
东海基金管理有限公司

关于东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更为东海海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金相关业务安排的公告

依据《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，以下简称“《操作指引》”）等法律法规的规定和《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》（以下简称“《资产管理合同》”）的有关约定，东海证券股份有限公司旗下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（以下简称“集合计划”）的变更已经中国证监会2024年11月19日证监许可〔2024〕1633号文准予变更注册。集合计划以通讯方式召开了集合计划份额持有人大会，并于2025年3月26日表决通过了《关于东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金的议案》。自本公告日起即2025年5月12日，集合计划的管理人由东海证券股份有限公司变更为东海基金管理有限责任公司（以下简称“本公司”或“本基金管理人”）；集合计划变更为东海海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）。

一、集合计划份额持有人大会会议情况

集合计划以通讯方式召开了份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自2025年2月24日起至2025年3月25日17:00止。会议审议了《关于东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金的议案》（以下简称“本次会议议案”），并由参与本次集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人或其代理人对本次会议议案进行表决。根据《东海证券股份有限公司关于东海证券海鑫双悦3个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次集合计划份额持有人大会于2025年3月26日表决通过了《关于东海证券海鑫双悦3个月滚动持有

债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金的议案》，本次大会决议自该日起生效。

二、本次变更主要内容

本次变更的主要内容如下：

1、管理人变化：

由东海证券变更为东海基金。

2、产品名称变化：

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为东海海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金。

3、产品类型变化：

由债券型集合资产管理计划变更为债券型证券投资基金。

4、存续期变化：

由“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。”变更为“不定期”。

5、运作方式变化：

原运作方式：

“契约型开放式

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。”

新运作方式：

“契约型开放式

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。”

6、管理费变化：

由0.5%/年变更为0.30%/年。

7、申购费率变化：

原申购费：

A类份额申购费率如下：

单笔申购金额（含申购费）M	申购费率
M<50万元	0.30%
50万元≤M<200万元	0.20%
200万元≤M<500万元	0.10%
M≥500万元	按笔收取，1,000元/笔

新申购费：

A类基金份额的申购费率，如下表所示：

申购金额（M，单位：元）	A类基金份额申购费率
M<100万	0.40%
100万≤M<500万	0.20%
M≥500万	1000元/笔

8、信用债券投资策略变化：

原信用债券投资策略：

“本集合计划通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险及合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

本集合计划依靠内部信用评级体系跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险，管理人设计了定性和定量相结合的内部信用评级框架。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，定量分析主要包括盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析等；定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，是对定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。

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），并将视经济周期、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：

（1）本集合计划投资于AAA信用评级的信用债的比例占全部信用债资产的50%-100%；

（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。”

新信用债券投资策略：

“本基金通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险及合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。

本基金依靠内部信用评级体系跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估，以此作为个券选择的基本依据。为了准确评估发债主体的信用风险，基金管理人设计了定性和定量相结合的内部信用评级框架。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，定量分析主要包括盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析等；定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，是对定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。

本基金将视经济周期、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：

（1）本基金投资于AAA信用评级的信用债的比例占全部信用债资产的50%-100%；

（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。”

9、业绩比较基准变化：

由“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”变更为“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”。

10、登记机构变化：

由东海证券变更为东海基金。

最后，根据最新的法律法规的修订情况同步更新相关法律文件。

三、其他需要提示的事项

1、自本公告日起（即2025年5月12日），《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，《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》同时失效。

2、自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

3、开放日及开放时间

本基金自2025年5月19日起开放申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资计划等业务。

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、转换转出申请。

4、对于通过原为集合计划的销售机构购买、且该销售机构已与东海基金签订基金销售服务协议、在赎回选择期末赎回集合计划份额的投资者，截至《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》生效日的前一日其仍然持有的集合计划份额，将在《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》生效日（即2025年5月12日）自动变更为东海海鑫双悦3个月持有期债券型证券投资基金A类基金份额或C类基金份额。基金份额持有人自2025年5月19日起可依据《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》的约定，在原销售机构对相应基金份额进行赎回及其他交易。

因《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》生效后，登记机构由东海证券变更为东海基金，份额持有人需开立东海基金基金账户，以便东海基金进行基金份额登记业务。份额持有人可以联系销售机构自行办理基金账户开立手续。若份额持有人在赎回选择期末赎回集合计划份额、也未能自行开立东海基金基金账户的，由销售机构根据其份额持有人已经提供的有效资料于《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》生效之前批量代为办理基金账户的开立手续。

5、日常转换业务办理规则

（1）转换费率

①转换费用

基金转换采取未知价法，即基金的转换价格以申请受理当日各转出、转入基金的基金份额净值为基础进行计算。基金转换费用由转出基金赎回费用及转出与转入基金申购费用的补差两部分构成。

基金转换时，申购补差费用按照转换金额对应的转出基金与转入基金的申购费差额进行补差，具体收取情况视每次转换时两只基金申购费的差异情况而定。从申购费用低的基金向申购费用高的基金转换的，每次收取申购补差费用；从申购费用高的基金向申购费用低的基金转换的，不收取申购补差费用。本公司旗下基金的原申购费率详见各基金的招募说明书以及相关公告。基金转换费用由基金份额持有人承担。

②基金转换的计算公式

转换费用=转出基金赎回费+转换申购补差费

转出基金赎回费=转出份额×转出基金当日基金份额净值×转出基金赎回费率

转换金额=转出份额×转出基金当日基金份额净值-转出基金赎回费

转换申购补差费用=Max {转换金额×转入基金申购费率÷(1+转入基金申购费率)-转换金额×转出基金申购费率÷(1+转出基金申购费率), 0}

转入份额=(转出份额×转出基金当日基金份额净值-转换费用)÷转入基金当日基金份额净值

赎回费按照转出基金的基金合同约定的比例归入转出基金资产，转出金额以四舍五入的方式保留至小数点后两位，由此产生的误差在转出基金的基金资产中列支；转入份额以四舍五入的方式保留至小数点后两位，由此产生的误差在转入基金的基金资产中列支。

基金管理人在不损害各基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式并公告。

(2) 其他与转换相关的事项

①转换业务适用基金范围

本次基金的转换业务，适用于本基金与本公司旗下管理并已开通转换业务的其他基金，同一基金的不同基金份额类别之间不能相互转换。具体请详见本公司于2023年4月25日发布的《东海基金管理有限责任公司关于旗下部分基金开通转换业务的公告》及其他相关产品公告。投资者可以在基金的开放期内，申请办理本基金与其他已开通转换业务基金的转换业务。

②基金转换业务规则

投资者办理基金转换业务时，转出方的基金必须处于可赎回或可转出的状态，转入方的基金必须处于可申购或可转入的状态。基金投资者提出的基金转换申请，在当日交易时间结束前可以撤销，交易时间结束后即不得撤销。

基金注册登记机构以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日(T日)，并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资者可在T+2日及之后到其提出基金转换申请的销售机构查询转换的确认情况。转换业务遵循“先进先出”的业务规则，即首先转换持有时间最长的基金份额。转换后，转入基金份额的持有时间将重新计算，即转入基金份额的持有期将自转入基金份额被确认日起重新开始计算。

基金遵循“份额转换”的原则，单笔转换份额不得低于100份。基金份额持有人可将其全部或部分基金份额转换成其它基金份额，留存份额不足1份的，只能一

次性转换全部剩余份额。各基金销售机构可在此基础上另设规定，具体以各基金销售机构的规定为准。各基金的基金合同或招募说明书以及相关公告中关于最低转换份额另有规定的，从其规定。

6、投资人欲了解本基金的详细情况，请认真阅读本基金《基金合同》及《招募说明书》等法律文件。

7、投资人可登录本公司网站（www.donghaifunds.com）查阅《基金合同》全文或拨打客户服务电话（40095 95531）咨询相关事宜。

风险提示：本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证最低收益。本公司管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证，投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

东海基金管理有限责任公司

2025年5月12日