办理变更管理人及变更注册的相关交接手续。集合计划管理人将另行发布相关公告。

四、修改方案可行性

（一）法律层面

《基金法》第四十七条规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：……（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同；（三）决定更换基金管理人、基金托管人……”。第八十六条规定，“……转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。”

根据《运作办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

因此，本次份额持有人大会审议事项属于特别决议，需经参加大会的份额持有人或其代理人所持表决票的三分之二以上（含三分之二）通过，决议方可生效。本次变更管理人以及修改资产管理合同有关事项的事宜符合相关法律法规要求，修订方案不存在法律层面的障碍。

（二）技术层面

为了保障本次持有人大会的顺利召开，集合计划管理人成立了工作小组，筹备、执行持有人大会相关事宜。集合计划管理人与投资者进行了充分沟通，保证持有人大会可以顺利召开。本次持有人大会决议生效并公告后，将公告修订后的基金合同及托管协议，并在法律法规规定的时间内更新招募说明书。管理人、托管人已就本集合计划变更有关事项进行了充分沟通和细致准备，技术可行。因此，变更注册方案不存在运营技术层面的障碍。

五、方案的主要风险及预备措施

（一）集合计划份额持有人大会不能成功召集或方案被否决的风险

根据《基金法》的相关规定及资产管理合同的相关约定，本次大会召开需满足“本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一（含二分之一）”的召集成功条件，以及“参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过”的表决通过条件。

为防范出现大会不能成功召集或方案被否决的风险，在提议修改资产管理合同并设计具体方案之前，集合计划管理人拟定议案综合考虑了集合计划份额持有人的要求。如有必要，集合计划管理人将根据集合计划份额持有人意见，对资产管理合同变更方案进行适当修订，并重新公告。集合计划管理人可在必要情况下，预留出足够的时间，以做二次召开或推迟集合计划份额持有人大会的召开的充分准备。如果本次议案未获得集合计划份额持有人大会通过，集合计划管理人计划在规定时间内，按照有关规定重新向集合计划份额持有人大会提交本次议案。

（二）集合计划持有人集中赎回集合计划份额的流动性风险及预备措施

在会议召开通知公告后，部分集合计划份额持有人可能选择赎回其持有的集合计划份额。集合计划管理人将提前做好流动性安排，保持投资组合流动性，以应对可能发生的规模赎回对基金运作的影响，尽可能降低净值波动率。

（三）需申请重新确认和登记份额的投资者面临的风险及预备措施

东海基金及其指定的销售机构收到投资者提交的对其持有的本集合计划份额申请进行重新确认和登记的申请材料后，将遵从谨慎性原则进行核对。若因投资者提供的资料不真实、不准确、不完整、不及时、不符合基金登记机构相关操作规则要求、或虽办理了相关手续但其身份仍不能核实的，东海基金及其指定销售机构有权拒绝其份额重新确认和登记的申请，份额持有人后续申购、赎回基金份额的便利性将受到影响，造成的损失由投资者自行承担。投资者可及时联系相关机构了解份额重新确认和登记的具体操作规则。

附件：《资产管理合同修改前后对照表》

附件：

《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》修 改前后对照表

章节	《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》条款	《东海润兴债券型证券投资基金基金合同（草案）》条款
管理人	东海证券股份有限公司	东海基金管理有限责任公司
全文	东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划	东海润兴债券型证券投资基金
全文	管理人	基金管理人
全文	托管人	基金托管人
全文	集合计划份额持有人	基金份额持有人
全文	集合计划、本集合计划、集合资产管理计划	证券投资基金、本基金、基金
全文	资产管理合同、本合同、《资产管理合同》、集合计划合同	基金合同、本基金合同、《基金合同》
全文	产品资料概要	基金产品资料概要
第一部分 基金的历史沿革	东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划由东海证券	东海润兴债券型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划变更而来。 东海证券海鑫尊利债券型集

	“东风2号”集合资产管理计划变更而来。 经中国证监会批准，自2021年12月6日起，《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》同日起失效。 管理人将按照《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》约定的变更程序，保障对原集合计划变更存在异议的投资者选择退出原集合计划的权利。投资者未退出的，其持有的原集合计划份额将通过折算转换为东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额。	合资产管理计划由东海证券“东风2号”集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来。 经中国证监会批准，自2021年12月6日起，《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》同日起失效。 根据《基金法》、《运作办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划经中国证监会2024年【】月【】日证监许可【】XXX号文准予变更注册。 东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划于2024年【】月【】日至2024年【】月【】日以通讯方式召开份额持有人大会，并于2024年【】月【】日表决通过《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案》，同意东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划变更管理人，管理人由东海证券
--	---	--

		股份有限公司变更为其子公司东海基金管理有限责任公司；东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划变更为东海润兴债券型证券投资基金，即本基金；并调整相关费率、份额类别设置、估值方法、投资范围、投资策略、投资限制等内容，上述份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》自【】年【】月【】日生效，《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。
第二部分 前言	一、订立本合同的目的、依据和原则 2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流

	动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。 二、集合资产管理计划资产管理合同（以下简称“集合计划合同”）是规定集合计划合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与集合资产管理计划相关的涉及集合计划合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与集合计划合同有冲突，均以集合计划合同为准。集合计划合同当事人按照《基金法》、集合计划合同及其他有关规定享有权利、承担义务。 集合计划合同的当事人包括集合资产管理计划管理人（以下简称“管理人”）、集合资产管理计划托管人（以下简称“托管人”）和集合资产管理计划份额持有人（以下简称“集合计划份额持有人”）。集合资产管理计划投资人自依本合同取得集合资产管理计划份额，即成为集合计划份额持有人和本合同的当事人，其持有集合资产管理计划份额的行为本身即表明其对集合计划合同的承认和接受。	动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。 二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。 基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。 三、本基金由东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划变更而来，并经中国证监会变更注册。
--	---	---

	三、东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)由东海证券“东风2号”集合资产管理计划变更而来,东海证券“东风2号”集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》(证监会令第17号)、《关于证券公司开展集合资产管理业务有关问题的通知》、《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》及其他有关规定募集,并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准设立。 中国证监会对东海证券“东风2号”集合资产管理计划变更为本集合计划的批准,并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本集合计划没有风险。	东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划由原集合计划变更而来,原集合计划由东海证券股份有限公司依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》(证监会令第17号)、《关于证券公司开展集合资产管理业务有关问题的通知》、《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》及其他有关规定募集,并经中国证监会核准设立。 中国证监会对原集合计划变更为东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的批准,东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的变更注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。 六、对于投资者依据原《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》获得的东海证券“东风2号”集合资产管理计划份额,自《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为的东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的集合计划份额,以及依据《东海证券海鑫尊利
--	---	--

		债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划集合计划份额，自本基金《基金合同》生效之日起均将全部自动转换为本基金 A 类基金份额。 七、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，基金管理人履行相应程序后，可以启用侧袋机制，具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间，基金管理人将对基金简称进行特殊标识，投资者不得办理侧袋账户份额的申购赎回等业务。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。 八、本基金单个投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。
第三部分 释义	1、集合资产管理计划：指东海证券股份有限公司设立管理的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划 7、招募说明书：指《东海	6、招募说明书或《招募说明书》：指《东海润兴债券型证券投资

	证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新 16、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会 21、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称 23、集合计划销售业务：指管理人或销售机构宣传推介集合计划, 办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 26、登记机构：指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司或接受东海证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构 28、集合计划交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理申购、赎回等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户 29、集合计划合同生效日：	资基金招募说明书》及其更新 15、银行业监督管理机构：指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局 20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金, 办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资计划等业务 25、登记机构：指办理登记业务的机构。基金的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司 27、基金交易账户：指销售机构为投资人开立的、记录投资人通过该销售机构办理基金申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资计划等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 28、基金合同生效日：指《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效之日，原《东海证券海
--	--	--

	指《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日,《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》同日失效 31、存续期:指《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》生效至《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》终止之间的期限 40、集合计划转换:指集合计划份额持有人按照本合同和管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有管理人管理的、某一集合资产管理计划的份额转换为管理人管理的其他集合资产管理计划份额的行为 42、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理申购申请的一种投资方式	鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日失效 30、存续期:指原《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限 39、基金转换:指基金份额持有人按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有基金管理人管理的、某一基金的基金份额转换为基金管理人管理的其他基金基金份额的行为 41、定期定额投资计划:指投资人通过有关销售机构提出申请,约定每期申购日、扣款金额及扣款方式,由销售机构于每期约定扣款日在投资人指定银行账户内自动完成扣款及受理基金申购申请的一种投资方式 50、销售服务费:指从基金财产中计提的,用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用 51、基金份额类别:指根据申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别,
--	---	---

		各基金份额类别代码不同，并分别公布基金份额净值和基金份额累计净值 52、A 类基金份额：指投资人申购时收取申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。对于投资者依据原《东海证券“东风 2 号”集合资产管理计划合同》获得的东海证券“东风 2 号”集合资产管理计划份额，自《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的集合计划份额，自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金 A 类基金份额；对于投资者依据《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额，自本基金《基金合同》生效之日起亦将全部自动转换为本基金 A 类基金份额 53、C 类基金份额：指本基金《基金合同》生效后，投资者申购时不收取申购费用，但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别
第四部分 基金的基	四、集合计划的投资目标	四、基金的投资目标

本情况	通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资人提供长期稳定的投资回报。 五、集合计划份额的面值 本集合计划份额的面值为人民币1.00元。 六、集合计划存续期限 自《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》生效至2025年6月6日。本集合计划自2025年6月6日后,按照中国证监会相关规定执行。 七、集合计划份额类别设置	本基金通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资人提供长期稳定的投资回报。 五、基金份额的面值 本基金基金份额的面值为人民币1.00元。 六、基金存续期限 不定期 七、基金份额类别设置 本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等的不同,将基金份额分为不同的类别。 A类基金份额:指投资人申购时收取申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。对于投资者依据原《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》获得的东海证券“东风2号”集合资产管理计划份额,自《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金 A类基金
-------------------	--	---

	在不违反法律法规、集合计划合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,经与托管人就清算交收、核算估值、系统支持等方面协商一致,管理人在履行适当程序后可增加或调整集合计划份额类别设置、对集合计划份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告,不需要召开集合计划份额持有人大会。	份额;对于投资者依据《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起亦将全部自动转换为本基金A类基金份额 C类基金份额:指本基金《基金合同》生效后,投资者申购时不收取申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。 本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码,并分别计算及公告基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可自行选择办理A类基金份额或C类基金份额的申购业务。 各类基金份额净值的计算公式为: $T日某类基金份额净值 = T日该类基金份额的基金资产净值 / T日该类基金份额余额总数。$ 本基金不同基金份额类别之间暂不开通相互转换业务。如后续开通此项业务的,无需召开基金份额持有人大会审议,但调整前基金管理人需及时公告。 有关基金份额类别的具体设
--	--	--

		置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书、基金产品资料概要中公告。 根据基金实际运作情况，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人在履行适当程序后可增加、减少或调整基金份额类别设置、对基金份额分类办法及规则进行调整、停止现有基金份额类别的销售、变更收费方式，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，无需召开基金份额持有人大会。
第五部分 基金的存 续	集合计划合同生效后，连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合资产管理计划合并或者终止集合计划合同等，并在6个月内召集集合计划份额持有人大会。	基金合同生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会。

	本集合计划存续期限为自《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》生效至2025年6月6日。本集合计划自2025年6月6日后，按照中国证监会相关规定执行。如2025年6月6日后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合计划份额持有人大会。 法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。	法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。
第六部分 基金份额的申购与赎回	二、申购和赎回的开放日及时间 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 管理人自集合计划合同生效之日起不超过3个月开始办理申购业务，具体业务办理时间在相关公告中规定。 管理人自集合计划合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回业务，具体业务办理时间在相关公告中规定。 管理人不得在集合计划合同约定之外的日期或者时间办理集合计划份额的申购、赎回或者转换。投资人在集合计划合同约定之外的日期或者时间提出	二、申购和赎回的开放日及时间 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理A类基金份额、C类基金份额申购的具体日期，具体业务办理时间在相关公告中规定。 本基金各类基金份额具体赎回业务办理时间在相关公告中规定。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期

	申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其集合计划份额申购、赎回价格为下一开放日集合计划份额申购、赎回的价格。 三、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算; 4、赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回; 5、办理申购、赎回业务时,应当遵循集合计划份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。 管理人可在法律法规允许且对份额持有人无实质性不利影响的情况下,对上述原则进行调整。管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式	或者时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。 三、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算; 4、赎回遵循“先进先出”原则,即按照投资人持有基金份额登记日期的先后次序进行顺序赎回;基金份额持有人持有集合计划份额的期限连续计算; 5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。 基金管理人可在法律法规允许且对基金份额持有人无实质性不利影响的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购
--	---	--

	2、申购和赎回的款项支付 投资人申购集合计划份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认集合计划份额时,申购生效。 集合计划份额持有人递交赎回申请,赎回成立;登记机构确认赎回时,赎回生效。投资者赎回申请生效后,管理人将在 T + 7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时,赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本合同有关条款处理。 3、申购和赎回申请的确认 管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T	资金,投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请不成立。 2、申购和赎回的款项支付 投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认基金份额时,申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立,申购款项将退回投资人账户,基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等损失。 基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;登记机构确认赎回时,赎回生效。投资者 T 日赎回申请生效后,基金管理人将在 T + 7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时,赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。
--	--	---

	日), 在正常情况下, 登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请, 投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功, 则申购款项退还给投资人。 集合计划销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功, 而仅代表销售机构确实接收到申购、赎回申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况, 投资人应及时查询并妥善行使合法权利。 五、申购和赎回的数量限制 6、当接受申购申请对存量集合计划份额持有人利益构成潜在重大不利影响时, 管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或集合计划单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停集合计划申购等措施, 切实保护存量集合计划份额持有人的合法权益。管理人基于投资运作与风险控制的需要, 可采取上述措	3、申购和赎回申请的确认 基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T 日), 在正常情况下, 登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请, 投资人应在 T+2 日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功, 则申购款项本金退还给投资人。 基金销售机构对申购、赎回申请的受理并不代表该申请一定成功, 而仅代表销售机构确实接收到申请。申购、赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况, 投资人应及时查询并妥善行使合法权利。 基金管理人或登记机构可以在法律法规和基金合同允许的范围内, 且在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下, 对上述业务办理时间进行调整, 在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 五、申购和赎回的数量限制 6、当接受申购申请对存量基
--	--	---

	施对集合计划规模予以控制。具体见管理人相关公告。 7、管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本集合计划份额净值的计算,保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T日的集合计划份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式:本集合计划申购份额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的申购费率由管理人决定,并在招募说明书及产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的集合计划份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,	金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见招募说明书或相关公告。 7、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金各类基金份额净值的计算,均保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式:本基金申购份额的计算及余额的处理方式详见《招募说明
--	---	---

	由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本集合计划赎回金额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的赎回费率由管理人决定，并在招募说明书及产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日集合计划份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。 4、申购费用由投资人承担，不列入集合计划财产。 七、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请： 2、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时，管理人可暂停或拒绝接受投资人的申购申请。	书》。本基金的A类基金份额申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用（如有），赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 4、A类基金份额申购费用由申购A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产。C类基金份额不收取申购费用。 七、拒绝或暂停申购的情形 发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购
--	---	---

	发生上述第 1、2、3、5、6、8 项暂停申购情形之一且管理人决定暂停接受投资人申购申请时, 管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 项情形时, 管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制, 管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝, 被拒绝部分的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时, 管理人应及时恢复申购业务的办理。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回: 当管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时, 管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合资产管理计划总份额的 10%的前提下, 可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请, 应当按单个账户赎回申请量	申请: 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时, 基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 8、申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、当日申购金额限制、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时, 基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7、8 项情形时, 基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制, 基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝, 被拒绝部分的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时, 基金管理人应及时恢复申购业务的办理。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2) 部分延期赎回: 当基金
--	--	--

	占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 (3) 当本集合计划发生巨额赎回时,在单个集合计划份额持有人赎回申请超过前一开放日集合计划总份额 10%的情形下,对该单个集合计划份额持有人在比例以内的赎回申请,与当日其他赎回申请一起,按上述(1)、(2)方式处理,对该单个集合计划份额持有人超过该比例的赎回申请,如管理人认为支付该集合计划份额持有人的赎回款项有困难或者因支付该集合计划份额持有人的赎回款项	管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的 10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 (3) 当基金出现巨额赎回时,在单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额 10%的情形下,基金管理人认为支
--	---	---

	而进行的财产变现可能会对本集合计划资产净值造成较大波动时，管理人有权实施延期办理。对于该集合计划份额持有人未能赎回部分，集合计划份额持有人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。 选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，并与下一开放日新增的赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的本集合计划份额净值为基础计算赎回金额。 选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。 如集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择，集合计划份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理，具体见相关公告。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、如发生暂停的时间为1日，管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的集合计划份额净值。	付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分取消赎回或延期办理。如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择“取消赎回”的，则其当日未获受理部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。对该单个基金份额持有人当日赎回申请中未超过上一开放日基金总份额10%的部分与其他投资者的赎回申请按上述（1）或（2）方式处理，具体见相关公告。
--	--	--

	3、若暂停时间超过1日，则管理人可以根据《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日，在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的集合计划份额净值。 十一、集合计划转换 管理人可以根据相关法律法规以及本合同的规定决定开办本集合计划与管理人管理的其他集合资产管理计划之间的转换业务，集合计划转换可以收取一定的转换费，相关规则由管理人届时根据相关法律法规及本合同的规定制定并公告，并提前告知托管人与相关机构。 十二、集合计划的非交易过户 集合计划的非交易过户是指集合计划登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划份额的投	十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、如发生暂停的时间为1日，基金管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的各类基金份额净值。 3、若暂停时间超过1日，则基金管理人可以根据《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放申购或赎回日，在规定媒介上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的各类基金份额净值；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。 十一、基金转换 基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金基金份额之间的转换业务，基金转换可以收取一定的转换费，相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告，并提前告知基金托管人与相关机构。
--	--	---

	资人。 十五、集合计划份额的冻结和解冻 集合计划登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻, 以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。 十六、集合计划份额的转让 本集合计划暂时不支持份额的转让, 但在法律法规允许且条件具备的情况下, 管理人可受理集合计划份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请, 并由登记机构办理集合计划份额的过户登记。管理人拟受理集合计划份额转让业务的, 将提前公告, 集合计划份额持有人应根据管理人公告的业务规则办理集合计划份额转让业务。 如相关法律法规允许管理人办理其他集合计划业务, 管理	十二、基金的非交易过户 基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下, 接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。 十五、基金份额的冻结、解冻与质押 基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻, 以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金份额被冻结的, 被冻结部分产生的权益一并冻结, 被冻结部分份额仍然参与收益分配, 法律法规另有规定的除外。 如相关法律法规允许, 在对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下, 基金管理人履行相关程序后可办理基金份额的质押业务或其他基金业务, 基金管理人将制定和实施相应的业务规则。 十六、基金份额的转让 在法律法规允许且条件具备的情况下, 且对基金份额持有人利益无实质性不利影响, 基金管理人
--	--	---

	人将制定和实施相应的业务规则。	履行相关程序后可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请，并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的，将提前公告，基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。 十八、在不违反相关法律法规规定和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告，无需召开基金份额持有人大会审议。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、管理人 （一） 管理人简况 名称：东海证券股份有限公司（简称：东海证券） 住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层 法定代表人：王文卓 设立日期：1993 年 1 月 16 日 批准设立机关及批准设立	一、基金管理人 （一） 基金管理人简况 名称：东海基金管理有限责任公司 住所：上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 360 室 法定代表人：严晓珺 设立日期：2013 年 2 月 25 日

	文号: 中国人民银行银复[1992] 362 号 资产管理业务资格批准文号: 中国证监会证监机构字[2005] 77 号 组织形式: 股份有限公司 注册资本: 167,000 万元整 存续期限: 持续经营 联系电话: 021-20333333 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 管理人的义务包括但不限于: (9) 编制季度报告、中期报告和年度报告; (11) 保守集合计划商业秘密, 不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外, 在集合计划信息公开披露前应予保密, 不向他人泄露; 二、托管人 (二) 托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 托管人的权利包括但不限于:	批准设立机关及批准设立文号: 中国证监会《关于核准设立东海基金管理有限责任公司的批复》(证监许可[2013]179 号) 组织形式: 有限责任公司 注册资本: 16480.3118 万元人民币 存续期限: 持续经营 联系电话: 021-60586900 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金管理人的义务包括但不限于: (9) 编制基金季度报告、中期报告和年度报告; (11) 保守基金商业秘密, 不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前应予保密, 不向他人泄露, 但因监管机构、司法机关等有权机关、行业自律组织的要求提供, 或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外; 二、基金托管人 (二) 基金托管人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人
--	---	--

	(4) 根据相关市场规则, 为集合计划开设资金账户、证券账户、期货账户等投资所需账户、为集合计划办理证券、期货交易资金清算; 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 托管人的义务包括但不限于: (2) 设立专门的托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员, 负责集合计划财产托管事宜; (7) 保守集合计划商业秘密, 除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外, 在集合计划信息公开披露前予以保密, 不得向他人泄露; (8) 复核、审查管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购、赎回价格; 三、集合计划份额持有人 集合计划投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《集合计划合同》的承认和接受, 集合计划投资者自依据《集合计划	的权利包括但不限于: (4) 根据相关市场规则, 为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户, 为基金办理证券、期货交易资金清算; 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定, 基金托管人的义务包括但不限于: (2) 设立专门的基金托管部门, 具有符合要求的营业场所, 配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员, 负责基金财产托管事宜; (7) 保守基金商业秘密, 除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外, 在基金信息公开披露前予以保密, 不得向他人泄露, 但因监管机构、司法机关等有权机关、行业自律组织的要求提供, 或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外; (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格; 三、基金份额持有人 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受, 基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额, 即成
--	---	---

	合同》取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《集合计划合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的集合计划份额。集合计划份额持有人作为《集合计划合同》当事人并不以在《集合计划合同》上书面签章或签字为必要条件。 每份集合计划份额具有同等的合法权益。	为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。 同一类别每份基金份额具有同等的合法权益。
第八部分 基金份额持有人大会	本集合计划份额持有人大会不设日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开集合计划份额持有人大会，但法律法规另有规定或本合同另有约定的除外： (5) 调整管理人、托管人的报酬标准； (11) 单独或合计持有本集	本基金基金份额持有人大会不设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规另有规定或本基金合同另有约定的除外： (5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率，但法律法规要求调整该等报酬标准或提高销售服务费率的除外； (11) 单独或合计持有本基金

	合计划总份额 10%以上（含 10%）集合计划份额的集合计划份额持有人（以管理人或托管人收到提议当日的集合计划份额计算，下同）就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会； 2、在法律法规规定和《集合计划合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由管理人和托管人协商后修改，不需召开集合计划份额持有人大会： （2）增加或调整本集合计划的集合计划份额类别、对集合计划份额分类办法及规则进行调整、调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率，或变更收费方式； （4）对《集合计划合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《集合计划合同》当事人权利义务关系发生变化； （5）管理人将本合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司；	总份额 10%以上（含 10%）基金份额的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会； 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （2）调整本基金的基金份额类别、对基金份额分类办法及规则进行调整、停止现有基金份额类别的销售、调整本基金的申购费率、调低销售服务费率，或变更收费方式； （4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化； （5）基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则； （6）履行适当程序后，基金
--	--	---

	二、会议召集人及召集方式 2、管理人未按规定召集或不能召开时，由托管人召集。 四、集合计划份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会。…… (2) 召集人按集合计划合同约定通知托管人(如果托管人为召集人，则为管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人(如果托管人为召集人，则为管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取份额持有人的书面表决意见；托管人或管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力； 九、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定 同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。	推出新业务或服务； 二、会议召集人及召集方式 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。 四、基金份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会。…… (2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人，则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力； 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户
--	---	--

		份额无表决权。 侧袋机制实施期间，关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准，本节没有规定的适用本部分相关约定。
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	一、管理人和托管人职责终止的情形 （一）管理人职责终止的情形 4、管理人将本合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立的具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司； 二、管理人和托管人的更换程序 （二）管理人更换的特殊程序 当管理人根据相关法律法规的规定，以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司时，在管理人和托管人协商一致的基础上，管理人有权将本合同中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司，本集合计划的管理人变更为前述从事资产管理业务的公司。前述变更事项无需召开集合计划份额持有人大会审议，但管理人应当	一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形 （一）基金管理人职责终止的情形 二、基金管理人和基金托管人的更换程序

	保证受让人具备管理本集合计划的相关资格,按照法律法规和中国证监会的要求履行相关程序,并按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。	
第十一部分 基金份额的登记	四、集合计划登记机构的义务 1、配备足够的专业人员办理本集合计划份额的登记业务;	四、基金登记机构的义务 1、配备足够的专业人员办理本基金基金份额的登记业务;
第十二部分 基金的投资	一、投资目标 通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资人提供长期稳定的投资回报。 二、投资范围 本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的	一、投资目标 本基金通过分析影响债券市场的各类要素,对债券组合的平均久期、期限结构、类属品种进行有效配置,力争为投资人提供长期稳定的投资回报。 二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括债券(含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的

	相关规定。 本集合计划不直接买入股票,也不参与新股申购和新股增发,因所持可转换债券转股形成的股票、可交换债券换股形成的股票,本集合计划应在其可交易之日起 10 个交易日内卖出。 集合计划的投资组合比例为: 本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 三、投资策略 4、个券精选策略 在个券选择上,本集合计划重点考虑个券的流动性,包括是否可以进行质押融资回购等要素,还将根据对未来利率走势的判断,综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外,对于可	本基金不投资于股票等权益类资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。 基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。 若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,本基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。 三、投资策略 4、个券精选策略 在个券选择上,本基金重点考虑个券的流动性,包括是否可以进行质押融资回购等要素,还将根据对未来利率走势的判断,综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。
--	---	--

	转换债券等内嵌期权的债券,还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断,最终确定其投资策略。 本集合计划将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券: (4) 公司基本面良好,具备良好的成长空间与潜力,转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。 5、信用债券投资策略 本集合计划的内部信用评级体系包含即期评级和跟踪评级。即期评级侧重于评级的准确性,为信用产品的实时交易提供参考;此外,本集合计划会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪评级,以有效规避信用风险,并把握市场变动带来的投资机会。 本集合计划所投资的信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于 AA+ (含),并将视经济周期、信用周期的变化,动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例,在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上,积极发掘信	本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券: 5、信用债券投资策略 本基金将视经济周期、信用周期的变化,动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例,在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上,积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资,并采取分散化投资策略,严格控制组合整体的违约风险水平。 本基金投资信用债(含资产支持证券,下同)评级须在 AA+ (含 AA+) 以上,为更好控制投资组合面临的信用风险,本基金的投资遵从以下投资比例限制:…… 上述信用评级为债项评级,短
--	--	--

	用利差具有相对投资机会的个券进行投资,并采取分散化投资策略,严格控制组合整体的违约风险水平。 本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于 AA+ (含), 且应当遵守下列要求: …… 信用评级参照评级机构(中债资信除外)评定的最新债项评级, 无债项评级的参照主体评级或担保人评级。 6、可转换债券/可交换债券投资策略 可转换债券兼具股票资产与债券资产的特点, 具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本集合计划着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究, 重点关注盈利能力或成长前景较好的上市公司的转债, 确定不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值, 同时考	期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级, 本基金投资的信用债若无债项评级的, 参照主体信用评级。评级信息参照资信评级机构发布的最新评级结果, 评级机构不包含中债资信评估有限责任公司。本基金持有信用债期间, 如果其信用评级下降、基金规模变动、变现信用债券支付赎回款项等使得投资比例不再符合前述标准, 应在评级报告发布之日或不再符合前述标准之日起3个月内调整至符合约定。
--	---	--

	考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征,选择合适的投资品种,分享正股上涨带来的收益。 本集合计划将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债券的战略结构性投资机遇,适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会,选择最具吸引力标的进行配置。 本集合计划投资于可转换债券和可交换债券的比例合计不超过集合计划资产净值的20%。 四、投资限制 1、组合限制 集合计划的投资组合应遵循以下限制: (1) 本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%; (2) 本集合计划每个交易	未来,随着市场的发展和基金管理运作的需要,基金管理人可以在不改变投资目标的前提下,遵循法律法规的规定并履行适当程序后,相应调整或更新投资策略,并在招募说明书更新中公告。 四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%; (2) 本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等; (4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制; (8) 本基金管理人管理的全
--	---	--

	日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等; (4) 本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%,完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制; (8) 本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%; (9) 本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。集合计划持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出; (10) 本集合计划进入全国	部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%; (9) 若本基金投资于国债期货,应满足如下限制: ①在任何交易日日终,本基金持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的 15%; ②在任何交易日日终,本基金持有的卖出国债期货合约价值,不得超过基金持有的债券总市值的 30%; ④本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合《基金合同》关于债券投资比例的有关
--	---	--

	银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%，进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期； (11) 本集合计划投资于国债期货，应满足如下限制： (a) 本集合计划在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的 15%； (b) 本集合计划在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的 30%； (c) 本集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应不低于集合计划资产的 80%； 除上述（2）、（9）、（12）、（13）情形之外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比	约定； 除上述（2）、（10）、（11）情形之外，因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。 2、禁止行为 (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； 五、业绩比较基准 中债新综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖银行间债券市场和交易所市场，指数成份券种包括国债、企业债等主要债券品种。该指数具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本基金的
--	--	---

	例的，管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。 法律法规或监管部门取消或变更上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制或以变更后的规定为准，但须提前公告，不需要经集合计划份额持有人大会审议。 2、禁止行为 (4) 买卖其他集合计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外； 五、业绩比较基准 中债新综合指数（全价）由中央国债登记结算有限责任公司编制，该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖银行间市场和交易所市场，指数成份券种包括国债、企业债等主要债券品种。该指数具有广泛的市场代表性，能够反映债券市场总体走势，适合作为本集合计划的业绩比较基准。其中，一年期银行定期存款收益率是指中国人民银行公布的金融机构一年期人民币存款基准利率。	业绩比较基准。其中，一年期银行定期存款收益率是指中国人民银行公布的金融机构一年期人民币存款基准利率。 本基金选择上述业绩比较基准的原因为本基金是通过债券等固定收益资产来获取收益，力争获取相对稳健的回报，追求基金财产的保值增值。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有现金或到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。根据本基金设定的投资范围和投资比例，基金管理人以 80% 的中债新综合指数（全价）和 20% 的一年期银行定期存款收益率（税后）构建的复合指数作为本基金的业绩比较基准，与本基金的投资风格基本一致，可以较好的反映本基金的风险收益特征。 如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，或中国人民银行
--	--	---

	本集合计划选择上述业绩比较基准的原因为本集合计划是通过债券等固定收益资产来获取收益,力争获取相对稳健的回报,追求集合计划财产的保值增值。本集合计划投资于债券资产的比例不低于集合计划资产的 80%,每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%。根据本集合计划设定的投资范围和投资比例,管理人以 80%的中债新综合指数(全价)和 20%的一年期银行定期存款收益率(税后)构建的复合指数作为本集合计划的业绩比较基准,与本集合计划的投资风格基本一致,可以较好的反映本集合计划的风险收益特征。 如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布,或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准,或中国人民银行调整或停止发布基准利率,或今后法律法规发生	调整或停止发布基准利率,或今后法律法规发生变化,或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本基金的业绩比较基准时,本基金基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,依据维护基金份额持有人利益的原则,经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后调整基金的业绩比较基准并及时公告。 六、风险收益特征 本基金为债券型基金,理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。 七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代表或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。
--	--	---

	变化,或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本集合计划的业绩比较基准时,本集合计划管理人可以根据本集合计划的投资范围和投资策略,调整集合计划的业绩比较基准,但应在取得托管人同意后履行适当程序,并及时公告,无须召开集合计划份额持有人大会审议。 六、风险收益特征 本集合计划为债券型集合资产管理计划,理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划。 七、管理人代表集合计划行使债权人权利的处理原则及方法 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。	
第十四部分 基金资产估值	二、估值对象 集合计划所拥有的股票、债券、国债期货合约、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 四、估值方法	二、估值对象 基金所拥有的债券、国债期货合约、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

	1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1) 交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； (2) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值； (3) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值； (4) 交易所上市交易的可转换债券、可交换债券以每日收	四、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 (1) 交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（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或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。 (2) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价，基金管理人应根据相关法律、法规的规定进行涉税处理。 (3) 对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（法规另有规定的除外），选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价。
--	---	--

	盘价作为估值全价; (5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值;在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值; (6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。 2、首次公开发行未上市的债券,采用估值技术确定公允价值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。 3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品	(4) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值。 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理: (1) 首次公开发行未上市或未挂牌转让的债券,采用估值技术确定公允价值。 (2) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券,对存在活跃市场的情况下,应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值;对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下,应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值;对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下,应采用估值技术确定其公允价值。 3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种,按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种,按照第三方估值
--	--	---

	种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。 4、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。 5、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。 6、存款的估值方法 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。 7、同业存单的估值方法 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供	机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。 4、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。 5、国债期货的估值 国债期货合约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。 6、银行定期存款或通知存款以本金列示，根据存款协议列示的利息总额或约定利率每自然日计提利息。如提前支取或利率发生变化，则按需进行账户调整。
--	---	--

	估值价格的，按成本估值。 9、当集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。 五、估值程序 1、集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，集合计划资产净值除以当日集合计划份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。 管理人每个工作日计算集合计划资产净值及集合计划份额净值，并按规定公告。 2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。	7、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。 8、回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。 五、估值程序 1、某一类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后，某一类别基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。 基金管理人每个工作日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。 2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金资产净值和各类基金份额净值结
--	---	---

	六、估值错误的处理 5、特殊情况的处理 (1) 管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第8项进行估值时,所造成的误差不能作为集合计划资产估值错误处理; (2) 由于不可抗力原因、有关会计制度变化、市场规则变更或由于证券/期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等,管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的集合计划资产估值错误,管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。 七、暂停估值的情形 4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。 八、集合计划净值的确认 集合计划资产净值和集合计划份额净值由管理人负责计算,托管人负责进行复核。管理人应于每个工作日交易结束后	果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人按规定对外公布。 六、估值错误的处理 5、特殊情况的处理 (1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第9项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理; (2) 由于不可抗力原因、有关会计制度变化、市场规则变更或由于证券/期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等非基金管理人或基金托管人原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。 七、暂停估值的情形 4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。 八、基金净值的确认 基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理
--	--	--

	计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人,由管理人按规定对集合计划净值予以公布。	人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人按规定对基金净值予以公布。
第十五部分 基金费用与税收	一、集合计划费用的种类 4、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费和诉讼费、仲裁费等; 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式 1、管理人的管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下: $H = E \times 0.5\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的集合计划管理费 E 为前一日的集合计划资产净值	一、基金费用的种类 3、C 类基金份额的销售服务费; 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等; 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下: $H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值 3、销售服务费 本基金 A 类基金份额不收取销售服务费, C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.20%。本基金销售服务费主要用于本基金基金份

	额持有人服务等各项费用。销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.20% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下： $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为前一日的 C 类基金份额的基金资产净值 销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月首日起两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，由基金管理人代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。 上述“一、基金费用的种类”中第 4-10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。 三、不列入基金费用的项目 3、《基金合同》生效前的相关费用，根据《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》约定执行；	上述“一、集合计划费用的种类”中第 3-9 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。 三、不列入集合计划费用的项目 3、《集合计划合同》生效前的相关费用，根据《东海证券“东风 2 号”集合资产管理计划合同》约定执行；
第十六部分 基金的	三、集合计划收益分配原则	三、基金收益分配原则

收益与分配	1、本集合计划符合分红条件的前提下,由管理人根据集合计划特点自行约定收益分配次数、比例等,具体分配方案以公告为准; 2、本集合计划收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为集合计划份额进行再投资;若投资者不选择,本集合计划默认的收益分配方式是现金分红; 3、集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值,即集合计划收益分配基准日的集合计划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、每一集合计划份额享有同等分配权; 四、收益分配方案 收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。 六、集合计划收益分配中发	1、在本基金符合有关基金分红条件的前提下,本基金可以根据实际情况进行收益分配,具体分配方案以公告为准; 2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红; 3、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值; 4、由于本基金各基金份额费用收取不同,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权; 四、收益分配方案 收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。 六、基金收益分配中发生的费用
---------------------	---	---

	生的费用 集合计划收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,集合计划登记机构可将集合计划份额持有人的现金红利自动转为集合计划份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。	基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金登记机构可将基金份额持有人的现金红利自动转为相应类别的基金份额。红利再投资的计算方法,依照《业务规则》执行。
	第十七部分 集合计划份额的折算 在集合计划合同生效日或管理人决定的其他日期,管理人可以对本集合计划份额进行折算。本集合计划将按照以下规则进行份额折算: 一、集合计划份额折算基准日 在集合计划合同生效日或管理人决定的其他日期,管理人可根据市场情况确定折算基准日。 二、集合计划份额折算对象 集合计划份额折算基准日登记在册的本集合计划份额。 三、集合计划份额折算频率 不定期。	

	四、集合计划份额折算方式 在集合计划合同生效日或管理人决定的其他日期, 管理人对本集合计划份额进行折算时, 本集合计划将按照以下公式进行份额折算: $\text{NUM 后} = \text{NAV 前} \times \text{NUM 前} / 1.0000$ 其中: NAV 前为折算前集合计划份额净值 NUM 前为折算前集合计划份额的份额数 NUM 后为折算后原集合计划份额持有人持有的集合计划份额的份数 集合计划份额的份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位, 小数点第三位及第三位以后的部分舍去, 由此产生的误差计入集合计划财产。 在实施集合计划份额折算时, 折算日折算前集合计划份额净值具体见管理人届时发布的相关公告。 五、集合计划份额折算期间的集合计划业务办理 为保证集合计划份额折算期间本集合计划的平稳运作, 管	
--	---	--

	理人可暂停本集合计划份额的申购或赎回等相关业务,具体见管理人届时发布的相关公告。 六、份额折算的公告 管理人应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。	
第十七部分 基金的会计与审计	一、集合计划会计政策 1、管理人为本集合计划的会计责任方;	一、基金会计政策 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方;
第十八部分 基金的信息披露	五、公开披露的集合计划信息 公开披露的集合计划信息包括: (一) 招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、产品资料概要 本集合计划变更经中国证监会批准后,管理人应将招募说明书提示性公告、《集合计划合同》提示性公告登载在规定报刊上,将招募说明书、产品资料概要、《集合计划合同》和托管协议登载在规定网站上,并将产品资料概要登载在集合计划销售机构网站或营业网点;托管人应当同时将《集合计划合同》、托管协议登载在网站上。 (二)《集合计划合同》生效公告	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: (一) 招募说明书、《基金合同》、托管协议、基金产品资料概要 (二) 基金净值信息 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或赎回前,基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和各

	管理人应当在收到中国证监会批准文件后,将在规定媒介上登载《集合计划合同》生效公告。 (三) 集合计划净值信息 《集合计划合同》生效后,在开始办理集合计划份额申购或赎回前,管理人应当至少每周在规定网站披露一次集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。在开始办理集合计划份额申购或者赎回后,管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、集合计划销售机构网站或者营业网点披露开放日的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。 管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在规定网站披露半年度和年度最后一日的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。 (五) 定期报告,包括年度报告、中期报告和季度报告 管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成年度报告,将年度报告登载在规定网站上,并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。年度报告中的	类基金份额累计净值。在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。 基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日,在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。 (四) 基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将基金年度报告登载在规定网站上,并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告登载在规定网站上,并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。 基金管理人应当在季度结束
--	---	--

	财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。 管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成中期报告,将中期报告登载在规定网站上,并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。 管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内,编制完成季度报告,将季度报告登载在规定网站上,并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。 如报告期内出现单一投资者持有集合计划份额达到或超过集合计划总份额 20%的情形,为保障其他投资者的权益,管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本集合计划的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。 管理人应当在年度报告和中期报告中披露集合计划组合资产情况及其流动性风险分析等。 (六) 临时报告	之日起 15 个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告登载在规定网站上,并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。 基金管理人应当在基金年度报告和基金中期报告中披露基金组合资产情况及其流动性风险分析等。 (五) 临时报告 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项,基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项; 8、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动;
--	---	--

	5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项, 托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项; 8、管理人分管资产管理业务的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动; 9、管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十, 管理人、托管人专门托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十; 10、涉及集合计划财产、集合资产管理计划管理业务、托管业务的诉讼或仲裁; 11、管理人或其高级管理人员、投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚, 托管人或其专门托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚; 14、管理费、托管费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更; 15、集合计划份额净值估值错误达集合计划份额净值百分	9、基金管理人的董事在最近 12 个月内变更超过百分之五十, 基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十; 10、涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁; 11、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚, 基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚; 14、管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更; 15、任一类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五; 20、本基金发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时; 22、基金推出新业务或服务; (六) 澄清公告 在《基金合同》存续期限内, 任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额
--	--	--

	之零点五； 20、发生涉及集合计划申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时； (七) 澄清公告 在《集合计划合同》存续期限内,任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害集合计划份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清,并将有关情况立即报告中国证监会。 (九) 投资资产支持证券信息披露 管理人应在年度报告、中期报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。	价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害基金份额持有人权益的,相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。 (七) 清算报告 基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。 (九) 投资资产支持证券信息披露 基金管理人应在基金年度报告、中期报告中披露基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。 基金管理人应在基金季度报告中披露基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。 (十) 投资国债期货信息披露
--	---	---

	管理人应在季度报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。 (十) 投资国债期货信息披露 管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。 六、信息披露事务管理 托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《集合计划合同》的约定，对管理人编制的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、集合计划清算报告等相关集合计划信息进行复核、审查，并向管理人进行书面或电子确认。	基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标等。 六、信息披露事务管理 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。
--	---	--

第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	一、《集合计划合同》的变更 1、变更集合计划合同涉及法律法规规定或本合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的,应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和集合计划合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项,由管理人和托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。 三、集合计划财产的清算 1、集合计划财产清算小组:自出现《集合计划合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组,管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。 4、集合计划财产清算程序: (1)《集合计划合同》终止情形出现时,由集合计划财产清算小组统一接管集合计划; 5、集合计划财产清算的期限为 6 个月,但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,管理人可针对该部分未能变现证券制定二次清算方案,该方案应经托管人认	一、《基金合同》的变更 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并按规定报中国证监会备案。 三、基金财产的清算 1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立基金财产清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。 4、基金财产清算程序: (1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金财产; 5、基金财产清算的期限为 6 个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限可相应顺延。
--	---	---

	可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对该部分流通受限证券在可流通变现后进行二次或多次清算，并将变现后的资产按合同约定以货币形式全部分配给份额持有人。 四、清算费用 清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。	四、清算费用 清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。
第二十部分 违约责任	一、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《集合计划合同》约定，给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人免责： 2、管理人、托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会的规定作为或不作为	一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中，违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定，给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的，应当承担连带赔偿责任，对损失的赔偿，仅限于直接损失。但是发生下列情况的，当事人免责： 2、基金管理人、基金托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会的规定、市场交易规

	而造成的损失； 二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护集合计划份额持有人利益的前提下，《集合计划合同》能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。	则的作为或不作为而造成的损失； 二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，《基金合同》能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。
第二十一部分 争议的处理和适用的法律	《集合计划合同》受中国法律管辖。	《基金合同》受中国法律（为本基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖并从其解释。
第二十二部分 基金合同的效力	1、《集合计划合同》经管理人、托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章后，经管理人向中国证监会提交变更《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》的申请并经中国证监会批准后，于2021年12月6日起生效，原《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》同日起失效。	1、《基金合同》由《东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划资产管理合同》变更注册而来，经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，经向中国证监会办理变更注册手续获得中国证监会书面确认。经202X年XX月XX日东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划的份额持有人大会决议通过，并报中国证监会备案，自202X年XX月XX日起修订后

	4、《集合计划合同》正本一式六份,除上报有关监管机构一式二份外,管理人、托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。	的《基金合同》生效。 4、《基金合同》正本一式三份,除上报有关监管机构一式一份外,基金管理人、基金托管人各持有一份,每份具有同等的法律效力。
--	--	--