
关于东方红 4 号-积极成长集合资产管理计划 变更为东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金 及法律文件变更的征询意见函

尊敬的投资者：

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》（以下简称“《运作办法》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告[2018]39 号）等法律法规的规定及中国证券监督管理委员会《关于准予东方红 4 号-积极成长集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可[2021]361 号），我司作为东方红 4 号-积极成长集合资产管理计划（以下简称“东方红 4 号”或“东方红 4 号集合”）的管理人，经与托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，拟将东方红 4 号集合变更为东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金（以下简称“东方红启恒”或“东方红启恒基金”或“本基金”），并按照《东方红 4 号-积极成长集合资产管理合同》（以下简称“《资管合同》”）、《东方红 4 号-积极成长集合资产管理计划说明书》等法律文件的约定履行法律文件变更程序。

东方红 4 号集合变更为东方红启恒基金涉及法律文件全文变更，即由原东方红 4 号集合法律文件变更为东方红启恒基金的法律文件，包括《东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）、《东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金托管协议》（以下简称“托管协议”）、《东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）等，上述法律文件已同步在我司网站披露，敬请投资者仔细阅读。

本次东方红 4 号集合变更为东方红启恒基金涉及的主要变更和具体流程说明如下：

一、主要变更

（一）变更产品名称

产品名称由“东方红 4 号-积极成长集合资产管理计划”变更为“东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金”。

（二）变更产品类型

产品类型由“非限定性集合资产管理计划”变更为“契约型开放式混合型证券投资基金”。

（三）增加份额类别设置

《基金合同》生效后，原东方红 4 号集合的份额变更为 A 类基金份额，基金管理人不再办理该类基金份额的申购业务，但红利再投资份额除外。对 A 类基金份额不设置锁定持有期，投资者可在每个开放日办理赎回。

增设 B 类基金份额，开放日常申购与赎回业务，但对每份 B 类基金份额设置三年锁定持有期（由红利再投资而来的 B 类基金份额除外）。

两类基金份额的收费模式不同：A 类基金份额免收固定管理费，但收取业绩报酬；B 类基金份额仅收取固定管理费，不收取业绩报酬（具体费率如下表所示）。

两类基金份额的固定管理费分别计算，并从各自对应的资产净值中扣除；业绩报酬从每笔份额的分红/退出资金中扣除。

管理人收取的费用种类	东方红启恒 A 类基金份额 (由原东方红 4 号集合份额变更而来，费用维持不变)	东方红启恒 B 类基金份额 (新增)
固定管理费	免收	1.5%/年
业绩报酬	年化收益率 5% 以上提取 20%， 分红、退出、终止时计提，其中 分红提取业绩报酬时设置分红	免收

管理人收取的费用种类	东方红启恒 A 类基金份额 (由原东方红 4 号集合份额变更而来, 费用维持不变)	东方红启恒 B 类基金份额 (新增)
	金额的 20% 为上限	

(四) 调整申购相关条款

1、申购安排及申购费率

基金合同生效后 A 类基金份额不开放申购业务, 仅 B 类基金份额开放申购业务。

B 类基金份额申购费率与原东方红 4 号集合的申购费率保持一致(1.2%不分档); 特别地, 通过基金管理人直销中心申购 B 类基金份额的养老金客户适用优惠的申购费率(0.24%不分档)。

因红利再投资而产生的基金份额, 不收取相应的申购费用。

2、调整申购份额的计算方法

为便于销售机构、投资者理解和计算, 申购费的计算由价内法调整为价外法:

东方红 4 号集合	东方红启恒 B 类基金份额
申购费 = 申购金额 × 申购费率	净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)
净申购金额 = 申购金额 - 申购费	申购费用 = 申购金额 - 净申购金额
申购份额 = 净申购金额 ÷ 申购价格	申购份额 = 净申购金额 / 申购当日 B 类基金份额净值

3、调整最低申购金额

东方红 4 号集合	东方红启恒 B 类基金份额
投资者首次参与集合计划的最低认购/申购金额(含认购/申购费)为 100,000 元; 投资者多次参与集合计划的最低认购/申购金额(含认购/申购费)为 10,000 元。	通过其他销售机构、本公司直销中心及网上交易系统申购本基金单笔最低金额为 10 元人民币(含申购费), 实际操作中对最低申购限额及交易级差的限制以各销售机构的具体规定为准。

（五）调整赎回相关条款

1、调整赎回费率

东方红4号集合的退出费按持有时间分档收取。持有期小于540个自然日的份额退出时，费率为0.5%；持有期大于或等于540个自然日的份额退出时，免收退出费。

除针对东方红启恒基金《基金合同》生效日下一个工作日的强制赎回外，根据公募基金相关法律法规要求，东方红启恒A类基金份额及B类基金份额的赎回费率按持有时间分档计算：

份额持续持有时间（L）	适用赎回费率
L < 7 日	1.50%
7 日 ≤ L < 30 日	0.75%
30 日 ≤ L < 365 日	0.50%
365 日 ≤ L < 730 日	0.30%
L ≥ 730 日	0

由原东方红4号集合份额变更而来的A类基金份额的持有期首日为东方红4号集合份额的参与确认日，申购而来的B类基金份额的持有期首日为B类基金份额的申购确认日，红利再投资份额的持有期首日为红利转份额日。

对份额持续持有时间小于30日的，赎回费用全部归基金财产，对份额持续持有时间长于30日小于3个月的，赎回费用总额的75%归基金财产，对份额持续持有时间长于3个月但小于6个月的，赎回费用总额的50%归基金财产，对份额持续持有时间长于6个月的，赎回费用总额的25%归基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费（注：一个月为30日）。

2、调整巨额赎回的情形及处理方式

在东方红启恒基金合同中增加“在发生巨额赎回，且单个基金份额持有人赎回申请超过上一工作日基金总份额30%的情形下，对单个基金份额持有人超过上一工作日基金总份额30%以上的赎回申请，基金管理人可延期办理赎回。对该单个基金份额持有人30%以内（含30%）的赎回申请按普通基金份额持有人（即其他赎回申请未超过上一工作日基金总份额30%以上的基金份额持有人）赎回程序（包括巨额赎回）办理，对该单个基金份额持有人超过30%的赎回申请进行延

期办理。对于未能赎回部分，该基金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，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。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。”

（六）调整投资相关条款

根据公募基金相关法律法规规定，调整原东方红 4 号集合的投资范围。删除证券投资基金、商业银行理财计划、融券、转融通、股票质押式回购等不符合法规要求的投资标的，细化债券类和权益类投资标的，新增存托凭证和股票期权；

根据变更后基金类型，调整各类资产的投资比例限制。其中，股票资产（含存托凭证）投资比例不低于基金资产的 60%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0%-50%）；

根据公募基金相关法律法规规定，调整投资限制、禁止行为及关联交易处理方式；

结合我司目前的投资逻辑、公募基金相关法规规定以及上述投资范围和比例的修改，相应调整投资策略和业绩比较基准。

主要投资条款的变更情况如下表：

调整项目	东方红 4 号集合	东方红启恒基金
投资目标	积极选股，稳健投资，稳定增值。	本基金在严格控制投资组合风险的前提下，通过深入研究、精选个股，追求基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中信成长指数×70%+中信国债指数×30%	沪深 300 指数收益率×70%+恒生指数收益率（经汇率估值调整）×10%+中债综合指数收益率×20%
投资范围	集合计划的投资范围包括中国境内依法发行的股票、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券、证券投资基金、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债期货、股指期货等金融衍生品、 保证收益及保本浮动收益商业银行理财计	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 （含中小板、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家债券、地方政府债、政府支持机构债、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、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、证券公司短期公司债券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其

调整项目	东方红4号集合	东方红启恒基金
	<p>划、证券回购以及中国证监会认可的其他投资品种。</p> <p>本集合计划可以参与融资融券交易，也可以将其持有的股票作为融券标的证券出借给证券金融公司。</p> <p>本集合计划可以参与股票质押式回购业务，集合资产管理计划为融出方的，在股票质押回购中质权人登记为管理人。</p> <p>在深港股票市场交易互联互通机制试点推出后，本集合计划可投资深港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票。</p> <p>在未来法律法规允许的情况下，本集合计划可投资在美国上市的中国公司股票，其中中国公司指满足如下两个条件之一的上市公司，1) 上市公司中最少百分之五十之营业额、盈利、资产、或制造活动来自中国大陆；2) 控股公司，其子公司的注册办公室在中国大陆，且主要业务活动亦在中国大陆。</p> <p>本集合计划如需投资商业银行理财计划、国债期货、沪深港通的股票，需与托管人就账户开立、资金划付及保管、估值核算等事项协商并达成一致意见后方可投资。</p>	<p>他债券)、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、股票期权、国债期货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相关规定)。</p> <p>本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资融券业务中的融资业务。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
资产配置比例	<p>1、固定收益类资产：债券逆回购(期限大于7天)、政府债券(到期日在1年以上)、央行票据(期限大于1年)、公司债、企业债、可转换债券、可分离交易债券、可交换债券、短期融资券、中期票据、政策性金融债、中小企业私募债、债券型基金、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、股票型及混合型分级基金的优先级份额、股票质押式回购业务、资产支持证券等，占资产净值的0~140%。其中，中小企业私募债券的投资比例不高于集合资产净值的30%(因规模缩水导致的被动超比例可不受限制)。本集合计划参与股票质押式回购业务，集合资产管理计划为融出方的，在股票质押回购中质权人登记为管理人。</p> <p>2、权益类资产：股票、股票型基金、混合型基金、股指期货、权证等，占资产净值</p>	<p>基金的投资组合比例为：本基金投资组合中股票资产(含存托凭证)投资比例不低于基金资产的60%(其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%)；</p> <p>本基金每个交易日日终在扣除股票期权、股指期货和国债期货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。</p> <p>如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人可在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>

调整项目	东方红 4 号集合	东方红启恒基金
	<p>的 0~140%，其中权证上限为 3%，股指期货投资范围是在中国金融期货交易所挂牌交易的股指期货合约。</p> <p>3、现金类资产：现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款、可转让存单等各类存款）、货币市场基金、期限不超过 7 天的债券逆回购、到期日在 1 年内的政府债券、到期日在 1 年内的央行票据等高流动性短期金融产品。</p> <p>4、集合计划可以参与证券回购，但融入资金余额不得超过集合计划资产净值的40%。</p>	
其他投资比例、投资限制及禁止行为	<p>其他比例限制：</p> <p>5、卖出股指期货合约价值总额不超过集合计划持有的权益类资产总市值的20%。</p> <p>6、买入股指期货合约价值总额不超过集合计划资产净值的10%。</p> <p>7、在任一时点持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计不超过资产净值的135%。</p> <p>8、如集合计划投资股指期货和/或国债期货，在任何交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后，保持不低于集合资产管理计划资产净值5%的现金及到期日在一年以内（含一年）的政府债券。</p> <p>9、在任何交易日日终，集合计划买入、卖出国债期货合约价值轧差计算后不超过资产净值的120%。</p> <p>管理人应按照《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》及其他相关监管规定及监管机构要求做好相关准备后，方可按照本合同的约定参与国债期货，管理人投资国债期货无须另行征求委托人意见。</p> <p>为维护委托人的合法权益，本集合计划投资禁止从事下列行为：</p> <p>1、集合计划参与证券回购融入资金余额超过集合计划资产净值的40%，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>2、将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）本基金投资于股票资产（含存托凭证）的比例不低于基金资产的60%（其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%）；</p> <p>（2）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；</p> <p>（3）本基金每个交易日日终在扣除股指期货、股票期权和国债期货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；</p> <p>（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%；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（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%；</p>

调整项目	东方红 4 号集合	东方红启恒基金
	<p>3、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</p> <p>4、将集合计划投资于一家公司发行的证券超过资产净值的 10%；因证券市场波动、投资对象合并、计划规模变动等管理人之外的因素致使投资不符合本规定的，管理人应在十个工作日进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定；</p> <p>5、将集合计划资产投资于一家公司发行的证券，超过该证券发行总量的 10%；因证券市场波动、投资对象合并、计划规模变动等管理人之外的因素致使投资不符合本规定的，管理人应在十个工作日进行调整，以符合上述规定。法律法规另有规定时，从其规定；</p> <p>6、本集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券的资金超过资产净值的 7%（投资于指数基金或者完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划可以不受上述限制）；如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起十个工作日内将投资比例降至许可范围内。法律法规另有规定时，从其规定；</p> <p>7、集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的现金总额，申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>8、在任一时点，集合资产管理计划持有的权益类证券市值和买入股指期货合约价值总额的合计超过资产净值的 135%；</p> <p>9、如集合计划投资股指期货和/或国债期货，在任何交易日日终，在扣除股指期货和国债期货合约占用的交易保证金后，持有的现金及到期日在一年以内（含一年）的政府债券低于集合资产管理计划资产净值的 5%；</p> <p>10、集合计划持有的卖出股指期货合约价值总额超过集合计划持有的权益类资产总市值的 20%；</p> <p>11、集合计划持有的买入股指期货合约价值总额超过集合计划资产净值的 10%；</p> <p>12、在任何交易日日终，集合计划买入、</p>	<p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>(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%；</p> <p>(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；</p> <p>(12) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>(13) 本基金参与股指期货和/或国债期货交易，应当遵守下列要求：</p> <p>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%。</p> <p>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%。</p> <p>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%；基金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%。</p> <p>4) 本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%。</p> <p>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。</p> <p>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；</p> <p>(14) 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；</p>

调整项目	东方红 4 号集合	东方红启恒基金
	<p>卖出国债期货合约价值轧差计算后超过资产净值的 120%；</p> <p>13、中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>上述投资限制系根据集合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>(15) 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%；</p> <p>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；</p> <p>(16) 本基金参与融资业务后，在任何交易日日终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%；</p> <p>(17) 本基金参与股票期权交易，应当遵守下列要求：</p> <p>1) 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%；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>(18) 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；</p> <p>(19) 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。</p> <p>除第 (3)、(11)、(14)、(15) 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。</p> <p>基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内，本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。</p> <p>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，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定执行，基金管理人及时根据《信息披露办法》在规定媒介公告。</p> <p>禁止行为：</p> <p>为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：</p> <p>(1) 承销证券；</p> <p>(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；</p>

调整项目	东方红4号集合	东方红启恒基金
		<p>(3) 从事承担无限责任的投资；</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是法律法规或中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(5) 向其基金管理人、基金托管人出资；</p> <p>(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；</p> <p>(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。如法律、行政法规或监管部门取消或调整上述禁止性规定，本基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以调整后的规定为准。</p>
关联交易	<p>委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券，但其投资比例不得超过资产净值的7%。（投资于指数基金或者完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划可以不受上述限制。）交易完成5个工作日内，管理人应书面通知托管人，通过管理人的网站告知委托人，并向证券交易所报告。</p>	<p>基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p>

（七）调整合同终止条款

主要条款对照如下：

东方红4号集合	东方红启恒基金
<p>有下列情形之一的，集合计划终止：</p> <p>1、本计划存续期间，计划的委托人少于2人；</p> <p>2、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格；</p> <p>3、托管人因解散、破产、撤销、丧失集合资产管理计划托管机构资格、停止营业等事由，不能继续担任托管人的职务，而无其它托管机构承受其原有权利及义务；</p> <p>4、法律法规及中国证监会规定的其他情况。</p>	<p>有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</p> <p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3、《基金合同》约定的其他情形；</p> <p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>

（八）调整估值方法

根据变更后的投资范围以及公募基金相关法律法规要求，相应修改了估值方法，并明确A类基金份额、B类基金份额分别计算基金份额净值，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。

（九）调整信息披露条款

由于公募基金与集合资产管理计划的相关法规存在差异，东方红启恒基金的信息披露条款有所调整，主要涉及如下几个方面：

1、法律文件

原东方红 4 号集合无需披露托管协议，改造后的东方红启恒基金需要披露托管协议。

2、定期报告

东方红 4 号集合和东方红启恒基金界定的定期报告类型不同，且定期报告包含的内容不同。东方红 4 号集合将单位净值报告和对账单定义为定期报告，而东方红启恒基金未将上述两项定义为定期报告；另外东方红启恒基金的定期报告还包含中期报告。同时，东方红启恒基金的定期报告中还需披露投资资产支持证券、股票期权、参与融资业务等投资标的的相关情况，以及业绩报酬收取、实施侧袋机制（如有）、单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金总份额 20%（如有）等方面的相关情况。

3、临时报告

根据公募基金相关法规规定调整临时披露事项。

4、信息披露方式

新增在规定媒介（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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》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）披露信息的相关条款。

（十）增加基金份额持有人大会

根据《基金法》和《运作办法》的规定，在东方红启恒基金的《基金合同》中设置基金份额持有人大会机制，约定须召开基金份额持有人大会的事项，并明确持有人大会会议召集人、召集方式；召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式；基金份额持有人出席会议的方式；议事内容与程序；表决、

计票规则、生效与公告；实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定等。

二、相关流程安排

《关于东方红 4 号-积极成长集合资产管理计划变更为东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金及法律文件变更的公告》（以下简称“《变更公告》”）已于 2021 年 3 月 23 日在我司网站（<https://www.dfham.com>）上公布，敬请查阅。

现向投资者发送本征询意见函，投资者不同意变更的，应在征询意见函发出后的十五个工作日内（即 2021 年 3 月 30 日至 2021 年 4 月 20 日）提出退出东方红 4 号集合的申请，投资者申请退出东方红 4 号集合应当于推广机构进行办理。投资者未在前述时间内回复意见也未退出东方红 4 号集合的，视为投资者同意东方红 4 号-积极成长集合资产管理计划变更为东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金及相关法律文件的变更，按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。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，管理人保障其退出东方红 4 号集合的权利；对于明确答复不同意变更但逾期未退出东方红 4 号集合的投资者，管理人将统一在变更生效日（即《基金合同》生效日）次一工作日（即 2021 年 4 月 22 日）做强制赎回处理（赎回价格为赎回当日的 A 类基金份额的基金份额净值），且不收取赎回费，业绩报酬根据《基金合同》的约定收取。

本次变更将于《变更公告》发布之日起二十个工作日后（即 2021 年 4 月 21 日起）生效，《基金合同》同日生效，原《资管合同》同日起失效。

投资者自《变更公告》发布之日起（含）至《基金合同》生效日前（不含）退出东方红 4 号集合的，不收取退出费，业绩报酬根据《资管合同》的约定收取。

三、重要提示

1、敬请投资者仔细阅读变更后东方红启恒基金的《基金合同》、《招募说明书》、《东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新》等信息披露文件。

2、原东方红4号集合份额在《基金合同》生效后变更为东方红启恒基金A类

基金份额，A类基金份额仅开放日常赎回业务（红利再投资除外）。基金管理人将在《基金合同》生效后开始办理东方红启恒基金B类基金份额的申购业务，具体业务办理时间和办理规则另行公告。

3、如您需更详细了解东方红4号集合变更为东方红启恒基金的相关事宜，请登录我司网站www.dfham.com 或致电400-920-0808查询。

感谢您一直以来给予东方红资产管理团队的关注和支持，祝您投资顺利、生活顺心！

附件：

《关于东方红4号-积极成长集合资产管理计划变更为东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》的回执

上海东方证券资产管理有限公司

2021年3月29日

附件：《关于东方红 4 号-积极成长集合资产管理计划变更为东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》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 4 号-积极成长集合资产管理计划变更为东方红启恒三年持有期混合型证券投资基金及法律文件变更的征询意见函》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：

上海市黄浦区外马路 108 号供销大厦 7 层，上海东方证券资产管理有限公司 智能客户服务部 姜珊（收），邮编：200010；电话：021-53952627。

回执接收电子邮箱：service@dfham.com