

关于东方红添利 11 号集合资产管理计划 拟变更资产管理合同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 11 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》的相关条款进行变更，《东方红添利 11 号集合资产管理计划说明书》相关内容一并调整，《东方红添利 11 号集合资产管理计划风险揭示书》此次不涉及修改。

《资产管理合同》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”	为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为： 1、集合计划参与债券、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； 2、集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 180%，中国证监会另有规定的除外； 3、本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的 25%；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	为维护委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为： 1、集合计划参与债券、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； 2、集合资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 180%，中国证监会另有规定的除外； 3、本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过集合计划资产净值的 25%；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

序号	位置	原条款	现条款
		（“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%”由管理人自行监控）； 4、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%； 5、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 20%（利率债除外）； 6、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。 7、同业存款发行主体的国内机构评级不低于 AA； 8、投资的可转债、可交债的主体评级不得低于 AA-；投资于主体评级为 AA-的可转债、可交债的比例合计不超过集合计划资产总值的 20%； 9、本计划应投资于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；其外部债项评级应为 AAA 及以上且主体评级（原始权益人）应为 AA+	（“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%”由管理人自行监控）； 4、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%； 5、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 20%； 6、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。 7、同业存款发行主体的国内机构评级不低于 AA； 8、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；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。）

序号	位置	原条款	现条款
		(含)以上,且剩余期限不超过3年;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) 10、除本合同另有约定外,本计划投资的全部信用债券及其他固定收益类资产主体评级应在AA(含)以上;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(本限制不包含可转换债和可交换债); 11、评级机构不包括中债资信; 12、投资国债期货必须以套期保值为目的,且只能做空,卖出国债期货合约价值总额不超过集合计划持有的固定收益类资产总市值的100%(固定收益类资产是指:国债、地方政府债、央行票据、金融债、公司债(含非公开发行公司债)、企业债、可转换债券(含私募可转换债)、可交换债(含私募可交换债)、可分离交易债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据、债券型基金、股票型及混合型分级基金的优先级	9、本计划应投资于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;其外部债项评级应为AAA及以上且主体评级(原始权益人)应为AA+(含)以上,且剩余期限不超过3年;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) 10、除本合同另有约定外,本计划投资的全部信用债券及其他固定收益类资产主体评级应在AA(含)以上;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(本限制不包含可转换债和可交换债); 11、评级机构不包括中债资信; 12、投资国债期货必须以套期保值为目的,且只能做空,卖出国债期货合约价值总额不超过集合计划持有的固定收益类资产总市值的100%(固定收益类资产是指:国债、地方政府债、央行票据、金融债、公司债(含非公开发行公司债)、企

序号	位置	原条款	现条款
		份额、银行间市场及交易所上市的资产支持证券、银行间市场上市的资产支持票据、非公开定向债务融资工具，以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等)； 13、本计划不得投资于中小企业私募债、创业板定向债； 14、本计划投资股票型及混合型分级基金的优先级份额、债券型基金合计不得超过计划资产净值的 20%； 15、本集合计划禁止投资于法律法规规定的非标准化资产； 16、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。	业债、可转换债券（含私募可转换债）、可交换债（含私募可交换债）、可分离交易债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、债券型基金、股票型及混合型分级基金的优先级份额、银行间市场及交易所上市的资产支持证券、银行间市场上市的资产支持票据、非公开定向债务融资工具，以及经银行间市场交易商协会批准注册发行的其他债务融资工具等)； 13、本计划不得投资于中小企业私募债、创业板定向债； 14、本计划投资股票型及混合型分级基金的优先级份额、债券型基金合计不得超过计划资产净值的 20%； 15、本集合计划禁止投资于法律法规规定的非标准化资产； 16、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。 投资监督事项的制定和调整应为托管人投资监督系统的开发和测试预留合理必要时间。

《关于东方红添利 11 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同部分条款的公告》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 11 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同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》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》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》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》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》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》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 11 号集合资产管理合同》及《东方红添利 11 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 11 号集合资产管理合同》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 11 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同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 11 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同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 11 号集合资产管理计划拟变更资产管理合同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。