

上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金增加侧袋机制并 修改基金合同等法律文件的公告

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》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》等法律法规及各基金基金合同的规定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，上海东方证券资产管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）决定对旗下9只基金的基金合同等法律文件进行修改，主要涉及增加侧袋机制相关条款及更新基金管理人、部分基金托管人的相关信息等。本次修改将自2021年6月17日（含）起正式生效。现将基金合同修改情况公告如下：

一、修改的基金

序号	基金名称	基金托管人
1	东方红收益增强债券型证券投资基金	招商银行股份有限公司
2	东方红信用债债券型证券投资基金	
3	东方红稳添利纯债债券型发起式证券投资基金	
4	东方红聚利债券型证券投资基金	
5	东方红鑫裕两年定期开放信用债债券型证券投资基金	中国建设银行股份有限公司
6	东方红鑫泰66个月定期开放债券型证券投资基金	上海浦东发展银行股份有限公司
7	东方红益丰纯债债券型证券投资基金	
8	东方红鑫安39个月定期开放债券型证券投资基金	交通银行股份有限公司
9	东方红汇利债券型证券投资基金	中国工商银行股份有限公司

二、基金合同的修改

本次修改主要系根据《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的相关约定增加侧袋机制，主要包括侧袋机制和特定资产的释义、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定、侧袋机制的实施和投资运作安排、实施侧袋机制期间的基金资产估值、实施侧袋机制

期间的基金费用、实施侧袋机制期间的收益分配、实施侧袋机制期间的信息披露等安排。

以东方红收益增强债券型证券投资基金为例，基金合同具体修改内容如下表所示：

位置	原条款	修改后条款
第一部分前言	八、本基金合同约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求，自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。	(删除)
第二部分释义		(增加) 58、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户 59、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产
第六部分基金份额的申购与赎回		(增加) 十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回 本基金实施侧袋机制的，本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。
第七部分基金合同当事人及权利义务	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区中山南路 318 号 31 层 法定代表人：潘鑫军 …… 联系电话：(021) 63325888	一、基金管理人 (一) 基金管理人简况 名称：上海东方证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区中山南路 109 号 7-11 层 法定代表人：宋雪枫 …… 联系电话：(021) 53952888
第七部分基金合	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：招商银行股份有限公司	二、基金托管人 (一) 基金托管人简况 名称：招商银行股份有限公司

同当事人及权利义务	注册地址：深圳市深南大道 7088 号 招商银行大厦 法定代表人：李建红	注册地址：深圳市深南大道 7088 号 招商银行大厦 法定代表人：缪建民
第八部分 基金份额持有人大会		<p>(增加)</p> <p>九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定</p> <p>若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）； 2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）； 3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）； 4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票； 5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人； 6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过； 7、特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三

		<p>三分之二以上（含三分之二）通过。</p> <p>同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。</p> <p>（其后条款序号相应调整）</p>
第十二部分 基金的投资		<p>（增加）</p> <p>七、侧袋机制的实施和投资运作安排 当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>
第十四部分 基金资产估值	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、当前一估值日基金资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p>	<p>六、暂停估值的情形</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>.....</p> <p>（增加）</p> <p>九、实施侧袋机制期间的基金资产估值</p> <p>本基金实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。</p>
第十五部分 基金费用与税收		<p>（增加）</p> <p>五、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费，详见招募说明书的规定。</p> <p>（其后条款序号相应调整）</p>
第十六部分		<p>（增加）</p> <p>七、实施侧袋机制期间的收益分配</p>

基金的收益与分配		本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。
第十八部分基金的信息披露		<p>(增加)</p> <p>(十五)实施侧袋机制期间的信息披露</p> <p>本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</p> <p>(其后条款序号相应调整)</p>
第二十二部分基金合同的效力	4、《基金合同》正本一式六份，除上报有关监管机构一式二份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。	4、《基金合同》正本一式三份，除上报有关监管机构一份外，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。
基金合同摘要根据正文调整		

因上述修订导致的序号变化顺序调整。

三、重要提示

1、上述基金基金合同因增加侧袋机制相关条款作出的修改系根据法律法规而作出，其他修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响，并已履行了规定的程序，符合相关法律法规的规定和上述基金基金合同的约定，修改自2021年6月17日（含）起生效。投资者可登录本基金管理人网站（www.dfham.com）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）查阅修改后的基金合同、托管协议及随后披露的招募说明书（更新）等信息披露文件。如有疑问，投资者可登录本基金管理人网站：www.dfham.com 或拨打客户服务热线：400-9200-808 咨询。

2、侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，因此启用侧袋机制时基金份额持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

3、风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资需谨慎，敬请投资者注意投资风险。投资者投资于上述基金前应认真阅读基金的基金合同、更新的招募说明书及基金产品资料概要。敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

上海东方证券资产管理有限公司

2021年6月17日