
关于东方红-新睿 2 号集合资产管理计划 变更为东方红新海混合型证券投资基金及法律文件 变更的征询意见函

尊敬的投资者：

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》”）、《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）等规定及中国证监会《关于准予东方红-新睿 2 号集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可[2021]1244 号文），作为东方红-新睿 2 号集合资产管理计划（以下简称“东方红-新睿 2 号”）的资产管理人，经与托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，我司拟将东方红-新睿 2 号集合资产管理计划变更为东方红新海混合型证券投资基金（以下简称“东方红新海”或“本基金”），并按照《东方红-新睿 2 号集合资产管理合同》（以下简称“《资管合同》”）、《东方红-新睿 2 号集合资产管理计划说明书》（以下简称“《计划说明书》”）有关约定履行法律文件变更程序。

东方红-新睿 2 号变更为东方红新海涉及法律文件全文变更，即由原东方红-新睿 2 号的法律文件变更为东方红新海的法律文件，包括《东方红新海混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《东方红新海混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）、《东方红新海混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）等，上述法律文件已于 2021 年 6 月 10 日在我司网站（www.dfham.com）披露，敬请投资者仔细阅读。本次东方红-新睿 2 号变更为东方红新海涉及的主要变更和具体流程说明如下：

一、主要变更

（一）变更产品名称

产品名称由“东方红-新睿 2 号集合资产管理计划”变更为“东方红新海混合型证券投资基金”。

（二）变更产品类型

产品类型由“非限定性集合资产管理计划”变更为“混合型证券投资基金”。

（三）增加份额类别设置

《基金合同》生效后，原东方红-新睿 2 号份额变更为 A 类基金份额，基金管理人不再办理该类基金份额的申购业务，但红利再投资份额除外，投资者可在开放赎回业务后每个开放日办理赎回。增设 B 类基金份额，投资者可在开放申购、赎回业务后每个开放日办理申购、赎回业务。

两类基金份额的管理费收费模式不同，A 类基金份额收取固定管理费和业绩报酬，B 类基金份额仅收取固定管理费。两类基金份额的固定管理费分别计算，并从各自对应的资产净值中扣除。变更后的两类基金份额的费用计提方法、计提标准和支付方式详见《基金合同》。

1、A 类基金份额

1) A 类基金份额固定管理费

A 类基金份额固定管理费根据该类基金份额前一日的基金份额累计净值(Y)分档收取，其中，当 $Y \geq 0.95$ 适用的年费率较原东方红-新睿 2 号整体有所降低，改造前后年费率如下表所示。

改造前（东方红-新睿 2 号）		改造后（A 类基金份额）	
集合计划前一日的累计单位净值（X）	适用固定管理费率	前一日的该类基金份额累计净值（Y）	适用固定管理费率
$X < 0.95$	0	$Y < 0.95$	0
$0.95 \leq X \leq 1.20$	1.0%	$Y \geq 0.95$	0.8%
$X > 1.20$	1.5%		

2) A 类基金份额业绩报酬

业绩报酬计提基准及计提比例变更如下：

原东方红-新睿 2 号的业绩报酬约定为，年化收益率 5%以上提取 20%；

东方红新海 A 类基金份额业绩报酬的约定调整为，《基金合同》生效前的部分按年化收益率 5%以上提取 20%计算，《基金合同》生效后的部分按年化收益率 6%以上提取 20%计算。

2、B 类基金份额

1) B 类基金份额固定管理费

B 类基金份额的固定管理费率为 1.50%/年。

2) B 类基金份额业绩报酬

B 类基金份额不收取业绩报酬。

(四) 调整申购相关条款

1、《基金合同》生效后 A 类基金份额不开放申购业务，仅 B 类基金份额开放申购业务。B 类基金份额申购费率与原东方红-新睿 2 号申购费率保持一致；特别地，通过基金管理人直销中心申购 B 类基金份额的养老金客户适用不同的申购费率。

通过基金管理人直销中心申购 B 类基金份额的养老金客户的申购费率如下：

申购金额（M）	适用申购费率
M<100 万元	0.30%
100 万元≤M<500 万元	0.20%
M≥500 万元	1000 元/笔

其他投资者申购 B 类基金份额的申购费率如下：

申购金额（M）	适用申购费率
M<100 万元	1.50%
100 万元≤M<500 万元	1.00%
M≥500 万元	1000 元/笔

因红利再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

2、按照公募基金相关规定调整申购份额的计算方法。

东方红-新睿2号	东方红新海
申购费 = 申购金额×申购费率 净申购金额 = 申购金额－申购费 申购份额 = 净申购金额÷申购价格 集合计划份额面值为 1.00 元。集合计划份额保留小数点后两位，第三位四舍五入。	(1) 申购费用适用比例费率时，申购份额的计算方法如下： 净申购金额=申购金额/（1+申购费率） 申购费用=申购金额-净申购金额 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值 (2) 申购费用为固定金额时，申购份额的计算方法如下： 申购费用=固定金额 净申购金额=申购金额－申购费用 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值

3、调整最低申购金额。东方红-新睿 2 号投资者首次参与集合计划的最低申购金额（含申购费）为 100,000 元，投资者多次参与集合计划的金额（含申购费）

为 100 元的整数倍。

东方红新海 B 类基金份额的单笔最低申购金额为 10 元人民币（含申购费），实际操作中对最低申购限额及交易级差以各销售机构的具体规定为准。

（五）调整赎回相关条款

1、调整赎回费率

东方红-新睿 2 号的退出费由投资者承担，用于推广机构指定营业网点退出业务办理等各项费用。退出费率根据份额存续时间分档收取，具体见下表：

份额存续时间（L）	适用退出费率
L<365 个自然日	0.5%
365 个自然日≤L<730 个自然日	0.3%
L≥730 个自然日	0

东方红新海的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回，适用费率按单笔分别计算。具体如下：

份额持续持有时间（L）	适用赎回费率
L<7 日	1.50%
7 日≤L<30 日	0.75%
30 日≤L<365 日	0.50%
365 日≤L<730 日	0.3%
L≥730 日	0

由原东方红-新睿 2 号份额变更而来的 A 类基金份额的持有期首日为东方红-新睿 2 号份额的参与确认日，申购而来的 B 类基金份额的持有期首日为 B 类基金份额的申购确认日，红利再投资份额的持有期首日为红利转份额日。

赎回费用由基金赎回人承担。对份额持续持有时间小于 30 日的，赎回费用全部归基金财产，对份额持续持有时间长于 30 日小于 3 个月的，赎回费用总额的 75%归基金财产，对份额持续持有时间长于 3 个月但小于 6 个月的，赎回费用总额的 50%归基金财产，对份额持续持有时间长于 6 个月的，赎回费用总额的 25%归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费（注：一个月为 30 日）。

2、调整巨额赎回的情形及处理方式

在东方红新海《基金合同》中增加了“在发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一工作日基金总份额 30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额 30%以上的赎回申请，基金管理人可延期办理赎回。

对该单个基金份额持有人 30%以内（含 30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一工作日基金总份额 30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过 30%的赎回申请进行延期办理。对于未能赎回部分，该基金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，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。”

（六）调整投资相关条款

根据公募基金相关法律法规规定，调整原东方红-新睿 2 号的投资范围。删除了证券投资基金、融资融券业务中的融券业务等不符合法规要求的投资标的，细化债券类和权益类投资标的。

根据变更后基金类型，调整权益类资产的投资比例限制。删除原东方红-新睿 2 号固定收益类资产的投资比例限制（不符合基金相关规定）、现金类资产的投资比例限制（不符合基金相关规定）、具有折价套利机会的资产比例等。

根据公募基金相关法律法规规定调整投资限制。增加股票资产、现金资产的投资比例限制；增加资产支持证券、新股申购、股票期权、流动性受限资产的相关投资限制，增加与私募产品开展逆回购交易质押品的资质要求与《基金合同》约定的投资范围一致的要求；调整参与股指期货、国债期货的相关限制；增加参与融资融券业务中的融资业务的相关限制；调整关联交易原则。

结合我司目前的投资逻辑和公募基金相关法规规定，调整产品资产配置策略、股票投资策略、债券等其他固定收益类投资策略、可转换债券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、定向增发策略、定增破发投资策略、大宗交易投资策略等；删除新股申购投资策略、封闭式基金投资策略、权证投资策略等；新增港股投资策略、存托凭证投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资投资策略、股票期权投资策略等的投资策略；新增业绩比较基准。

主要条款对照如下：

调整项目	东方红-新睿2号	东方红新海
投资目标	本集合计划以追求绝对收益为目标，充分挖掘各类投资品种折价和套利的机会，将价值回归转化成组合收益，并通过股指期货对冲部分系统性风险，力求在不同的市场环境下实现投资组合的稳健增值。	本基金以自上而下和自下而上相结合的方式，深入研究和挖掘权益类资产、可转债和其他债券类资产的投资价值，在严格控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资范围	国内依法发行的权益类资产、固定收益类资产、现金类资产及法律法规允许集合计划投资的其他金融工具。	本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票及存托凭证（包括创业板及其他经中国证监会核准或注册发行的股票及存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行的国家债券、地方政府债券、政府支持机构债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券、证券公司短期公司债券）、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货、股票期权以及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）。本基金可根据法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。
投资比例	（1）固定收益类资产：包括债券逆回购(期限大于7天)、政府债券(到期日在1年以上)、公司债、企业债、可转换债券（含分离交易可转债）、	基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）投资比例为基金资产的30%-70%（其中投资于港股通标的股票的比例

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
	可交换债券、短期融资券、政策性金融债、央行票据(到期日在 1 年以上)、中期票据、中小企业私募债(限于有担保或者国有控股企业发行的中小企业私募债)、股票型及混合型分级基金的优先级份额、股票质押式回购业务、资产支持证券等, 占资产净值的 0-135%。其中, 中小企业私募债券的投资比例不高于集合资产净值的 40% (因规模缩水导致的被动超比例可不受限制)。本集合计划可以参与融资融券交易, 也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。本集合计划参与股票质押式回购业务, 集合资产管理计划为融出方的, 在股票质押回购中质权人登记为管理人。 (2) 权益类资产: 股票 (包括新股申购所得股票, 参与定向增发所得股票)、股票型基金、混合型基金、权证等占资产净值的 0-135%。其中权证上限为 3%。 (3) 现金类资产: 现金、银行存款 (包括但不限于银行定期存款、协议存款、定活两便存款)、货币市场基金、期限为 7 天内(含 7 天)的债券逆回购、到期日在 1 年内(含 1 年)的国债、到期日在 1 年内(含 1 年)的央行票据等高流动性短期金融产品等, 在集合计划封闭期和开放期内占资产净值均不低于 5 %。 (4) 具有折价套利机会的资产, 是指通过某种交易方式使得购置价格低于二级市场价格, 或者通过某些交易方式和金融工具的运用具有套利可能的资产, 包括: 购置价格低	例占股票资产的 0%-50%); 本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后, 保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%, 前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制, 基金管理人在履行适当程序后, 可以调整上述投资品种的投资比例。

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
	于当日收盘价格的大宗交易所得资产、发行价格低于获配当日收盘价的定向增发股票、购置价格低于处于锁定期间的定向增发发行价格的股票、购置价格低于单位净值的封闭式基金、可转换债券及可转换债券转换所得的股票，可交换债券及可交换债券转换所得的股票等，上述资产与现金类资产的总和不低于资产净值的 50%。 （5）卖出股指期货合约价值总额不超过集合计划持有的权益类资产总市值的 20%。 （6）买入股指期货合约价值总额不超过集合计划资产净值的 10%。 （7）在任一时点持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计不超过资产净值的 135%。 （8）如集合计划投资股指期货和/或国债期货，在任何交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后，保持不低于集合资产管理计划资产净值 5%的现金及到期日在 1 年以内(含 1 年)的政府债券。 （9）在任何交易日日终，集合计划买入、卖出国债期货合约价值轧差计算后不超过资产净值的 120% （10）集合计划可以参与证券回购，但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%。 管理人投资融资融券、国债期货投资标的，需事前与托管人就运作流程等协商一致。 管理人应按照《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》及其他	

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
	相关监管规定及监管机构要求做好相关准备后，方可按照本合同的约定参与国债期货，管理人投资国债期货无须另行征求委托人意见。 本集合计划管理人将在集合计划成立之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合以上约定。如因一级市场申购或大宗交易发生投资比例超标，应在购买证券具备调整机会后五个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、投资对象合并、集合计划资产规模发生剧烈变动等因素发生比例超标，应在超标发生之日起在具备调整机会的五个交易日内将投资比例降至许可范围内。 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。	
投资限制	为维护委托人的合法权益，本集合计划投资禁止从事下列行为： 1、集合计划参与证券回购融入资金余额超过集合计划资产净值的 40%。 2、将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途； 3、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资； 4、将集合计划投资于一家公司发行的证券超过资产净值的 10%； 5、管理人将其所管理的客户资产投资于一家公司发行的证券，按证券面值计算，超过该证券发行总量的 10%；	1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金投资组合中股票资产（含存托凭证）投资比例为基金资产的 30%-70%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）； （2）本基金投资组合中可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券、因可转换债券或可交换债券转股所形成的股票以及货币市场工具的投资比例合计不低于基金资产的 30%； （3）每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货及股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
	6、本集合计划投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券（包括管理人母公司保荐（主承销）的证券）的资金超过资产净值的 7%。因集合计划资产申购新股新券或参与大宗交易，致使投资不符合本规定的，管理人应在具备调整机会的五个工作日内进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定； 7、投资于信托公司发行的产品； 8、集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的现金总额，申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量； 9、在任一时点，集合资产管理计划持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计超过资产净值的 135%； 10、如集合计划投资股指期货和/或国债期货，在任何交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后，持有的现金及到期日在 1 年以内的(含 1 年)政府债券低于集合资产管理计划资产净值的 5%； 11、集合计划持有的卖出股指期货合约价值总额超过集合计划持有的权益类资产总市值的 20%； 12、集合计划持有的买入股指期货合约价值总额超过集合计划资产净值的 10%； 13、中国证监会禁止的其他行为。 如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的	金资产净值 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）本基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过基金资产净值的 10%； （5）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），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； （6）本基金管理人管理的全部开放式基金（包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制； （7）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%； （8）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%； （9）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
	规定，则本集合计划不受上述限制。本计划管理人应当自集合计划合同生效之日起 6 个月内使集合计划的投资组合比例符合合同的约定。由于证券市场波动、上市公司合并或集合计划规模变动等管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内，但集合计划管理人应在具备调整机会的五个工作日内进行调整，以达到标准。法律法规另有规定的从其规定。	10%； （10）本基金管理人管理的全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%； （11）本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上（含 BBB）的资产支持证券。基金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； （12）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量； （13）本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资； （14）本基金参与股指期货和/或国债期货交易时，应当遵守下列要求： 1）基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%，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）基金在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%，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%。

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
		3) 基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%，在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%。 4) 任何交易日日终，持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。 其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等。 5) 基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定； 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约定； （15）本基金参与股票期权交易的，应当符合下列要求： 1) 基金因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 10%； 2) 开仓卖出认购期权的，应持有足额标的证券；开仓卖出认沽期权的，应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物； 3) 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的 20%，其中，合约

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
		面值按照行权价乘以合约乘数计算； （16）本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本基金合同约定的投资范围保持一致； （17）本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%； （18）参与融资业务后，在任何交易日日终，本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%； （19）本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行； （20）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。 除上述（3）、（11）、（13）、（16）情形之外，因证券、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，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。 基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。 基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。 法律法规或监管部门取消或调整上

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
		述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定执行，基金管理人及时根据《信息披露办法》在规定媒介公告。 2、禁止行为 为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动： （1）承销证券； （2）违反规定向他人贷款或者提供担保； （3）从事承担无限责任的投资； （4）买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外； （5）向其基金管理人、基金托管人出资； （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动； （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。 如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以调整后的规定为准。 3、关联交易原则 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有

调整项目	东方红-新睿 2 号	东方红新海
		人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。
业绩比较基准	无	沪深 300 指数收益率*50%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）*10%+中债综合指数收益率*40%。

（七）调整合同终止条款

根据公募基金相关规定调整合同终止条款，主要条款对照如下：

东方红-新睿 2 号	东方红新海
有下列情形之一的，集合计划终止： 1、本计划存续期间，计划的委托人少于 2 人； 2、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格； 3、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； 4、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格不能履行职责，且无其他适当的托管机构承接托管人原有的权利和义务； 5、托管人因解散、破产、撤销、丧失集合资产管理计划托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任托管人的职务，且无其他适当的托管机构承接托管人原有的权利及义务； 6、战争、自然灾害等不可抗力导致集合计划不能存续； 7、法律法规和中国证监会规定的其他情况。	有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止： 1、基金份额持有人大会决定终止的； 2、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的； 3、《基金合同》约定的其他情形； 4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

（八）调整估值方法

在估值核算上，根据公募基金相关规定调整原东方红-新睿 2 号的投资范围，相应删除了不符合公募基金要求的资产的估值方法，包括权证、资产支持受益凭证、证券投资基金、股票质押式回购、ETF 套利在途资金等项目、融券业务等不符合要求的投资标的估值方法；增加了股票期权、存托凭证等的估值方法，增加了实施侧袋机制期间的基金资产估值相关约定。此外，明确了 A 类基金份额、B 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为：

$$T \text{ 日某类基金份额净值} = T \text{ 日该类基金份额的基金资产净值} / T \text{ 日该类基金份额余额总数。}$$

东方红-新睿 2 号	东方红新海
七、估值方法 1、上市流通的股票和债券 （1）上市流通的股票，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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；估值日无交易，且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了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的集合计划资产净值的影响在 0.25%以上的，参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》，采用指数收益法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。如有充足证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实地反映股票的公允价值，计划管理人可以与计划托管人协商采用其它估值方法，对停牌股票进行估值。 （2）在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理： 实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，	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（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以估值日收盘价作为估值全价；交易所上市实行全价交易的债券（可转债除外），选取第三方估值机构提供的估值全价

东方红-新睿 2 号	东方红新海
按最近交易日的收盘价估值；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。 未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；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，将参考类似投资品种的现行市价（净价）及重大变化因素，调整最近交易日收盘价（净价），确定公允价值进行估值。如有充足证据表明最近交易日收盘价（净价）不能真实地反映公允价值的，应对最近交易日的收盘价(净价)进行调整，确定公允价值进行估值。 2、未上市的股票 （1）首次发行的股票，采用估值技术确定公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 （2）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日其所在证券交易所上市的同一股票的以第 1 条确定的估值价格进行估值。 （3）送股、转增股、配股和公开增发新股等方式发行的股票，按估值日该上市公司在证券交易所挂牌的同一流通股票的以第 1、（1）条确定的估值价格进行估值。	减去估值全价中所含的债券（税后）应收利息得到的净价进行估值； （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、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值； （2）首次公开发行未上市的股票和债券，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）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 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

东方红-新睿 2 号	东方红新海
3、非公开发行股票 (1) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1、(1) 条确定的估值价格低于非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1、(1) 条确定的估值价格作为估值日该非公开发行股票的价值； (2) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的以第 1、(1) 条确定的估值价格高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值： $FV = C + (P - C) \times \frac{D_l - D_r}{D_l}$ 其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D_l 为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；D_r 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易天数（不含估值日当天）。 4、权证 (1) 上市流通权证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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；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。 (2) 首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难	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、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的，按债券或股票所处的市场分别估值。 5、投资证券衍生品的估值方法 (1) 股指期货合约，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。 (2) 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。 (3) 股票期权合约，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。如有相关法律法规以及监管部门相关规定，按其规定内容进行估值。 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。如提前支取或利率发生变化，应及时进行账务调整。

东方红-新睿 2 号	东方红新海
以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 （3）因持有股票而享有的配股权证，以配股除权日起到配股确认日止，若收盘价高于配股价，则按收盘价和配股价的差额进行估值，若收盘价低于配股价，则估值为零。 （4）国家有最新规定的，按其规定进行估值。 5、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。 6、银行间债券的估值采用中央国债登记结算有限责任公司提供的中债收益率曲线估值价格计算 7、资产支持受益凭证的估值方法 （1）交易所以大宗交易方式转让的资产支持受益凭证，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。 （2）全国银行间市场交易的资产支持受益凭证，根据行业协会指导的处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、流动性及收益率曲线等因素确定其公允价值进行估值。 （3）国家有最新规定的，按其规定进行估值。 8、证券投资基金的估值方法 （1）同一基金分别在两个或两个以上市场交易、登记的，按照所处市场的公允价值分别估值。 （2）在证券交易所交易、登记的上市流通封闭式基金、ETF 基金、场内登记的 LOF 基金等，以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估	7、汇率 本基金外币资产价值计算中，涉及外币对人民币汇率的，应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币中间价为准。 若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，无需召开基金份额持有人大会。 8、本基金参与融资业务的，按照相关法律法规和监管部门的规定估值。 9、本基金投资存托凭证的估值核算依照内地上市交易的股票执行。 10、税收 对于按照中国法律法规和基金投资境内外股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金，本基金将按权责发生制原则进行估值；对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的，基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相应的估值调整。 11、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。 12、当本基金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，并需履行信息披露义务。 13、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

东方红-新睿 2 号	东方红新海
值。在场外交易、登记的开放式基金（含场外登记的 LOF 基金）按前一日基金单位净值估值；前一日未公布基金单位净值的，以最近公布的基金单位净值估值；在基金首次公布单位净值之前按照购入成本估值。 （3）未上市的封闭式基金按估值日的净值估值，若估值日未公布净值，按最近公布的净值估值。 （4）货币市场基金按成本估值，每天按前一开放日公布的万分收益计提收益，估值日无交易的，按最近交易日基金单位净值估值。 9、银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。 10、对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，按照成本估值。 11、股票质押式回购的估值方法 持有的股票质押式回购以成本计价，按股票质押式回购交易业务协议中约定的利率逐日确认利息收入，收益到账日实际收益与计提收益的差额计入当天损益。 12、融资融券交易和将持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司投资品种的估值方法，实际投资前，管理人应提前与托管人协商具体的核算估值办法和投资监督指标。 13、ETF 套利在途资金等项目的估值由管理人与托管人根据 ETF 的申购、赎回规则协商确定。 14、股指期货、国债期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。 15、如有确凿证据表明按上述规定不	如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值 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。

东方红-新睿 2 号	东方红新海
能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，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，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。 如有新增事项或变更事项，按国家有关最新规定估值。管理人应于新规定实施后及时在管理人网站和/或推广网点通告委托人。 16、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时或因其它任何不可抗力致使集合管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，集合管理人必须按规定完成估值工作。	

（九）信息披露条款

原东方红-新睿 2 号无需披露《托管协议》，且集合计划《计划说明书》无需定期更新，改造后的东方红新海需披露《托管协议》，且需要定期更新《招募说明书》。此外，根据公募基金相关规定调整东方红新海的信息披露条款。

主要条款对照如下：

东方红-新睿2号	东方红新海
1、定期报告 定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。 （1）集合计划单位净值报告。 自集合计划成立之日起，每周第一个工作日披露上周末单位净值；开放期内每个工作日披露截止前一个工作日的单位净值。 （2）集合计划的资产管理季度报告和	公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。 2、基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基

东方红-新睿2号	东方红新海
托管季度报告。 管理人每季度向委托人提供资产管理季度报告，托管季度报告在每季度由托管人先行提供给管理人，由管理人代托管人向委托人提供。资产管理季度报告和托管季度报告应对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动、托管情况等作出详细的说明。资产管理季度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，并按相关规定报监管机构备案。上述报告应于每季度结束后的 15 个工作日内由管理人负责披露。集合资产管理合同生效不满二个月的，可以不编制季度报告。 集合计划投资股指期货和/或国债期货的，管理人应当在资产管理季度报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货和/或国债期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货和/或国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。 （3）集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告。 管理人每年度向委托人提供资产管理年度报告，托管年度报告在每年由托管人先行提供给管理人，由管理人代托管人向委托人提供。资产管理年度报告和托管年度报告对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动、托管情况等作出详细的说明。资产管理年度报告由管理人编制，经托管人复核后由管理人公告，并按相关规定报监管机构备案。上述报告应于每会计年度结束后的 60 个工作日内由管理人负责披露。集合资产管理合同生效不满三个月的，可以不编制年度报告。	金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。 3、基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。 4、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。 本基金变更经中国证监会注册后，基金管理人应将基金招募说明书提示性公告、《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。 （二）《基金合同》生效公告 基金管理人应当在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。

东方红-新睿2号	东方红新海
集合计划投资股指期货和/或国债期货的，管理人应当在资产管理年度报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货和/或国债期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货和/或国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。 （4）年度审计报告。 管理人进行年度审计，应当同时对客户资产管理业务的运营情况进行审计，并要求具有证券相关业务资格的会计师事务所就本集合资产管理计划出具单项审计意见。 管理人应当将审计结果按相关规定报监管机构备案，并将本集合资产管理计划的单项审计意见提供给委托人和托管人。 （5）对账单。 管理人应按照有关法律法规的规定编制对账单，对委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况作出说明，在每个季度结束后向委托人提供。对账单的提供形式为邮寄或电子形式，委托人可以选择提供方式，默认的提供方式为电子形式（管理人将根据实际情况选择使用电子邮件、手机信息、管理人网站服务等方式）。 2、临时报告 集合计划存续期间发生以下可能对集合计划运作产生重大影响的事件时，管理人必须按照法律法规和中国证监会的有关规定，及时在管理人网站进行信息披露： （1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资	（三）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者赎回前，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的基金份额净值和基金份额累计净值。 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营业网点，披露开放日的各类基金份额的基金份额净值和基金份额累计净值。 本基金 A 类基金份额净值为未扣除基金管理人业绩报酬前的基金份额净值，不同时间参与的份额因参与时份额净值不同，持有期限不同，赎回时应承担的业绩报酬金额不同，实际赎回金额以登记机构确认数据为准。 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的基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人自 B 类基金份额开始办理申购业务首日起，开始计算并依约披露 B 类基金份额的基金净值信息。 （四）基金份额申购、赎回价格 基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。 （五）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，将年度报告登载于规定网站上，并将年度报

东方红-新睿2号	东方红新海
主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项，管理人应当及时将有关情况向住所所在地中国证监会派出机构报告，并向委托人披露； （2）集合计划资产的估值错误导致错误偏差达到计划资产净值的 0.5%； （3）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请； （4）发生巨额退出并导致延期退出的情形； （5）集合计划终止和清算； （6）合同的补充、修改与变更； （7）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项； （8）负责本集合计划的代理推广机构发生变更； （9）管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格； （10）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； （11）管理人将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券或与管理人有关关联方关系的公司承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易； （12）其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。	告提示性公告登载在规定报刊上。基金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。 《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。 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。 （六）临时报告 本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项； 2、《基金合同》终止、基金清算；

东方红-新睿2号	东方红新海
	3、转换基金运作方式、基金合并； 4、更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所； 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； 6、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更； 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更； 8、基金管理人高级管理人员、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； 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、涉及基金管理业务、基金财产、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； 12、基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易事项，中国证监会另有规定的情形除外； 13、基金收益分配事项； 14、固定管理费、托管费、申购费、赎

东方红-新睿2号	东方红新海
	回费、业绩报酬等费用计提标准、计提方式和费率发生变更； 15、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五； 16、本基金开始办理申购、赎回； 17、调整基金份额类别设置； 18、本基金发生巨额赎回并延期办理； 19、本基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项； 20、本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请； 21、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、基金管理人采用摆动定价机制进行估值； 23、基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。 （七）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。 （八）基金份额持有人大会决议 基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公告。 （九）基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露股指期货、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，并充分揭示股指期货、国债期货交易对本基金总体风险的影响以及是否符合既定

东方红-新睿2号	东方红新海
	的投资政策和投资目标。 （十）基金管理人应当在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金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。 （十一）基金管理人应在基金中期报告及年度报告中披露其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其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。 （十二）基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金参与港股通交易的相关情况。 （十三）基金管理人应在基金投资非公开发行股票后两个交易日内，在中国证监会规定媒介披露所投资非公开发行股票的名称、数量、总成本、账面价值，以及总成本和账面价值占基金资产净值的比例、锁定期等信息。 （十四）基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露本基金参与融资业务情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。 （十五）基金管理人应当在年度报告、中期报告等定期报告中披露业绩报酬收取情况，包括业绩报酬提取总金额、

东方红-新睿2号	东方红新海
	分层提取比例等。 （十六）实施侧袋机制期间的信息披露 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。 （十七）中国证监会规定的其他信息。

（十）增加基金份额持有人大会

根据《基金法》和《运作办法》的规定，在东方红新海《基金合同》中设置基金份额持有人大会机制，约定需召开基金份额持有人大会的事项，并明确持有人大会会议召集人、召集方式；召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式；基金份额持有人出席会议的方式；议事内容与程序；表决和计票规则；实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定等。

二、相关流程安排

《关于东方红-新睿 2 号集合资产管理计划变更为东方红新海混合型证券投资基金及法律文件变更的公告》（以下简称“《变更公告》”）已于 2021 年 6 月 10 日在我司网站公布，敬请查阅。根据《资管合同》及《变更公告》的约定，我司现向贵方发送此《关于东方红-新睿 2 号集合资产管理计划变更为东方红新海混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》。

投资者不同意变更的，应在本征询意见函发出后的十五个工作日内（即 2021 年 6 月 15 日至 2021 年 7 月 5 日）提出退出东方红-新睿 2 号的申请，未提出退出申请的，视同投资者已经同意本次变更；若投资者未对本次变更事项表态，也未在征询意见函发出后的十五个工作日内提出退出申请的，视为投资者同意相关变更事宜，即表明投资者对《基金合同》的承认和接受，并按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。

本次变更将于《变更公告》发布之日起二十个工作日后生效，即 2021 年 7 月 9 日起（含）生效，《基金合同》同日起生效，《资管合同》同日起失效。

投资者自《变更公告》发布之日起（含）至《基金合同》生效日前（不含）

退出集合计划的不收取赎回费，业绩报酬根据《资管合同》的约定收取。

三、重要提示

1、敬请投资者仔细阅读变更后东方红新海的《基金合同》、《托管协议》、《招募说明书》以及相关变更公告。

2、原东方红-新睿 2 号份额在《基金合同》生效后变更为东方红新海 A 类基金份额，A 类基金份额仅开放日常赎回业务（红利再投资除外）。基金管理人将在《基金合同》生效后开始办理东方红新海 B 类基金份额的申购业务，具体业务办理时间和办理规则另行公告。

3、如您需更详细了解东方红-新睿2号变更为东方红新海相关事宜，请登录我司网站www.dfham.com或致电400-920-0808查询。

感谢您一直以来给予东方红资产管理团队的关注和支持，祝您投资顺利、生活顺心！

附件：《关于东方红-新睿 2 号集合资产管理计划变更为东方红新海混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》的回执

上海东方证券资产管理有限公司

2021 年 6 月 11 日

附件：《关于东方红-新睿 2 号集合资产管理计划变更为东方红新海混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》的回执

上海东方证券资产管理有限公司：

本投资者确认，已充分阅读并理解《关于东方红-新睿 2 号集合资产管理计划变更为东方红新海混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》及其附件的相关内容，承诺自行承担投资风险和损失。

本投资者 ☐ 同意 ☐ 不同意 （请打勾）本次合同变更。

投资者：

个人填写：

姓名：_____证件类型：_____证件号码：_____

通信地址：_____ 邮政编码：_____

联系电话：_____ 移动电话：_____ 电子信箱：_____

TA 账号：_____

机构填写：

机构名称：_____ 法定代表人：_____

通信地址：_____ 邮政编码：_____

代理人姓名：_____ 身份证号码：_____

联系电话：_____ 其他：_____

TA 账号：_____

投资者（签字/盖章）：_____

签署日期：_____ 年 _____ 月 _____ 日

回执邮寄地址：

上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层，上海东方证券资产管理有限公司
智能客服部 姜珊（收），邮编：200010；电话：021-53952888-2627。

回执接收电子邮箱：service@dfham.com