
东海基金管理有限公司

关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划变更为东海润

兴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《东海证券海鑫尊利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尊利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2025年3月31日证监许可〔2025〕667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5月19日表决通过了《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴债券型证券投资基金的议案》。自本公告日起即2025年6月3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润兴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4月16日起至2025年5月16日17:00止。会议审议了《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴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尊利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5月19日表决通过了《关于东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划更换管理人并变更注册为东海润兴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：

由东海证券海鑫尊利债券型集合资产管理计划变更为东海润兴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“自《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》生效至2025年6月6日。本集合计划自2025年6月6日后，按照中国证监会相关规定执行。”变更为“不定期”。

5、份额类别设置变化：

由原不区分份额类别变更为：

设置A类基金份额、C类基金份额，A类基金份额、C类基金份额开放日常申购与赎回业务，A类基金份额、C类基金份额可在基金开放申购赎回业务后任一开放日办理申购赎回业务。

对于投资者依据原《东海证券“东风2号”集合资产管理计划合同》获得的东海证券“东风2号”集合资产管理计划份额，自《东海证券海鑫尊利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尊利债券型集合资产管理计划的集合计划份额，自《基金合同》生效之日起将全部自动转换为基金A类基金份额；对于投资者依据《东海证券海鑫尊利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尊利债券型集合资产管理计划份额，自基金《基金合同》生效之日起亦将全部自动转换为基金A类基金份额。

6、费率变化：

（1）管理费费率变化

由0.5%/年变更为0.30%/年。

（2）申购费费率变化：

原申购费：

投资人申购集合计划份额时，需交纳申购费用，申购费率按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体申购费率如下：

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%
M≥200万元	按笔收取，1,000元/笔

变更为：

本基金A类基金份额在申购时收取申购费用，C类基金份额不收取申购费用。

A类基金份额的申购费率，按照申购金额递减，即申购金额越大，所适用的申购费率越低。投资者在一天之内如果有多笔申购，A类基金份额须按每笔申购的A类基金份额所对应的费率档次分别计费。

本基金A类基金份额的具体申购费率如下：

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

7、投资范围变化：

由“本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、可转换债券、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。

本集合计划不直接买入股票，也不参与新股申购和新股增发，因所持可转换债券转股形成的股票、可交换债券换股形成的股票，本集合计划应在其可交易之日起10个交易日内卖出。”

变更为：

“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债券、中期票据、短

期融资券、超短期融资券、次级债、可分离交易可转债的纯债部分）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货等法律法规或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的相关规定。

本基金不投资于股票等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券”。

8、投资策略变化：

（1）原“个券精选策略”：

“在个券选择上，本集合计划重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外，对于可转换债券等内嵌期权的债券，还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断，最终确定其投资策略。

本集合计划将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

（1）信用等级高、流动性好；

（2）资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；

（3）在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；

（4）公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债”。

变更为：

“个券精选策略

在个券选择上，本基金重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。

本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

（1）信用等级高、流动性好；

（2）资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；

（3）在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券”。

(2) 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%。

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。”

变更为：

“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。”

（3）删除“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，分享正股上涨带来的收益。

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。

本集合计划投资于可转换债券和可交换债券的比例合计不超过集合计划资产净值的20%。”

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6月3日），《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效，《东海证券海鑫尊利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。

由于技术系统、数据传输等原因，可能存在投资者在原销售机构暂时查询不便等情况，敬请投资者关注，投资者可联系原销售机构、东海证券或东海基金了解详情。

3、开放日及开放时间

本基金自2025年6月6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。

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的投资人，截至《东海润兴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《东海润兴债券型证券投资基金基金合同》生效日（即2025年6月3日）自动变更为东海润兴债券型证券投资基金A类基金份额。基金份额持有人自2025年6月6日起可依据《东海润兴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《东海润兴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。若份额持有人未在开放申购赎回期间未赎回集合计划份额、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《东海润兴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6月3日