（上接B030版）

第二部分 前言	一、订立本合同的目的、依据和原则 2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称"《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。 二、集合资产管理计划资产管理合同(以下简称"集合计划合同")是规定集合计划合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件,其他与集合资产管理计划相关的涉及集合计划合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述,如与集合计划合同有冲突,均以集合计划合同为准。集合计划合同当事人按照《基金法》、集合计划合同及其他有关规定享有权利、承担义务。 集合计划合同的当事人包括集合资产管理计划管理人(以下简称"管理人")、集合资产管理计划托管人(以下简称"托管人")和集合资产管理计划份额持有人(以下简称"集合计划份额持有人")。集合资产管理计划投资人自依本合同取得集合资产管理计划份额,即成为集合计划份额持有人和本合同的当事人,其持有集合资产管理计划份额的行为本身即表明其对集合计划合同的承认和接受。 三、东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划(以下简称"本集合计划"或"集合计划")由东海证券双月盈集合资产管理计划变更而来,东海证券双月盈集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务管理办法》(证监会令第87号)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(证监会公告〔2012〕29号)、《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》及其他有关规定募集并设立。 中国证监会对东海证券双月盈集合资产管理计划变更为本集合计划的批准,并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本集合计划没有风险。 六、本集合计划合同生效后,原东海证券双月盈集合资产管理计划(以下简称"原集合计划")份额变更为本集合计划A类集合计划份额。投资者可按照本合同和招募说明书的约定在运作期到期日办理赎回业务。 七、本集合计划对于每份集合计划份额,设定3个月的滚动运作期。每个运作期到期日前,本集合计划份额持有人不能提出赎回申请。每个运作期到期日,本集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回,则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。故投资者在运作期间到期日前无法赎回的风险,以及错过当期运作期到期日未能赎回而进入下一运作期的风险。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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。 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、本基金由东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更而来,并经中国证监会变更注册。 东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划由原集合计划变更而来,原集合计划由东海证券股份有限公司依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》(证监会令第17号)、《证券公司集合资产管理业务实施细则(试行)》(证监会公告〔2008〕26号)、《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》及其他有关规定募集。 中国证监会对原集合计划变更为东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的批准、东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的变更注册,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。 六、对于投资者依据原《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》获得的东海证券双月盈集合资产管理计划份额,自《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的A类集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金A类基金份额,其持有期自原东海证券双月盈集合资产管理计划份额确认之日起连续计算。 七、对于投资者依据《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金相应类别的基金份额,其持有期自原东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额确认之日起连续计算。 八、本基金对于每份基金份额,设定3个月的最短持有期。在最短持有期内不得办理赎回或转换转出业务,最短持有期届满后方可提出赎回申请。因此,基金份额持有人面临在最短持有期内不能赎回基金份额的风险。请投资者合理安排资金进行投资。 九、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有关章节。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,投资者不得办理侧袋账户份额的申购赎回等业务。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。 十、本基金单个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情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

第三部分 释义	1、集合资产管理计划:指东海证券股份有限公司设立管理的投资者人数不受200人限制的集合资产管理计划 7、招募说明书:指《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新 16、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会 21、投资人、投资者:指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构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 23、集合计划销售业务:指管理人或销售机构宣传推介集合计划,办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 26、登记机构:指办理登记业务的机构。集合计划的登记机构为中国证券登记结算有限责任公司或接受东海证券股份有限公司委托代为办理登记业务的机构。本集合计划的登记机构为东海证券股份有限公司 28、集合计划交易账户:指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申购、赎回等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户 29、集合计划合同生效日:指《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日,《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》同日失效 31、存续期:指《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》生效至《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》终止之间的期限 37、运作期起始日:对于本集合计划合同生效前原集合计划份额而言,第一个运作期起始日指原集合计划份额参与确认日;对于本集合计划合同生效后每份申购份额而言,第一个运作期起始日指该集合计划份额申购确认日。对于上一运作期到期日未赎回的每份集合计划份额的下一运作期起始日,指该类集合计划份额上一运作期到期日的次一工作日 38、运作期到期日:对于每份计划份额,第一个运作期到期日指原集合计划份额参与申请日(对本集合计划合同生效前原集合计划份额而言,下同)或集合计划份额申购申请日(对本集合计划合同生效后的申购份额而言,下同)满3个月对应的月度对日,第二个运作期到期日为原集合计划份额参与申请日或集合计划份额申购申请日满6个月对应的月度对日,第三个运作期到期日为原集合计划份额参与申请日或集合计划份额申购申请日满9个月对应的月度对日,以此类推 39、月度对日:指某一特定日期在后续日历月中的对应日期,如没有对应日期或该日为非工作日,则顺延至下一工作日 40、《业务规则》:指《东海证券股份有限公司集合资产管理计划注册登记业务实施细则》及管理人对其不时做出的修订,是规范管理人所管理的集合计划登记方面的业务规则,由管理人和投资人共同遵守 43、集合计划转换:指集合计划份额持有人按照本合同和管理人届时有效公告规定的条件,申请将其持有管理人管理的、某一集合资产管理计划的份额转换为管理人管理的其他集合资产管理计划份额的行为 45、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集合计划申购申请的一种投资方式 56、A类集合计划份额或A类份额:指投资人申购时收取申购费用,但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费的集合计划份额类别。本合同生效后,原集合计划份额变更为本集合计划的A类集合计划份额 57、C类集合计划份额或C类份额:指从本类别集合计划资产中计提销售服务费而不收取申购费用的集合计划份额类别	6、招募说明书或《招募说明书》:指《东海证券海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金招募说明书》及其更新 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 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 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 25、登记机构:指办理登记业务的机构。基金的登记机构为东海基金管理有限责任公司或接受东海基金管理有限责任公司委托代为办理登记业务的机构 27、基金交易账户:指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、定期定额投资计划等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户 28、基金合同生效日:指《东海海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金基金合同》生效之日,原《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日失效 30、存续期:指原《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限 36、最短持有期:指本基金对每份基金份额设置3个月的最短持有期,即自基金份额申购确认日(对申购份额而言)或集合计划份额确认日(对持有原东海证券双月盈集合资产管理计划份额和/或东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额转型后变更为本基金相应类别的基金份额而言)起至该日3个月后的月度对日(含当日)的期间内,投资者不能提出赎回申请;该日3个月后的月度对日(含当日)起,投资者可以提出赎回申请。若该月度对日不存在对应日期或为非工作日,则顺延至下一工作日。对于持有原东海证券双月盈集合资产管理计划份额和/或东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额转型后变更为本基金相应类别的基金份额,其持有期自原东海证券双月盈集合资产管理计划份额和/或东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的集合计划份额确认之日起连续计算 37、月度对日:指某一特定日期在后续日历月中的对应日期,如没有对应日期或该日为非工作日,则顺延至下一工作日 38、《业务规则》:指东海基金管理有限责任公司相关业务规则,是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则,由基金管理人和投资人共同遵守 40、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 42、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 53、A类基金份额:指投资人申购时收取申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。对于投资者依据原《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》获得的东海证券双月盈集合资产管理计划份额,自《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的A类集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金 A类基金份额;对于投资者依据《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划A类集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金A类基金份额 54、C类基金份额:指投资人申购时不收取申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。对于投资者依据《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划C类集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金C类基金份额

第四部分 集合计划的基本情况	三、集合计划的运作方式 1、投资人在开放日申请办理集合计划份额的申购,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停申购时除外。 2、每个运作期到期日前,本集合计划份额持有人不能提出赎回申请。 对于每份集合计划份额,第一个运作期指原集合计划份额参与确认日(对本集合计划合同生效前原集合计划份额而言,下同)或集合计划份额申购确认日(对本集合计划合同生效后的申购份额而言,下同)起(即第一个运作期起始日),至原集合计划份额参与申请日(对本集合计划合同生效前原集合计划份额而言,下同)或集合计划份额申购申请日(对本集合计划合同生效后的申购份额而言,下同)满3个月对应的月度对日(即第一个运作期到期日)止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起,至原集合计划份额参与申请日或集合计划份额申购申请日满6个月对应的月度对日止。第三个运作期指第二个运作期到期日的次一工作日起,至原集合计划份额参与申请日或集合计划份额申购申请日满9个月对应的月度对日止。以此类推。 3、每个运作期到期日,本集合计划份额持有人可提出赎回申请。 每个运作期到期日,本集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回,则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。 集合计划份额持有人在运作期到期日申请赎回的,管理人按照集合计划合同和招募说明书的约定为集合计划份额持有人办理赎回事宜。 五、集合计划份额的面值 本集合计划份额的面值为人民币1.00元。 六、集合计划存续期限 本集合计划存续期限自《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》生效至2025年6月20日。本集合计划自2025年6月20日后,按照中国证监会相关规定执行。 七、集合计划份额类别设置 本集合计划根据申购费用、销售服务费收取方式的不同,将集合计划份额分为不同的类别。 A类份额:投资人申购时收取申购费用,但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费。 C类份额:从本类别集合计划资产中计提销售服务费而不收取申购费用。 本集合计划A类份额、C类份额分别设置代码,分别计算并公布集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。投资者可选择办理A类份额或C类份额的申购业务。本合同生效后,原集合计划份额变更为本集合计划的A类份额,不另行收取申购费用。 管理人可在不违反法律法规、本合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,经与托管人协商一致,在履行适当程序后管理人增加、减少或调整集合计划份额类别,或对集合计划份额分类办法及规则进行调整,并在调整实施日前管理人依照《信息披露办法》的规定公告,不需要召开集合计划份额持有人大会。	三、基金的运作方式 本基金对于每份基金份额设定 3个月的最短持有期限,即自基金份额申购确认日(对申购份额而言)或集合计划份额确认日(对持有原东海证券双月盈集合资产管理计划份额和/或东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额转型后变更为本基金相应类别的基金份额而言)起至该日3个月后的月度对日的期间内,投资者不能提出赎回申请;该日3个月后的月度对日(含当日)起,投资者可以提出赎回申请。若该月度对日不存在对应日期或为非工作日,则顺延至下一工作日。对于持有原东海证券双月盈集合资产管理计划份额和/或东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额转型后变更为本基金相应类别的基金份额,其持有期自原东海证券双月盈集合资产管理计划份额和/或东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的集合计划份额确认之日起连续计算。 每份基金份额自最短持有期到期日(含该日)起,投资者可以提出赎回申请。 在基金开始办理赎回业务且相应基金份额最短持有期到期日(含该日)起,基金管理人按照《招募说明书》的约定为基金份额持有人办理赎回事宜。 如发生不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放或需依据基金合同暂停申购与赎回业务的,基金管理人有权合理调整申购或赎回业务的办理期间并予以公告。 五、基金份额的面值 本基金基金份额的面值为人民币1.00元。 六、基金存续期限 不定期 七、基金份额类别设置 本基金根据申购费用、销售服务费收取方式等的不同,将基金份额分为不同的类别。 A类基金份额:指投资人申购时收取申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。对于投资者依据原《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》获得的东海证券双月盈集合资产管理计划份额,自《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效后变更为东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的A类集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金 A类基金份额;对于投资者依据《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划A类集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金A类基金份额。 C类基金份额:指投资人申购时不收取申购费用,但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。对于投资者依据《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划C类集合计划份额,自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金 C类基金份额。 本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码,分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资者可选择办理A类基金份额或C类基金份额的申购业务。 各类基金份额净值的计算公式为: T日某类基金份额净值=T日该类基金份额的基金资产净值/T日该类基金份额余额总数。 本基金不同基金份额类别之间暂不开通相互转换业务。如后续开通此项业务的,无需召开基金份额持有人大会审议,但调整前基金管理人需及时公告。 有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由管理人确定,并在招募说明书、基金产品资料概要中公告。 根据基金实际运作情况,基金管理人可在不违反法律法规、本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,经与基金托管人协商一致,在履行适当程序后调整基金份额类别,对基金份额分类办法及规则进行调整,停止现有基金份额类别的销售,调整本基金的申购费率、调低销售服务费率或变更收费方式,并在调整实施日前依照《信息披露办法》的规定公告,不需要召开基金份额持有人大会。

第五部分 集合计划的存续	集合计划合同生效后,连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的,管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他集合资产管理计划合并或者终止集合计划合同等,并在6个月内召集集合计划份额持有人大会。 本集合计划存续期限自《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》生效至2025年6月20日。本集合计划自2025年6月20日后,按照中国证监会相关规定执行。如2025年6月20日后,不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的,无须召开集合计划份额持有人大会。 法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。	基金合同生效后,连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续60个工作日出现前述情形的,基金管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并在6个月内召集基金份额持有人大会。 法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

第六部分 集合计划份额的申购与赎回	二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理集合计划份额的申购,在运作期到期日办理集合计划份额的赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 本集合计划管理人自集合计划合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。 集合计划份额每个运作期到期日,集合计划份额持有人方可就该集合计划份额提出赎回申请。具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。 管理人不得在集合计划合同约定之外的日期或者时间办理集合计划份额的申购、赎回或者转换。投资人在集合计划合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或转换申请的为无效申请。 三、申购与赎回的原则 1、"未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算; 4、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回; 5、办理申购、赎回业务时,应当遵循集合计划份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。 管理人可在法律法规允许且对份额持有人无实质性不利影响的情况下,对上述原则进行调整。管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 2、申购和赎回的款项支付 投资人申购集合计划份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认集合计划份额时,申购生效。 集合计划份额持有人递交赎回申请,赎回成立;登记机构确认赎回时,赎回生效。投资者赎回申请生效后,管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时,赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本合同有关条款处理。 3、申购和赎回申请的确认 管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项退还给投资人。 五、申购和赎回的数量限制 6、当接受申购申请对存量集合计划份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或集合计划单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停集合计划申购等措施,切实保护存量集合计划份额持有人的合法权益。管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对集合计划规模予以控制。具体见管理人相关公告。 7、管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。管理人必须在调整前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本集合计划各类份额净值的计算,均保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T日的集合计划各类份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式:本集合计划申购份额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的A类份额的申购费率由管理人决定,并在招募说明书及产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类集合计划份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式:本集合计划赎回金额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的赎回费率由管理人决定,并在招募说明书及产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类集合计划份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。 4、本集合计划A类份额的申购费用由申购A类份额的投资人承担,不列入集合计划财产。 8、管理人可以在不违反法律法规规定及集合计划合同约定且对存量集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定集合计划促销计划,定期或不定期地开展集合计划促销活动。在集合计划促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,管理人可以适当调低集合计划销售费用。 七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生集合计划合同规定的暂停集合计划资产估值情况时,管理人可暂停或拒绝接受投资人的申购申请。 8、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形之一且管理人决定暂停接受投资人申购申请时,管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第7项情形时,管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制,管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝,被拒绝部分的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,管理人应及时恢复申购业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生上述第1、2、3、5、6、7项情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,管理人应在当日报中国证监会备案,已确认的赎回申请,管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形,按集合计划合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2)部分延期赎回:当管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时,管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合资产管理计划总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资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别集合计划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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。 (3)当本集合计划发生巨额赎回时,在单个集合计划份额持有人赎回申请超过前一开放日集合计划总份额10%的情形下,对该单个集合计划份额持有人在该比例以内的赎回申请,与当日其他赎回申请一起,按上述(1)或(2)方式处理,对该单个集合计划份额持有人超过该比例的赎回申请,如管理人认为支付该集合计划份额持有人的赎回款项有困难或者因支付该集合计划份额持有人的赎回款项而进行的财产变现可能会对本集合计划资产净值造成较大波动时,管理人有权实施延期办理。对于该集合计划份额持有人未能赎回部分,集合计划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,并与下一开放日新增的赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的该类别集合计划份额净值为基础计算赎回金额,以此类推。 选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。 如集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,集合计划份额持有人未能赎回部分作自动延期赎回处理,具体见相关公告。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。 3、巨额赎回的公告 当发生上述巨额赎回并延期办理时,管理人应当通过邮寄、传真或者公告等其他方式在3个交易日内通知集合计划份额持有人,说明有关处理方法,并在两日内在规定媒介上刊登公告。 十一、集合计划转换 管理人可以根据相关法律法规以及本合同的规定决定开办本集合计划与管理人管理的其他集合资产管理计划之间的转换业务,集合计划转换可以收取一定的转换费,相关规则由管理人届时根据相关法律法规及本合同的规定制定并公告,并提前告知托管人与相关机构。 十二、集合计划的非交易过户 集合计划的非交易过户是指集合计划登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本集合计划份额的投资人。 十五、集合计划份额的冻结和解冻 集合计划登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。 十六、集合计划份额的转让 本集合计划暂时不支持份额的转让,但在法律法规允许且条件具备的情况下,管理人可受理集合计划份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请,并由登记机构办理集合计划份额的过户登记。管理人拟受理集合计划份额转让业务的,将提前公告,集合计划份额持有人应根据管理人公告的业务规则办理集合计划份额转让业务。 如相关法律法规允许管理人办理其他集合计划业务,管理人将制定和实施相应的业务规则。	二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理基金份额的申购和/或赎回,具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间,但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 本基金对每份基金份额设定3个月的最短持有期,在本基金开放赎回后,基金管理人仅对持有已满最短持有期的基金份额持有人办理相应基金份额的赎回确认。 基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期或时间提出申购、赎回或转换申请且登记机构确认接受的,其基金份额申购、赎回价格为下一开放日该类基金份额申购、赎回的价格。 三、申购与赎回的原则 1、"未知价"原则,即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算; 4、赎回遵循"先进先出"原则,即按照投资人持有基金份额登记日期的先后次序进行顺序赎回。基金份额持有人持有集合计划份额的期限连续计算; 5、办理申购、赎回业务时,应当遵循基金份额持有人利益优先原则,确保投资者的合法权益不受损害并得到公平对待。 基金管理人可在法律法规允许且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 四、申购与赎回的程序 1、申购和赎回的申请方式 投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金,投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额,否则所提交的申购、赎回申请不成立。 2、申购和赎回的款项支付 投资人申购基金份额时,必须全额交付申购款项,投资人交付申购款项,申购成立;登记机构确认基金份额时,申购生效。若资金在规定时间内未全额到账则申购不成立,申购款项将退回投资人账户,基金管理人、基金托管人和销售机构等不承担由此产生的利息等损失。 基金份额持有人递交赎回申请,赎回成立;登记机构确认赎回时,赎回生效。投资者T日赎回申请生效后,基金管理人将在T+7日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券/期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程时,赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本基金合同载明的其他暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形时,款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。 3、申购和赎回申请的确认 基金管理人应以交易时间结束前受理有效申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),在正常情况下,登记机构在T+1日内对该交易的有效性进行确认。T日提交的有效申请,投资人应在T+2日后(包括该日)及时到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。若申购不成功,则申购款项本金退还给投资人。 基金管理人或登记机构可以在法律法规和基金合同允许的范围内,且在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,对上述业务办理时间进行调整,在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 五、申购和赎回的数量限制 6、当接受申购申请对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时,基金管理人应当采取设定单一投资者申购金额上限或基金单日净申购比例上限、拒绝大额申购、暂停基金申购等措施,切实保护存量基金份额持有人的合法权益。基金管理人基于投资运作与风险控制的需要,可采取上述措施对基金规模予以控制。具体请参见招募说明书或相关公告。 7、基金管理人可在法律法规允许的情况下,调整上述规定申购金额和赎回份额等数量限制。基金管理人必须在调整实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金各类基金份额净值的计算,均保留到小数点后4位,小数点后第5位四舍五入,由此产生的收益或损失由基金财产承担。T日的各类基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,经履行适当程序,可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式:本基金申购份额的计算及余额的处理方式详见《招募说明书》。本基金的A类基金份额申购费率由基金管理人决定,并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值,有效份额单位为份,上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式:本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定,并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用(如有),赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法,保留到小数点后2位,由此产生的收益或损失由基金财产承担。 4、A类基金份额申购费用由申购A类基金份额的投资人承担,不列入基金财产。C类基金份额不收取申购费用。 8、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定且对存量基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下,根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金销售费用。 七、拒绝或暂停申购的情形 2、发生基金合同规定的暂停基金资产估值情况时,基金管理人可暂停接受投资人的申购申请。 8、申购申请超过基金管理人设定的基金总规模、当日申购金额限制、单日净申购比例上限、单一投资者单日或单笔申购金额上限的情形。 9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。 发生上述第1、2、3、5、6、9项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时,基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第7、8项情形时,基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制,基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝,被拒绝部分的申购款项本金将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时,基金管理人应及时恢复申购业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时,基金管理人应按规定报中国证监会备案,已确认的赎回申请,基金管理人应足额支付;如暂时不能足额支付,应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人,未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形,按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时,基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 (2)部分延期赎回:当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下,可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请,应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资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。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。 (3)当本基金出现巨额赎回时,在单个基金份额持有人当日赎回申请超过上一开放日基金总份额10%的情形下,基金管理人认为支付该基金份额持有人的全部赎回申请有困难或者因支付该基金份额持有人的全部赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时,基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出10%的赎回申请实施延期办理,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的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。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分取消赎回或延期办理。如该基金份额持有人在提交赎回申请时选择"取消赎回"的,则其当日未获受理部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。部分延期赎回不受单笔赎回最低份额的限制。对该单个基金份额持有人当日赎回申请中未超过上一开放日基金总份额10%的部分与其他投资者的赎回申请按上述(1)或(2)方式处理,具体见相关公告。 3、巨额赎回的公告 当发生上述巨额赎回并延期办理时,基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个交易日内通知基金份额持有人,说明有关处理方法,并在两日内在规定媒介上刊登公告。 十一、基金转换 基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。 十二、基金的非交易过户 基金的非交易过户是指基金登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其它非交易过户。无论在上述何种情况下,接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资人。 十五、基金份额的冻结、解冻与质押 基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的,被冻结部分产生的权益一并冻结,被冻结部分份额仍然参与收益分配,法律法规另有规定的除外。 如相关法律法规允许,在对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下,基金管理人履行相关程序后可办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人将制定和实施相应的业务规则。 十六、基金份额的转让 在法律法规允许且条件具备的情况下,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响,基金管理人履行相关程序后可受理基金份额持有人通过中国证监会认可的交易场所或者交易方式进行份额转让的申请,并由登记机构办理基金份额的过户登记。基金管理人拟受理基金份额转让业务的,将提前公告,基金份额持有人应根据基金管理人公告的业务规则办理基金份额转让业务。 十八、在不违反相关法律法规规定和基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人可根据具体情况对上述申购和赎回以及相关业务的安排进行补充和调整并提前公告,无需召开基金份额持有人大会审议。

第七部分 集合计划合同当事人及权利义务	一、管理人 (一)管理人简况 名称:东海证券股份有限公司(简称:东海证券) 住所:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层 法定代表人:王文卓 设立日期:1993年1月16日 批准设立机关及批准设立文号:中国人民银行银复〔1992〕362号 资产管理业务资格批准文号:中国证监会证监机构字〔2005〕77号 组织形式:股份有限公司 注册资本:185,555.5556万元整 联系电话:021-20333333 (二)管理人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,管理人的义务包括但不限于: (7)采取适当合理的措施使计算集合计划份额申购、赎回和注销价格的方法符合《集合计划合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告集合计划净值信息,确定集合计划各类份额申购、赎回的价格; (9)编制季度报告、中期报告和年度报告; (11)保守集合计划商业秘密,不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外,在集合计划信息公开披露前应予保密,不向他人泄露; (15)按规定保存集合计划财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料20年以上且不低于法律法规规定的最低期限; 二、托管人 (一)托管人简况 法定代表人:廖林 注册资本:人民币356,406,257,089元 (二)托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,托管人的义务包括但不限于: (2)设立专门的托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员,负责集合计划财产托管事宜; (7)保守集合计划商业秘密,除《基金法》、《集合计划合同》及其他有关规定另有规定外,在集合计划信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露; (8)复核、审查管理人计算的集合计划资产净值、集合计划各类份额净值、集合计划各类份额申购、赎回价格; 三、集合计划份额持有人 集合计划投资者持有本集合计划份额的行为即视为对《集合计划合同》的承认和接受,集合计划投资者自依据《集合计划合同》取得集合计划份额,即成为本集合计划份额持有人和《集合计划合同》的当事人,直至其不再持有本集合计划的集合计划份额。集合计划份额持有人作为《集合计划合同》当事人并不以在《集合计划合同》上书面签章或签字为必要条件。	一、基金管理人 (一)基金管理人简况 名称:东海基金管理有限责任公司 住所:上海市虹口区丰镇路806号3幢360室 法定代表人:严晓珺 设立日期:2013年2月25日 批准设立机关及批准设立文号:中国证监会《关于核准设立东海基金管理有限责任公司的批复》(证监许可[2013]179 号) 组织形式:有限责任公司 注册资本:16480.3118 万元人民币 联系电话:021-60586900 (二)基金管理人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于: (7)采取适当合理的措施使计算基金份额申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金净值信息,确定基金份额申购、赎回的价格; (9)编制基金季度报告、中期报告和年度报告; (11)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露,但因监管机构、司法机关等有权机关、行业自律组织的要求提供,或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外; (15)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限; 二、基金托管人 (一)基金托管人简况 法定代表人:廖林 注册资本:人民币35,640,625.71万元 (二)基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的义务包括但不限于: (2)设立专门的基金托管部门,具有符合要求的营业场所,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员,负责基金财产托管事宜; (7)保守基金商业秘密,除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前予以保密,不得向他人泄露,但因监管机构、司法机关等有权机关、行业自律组织的要求提供,或因审计、法律等外部专业顾问提供服务需要提供的情况除外; (8)复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格; 三、基金份额持有人 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自依据《基金合同》取得基金份额,即成为本基金基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

第八部分 集合计划份额持有人大会	本集合计划份额持有人大会不设日常机构。在本集合计划存续期内,根据本集合计划的运作需要,集合计划份额持有人大会可以设立日常机构,日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开集合计划份额持有人大会,但法律法规另有规定或本合同另有约定的除外: (5)调整管理人、托管人的报酬标准或提高销售服务费; (11)单独或合计持有本集合计划总份额10%以上(含10%)集合计划份额的集合计划份额持有人(以管理人或托管人收到提议当日的集合计划份额计算,下同)就同一事项书面要求召开集合计划份额持有人大会; 2、在法律法规规定和《集合计划合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由管理人和托管人协商后修改,不需召开集合计划份额持有人大会: (2)增加、减少或调整本集合计划的集合计划份额类别、对集合计划份额分类办法及规则进行调整、停止现有集合计划份额类别的销售、调整本集合计划的申购费率、调低销售服务费率或变更收费方式; (4)对《集合计划合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《集合计划合同》当事人权利义务关系发生变化; (5)管理人将本合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司; 二、会议召集人及召集方式 2、管理人未按规定召集或不能召开时,由托管人召集。 四、集合计划份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或集合计划合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或集合计划合同约定的其他方式进行表决。 (2)召集人按集合计划合同约定通知托管人(如果托管人为召集人,则为管理人)到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人(如果托管人为召集人,则为管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取份额持有人的书面表决意见;托管人或管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力; 六、表决 2、特别决议,特别决议应当经参加大会的集合计划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)通过方可做出。除本合同另有约定外,转换集合计划运作方式、更换管理人或者托管人、终止《集合计划合同》、本集合计划与其他集合资产管理计划合并以特别决议通过方为有效。 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当计入出具书面意见的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。 七、计票 2、通讯开会 在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在托管人授权代表(若由托管人召集,则为管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。管理人或托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。 九、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定 若本集合计划实施侧袋机制,则相关集合计划份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例,但若相关集合计划份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例: 3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一(含二分之一); 4、在参与集合计划份额持有人大会投票的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一、召集人在原公告的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的集合计划份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关集合计划份额的持有人参与或授权他人参与集合计划份额持有人大会投票; 7、特别决议应当经参加大会的集合计划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。 同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。	本基金基金份额持有人大会不设日常机构。在本基金存续期内,根据本基金的运作需要,基金份额持有人大会可以设立日常机构,日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的,应当召开基金份额持有人大会,但法律法规另有规定或本基金合同另有约定的除外: (5)调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费率,但法律法规要求调整该等报酬标准或提高销售服务费率的除外; (11)单独或合计持有本基金总份额10%以上(含10%)基金份额的基金份额持有人(以基金管理人收到提议当日的基金份额计算,下同)就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会; 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改,不需召开基金份额持有人大会: (2)调整本基金的基金份额类别、对基金份额分类办法及规则进行调整、停止现有基金份额类别的销售、调整本基金的申购费率、调低销售服务费率或变更收费方式; (4)对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化; (5)基金管理人、登记机构、基金销售机构调整有关基金申购、赎回、转换、基金交易、非交易过户、转托管等业务规则; (6)履行适当程序后,基金推出新业务或服务; 二、会议召集人及召集方式 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时,由基金托管人召集。 四、基金份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。 (2)召集人按基金合同约定通知基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人(如果基金托管人为召集人,则为基金管理人)和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见;基金托管人或基金管理人经通知不参加收取书面表决意见的,不影响表决效力; 六、表决 2、特别决议,特别决议应当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)通过方可做出。除法律法规或本基金合同另有约定外,转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。 采取通讯方式进行表决时,除非在计票时有充分的相反证据证明,否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者,表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决,表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决,但应当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。 七、计票 2、通讯开会 在通讯开会的情况下,计票方式为:由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表(若由基金托管人召集,则为基金管理人授权代表)的监督下进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的,不影响计票和表决结果。 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 若本基金实施侧袋机制,本部分和"基金管理人、基金托管人的更换条件和程序"部分约定的以下情形中的相关基金份额或表决权的比例均指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例,但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的,则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例: 3、通讯开会的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相关基金份额的二分之一(含二分之一); 4、当参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一,召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上(含三分之一)相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票; 7、特别决议应当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。 侧袋机制实施期间,基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的,应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决,同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。表决事项未涉及侧袋账户的,侧袋账户份额无表决权。 侧袋机制实施期间,关于基金份额持有人大会的相关规定以本节特殊约定内容为准,本节没有规定的适用本部分相关约定。

第九部分 管理人、托管人的更换条件和程序	一、管理人和托管人职责终止的情形 (一)管理人职责终止的情形 4、管理人将本合同项下权利义务转让给其以独资或控股方式成立的具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司; (二)管理人更换的特殊程序 当管理人根据相关法律法规的规定,以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司时,在管理人和托管人协商一致的基础上,管理人有权将本合同中管理人的全部权利和义务转让给前述从事资产管理业务的公司,本集合计划的管理人变更为前述从事资产管理业务的公司。前述变更事项无需召开集合计划份额持有人大会审议,但管理人应当保证受让人具备管理本集合计划的相关资格,按照法律法规和中国证监会的要求履行相关程序,并按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。	一、基金管理人和基金托管人职责终止的情形 (一)基金管理人职责终止的情形
第十一部分 集合计划份额的登记	四、集合计划登记机构的义务 集合计划登记机构承担以下义务: 1、配备足够的专业人员办理本集合计划份额的登记业务; 2、严格按照法律法规和《集合计划合同》规定的条件办理本集合计划份额的登记业务;	四、基金登记机构的义务 基金登记机构承担以下义务: 1、配备足够的专业人员办理本基金基金份额的登记业务; 2、严格按照法律法规和《基金合同》规定的条件办理本基金基金份额的登记业务;

第十二部分 集合计划的投资	二、投资范围 集合计划的投资组合比例为: 本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本集合计划保持现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 三、投资策略 本集合计划的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、板块轮换策略、骑乘策略、价值驱动的个券选择策略、信用债券投资策略、可转换债券/可交换债券投资策略、国债期货投资策略、适度的融资杠杆策略、资产支持证券投资策略等,在有效管理风险的基础上,达成投资目标。 5、骑乘策略 通过分析收益率曲线各期限段的利差情况,买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券,随着所持有债券的剩余期限下降,债券的到期收益率将下降,从而获得资本利得。 7、信用债券投资策略 本集合计划的内部信用评级体系包含即期评级和跟踪评级。即期评级侧重于评级的准确性,为信用产品的实时交易提供参考;此外,本集合计划会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪评级,以有效规避信用风险,并把握市场变动带来的投资机会。 本集合计划所投资的信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于AA(含),并将根据经济周期、信用周期的变化,动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例,在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上,积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券选择进行投资,并采取分散化投资策略,严格控制组合整体的违约风险水平。 本集合计划投资于信用债主体评级或债项评级或担保人评级不低于AA(含),且应当遵守下列要求: (2)本集合计划投资于AA+信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的50%; (3)本集合计划投资于AA信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的20%。 信用评级参照评级机构(中债资信除外)评定的最新债项评级,无债项评级的参照主体评级或担保人评级。 8、可转换债券/可交换债券投资策略 可转换债券兼具股票资产与债券资产的特点,具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本集合计划着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究,重点关注盈利能力或成长前景较好的上市公司的转债,确定不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值,同时考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征,选择合适的投资品种。 本集合计划将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债券的战略结构性投资机遇,适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会,选择最具吸引力标的进行配置。 四、投资限制 1、组合限制 集合计划的投资组合应遵循以下限制: (1)本集合计划投资于债券的比例不低于集合计划资产的80%; (2)每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,保持不低于集合计划资产净值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、应收申购款等; (4)本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%; (8)本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划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%; (9)本集合计划应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。集合计划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; (10)本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的40%,进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年,债券回购到期后不得展期; (11)本集合计划投资于国债期货,还应遵循如下投资组合限制: ④本集合计划所持有的债券(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《集合计划合同》关于债券投资比例的有关约定。 除上述(2)、(9)、(12)、(13)情形之外,因证券市场波动、期货市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的,管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。 法律法规或监管部门取消或变更上述限制,如适用于本集合计划,管理人在履行适当程序后,则本集合计划投资不再受相关限制或以变更后的规定为准,但须提前公告,不需要经集合计划份额持有人大会审议。 2、禁止行为 (4)买卖其他集合计划份额或基金份额,但是中国证监会另有规定的除外; 五、业绩比较基准 本集合计划采用"中债综合财富(1年以下)指数收益率×90%+一年期定期存款利率(税后)×10%"作为业绩比较基准。 本集合计划选择上述业绩比较基准的原因为:中债综合财富(1年以下)指数是中债金融估值中心有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的短期债券指数,旨在反映短期债券的整体价格和投资回报情况;银行一年期定期存款税后利率为中国人民银行公开发布,具有较强的权威性和市场影响力。基于本集合计划的投资范围和投资比例限制,该业绩比较基准能够较好地反映本集合计划的风险收益特征。 如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布,或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准,或今后法律法规发生变化,或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本集合计划的业绩比较基准时,本集合计划管理人可以根据本集合计划的投资范围和投资策略,调整集合计划的业绩比较基准,但应在取得托管人同意后履行适当程序,并及时公告。 六、风险收益特征 本集合计划为债券型集合资产管理计划,理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金、混合型集合资产管理计划、股票型基金、股票型集合资产管理计划。 七、管理人代表集合计划行使债权人权利的处理原则及方法 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。	二、投资范围 基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 若法律法规的相关规定发生变更或监管机构允许,基金管理人在履行适当程序后,可对上述资产配置比例进行调整。 三、投资策略 本基金的投资策略包括买入持有策略、久期调整策略、收益率曲线配置策略、板块轮换策略、骑乘策略、价值驱动的个券选择策略、信用债券投资策略、可转换债券/可交换债券投资策略、国债期货投资策略、适度的融资杠杆策略、资产支持证券投资策略等,在有效管理风险的基础上,达成投资目标。 5、骑乘策略 通过分析收益率曲线各期限段的利差情况,买入收益率曲线较为陡峭处所对应的期限债券,随着所持有债券的剩余期限下降,债券的到期收益率将下降,从而获得资本利得。 7、信用债券投资策略 本基金将根据经济周期、信用周期的变化,动态调整不同行业、不同评级信用债券的配置比例,在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上,积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资,并采取分散化投资策略,严格控制组合整体的违约风险水平。 本基金投资信用债(含资产支持证券,下同)评级须在AA+(含AA+)以上,为更好控制投资组合面临的信用风险,本基金的投资遵从以下投资比例限制: (2)本基金投资于AA+信用评级的信用债的比例不超过全部信用债资产的50%。 上述信用评级为债项评级,短期融资券、超短期融资券等短期信用债的信用评级依照评级机构出具的主体信用评级,本基金投资的信用债若无债项评级的,参照主体信用评级。评级信息参照资信评级机构发布的最新评级结果,评级机构不包含中债资信评估有限责任公司。本基金持有信用债期间,如果其信用评级下降、基金规模变动、变现信用债券支付赎回款项等使得投资比例不再符合前述标准,应在评级报告发布之日或不再符合前述标准之日起3个月内调整至符合约定。 8、可转换债券、可交换债券投资策略 可转换债券兼具股票资产与债券资产的特点,具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本基金着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究,重点关注盈利能力或成长前景较好的上市公司的可转债,确定不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值,同时考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征,选择合适的投资品种。 本基金将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债券的战略结构性投资机遇,适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会,选择具有吸引力标的进行配置。 四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制: (1)本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%; (2)每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; (4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,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; (8)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%; (9)本基金管理人管理的全部开放式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; (10)本基金投资于国债期货,还应遵循如下投资组合限制: ④本基金所持有的债券(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; 除上述(2)、(11)、(12)情形之外,因证券市场波动、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。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。 2、禁止行为 (4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外; 五、业绩比较基准 本基金采用"中债综合全价(总值)指数收益率×80%+一年期定期存款利率(税后)×20%"作为业绩比较基准。 本基金选择上述业绩比较基准的原因为:中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖范围广,适合作为债券市场投资收益的衡量标准。基于本基金主要投资债券类资产,选取该业绩比较基准能够忠实的反映本基金的风险收益特征;银行一年期定期存款利率(税后)为中国人民银行公开发布,具有较强的权威性和市场影响力。基于本基金的投资范围和投资比例限制,该业绩比较基准能够较好地反映本基金的风险收益特征。 如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布,或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准,或今后法律法规发生变化,或市场上出现其他代表性更强、更加适用于本基金的业绩比较基准时,本基金基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,依据维护基金份额持有人利益的原则,经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后调整本基金的业绩比较基准并及时公告。 六、风险收益特征 本基金为债券型基金,理论上其预期收益和预期风险高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。 七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法 3、不通过关联交易为自身、雇员、授权代表或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

第十四部分 集合计划资产估值	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,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每日收盘价作为估值全价; (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; 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理: 首次公开发行未上市的债券,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、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、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别估值。 5、投资证券衍生品的估值方法 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。 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。 7、同业存单的估值方法 同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值;选定的第三方估值机构未提供估值价格的,按成本估值。 8、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,管理人可根据具体情况与托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。 9、当集合计划发生大额申购或赎回情形时,管理人可以采用摆动定价机制,以确保集合计划估值的公平性,具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定,具体见管理人届时的相关公告。 五、估值程序 1、某一类别集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后,某一类别集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算,精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。 2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后,将当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值结果发送托管人,经托管人复核无误后,由管理人按规定对外公布。 六、估值错误的处理 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下: (3)当集合计划份额净值计算错误给集合计划和集合计划份额持有人造成损失需要进行赔偿时,管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任,经确认后按以下条款进行赔偿: 1)本集合计划的会计责任方由管理人担任,与本集合计划有关的会计问题,如经双方在平等基础上充分讨论后,尚不能达成一致时,按管理人的建议执行,由此给集合计划份额持有人和集合计划财产造成的损失,由管理人负责赔付。 2)若管理人计算的集合计划份额净值已由托管人复核确认后公告,由此给集合计划份额持有人造成损失的,应根据法律法规的规定对份额持有人或集合计划支付赔偿金,就实际向份额持有人或集合计划支付的赔偿金额,管理人与托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。 3)如管理人和托管人对集合计划份额净值的计算结果,虽然多次重新计算和核对或对管理人采用的估值方法,尚不能达成一致时,为避免不能按时公布集合计划份额净值的情形,以管理人的计算结果对外公布,由此给集合计划份额持有人和集合计划造成的损失,由管理人负责赔付。 4)由于管理人提供的信息错误(包括但不限于集合计划申购或赎回金额等),进而导致集合计划份额净值计算错误而引起的集合计划份额持有人和集合计划财产的损失,由管理人负责赔付。 (4)管理人和托管人由于各自技术系统设置而产生的净值计算尾差,以管理人计算结果为准。 5、特殊情况的处理 (1)管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第8项进行估值时,所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理; (2)由于不可抗力原因、有关会计制度变化、市场规则变更或由于证券/期货交易所及登记结算公司等第三方机构发送的数据错误等,管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的集合计划资产估值错误,管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。 七、暂停估值的情形 4、中国证监会和集合计划合同认定的其它情形。 八、集合计划净值的确认 集合计划资产净值和各类集合计划份额净值由管理人负责计算,托管人负责进行复核。管理人应于每个估值日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人,由管理人按规定对集合计划净值予以公布。	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,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)对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种(法规另有规定的除外),选取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,基金管理人应根据相关法律、法规的规定进行涉税处理。 (3)对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券,实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。 (4)对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种(法规另有规定的除外),选取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。 (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。 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理: (1)首次公开发行未上市或未挂牌转让的债券,采用估值技术确定公允价值。 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相应品种当日的估值全价估值。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全价或推荐估值全价估值。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选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值,同时应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。 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、国债期货的估值 国债期货合约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。 6、银行定期存款或通知存款以本金列示,根据存款协议列示的利息总额或约定利率每日计提利息。如提前支取或利率发生变化,则按需进行账户调整。 7、如有充分理由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。 8、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。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。 五、估值程序 1、某一类别基金份额净值是按照每个工作日闭市后,某一类别基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算,均精确到0.0001元,小数点后第5位四舍五入。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的,从其规定。 2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值,但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后,将基金资产净值和各类基金份额净值结果发送基金托管人,经基金托管人复核无误后,由基金管理人按规定对外公布。 六、估值错误的处理 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下: 5、特殊情况的处理 (1)基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第7项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理; (2)由于不可抗力原因、有关会计制度变化或由于证券/期货交易所及登记结算公司发送的数据错误等非基金管理人和基金托管人原因,基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查,但未能发现错误的,由此造成的基金资产估值错误,基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。 七、暂停估值的情形 4、法律法规规定、中国证监会和基金合同认定的其它情形。 八、基金净值的确认 基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人,由基金管理人按规定对基金净值予以公布。

第十五部分 集合计划费用与税收	一、集合计划费用的种类 5、《集合计划合同》生效后与集合计划相关的会计师费、律师费和诉讼费、仲裁费等; 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式 1、管理人的管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.5%÷当年天数 H为每日应计提的集合计划管理费 E为前一日的集合计划资产净值 2、托管人的托管费 本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.1%÷当年天数 H为每日应计提的集合计划托管费 E为前一日的集合计划资产净值 3、销售服务费 本集合计划A类计划份额不收取销售服务费,C类计划份额的销售服务费年费率为0.3%。本集合计划销售服务费主要用于本计划份额持有人服务等各项费用。销售服务费按前一日C类计划份额资产净值的年费率计提。计算方法如下: H=E×0.3%÷当年天数 H为每日应计提的C类计划份额销售服务费 E为前一日的C类计划份额的资产净值	一、基金费用的种类 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费等; 二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.30%÷当年天数 H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值 2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=E×0.10%÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值 3、销售服务费 本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.30%。本基金销售服务费主要用于本基金基金份额持有人服务等各项费用。销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.30%年费率计提。销售服务费的计算方法如下: H=E×0.30%÷当年天数 H为C类基金份额每日应计提的销售服务费 E为前一日的C类基金份额的基金资产净值
第十六部分 集合计划的收益与分配	三、集合计划收益分配原则 1、在符合有关集合计划分红条件的前提下,由管理人根据集合计划特点自行约定收益分配次数、比例等; 2、本集合计划收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资;若投资者不选择,本集合计划默认的收益分配方式是现金分红; 3、集合计划收益分配后各类别集合计划份额净值不能低于面值,即集合计划收益分配基准日的集合计划各类别份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值; 4、由于本集合计划A 类份额不收取销售服务费,而C类份额收取销售服务费,各份额类别对应的可供分配利润将有所不同。本集合计划同一类别的每一集合计划份额享有同等分配权; 四、收益分配方案 收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。	三、基金收益分配原则 1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金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; 2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的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;以红利再投资方式取得的基金份额最短持有期到期日与原持有的基金份额最短持有期到期日一致; 3、基金收益分配后各类基金份额净值均不能低于面值,即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值; 4、由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权; 四、收益分配方案 基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。
第十七部分 集合计划的会计与审计	一、集合计划会计政策 1、管理人为本集合计划的会计责任方;	一、基金会计政策 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方;

第十八部分 集合计划的信息披露	五、公开披露的集合计划信息 公开披露的集合计划信息包括: (一)招募说明书、《集合计划合同》、托管协议、产品资料概要 本集合计划变更经中国证监会批准后,管理人应将招募说明书提示性公告、《集合计划合同》提示性公告登载在规定报刊上,将招募说明书、产品资料概要、《集合计划合同》和托管协议登载在规定网站上,并将产品资料概要登载在集合计划销售机构网站或营业网点;托管人应当同时将《集合计划合同》、托管协议登载在规定网站上。 (二)《集合计划合同》生效公告 管理人应当在收到中国证监会批准文件后,将在规定媒介上登载《集合计划合同》生效公告。 (四)集合计划份额申购、赎回价格 管理人应当在《集合计划合同》、招募说明书等信息披露文件上载明集合计划各类份额申购、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集合计划销售机构网站或者营业网点查阅或者复制前述信息资料。 (五)定期报告,包括年度报告、中期报告和季度报告 (六)临时报告 本集合计划发生重大事件,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,是指可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的下列事件: 8、管理人分管资产管理业务的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动; 11、管理人或其高级管理人员、投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚,托管人或其专门托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚; 15、集合计划份额净值估值错误达集合计划份额净值百分之零点五; (七)澄清公告 在《集合计划合同》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集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动,以及可能损害集合计划份额持有人权益的,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,并将有关情况立即报告中国证监会。 (九)投资资产支持证券信息披露 管理人应在年度报告及中期报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。 管理人应在季度报告中披露集合计划持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小排序的前10名资产支持证券明细。 (十)投资国债期货信息披露 管理人应在季度报告、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,并充分揭示国债期货交易对集合计划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等。 六、信息披露事务管理 托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《集合计划合同》的约定,对管理人编制的集合计划资产净值、各类集合计划份额净值、各类集合计划份额申购赎回价格、定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、集合计划清算报告等相关集合计划信息进行复核、审查,并向管理人进行书面或电子确认。 八、暂停或延迟信息披露的情形 1、集合计划投资所涉及的证券、期货交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: (一)招募说明书、《基金合同》、托管协议、基金产品资料概要 (三)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者营业网点查阅或者复制前述信息资料。 (四)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 (五)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: 8、基金管理人的高级管理人员、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; 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; 15、任一类基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之零点五; 22、基金推出新业务或服务; (六)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。 (七)清算报告 基金合同终止的,基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。 (九)投资资产支持证券信息披露 基金管理人应在基金年度报告、中期报告中披露基金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基金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)投资国债期货信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露国债期货交易情况,包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标等。 六、信息披露事务管理 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定,对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查,并向基金管理人进行书面或电子确认。 八、暂停或延迟基金相关信息披露的情形 1、基金投资所涉及的证券/期货交易所市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时;

第十九部分 集合计划合同的变更、终止与集合计划财产的清算	一、《集合计划合同》的变更 1、变更《集合计划合同》涉及法律法规规定或本合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的,应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和集合计划合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项,由管理人和托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案。 三、集合计划财产的清算 1、集合计划财产清算小组:自出现《集合计划合同》终止事由之日起30个工作日内成立清算小组,管理人组织集合计划财产清算小组并在中国证监会的监督下进行集合计划清算。 4、集合计划财产清算程序: (1)《集合计划合同》终止情形出现时,由集合计划财产清算小组统一接管集合计划; 5、集合计划财产清算的期限为6个月,但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,管理人可针对该部分未能变现证券制定二次清算方案,该方案应经托管人认可,并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定,对该部分流通受限证券在可流通变现后进行二次或多次清算,并将变现后的资产按合同约定以货币形式全部分配给份额持有人。 四、清算费用 清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。	一、《基金合同》的变更 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的,应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报规定报中国证监会备案。 三、基金财产的清算 1、基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。 4、基金财产清算程序: (1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金财产; 5、基金财产清算的期限为6个月,但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的,清算期限可相应顺延。 四、清算费用 清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。
第二十部分 违约责任	一、管理人、托管人在履行各自职责的过程中,违反《基金法》等法律法规的规定或者《集合计划合同》约定,给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;因共同行为给集合计划财产或者集合计划份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任,对损失的赔偿,仅限于直接损失。但是发生下列情况的,当事人免责: 2、管理人、托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失;	一、基金管理人、基金托管人在履行各自职责的过程中,违反《基金法》等法律法规的规定或者《基金合同》约定,给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任;因共同行为给基金财产或者基金份额持有人造成损害的,应当承担连带赔偿责任,对损失的赔偿,仅限于直接损失。但是发生下列情况的,当事人免责: 2、基金管理人、基金托管人按照当时有效的法律、法规、规章或中国证监会的规定、市场交易规则的作为或不作为而造成的损失;
第二十一部分 争议的处理和适用的法律	《集合计划合同》受中国法律管辖。	《基金合同》受中国法律(为本基金合同之目的,在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律)管辖并从其解释。
第二十二部分 集合计划合同的效力	1、《集合计划合同》经管理人、托管人双方加盖公章(或托管业务专用章)以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章并经管理人向中国证监会提交变更《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》的申请并经中国证监会批准后,自管理人公告的生效之日起生效,原《东海证券双月盈集合资产管理计划合同》同日起失效。 4、《集合计划合同》正本一式六份,除上报有关监管机构一式二份外,管理人、托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。	1、《基金合同》由《东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》变更注册而来,经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章,经向中国证监会办理变更注册手续获得中国证监会书面确认。经202X年XX月XX日东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划的份额持有人大会决议通过,并报中国证监会备案,自202X年XX月XX日起修订后的《基金合同》生效。 4、《基金合同》正本一式三份,除上报有关监管机构一式一份外,基金管理人、基金托管人各持有一份,每份具有同等的法律效力。