

关于东方红-量化 2 号集合资产管理计划

2024 年开放期有关事项的公告

根据《东方红-量化 2 号集合资产管理合同》（以下简称《合同》），东方红-量化 2 号集合资产管理计划（以下简称本集合计划）常规开放期为自成立之日起封闭一个月，封闭期结束后每个自然周的前两个工作日开放（当周只有一个工作日的，则当周只开放一个工作日；当周无工作日的，则当周不开放），若前述工作日为非港股通交易日，则本集合计划当日不开放，开放期顺延，若当周无下一个工作日的，则不再顺延。

现对本集合计划 2024 年度开放期相关事宜公告如下：

一、开放期安排

投资者可在下列开放日交易时间内根据销售机构的业务规则办理本集合计划的参与和退出业务：

1 月 2 日	1 月 3 日
1 月 8 日	1 月 9 日
1 月 15 日	1 月 16 日
1 月 22 日	1 月 23 日
1 月 29 日	1 月 30 日
2 月 5 日	2 月 6 日
2 月 19 日	2 月 20 日
2 月 26 日	2 月 27 日
3 月 4 日	3 月 5 日
3 月 11 日	3 月 12 日
3 月 18 日	3 月 19 日
3 月 25 日	3 月 26 日
4 月 2 日	4 月 3 日
4 月 8 日	4 月 9 日
4 月 15 日	4 月 16 日
4 月 22 日	4 月 23 日
4 月 29 日	4 月 30 日
5 月 6 日	5 月 7 日
5 月 13 日	5 月 14 日
5 月 20 日	5 月 21 日
5 月 27 日	5 月 28 日
6 月 3 日	6 月 4 日
6 月 11 日	6 月 12 日
6 月 17 日	6 月 18 日
6 月 24 日	6 月 25 日
7 月 2 日	7 月 3 日

7 月 8 日	7 月 9 日
7 月 15 日	7 月 16 日
7 月 22 日	7 月 23 日
7 月 29 日	7 月 30 日
8 月 5 日	8 月 6 日
8 月 12 日	8 月 13 日
8 月 19 日	8 月 20 日
8 月 26 日	8 月 27 日
9 月 2 日	9 月 3 日
9 月 9 日	9 月 10 日
9 月 19 日	9 月 20 日
9 月 23 日	9 月 24 日
9 月 30 日	
10 月 8 日	10 月 9 日
10 月 14 日	10 月 15 日
10 月 21 日	10 月 22 日
10 月 28 日	10 月 29 日
11 月 4 日	11 月 5 日
11 月 11 日	11 月 12 日
11 月 18 日	11 月 19 日
11 月 25 日	11 月 26 日
12 月 2 日	12 月 3 日
12 月 9 日	12 月 10 日
12 月 16 日	12 月 17 日
12 月 23 日	12 月 24 日
12 月 30 日	12 月 31 日

二、开放期业务说明

1、参与：

（1）参与金额限制：首次参与最低金额为人民币 100 万元。追加参与最低金额为人民币 1 万元。

（2）参与费率：0。

（3）参与份额的计算方法（计算结果保留到小数点后两位）：

申购份额 = 申购金额 ÷ 申购价格

2、退出：

（1）退出金额限制：当投资者在某一销售机构处持有的计划份额资产净值高于 40 万元时，投资者可以选择全部或部分退出；选择部分退出的，投资者在退出后在该销售机构处持有的计划份额资产净值应当不低于 40 万元，否则管理人有权适当减少该投资者的退出份额，以保证部分退出申请确认后投资者在该销售机构处持有的计划资产净值

不低于 40 万元。当投资者在该销售机构处持有的计划资产净值低于或等于 40 万元时，需要退出的，应当一次性全部退出。

(2) 退出费率：0。

(3) 退出金额的计算方法（计算结果保留到小数点后两位）：

退出金额=退出份额×单位净值-业绩报酬（如有）

3、其他主要费用

(1) 管理费率：1.0%/年

(2) 托管费率：0.15%/年

(3) 业绩报酬：符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红日、委托人退出日和本集合计划终止日，以该笔份额参与日（推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的年化收益率，对 R 大于 5% 的部分提取 20% 的业绩报酬。

关于本集合计划的其他费用、业绩报酬计提方法等详见《合同》“十二、集合计划的费用、业绩报酬和税收”的相关约定，如后续《合同》变更，请以最新《合同》约定的费率为准。业绩报酬计提基准仅用于约定计提业绩报酬的标准，不构成资产管理人对集合计划收益的承诺或保证。

三、其他需要提示的事项

1、首次参与本集合计划的投资者，需签署电子签名约定书，并以电子签名方式签署《合同》后方可参与本集合计划；原已持有本集合计划份额的投资者追加参与时，无需要重复签署《合同》，可直接提交参与申请。

2、参与/退出申请是否有效应以份额登记机构的确认为准。投资者于 T 日提交参与/退出申请后，一般可于 T+2 日后在办理参与/退出的销售机构查询参与/退出确认情况。

3、本公告仅对本集合计划开放期的有关事项予以说明。投资者欲了解本集合计划的详细情况，可通过本公司网站查阅本集合计划的《合同》和《东方红-量化 2 号集合资产管理计划说明书》。敬请投资者关注适当性管理及合格投资者相关规定，确认符合合格投资者要求并提前做好风险测评，根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

如有疑问，投资者可拨打服务热线或登录相关网址进行咨询或查询，网址：www.dfham.com，服务热线：4009200808。

上海东方证券资产管理有限公司

2023 年 12 月 29 日