

关于东方红添利 9 号集合资产管理计划 拟变更资产管理合同等法律文件部分条款的征询意见函

尊敬的投资者：

根据相关法律法规及《东方红添利 9 号集合资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的约定，我司拟对《资产管理合同》、《东方红添利 9 号集合资产管理计划托管协议》（以下简称“《托管协议》”）的相关条款进行变更，《东方红添利 9 号集合资产管理计划说明书》的相关内容一并调整，《东方红添利 9 号集合资产管理计划风险揭示书》本次不涉及变更。

《资产管理合同》、《托管协议》的具体修改内容如下：

序号	位置	原条款	现条款
1	《资产管理合同》 “十七、投资限制及禁止行为”中 “（一）投资限制”	<p>（一）投资限制</p> <p>为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>1、本计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>2、本集合计划不可以直接从二级市场买入股票，但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因可交换债券换股所形成的股票、因前述所持股票进行股票配售及派发所形成的股票。</p> <p>通过上述方式持有股票的，应遵守以下投资限制：</p>	<p>（一）投资限制</p> <p>为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>1、本计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>2、本集合计划不可以直接从二级市场买入股票，但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因可交换债券换股所形成的股票、因前述所持股票进行股票配售及派发所形成的股票。</p> <p>通过上述方式持有股票的，应遵守以下投资限制：</p>

序号	位置	原条款	现条款
		<p>(1) 本计划投资于单一股票（包括创业板）不得超过本计划资产净值的 5%（按成本计算），因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等因素致使资产管理计划投资不符合本条约定的投资限制的，应当在相关资产可出售、可转让或可交易的 10 个交易日内调整完毕，遇股票停牌等限制流通的情况，调整时间顺延；</p> <p>(2) 本计划投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的 4.99%，同时不得超过该上市公司流通股本的 10%，因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等因素致使资产管理计划投资不符合本条约定的投资限制的，应当在相关资产可出售、可转让或可交易的 10 个交易日内调整完毕，遇股票停牌等限制流通的情况，调整时间顺延；</p> <p>3、本计划投资于单一证券投资基金不得超过本计划资产净值的 20%；</p> <p>4、本计划持有的单只债券市值不得超过计划资产净值的 10%（利率债除外），投资于单一债券的数量不得超过该债券发行</p>	<p>(1) 本计划投资于单一股票（包括创业板）不得超过本计划资产净值的 5%（按成本计算），因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等因素致使资产管理计划投资不符合本条约定的投资限制的，应当在相关资产可出售、可转让或可交易的 10 个交易日内调整完毕，遇股票停牌等限制流通的情况，调整时间顺延；</p> <p>(2) 本计划投资于一家上市公司所发行的股票，不得超过该上市公司总股本的 4.99%，同时不得超过该上市公司流通股本的 10%，因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等因素致使资产管理计划投资不符合本条约定的投资限制的，应当在相关资产可出售、可转让或可交易的 10 个交易日内调整完毕，遇股票停牌等限制流通的情况，调整时间顺延；</p> <p>3、本计划投资于单一证券投资基金不得超过本计划资产净值的 20%；</p> <p>4、本计划持有的单只债券市值不得超过计划资产净值的 10%，投资于单一债券的数量不得超过该债券发行规模的</p>

序号	位置	原条款	现条款
		<p>规模的 20%，因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等因素致使资产管理计划投资不符合本条约定的投资限制的，应当在相关资产可出售、可转让或可交易的 10 个交易日内调整完毕，遇限制流通的情况，调整时间顺延；</p> <p>5、本计划应投资于主体信用评级为 AA 以上(含 AA)的信用债（认可评级机构不含中债资信，可转债、可交债除外）。本计划持有期间，若其信用等级下降、不再符合该投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>7、本计划不得投资于中小企业私募债、创业板定向债；</p> <p>8、本计划投资同业存款的银行其主体评级不低于 AA+（认可评级机构不含中债资信）；</p> <p>9、本计划投资混合型分级基金的优先级份额、债券型基金不得超过计划资产净值的 10%；</p> <p>10、本计划的负债比例（总资产/净资产）不得超过 180%；</p> <p>12、本计划投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%；资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同</p>	<p>20%，因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动等因素致使资产管理计划投资不符合本条约定的投资限制的，应当在相关资产可出售、可转让或可交易的 10 个交易日内调整完毕，遇限制流通的情况，调整时间顺延；</p> <p>5、本计划应投资于主体信用评级为 AA 以上(含 AA)的信用债（认可评级机构不含中债资信，可转债、可交债除外）。本计划持有期间，若其信用等级下降、不再符合该投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>7、本计划不得投资于中小企业私募债、创业板定向债；</p> <p>8、本计划投资同业存款的银行其主体评级不低于 AA+（认可评级机构不含中债资信）；</p> <p>9、本计划投资混合型分级基金的优先级份额、债券型基金不得超过计划资产净值的 10%；</p> <p>10、本计划的负债比例（总资产/净资产）不得超过 180%；</p> <p>12、本计划投资于同一资产的资金不得超过本计划资产净值的 25%；资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资</p>

序号	位置	原条款	现条款
		<p>一资产的资金，不得超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外（“资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外”由管理人自行监控）。</p> <p>13、投资银行存款、同业存单，交易对手应该在本计划白名单范围内，白名单由管理人负责建立及不定期维护，生效后的最新名单应邮件发送托管人及委托人；</p> <p>14、投资国债期货必须以套期保值为目的，且只能做空，卖出期货合约价值总额不超过本计划持有的对应基础资产总市值的 100%。</p> <p>15、投资可转债、可交债评级不得低于 AA-，投资评级为 AA- 的可转债、可交债比例不超过资产总值的 20%（评级以主体评级或债项评级为准，认可评级机构不含中债资信）。</p> <p>16、全部 ABS 资产支持证券的外部债项评级应为 AAA 级以</p>	<p>产的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外（“资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外”由管理人自行监控）。</p> <p>13、投资银行存款、同业存单，交易对手应该在本计划白名单范围内，白名单由管理人负责建立及不定期维护，生效后的最新名单应邮件发送托管人及委托人；</p> <p>14、投资国债期货必须以套期保值为目的，且只能做空，卖出期货合约价值总额不超过本计划持有的对应基础资产总市值的 100%。</p> <p>15、可转债、可交债债项评级不低于 AA，没有债项评级的，以主体评级为准（评级以主体评级或债项评级为准，认可评级机构不含中债资信）；投资时可转债转股溢价率不超过 50%，当可转债纯债溢价率不超过 10%时，转股溢价率不超过 100%。（其中“投资时可转</p>

序号	位置	原条款	现条款
		<p>上，主体评级（原始权益人）应为 AA+（含）以上，且剩余期限不超过 3 年（认可评级机构不含中债资信）。</p> <p>17、投资现金、到期日在一年以内的国债、中央银行票据和政策性金融债券占比不低于资管计划资产净值的 5%。</p> <p>18、本计划投资的银行间市场及交易所上市的资产支持证券优先级、银行间市场上市的资产支持票据优先级，其底层资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产。 （“其底层资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产”由管理人自行监控）</p> <p>19、本计划禁止投资于法律法规规定的非标准化资产；</p> <p>20、本产品不得投资于存托凭证、QDII 基金、商品基金（含商品期货基金和商品 ETF）、黄金 ETF。（对于存托凭证的禁止投资事项由管理人自行监控）</p> <p>21、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定，不需经委托人及托管人同意。</p> <p>上述投资限制第 1 款系根据证券期货经营机构私募资产管理业务的相关法规而制定。若相</p>	<p>债转股溢价率不超过 50%，当可转债纯债溢价率不超过 10% 时，转股溢价率不超过 100%”由管理人自行监控。）</p> <p>16、全部 ABS 资产支持证券的外部债项评级应为 AAA 级以上，主体评级（原始权益人）应为 AA+（含）以上，且剩余期限不超过 3 年（认可评级机构不含中债资信）。</p> <p>17、投资现金、到期日在一年以内的国债、中央银行票据和政策性金融债券占比不低于资管计划资产净值的 5%。</p> <p>18、本计划投资的银行间市场及交易所上市的资产支持证券优先级、银行间市场上市的资产支持票据优先级，其底层资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产。 （“其底层资产不得为资管产品或其收/受益权等具有产品性质的资产”由管理人自行监控）</p> <p>19、本计划禁止投资于法律法规规定的非标准化资产；</p> <p>20、本产品不得投资于存托凭证、QDII 基金、商品基金（含商品期货基金和商品 ETF）、黄金 ETF。（对于存托凭证的禁止投资事项由管理人自行监控）</p>

序号	位置	原条款	现条款
		<p>关法规有所变化，本集合计划的投资限制也将自动作相应的调整。</p> <p>管理人相关投资监督事项的制定和修改应为托管人监控系统修改、测试预留合理必要时间。</p>	<p>21、法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定，不需经委托人及托管人同意。</p> <p>上述投资限制第 1 款系根据证券期货经营机构私募资产管理业务的相关法规而制定。若相关法规有所变化，本集合计划的投资限制也将自动作相应的调整。</p> <p>管理人相关投资监督事项的制定和修改应为托管人监控系统修改、测试预留合理必要时间。</p>
2	<p>《托管协议》</p> <p>“九、投资组合比例监控”中</p> <p>“(一) 投资限制”、“(二) 为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划禁止从事下列投资行为：”</p>	<p>(一) 集合计划管理人严格按照相关法规和集合计划投资原则和投资范围进行投资。</p> <p>投资范围与投资比例：托管人根据《集合资产管理合同》第四条“集合资产管理计划的基本情况”第(四)项“(四) 投资范围和投资比例”中第 1 点“投资范围”与第 2 点“资产配置比例”的约定进行监督。</p> <p>投资限制与禁止行为：托管人根据《集合资产管理合同》第十七条“投资限制及禁止行为”第(一)项“(一) 投资限制”与第(二)项“(二) 禁止行为”的约定进行监督。</p>	<p>(一) 集合计划管理人严格按照相关法规和集合计划投资原则和投资范围进行投资。</p> <p>投资范围与投资比例：托管人根据《集合资产管理合同》第四条“集合资产管理计划的基本情况”第(四)项“(四) 投资范围和投资比例”中第 1 点“投资范围”与第 2 点“资产配置比例”的约定进行监督。</p> <p>投资限制与禁止行为：托管人根据《集合资产管理合同》第十七条“投资限制及禁止行为”第(一)项“(一) 投资限制”的约定进行监督。</p>

序号	位置	原条款	现条款
		<p>(二) 为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划禁止从事下列投资行为：</p> <p>1、投资限制与禁止行为：托管人根据《集合资产管理合同》第十七条“投资限制及禁止行为”第（一）项“（一）投资限制”与第（二）项“（二）禁止行为”的约定进行监督；</p> <p>2、相关法律法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>	<p>(二) 为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划禁止从事下列投资行为：</p> <p>1、投资限制与禁止行为：托管人根据《集合资产管理合同》第十七条“投资限制及禁止行为”第（一）项“（一）投资限制”的约定进行监督；</p> <p>2、相关法律法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>

《关于东方红添利 9 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同等法律文件部分条款的公告》已于 2020 年 11 月 2 日在我司网站（www.dfham.com）公布，敬请查阅。根据《资产管理合同》的约定，我司现向贵方发送此《关于东方红添利 9 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同等法律文件部分条款的征询意见函》。

投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后的最近一个开放期（即 2020 年 11 月 3 日、2020 年 11 月 4 日，以下简称“指定开放期”）提出退出本集合计划的申请；投资者未在前述时间回复意见也未在指定开放期退出计划的，视为投资者同意《资产管理合同》等法律文件变更。投资者不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

投资者不同意变更的，管理人保障其退出集合计划的权利；对于明确答复不同意《资产管理合同》等法律文件变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在《资产管理合同》等法律文件变更生效日次一工作日（即 2020 年 11 月 6 日）做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）。

投资者同意，无论其是否提出退出申请，管理人经与托管人书面达成一致后变更《资产管理合同》等法律文件的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人

的违约行为。

《资产管理合同》等法律文件变更于指定开放期结束后的第一个工作日（即2020年11月5日）起生效，公告内容即成为《资产管理合同》等法律文件的组成部分，届时管理人将在公司网站发布变更后的《东方红添利9号集合资产管理合同》、《东方红添利9号集合资产管理计划托管协议》及《东方红添利9号集合资产管理计划说明书》。

如您需更详细了解《东方红添利9号集合资产管理合同》等法律文件部分条款变更相关事宜，请登录我司网站 www.dfham.com 或致电公司客服电话 400-920-0808 查询。

感谢您一直以来给予的关注和支持，祝您投资顺利、生活顺心！

附件：关于《关于东方红添利9号集合资产管理计划拟变更资产管理合同等法律文件部分条款的征询意见函》的回执

上海东方证券资产管理有限公司

2020年11月2日

附件：关于《关于东方红添利 9 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同等法律文件部分条款的征询意见函》的回执

上海东方证券资产管理有限公司：

本委托人确认，已充分阅读并理解《关于东方红添利 9 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同等法律文件部分条款的征询意见函》及其附件的相关内容，承诺自行承担投资风险和损失。

本委托人 同意 不同意 (请打勾) 此次合同变更。

委托人：

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：_____

委托人（签字/盖章）：_____

签署日期：_____年_____月_____日

回执邮寄地址：

上海市黄浦区中山南路 318 号 2 号楼 31 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：021-63325888-4215。