关于召开东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的第一次提示性公告

上海东方证券资产管理有限公司已于2024年12月20日发布了《关于召开东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的公告》。为了使本次基金份额持有人大会顺利召开,现发布《关于召开东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的第一次提示性公告》。

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》和《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)的有关规定,东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称本基金)的基金管理人上海东方证券资产管理有限公司(以下简称基金管理人)决定以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会,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2024年12月23日起,至2025年2月19日17:00时止(投票表决时间以本公告列明的纸质表决票的寄达地点收到表决票时间为准)。基金管理人有权根据实际情况延迟投票表决截止时间,届时请基金份额持有人关注相关公告。

二、会议审议事项

《关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》(见附件一)。

三、基金份额持有人的权益登记日

本次大会的权益登记日为2024年12月20日,即该日下午交易时间结束后,该日在本基金登记机构登记在册的本基金全体基金份额持有人均有权参与本次基金份额持有人大会的表决。

四、投票

(一)纸质表决票

1、本次会议表决票详见附件四。基金份额持有人可通过本基金管理人网站(www.dfham.com)及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纸质表决票。

2、基金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,并提供本人的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(或基金管理人认可的其他印章,下同),并提供加盖公章的营业执照复印件(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、开户证明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,以及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和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件。

(3)基金份额持有人可根据基金管理人于2024年12月6日发布的《关于拟召开东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会(通讯方式)的预公告》(以下简称《预公告》)及本公告"五、授权"章节的规定授权本基金的基金管理人、基金销售机构以及其他符合法律规定的个人或机构代其在本次基金份额持有人大会上投票。受托人(或称代理人)应在表决票上签字或盖章。如受托人为个人的,需提供受托人的有效身份证件正反面复印件;如受托人为机构的,需提供受托人加盖公章的营业执照复印件(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、开户证明或登记证书复印件等)。受托人接受基金份额持有人纸质方式授权代理投票的,应提供授权委托书原件以及相关公告规定的基金份额持有人的身份证明文件或机构主体资格证明文件等相关文件的复印件。

(4)以上各项中的公章、批文、开户证明及登记证书等,以基金管理人的认可为准。

3、基金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于前述会议投票表决起止时间内或召集人另行公告延迟后的最终投票表决截止时间以前(投票表决时间以本公告列明的纸质表决票的寄达地点收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至以下地址:

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
收件人:吴比
联系地址:上海市黄浦区外马路108号供销大厦7层
投票咨询电话:4009200808(免长途通话费)
会议议案咨询电话:4009200808(免长途通话费)
邮政编码:200010

请在信封表面注明:"东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会投票专用"

(二)基金份额持有人的表决意见代表该基金份额持有人在权益登记日所持全部基金份额的表决意见。

五、授权

本基金的基金份额持有人如不能亲自参与本次大会,自《预公告》发布之日起,可以授权委托基金管理人、基金销售机构或其他符合法律法规规定的机构或个人等代理人参与大会并行使表决权,授权形式及程序应符合本公告的规定。

(一)纸质方式授权

1、授权委托书样本

基金份额持有人通过纸质方式授权的,授权委托书的样本请见本公告附件五。基金份额持有人可通过本基金管理人网站(www.dfham.com)及中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)下载等方式获取授权委托书样本。

2、纸质授权所需提供的文件

(1)个人基金份额持有人授权委托他人投票的,应由委托人填妥并签署授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件五的样本),并提供个人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、开户证明或登记证书复印件等)。

(2)机构基金份额持有人授权委托他人投票的,应由委托人填妥授权委托书原件(授权委托书的格式可参考附件五的样本)并在授权委托书上加盖该机构公章,并提供该机构持有人加盖公章的营业执照复印件(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、开户证明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、开户证明或登记证书复印件等)。

(3)以上各项中的公章、批文、开户证明、登记证书等,以基金管理人的认可为准。

3、纸质授权文件的送达

纸质授权文件应与纸质表决票一同于会议投票表决起止时间内或召集人另行公告延迟后的最终投票表决截止时间以前(投票表决时间以本公告列明的纸质表决票的寄达地点收到表决票时间为准)通过专人送交或邮寄的方式送达至本公告列明的寄达地点。

基金份额持有人纸质授权文件的送达方式、送达时间、收件地址、联系方式等与纸质表决票送达要求一致。

(二)录音电话方式授权(仅适用于个人投资者)

1、基金份额持有人可拨打基金管理人或基金销售机构客户服务电话,并按提示确认身份后授权基金管理人或基金销售机构行使表决权,实际以基金管理人和各销售机构具体情况为准。基金管理人及基金销售机构的呼叫中心也可主动与基金份额持有人取得联系,在通话过程中以回答提问方式核实基金份额持有人身份后,基金管理人及基金销售机构根据基金份额持有人意愿进行授权记录并获得授权。为保护基金份额持有人利益,整个通话过程将被录音。

2、此授权方式的截止时间为2025年2月14日(投票截止日前3个工作日)15:00时止。如基金管理人决定延迟投票表决截止时间的,则电话授权截止时间相应延迟,届时以相关公告为准(授权时间以系统记录时间为准)。

3、基金份额持有人通过电话授权基金管理人或基金销售机构进行投票的方式仅适用于个人投资者。

(三)网络方式授权(仅适用于个人投资者)

1、基金管理人可在基金管理人官网(www.dfham.com)、官方微信平台(dfh_zcgl)、东方红资产管理APP等官方平台设立网络授权专区,基金份额持有人可通过网络授权专区,或登录网址https://dfham.com/s/y,按提示进行网络授权操作,授权基金管理人代为行使表决权。基金份额持有人通过基金管理人官网或其他官方平台网络授权专区进行授权的,基金管理人将核实基金份额持有人的身份,确保基金份额持有人权益。

2、本基金销售机构可在其指定网站或网络平台设立网络授权专区,基金份额持有人可按网页提示进行网络授权操作,授权基金管理人或基金销售机构代为行使表决权。基金份额持有人通过基金销售机构指定网站或网络平台进行授权的,基金销售机构将核实基金份额持有人的身份,确保基金份额持有人权益。

3、此授权方式的截止时间为2025年2月14日(投票截止日前3个工作日)15:00时止。如基金管理人决定延迟投票表决截止时间的,则网络授权截止时间相应延迟,届时以相关公告为准(授权时间以系统记录时间为准)。

4、基金份额持有人通过网络授权基金管理人或基金销售机构进行投票的方式仅适用于个人投资者。

(四)短信授权(仅适用于个人投资者)

1、基金管理人和基金销售机构可通过短信平台向预留手机号码的基金份额持有人发送征集授权短信,基金份额持有人根据征集授权短信的提示以回复短信表明授权意见,未回复意见的视为未授权。

2、此授权方式的截止时间为2025年2月14日(投票截止日前3个工作日)15:00时止。如基金管理人决定延迟投票表决截止时间的,则短信授权截止时间相应延迟,届时以相关公告为准(授权时间以系统记录时间为准)。

3、基金份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的,可选择其他方式进行授权。

4、基金份额持有人通过短信授权基金管理人或基金销售机构进行投票的方式仅适用于个人投资者。

(五)授权效力确定规则

1、基金份额持有人送达了有效表决票,又存在有效纸质授权或有效的其他方式授权的,除另有规定外,以其送达的有效表决票为准。相关授权均视为无效。

2、同一基金份额存在有效的纸质授权和有效的其他方式授权的,不论授权时间先后,均以有效的纸质授权为准。

3、同一基金份额存在多次纸质授权的,以代理人收到的最后一次有效纸质授权为准。如最后时间收到的有效纸质授权有多次,不能确定最后一次纸质授权的,按以下原则处理:若多次授权的授权表示一致的,以一致的授权表示为准;若多次授权同一代理人但授权表示不一致的,视为委托人授权代理人投弃权票;若授权不同代理人且授权表示不一致的,视为授权无效。

4、同一基金份额只存在纸质授权以外的有效的其他方式授权时,以有效的该种授权方式为准。多次以纸质授权以外的其他方式进行有效授权的,以时间在最后的授权为准。如最后时间收到的有效授权委托有多次,不能确定最后一次授权的,按以下原则处理:若多次授权的授权表示一致的,以一致的授权表示为准;若多次授权同一代理人但授权表示不一致的,视为委托人授权代理人投弃权票;若授权不同代理人且授权表示不一致的,视为授权无效。

5、如果委托人在授权委托书中明确其表决意见的,以委托人的表决意见为准;如果授权委托书中未明确委托人的表决意见的,即视为授权代理人按照代理人的意志全权行使表决权;如委托人在同一授权委托表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权代理人投弃权票。

6、基金份额持有人的授权意见代表基金份额持有人在权益登记日所持全部基金份额的授权意见。投资者在权益登记日未持有本基金基金份额的,授权无效。

7、上述授权有效期自授权之日起至本次基金份额持有人大会会议结束之日止;但如果本基金根据本公告"八、二次召集基金份额持有人大会"章节的规定就相同审议事项重新召集持有人大会的,上述授权继续有效。

六、计票

1、本次持有人大会的计票方式为:由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人(中国光大银行股份有限公司)授权代表的监督下在本公告的表决截止日期后2个工作日内进行计票,并由公证机构对其计票过程予以公证并形成决议。

2、基金份额持有人所持每份基金份额享有一票表决权,且每一基金份额享有平等的表决权。

3、表决票效力的认定详见附件三。

七、决议生效与备案

1、本人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基金总份额的50%(含50%),则本次通讯开会视为有效;

2、本次议案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分之二以上(含三分之二)通过方为有效;

3、基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,该决议将由本基金管理人在生效后2日内在规定媒介公告,将在生效后5日内报中国证监会备案。

八、二次召集基金份额持有人大会

根据《基金法》及《基金合同》的规定,本次持有人大会需要本人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代表的本基金基金份额占权益登记日基金总份额的50%以上(含50%)方可召开。如果本次基金份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开,本基金管理人可在《基金合同》规定时间内就同一议案重新召集基金份额持有人大会。重新召集基金份额持有人大会时,对于投票而言,基金份额持有人在本次基金份额持有人大会所投的有效表决票依然有效;如果基金份额持有人在本次基金份额持有人大会中提供了不愿意参加二次大会的说明(具体需以基金管理人认可为准),其在本次基金份额持有人大会所投的有效表决票不计入参加二次大会表决的基金份额总数;如果基金份额持有人重新进行投票的,则以最新的有效表决票为准。对于授权而言,除非授权文件另有载明,本次基金份额持有人大会授权期间基金份额持有人已作出的各类授权依然有效,但如果基金份额持有人重新作出授权,则以最新授权为准,详细说明见届时发布的重新召集基金份额持有人大会的通知。

九、本次大会相关机构

1、召集人(基金管理人):上海东方证券资产管理有限公司
持有人大会专线/客服电话:4009200808(免长途通话费)
联系人:吴比
传真:021-63326981
网址:www.dfham.com
电子邮件:service@dfham.com

2、基金托管人:中国光大银行股份有限公司

3、公证机构:上海市徐汇公证处
联系人:许周莹
联系电话:021-64310286

4、见证律师事务所:上海市通力律师事务所

十、重要提示

1、请基金份额持有人认真阅读本次持有人大会的议案及其说明,详见附件一、附件二。

2、请基金份额持有人认真阅读本次持有人大会表决票效力认定程序和标准,详见附件三。

3、基金份额持有人在提交纸质表决票时,请充分考虑邮寄在途时间,提前寄出纸质表决票。

4、本基金上市交易,为保护基金份额持有人利益,根据深圳证券交易所的业务规定,本基金首次停牌时间为2024年12月20日开市起至当日上午10:30止,10:30起复牌。本基金第二次停牌时间为基金份额持有人大会计票日(2025年2月20日)开市起至基金份额持有人大会会议情况公告日或决议生效公告日(2025年2月21日)上午10:30止,10:30起复牌。如基金份额持有人大会表决通过了本次议案,本基金将在本次基金份额持有人大会决议生效后预留不少于20个交易日的转型选择期。如本次议案未获通过,后续相关业务安排详见基金管理人届时发布的公告。敬请基金份额持有人关注本基金停牌期间的流动性风险。

5、若本次基金份额持有人大会表决通过本基金的转型事宜,基金管理人将在本次基金份额持有人大会决议生效后预留不少于二十个交易日的转型选择期。转型选择期期间,基金份额持有人可以选择将场内份额进行场内赎回、卖出或者通过跨系统转托管转到场外后继续持有场外份额,并同时开放场内买入和场外赎回及转换转出业务。此外,选择期期间本基金不开放场内申购、场外申购及转换转入业务,以及暂停场外转场内的跨系统转托管业务。具体安排详见基金管理人届时发布的相关公告。

无意继续持有转型后东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金份额的投资者请提前做好退出的相关安排。

若转型选择期结束后,基金份额持有人未选择将场内份额进行场内赎回、卖出或未主动通过跨系统转托管转到场外的,原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额,将统一转登记至基金管理人开立的中国证券登记结算有限责任公司场外基金账户上,后续基金份额持有人需对持有的基金份额进行重新确认与登记,此过程即为"确权"。投资者未主动办理确权时,基金管理人有权根据届时发布的公告进行批量确权。确权完成后,基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他交易。基金份额持有人通过二级市场买入的场内份额在转型后不受锁定持有期的限制,但仍需根据转型后《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定办理。

对于基金份额持有人通过二级市场买入的场内份额,如未能在转型选择期内按照相关公告进行退出的,需在确权完成后根据《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定办理赎回。为避免产生赎回成本,请投资者提前做好相关安排。

6、若本次基金份额持有人大会审议的转型及修改基金合同有关事项的议案获表决通过并生效,则本基金基金合同、托管协议、招募说明书、基金产品资料概要将按照决议内容进行修订。

7、本次基金份额持有人大会的有关公告可通过本基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站查阅,投资者如有任何疑问,可致电基金管理人客户服务电话4009200808咨询。

8、本公告的有关内容由上海东方证券资产管理有限公司负责解释。

上海东方证券资产管理有限公司
2024年12月23日

附件:

一、《关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》

二、《关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的说明》

三、《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票效力认定程序和标准》

四、《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决票》

五、《授权委托书》

六、《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金合同》

附件一:

关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
转型及修改基金合同有关事项的议案

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人:

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金由东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)转型而来。基金自2015年1月19日成立以来,运行至今表现平稳。为更好地满足投资者需求,保护基金份额持有人的利益,基金管理人经与基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,决定召开本基金的基金份额持有人大会,对本基金实施转型,将本基金由三年定期开放变更为设置三年锁定持有期,向深圳证券交易所申请终止基金份额的上市交易,并调整投资范围、投资比例、投资策略和投资限制等。转型方案说明见附件二《关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的说明》。

本次基金份额持有人大会中,本人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基金总份额的50%(含50%),则本次通讯开会视为有效;本次议案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分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

同时,为实施本基金转型方案,提议本基金的基金份额持有人授权基金管理人办理本次基金转型的有关具体事宜,并根据基金份额持有人大会决议以及转型后基金运作的特点及现时有效的法律法规,对《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》进行修改和补充。本基金的招募说明书、托管协议及基金产品资料概要也将进行必要的修改或补充。

基金管理人将在本次基金份额持有人大会决议生效后预留不少于二十个交易日供持有人选择赎回的前提下,制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排、向深圳证券交易所申请终止上市交易等事项的转型实施安排并提前公告。提示投资者及时关注基金管理人届时发布的相关公告。

转型选择期期间,基金份额持有人可以选择将场内份额进行场内赎回、卖出或者通过跨系统转托管转到场外后继续持有场外份额。若转型选择期结束后,基金份额持有人未选择将场内份额进行场内赎回、卖出或未主动通过跨系统转托管转到场外的,原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额,将统一转登记至基金管理人开立的中国证券登记结算有限责任公司场外基金账户上,后续基金份额持有人需对持有的基金份额进行重新确认与登记,此过程即为"确权"。投资者未主动办理确权时,基金管理人有权根据届时发布的公告进行批量确权。确权完成后,基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他交易。基金份额持有人通过二级市场买入的场内份额在转型后不受锁定持有期的限制,但仍需根据转型后《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定办理。

以上议案,请予审议。

上海东方证券资产管理有限公司
2024年12月23日

附件二:

关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
转型及修改基金合同有关事项的说明

为更好地满足投资者需求,保护投资者利益,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》和《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)的有关规定,基金管理人上海东方证券资产管理有限公司(以下简称基金管理人)经与本基金基金托管人中国光大银行股份有限公司协商一致,拟对东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金实施转型,本基金的转型已经中国证监会变更注册,基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,表决通过的决议需依法报中国证监会备案。

一、转型方案要点

(一) 变更基金名称

基金名称由"东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金"变更为"东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金"。

(二) 变更基金的运作方式

由三年定期开放变更为设置三年锁定持有期。变更后的运作方式为:

"除基金合同另有约定外,本基金对每份基金份额设置三年锁定持有期。锁定持有期指基金份额登记日(对基金合同生效前已经持有的份额而言,下同)、基金份额申购申请日(对基金合同生效后申购份额而言,下同)或基金份额转换转入申请日(对基金合同生效后转换转入份额而言,下同)起(即锁定持有期起始日),至基金份额登记日、基金份额申购申请日或基金份额转换转入申请日次三年的年度对日的前一日(即锁定持有期到期日)之间的区间。每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期,开放持有期首日为锁定持有期起始日次三年的年度对日。每份基金份额在开放持有期的开放日可以办理赎回及转换转出业务。"

相应删除《基金合同》中有关封闭期、开放期的内容,增加有关持有期的内容。

(三) 终止本基金的上市交易及场内申购赎回安排。相应删去《基金合同》中基金上市交易、场内申购赎回相关的内容。

(四) 变更投资范围

删除"中小板、中小企业私募债、权证",增加"地方政府债、政府支持机构债、超短期融资券、银行存款、股票期权、信用衍生品",且可根据法律法规规定参与融资业务。变更后的投资范围为:

"本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票及存托凭证(含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票及存托凭证)、港股通标的股票、债券(包括国内依法发行的国债、地方政府债、政府支持机构债、金融债、次级债、中央银行票据、企业债、公司债(含证券公司发行的短期公司债)、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)、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、信用衍生品以及经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业务。"

(五) 变更投资比例

由于本基金运作方式的变更,基金投资比例相应变更为:"本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例为基金资产的60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的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。"

(六) 变更投资策略

根据本基金运作方式和投资范围的变更,变更完善可投资标的的投资策略。变更后的投资策略包括:资产配置、股票投资策略、可转换债券、可分离交易可转债和可交换债券的投资策略、其他固定收益类证券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、信用衍生品投资策略、参与融资业务策略。

(七) 调整投资限制

根据转型后的产品特点及可投资标的,基金投资限制条款相应调整为:

"(1)本基金投资于股票资产(含存托凭证)的比例为基金资产的60%-95%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%);

(2)本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)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;

(4)本基金持有一家公司发行的证券,其市值(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)本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(13)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%。

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)基金在任何交易日日终,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;

(14)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,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(15)本基金不得持有信用保护卖方属性的信用衍生品,不得持有合约类信用衍生品,持有的信用衍生品的名义本金不得超过本基金对应受保护债券面值的100%;

(16)本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品的名义本金合计不得超过基金资产净值的10%;

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不符合前述(15)、(16)所规定比例限制的,基金管理人应在3个月之内进行调整;

(17)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基金合同约定的投资范围保持一致;

(18)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的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前款所规定的比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(19)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%;

(20)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;

(21)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。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,则在履行适当程序后,本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行,基金管理人及时根据《信息披露办法》规定在规定媒介公告。

除(2)、(11)、(15)、(16)、(17)、(18)条外,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。"

(八) 变更业绩比较基准

由"沪深300指数收益率×60% +恒生指数收益率×20% +中国债券总指数收益率×20%"变更为"沪深300指数收益率×60% +恒生指数收益率(经汇率估值调整)×20% +中国债券总指数收益率×20%"。

(九) 变更基金的收益与分配

由于本基金终止上市交易,调整基金收益分配原则如下:

"1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金管理人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,若《基金合同》生效不满3个月则可不进行收益分配;

2、本基金的收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金分红或将现金分红自动转为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;选择采取红利再投资形式的,红利再投资的份额免收申购费;

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4、本基金的每份基金份额享有同等分配权;

5、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。"

(十) 调整基金的估值对象和估值方法

根据最新的法律法规、相关规定及本次修改投资范围的实际情况,对原基金的估值对象和估值方法进行了补充调整。

变更后的估值对象为:"基金所拥有的股票、债券、资产支持证券、股票期权合约、股指期货合约、国债期货合约、信用衍生品和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产和负债。"

变更后的估值方法为:

"1、上市或挂牌转让的有价证券的估值

(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了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)已上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种(另有规定的除外),选取估值日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进行估值;

(3)已上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种(另有规定的除外),选取估值日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进行估值;

(4)对于交易所上市交易的公开发行的可转债等有活跃市场的含转股权的债券,实行全价交易的债券以估值日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券以估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价;

(5)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以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进行估值,同时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;

(6)已上市或挂牌转让且不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值。

2、处于未上市或未挂牌转让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,采用估值技术确定公允价值;

(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;

(4)对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

3、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本金或利息,或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种,第三方估值基准服务机构如在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示的,基金管理人在与基金托管人协商一致后,可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。

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、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。

(4)信用衍生品按第三方估值基准服务机构提供的当日估值价格进行估值,但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除;选定的第三方估值基准服务机构未提供估值价格的,依照有关法律法规及《企业会计准则》要求采用合理估值技术确定公允价值。

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,基金管理人应及时进行账务调整。

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汇率中间价为准。

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,并履行相关信息披露义务。

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。

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,基金管理人计算基金资产净值,基金托管人复核、审查基金管理人计算的基金资产净值。基金资产净值计算、基金份额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,基金管理人向基金托管人出具盖章的书面说明后,按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。"

(十一) 其他相关事项的修改

1、补充侧袋机制相关内容,并更新基金托管人信息。

2、根据基金实际情况修改基金的历史沿革。

3、基金管理人需要根据法律法规的要求及转型后的东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金的产品特征、实际运作修订《基金合同》的相关内容。

综上所述,基金管理人拟提请基金份额持有人大会授权基金管理人按照法律法规的规定及转型后的东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金的产品特征,并根据基金份额持有人大会决议修订《基金合同》的其他内容。具体请投资者关注附件六《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金合同》。

二、基金转型前后的申购赎回安排

(一)安排办理申购和赎回业务的转型选择期

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金在深圳证券交易所上市交易,变更注册为东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金后将不再上市交易,且同时取消场内申购赎回安排。本次基金份额持有人大会决议生效后,本基金管理人将向深圳证券交易所申请终止上市及安排终止场内申购、赎回等业务。

基金管理人将在本次基金份额持有人大会决议生效后预留不少于二十个交易日供持有人选择赎回的前提下,制订有关基金转型正式实施的日期、转型实施前的申购赎回安排、向深圳证券交易所申请终止上市交易等事项的转型实施安排并提前公告。提示投资者及时关注基金管理人届时发布的相关公告。

转型选择期期间,基金份额持有人可以选择将场内份额进行场内赎回、卖出或者通过跨系统转托管转到场外后继续持有场外份额。若转型选择期结束后,基金份额持有人未选择将场内份额进行场内赎回、卖出或未主动通过跨系统转托管转到场外的,原登记在中国证券登记结算有限责任公司深圳证券登记结算系统的场内基金份额,将统一转登记至基金管理人开立的中国证券登记结算有限责任公司场外基金账户上,后续基金份额持有人需对持有的基金份额进行重新确认与登记,此过程即为"确权"。投资者未主动办理确权时,基金管理人有权根据届时发布的公告进行批量确权。确权完成后,基金份额持有人方可在场外对相关基金份额进行赎回及其他交易。基金份额持有人通过二级市场买入的场内份额在转型后不受锁定持有期的限制,但仍需根据转型后《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定办理。

转型选择期期间,本基金将不开放场内申购、场外申购及转换转入业务,以及暂停场外转场内的跨系统转托管业务。同时,本基金场内交易、场内赎回、场外赎回及转换转出、场内转场外跨系统转托管业务正常办理。

(二)《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金合同》的生效

自转型选择期结束之日的次一工作日起,本基金管理人将根据基金份额持有人大会决议执行基金的正式转型,将原基金份额变更为东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金的基金份额。

自转型选择期结束之日的次一工作日起,《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金合同》生效,《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时失效,东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金正式变更为东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金(以下简称"转型后基金"),基金合同当事人将按照《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金合同》享有权利并承担义务。

(三)转型后基金申购、赎回业务的办理

转型后基金对每份基金份额设置三年锁定持有期,但基金合同另有约定除外。锁定持有期指基金份额登记日(对基金合同生效前已经持有的份额而言,下同)、基金份额申购申请日(对基金合同生效后申购份额而言,下同)或基金份额转换转入申请日(对基金合同生效后转换转入份额而言,下同)起(即锁定持有期起始日),至基金份额登记日、基金份额申购申请日或基金份额转换转入申请日次三年的年度对日的前一日(即锁定持有期到期日)之间的区间。每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期,开放持有期首日为锁定持有期起始日次三 年的年度对日。每份基金份额在开放持有期的开放日可以办理赎回及转换转出业务。

三、召开基金份额持有人大会的主要风险及预备措施

(一)转型方案被持有人大会否决的风险

为防范转型方案被基金份额持有人大会否决的风险,基金管理人将提前向基金份额持有人征询意见。如有必要,基金管理人将根据基金份额持有人意见,对转型方案进行适当的修订,并重新公告。基金管理人可在必要情况下,推迟基金份额持有人大会的召开时间。

如果议案未获得持有人大会的批准,基金管理人将按照有关规定重新向持有人大会提交转型方案议案。

(二)转型方案通过后遭遇大规模赎回的风险

为应对转型方案通过后遭遇大规模赎回,基金在转型期间将尽可能保证投资组合的流动性,应付转型前后可能出现的较大规模赎回,降低净值波动率。

四、基金管理人联系方式

基金份额持有人若对本方案的内容有任何意见和建议,请通过以下方式联系
基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
客服电话:400-920-0808
公司网站:www.dfham.com

特此说明。

上海东方证券资产管理有限公司
2024年12月23日

附件三:

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金份额持有人大会表决票效力认定程序和标准

一、由本基金管理人授权的两名监督员在基金托管人授权代表的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。

二、纸质表决票通过专人送交或邮寄的方式送达本公告规定的收件人的,表决时间以本基金管理人收到时间为准。2024年12月23日以前或2025年2月19日17:00以后送达基金管理人的,为无效表决,不视为已参与本次基金份额持有人大会表决,亦不计入参与本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数之内。

三、纸质表决票的效力认定

1、纸质表决票填写完整清晰,所提供文件符合本公告规定,且在规定时间之内送达本基金管理人的,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,其所代表的基金份额计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

2、纸质表决票上的表决意见未选、多选、模糊不清或相互矛盾,但其他各项符合本公告规定的视为弃权表决,弃权表决票计入对应的表决结果,其所代表的基金份额计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

3、纸质表决票上的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持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的,或未能在规定时间之内送达本基金管理人的,均为无效表决票;无效表决票不计入参加本次基金份额持有人大会表决的基金份额总数。

4、基金份额持有人重复提交纸质表决票的,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:

(1)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;

(2)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,计入有效表决票;

(3)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,邮寄的以本基金管理人收到的时间为准。

附件四:

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金
基金份额持有人大会表决票

基金份额持有人基本资料		
1	基金份额持有人姓名或名称:	
2	身份证件类型及号码:(个人投资者填写)	
3	营业执照类型及号码:(机构投资者填写)	
如基金份额持有人委托他人代为投票,请填写		
4	代理人姓名或名称:	
5	身份证件类型及号码:(如代理人为个人)	
6	营业执照类型及号码:(如代理人为机构)	
表决意见:《关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》(请在意见栏右方划"√")		
7	同意	
	反对	
	弃权	
签字或盖章		
8	基金份额持有人/代理人签字或盖章: 年 月 日	

(本表决票可打印,在填写完整并签字盖章后均为有效)

关于表决票的填写说明:

请以打"√"方式在表格对应位置注明表决意见。基金份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表基金份额持有人所持全部基金份额的表决意见。表决意见效力的认定规则请详细阅读本次大会公告附件三。

附件五:

授权委托书

本人(或本机构)持有东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")的基金份额,就需基金份额持有人大会审议的《关于东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型及修改基金合同有关事项的议案》,本人(或本机构)的意见为(请在意见栏下方划"√"):

同意	反对	弃权

本人(或本机构)特此授权______代表本人(或本机构)参加东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金份额持有人大会,并按照上述意见代为行使表决权。

上述授权有效期自签署日起至审议上述事项的基金份额持有人大会会议结束之日止。若本基金重新召开审议相同议案的持有人大会的,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):
委托人身份证件号或营业执照号:
代理人(签字/盖章):
代理人身份证件号或营业执照号:
签署日期: 年 月 日

授权委托书填写注意事项:

1. 本授权委托书(样本)可打印或按以上格式自制,在填写完整并签字或盖章后均为有效。

2. 基金份额持有人可以委托本基金的基金管理人、基金销售机构以及其他符合法律法规规定的机构和个人,代为行使本次基金份额持有人大会上的表决权。如基金份额持有人做出多次有效纸质授权的,以代理人收到的最后一次有效纸质授权为准。如最后时间收到的有效纸质授权有多次,不能确定最后一次有效纸质授权的,按以下原则处理:若多次授权的授权表示一致的,以一致的授权表示为准;若多次授权同一代理人但授权表示不一致的,视为委托人授权代理人投弃权票;若授权不同代理人且授权表示不一致的,视为授权无效。

3. 如果委托人在授权委托书中明确其表决意见的,以委托人的表决意见为准;如委托人未在授权委托书表示中明确其表决意见的,视为委托人授权代理人按照代理人的意志全权行使表决权;如委托人在同一授权委托表示中表达多种表决意见的,视为委托人授权代理人投弃权票。

4. 本授权委托书中委托人身份证件号或营业执照号,指基金份额持有人持有本基金基金份额时所使用的证件号码或该证件号码的更新。

5.授权委托书中委托人所持基金的份额以持有人大会权益登记日交易时间结束以后登记在册的信息为准。如本次持有人大会权益登记日交易时间结束后,投资者不再持有本基金的基金份额,则其授权委托书自动失效。

附件六:

上海东方证券资产管理有限公司
东方红睿阳三年持有期混合型
证券投资基金基金合同
基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司
基金托管人:中国光大银行股份有限公司
二零二 年 月

第一部分 前言

一、订立本基金合同的目的、依据和原则

1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益,明确基金合同当事人的权利义务,规范基金运作。

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。

3、订立本基金合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护投资人合法权益。

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、东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金由东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来。变更后的东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金已经中国证监会变更注册。

中国证监会对东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更为本基金的注册,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。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证投资于本基金一定盈利,也不保证最低收益。

四、基金管理人、基金托管人在本基金合同之外披露涉及本基金的信息,其内容涉及界定基金合同当事人之间权利义务关系的,如与基金合同有冲突,以基金合同为准。

投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。

五、本基金按照中国法律法规成立并运作,若基金合同的内容与届时有效的法律法规的强制性规定不一致,应当以届时有效的法律法规的规定为准。

六、本基金可通过内地与香港股票市场交易互联互通机制(以下简称"港股通机制")买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。具体风险揭示烦请查阅本基金招募说明书"风险揭示"章节内容。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,基金资产并非必然投资港股。

七、本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外交易机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。具体风险揭示烦请查阅本基金招募说明书"风险揭示"章节内容。

本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证,基金资产并非必然投资存托凭证。

八、本基金可投资股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品,金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈,会放大收益或损失,在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于金融衍生品或选择不将基金资产投资于金融衍生品,基金资产并非必然投资金融衍生品。

九、为对冲信用风险,本基金可能投资于信用衍生品,信用衍生品投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。

十、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相关内容。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,并且不办理侧袋账户的申购赎回。侧袋机制的具体风险烦请查阅本基金招募说明书"风险揭示"章节内容。

十一、除基金合同另有约定外,本基金每份基金份额设置三年锁定持有期,基金份额在锁定持有期内不办理赎回、转换转出业务。锁定持有期到期后进入开放持有期,每份基金份额自其开放持有期首个开放日起开始办理赎回及转换转出业务。因此基金份额持有人面临在锁定持有期内不能赎回、转换转出基金份额的风险。

十二、基金单一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基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管部门另有规定的,从其规定。

第二部分 释义

《基金合同》中除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:

1、基金或本基金:指东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金,本基金由东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更而来

2、基金管理人:指上海东方证券资产管理有限公司

3、基金托管人:指中国光大银行股份有限公司

4、本基金合同、《基金合同》:指《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效的修订和补充

5、托管协议:指基金管理人与基金托管人签订的《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充

6、招募说明书:指《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

7、基金产品资料概要:指《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新

8、法律法规:指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、规范性文件、司法解释、行政规章以及其他对基金合同当事人有约束力的决定、决议、通知等

9、《基金法》:指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过,经2012年12月28日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订,自2013年6月1日起实施,并经2015年4月24日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改<中华人民共和国港口法>等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订

10、《销售办法》:指中国证监会2020年8月28日颁布、同年10月1日实施的《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

11、《信息披露办法》:指中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施,并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

12、《运作办法》:指中国证监会2014年7月7日颁布、同年8月8日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订

13、《流动性风险管理规定》:指中国证监会2017年8月31日颁布、同年10月1日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订

14、中国证监会:指中国证券监督管理委员会

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

16、基金合同当事人:指受基金合同约束,根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

17、个人投资者:指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人

18、机构投资者:指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织

19、合格境外投资者:指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》(包括其不时修订)及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者,包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者

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

21、基金份额持有人:指依《基金合同》和招募说明书合法取得本基金基金份额的投资人

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等业务

23、销售机构:指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议,办理基金销售业务的机构

24、登记业务:指基金登记、存管、过户、清算和结算业务,具体内容包括投资人基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等

25、登记机构:指办理基金登记业务的机构,本基金的登记机构为上海东方证券资产管理有限公司或接受上海东方证券资产管理有限公司委托代为办理基金登记业务的机构

26、基金账户:指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

27、基金交易账户:指各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、转托管及定期定额投资等业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

28、基金合同生效日:指《东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金基金合同》生效日,原《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同一日终止

29、基金合同终止日:指基金合同规定的基金合同终止事由出现后,基金财产清算完毕,清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

30、基金存续期:指《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效至终止之间的不定期期间

31、工作日:指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

32、年度对日:指某一特定日期在后续日历年份中的对应日期,如该对应日期为非工作日,则顺延至下一个工作日,若该日历年份中不存在对应日期的,则顺延至该月最后一日的下一工作日

33、T日:指销售机构在规定时间受理投资人申购、赎回或其他基金业务申请的开放日

34、T+n日:指自T日起第n个工作日(不包含T日)

35、开放日:指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日,若该工作日为非港股通交易日,则基金管理人有权决定本基金是否开放

36、开放时间:指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

37、锁定持有期:除基金合同另有约定外,对于每份基金份额,锁定持有期指基金份额登记日(对基金合同生效前已经持有的份额而言,下同)、基金份额申购申请日(对基金合同生效后申购份额而言,下同)或基金份额转换转入申请日(对基金合同生效后转换转入份额而言,下同)起(即锁定持有期起始日),至基金份额登记日、基金份额申购申请日或基金份额转换转入申请日次三年的年度对日的前一日(即锁定持有期到期日)之间的区间,基金份额在锁定持有期内不办理赎回、转换转出业务

38、开放持有期:除基金合同另有约定外,对于每份基金份额,自锁定持有期结束后即进入开放持有期,开放持有期首日为锁定持有期起始日次三年的年度对日。每份基金份额在开放持有期期间的开放日可以办理赎回及转换转出业务

39、《业务规则》:指《上海东方证券资产管理有限公司开放式基金业务规则》以及其他适用于证券投资基金的业务规则

40、申购:指基金合同生效后,投资人根据基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

41、赎回:指基金合同生效后,基金份额持有人按基金合同和招募说明书规定的条件要求将基金份额兑换为现金的行为

42、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

43、转托管:指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施的变更所持基金份额销售机构的操作

44、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

45、巨额赎回:指本基金单个开放日,基金净赎回申请(赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额)超过上一工作日基金总份额的10%时的情形

46、元:指人民币元

47、基金收益:指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约

48、基金资产总值:指基金拥有的各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收申购基金款及其他资产的价值总和

49、基金资产净值:指基金资产总值减去基金负债后的价值

50、基金份额净值:指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

51、基金份额累计净值:指计算日基金份额净值与每份基金份额累计分红之和

52、基金资产估值:指计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

53、规定媒介:指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站(包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介

54、不可抗力:指本基金合同当事人不能预见、不能避免并不能克服,且在基金合同由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的,使基金合同当事人无法全部履行或无法部分履行基金合同的任何事件,包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

55、基金销售网点:指基金管理人的直销网点及其他基金销售机构的销售网点

56、货币市场工具:指现金(活期存款);期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具

57、港股通标的股票:指内地投资者委托内地证券公司,经由上海证券交易所、深圳证券交易所或者经中国证监会认可的机构设立的证券交易服务公司,向香港联合交易所有限公司(以下简称"香港联合交易所")进行申报,买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票

58、信用衍生品:指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则,专门用于管理信用风险的信用衍生工具

59、信用保护买方:亦称信用保护购买方,指接受信用风险保护的一方

60、信用保护卖方:亦称信用保护提供方,指提供信用风险保护的一方

61、名义本金:亦称交易名义本金,指一笔信用衍生品交易提供信用保护的金额,各项支付和结算以此金额为计算基准

62、流动性受限资产:指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产,包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、停牌股票、流通受限的新股及非公开发行股票、资产支持证券、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券等

63、摆动定价机制:指当开放式基金遭遇大额申购赎回时,通过调整基金份额净值的方式,将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者,从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待

64、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

65、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

第三部分 基金的基本情况

一、基金名称

东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金。

二、基金的类别

混合型证券投资基金。

三、基金的运作方式

契约型开放式

除基金合同另有约定外,本基金对每份基金份额设置三年锁定持有期。锁定持有期指基金份额登记日(对基金合同生效前已经持有的份额而言,下同)、基金份额申购申请日(对基金合同生效后申购份额而言,下同)或基金份额转换转入申请日(对基金合同生效后转换转入份额而言,下同)起(即锁定持有期起始日),至基金份额登记日、基金份额申购申请日或基金份额转换转入申请日次三年的年度对日的前一日(即锁定持有期到期日)之间的区间。每份基金份额的锁定持有期结束后即进入开放持有期,开放持有期首日为锁定持有期起始日次三年的年度对日。每份基金份额在开放持有期的开放日可以办理赎回及转换转出业务。

四、基金的投资目标

本基金在严格控制投资组合风险的前提下,追求资产净值的长期稳健增值。

五、基金存续期限

不定期

六、基金份额类别设置

在不违反法律法规规定、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,经与基金托管人就清算交收、核算估值、系统支持等方面协商一致,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,不需要召开基金份额持有人大会。

第四部分 基金的历史沿革

东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会2014年12月2日《关于准予东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2014]1293号文)注册募集,基金管理人为上海东方证券资产管理有限公司,基金托管人为中国光大银行股份有限公司。

东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金自2014年12月22日至2015年1月12日进行公开募集,募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认,《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年1月19日起正式生效。

根据《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定,《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效后进入封闭期,封闭期为三年(含三年),封闭期届满后转换为上市开放式基金(LOF)。东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金已于2018年1月19日转型为上市开放式基金(LOF),并将基金名称变更为东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)。

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会2018年10月23日《关于准予东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)变更注册的批复》(证监许可[2018]1698号文)变更注册。

东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)自2018年11月20日至2018年12月13日召开基金份额持有人大会,会议审议通过了《关于东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)投资范围增加港股通标的股票的议案》和《关于东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)转型及修改基金合同有关事项的议案》,上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

自2019年1月16日起,《东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效,《东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金(LOF)基金合同》自同日起失效。

东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金由东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金转型而来。

东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金已经中国证监会20XX年X月X日《关于准予东方红睿阳三年定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更注册的批复》(证监许可[20XX]XX号文)准予变更注册为东方红睿阳三年持有期混合型证券投资基金。

(下转C2版)