

# 上海东方证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准等事项并修改基金合同的公告

为更好地保护基金份额持有人的利益，以更科学、合理的业绩比较基准评价基金的业绩表现，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和相关基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，上海东方证券资产管理有限公司（以下简称“本公司”）决定自 2024 年 12 月 2 日起（含）对旗下部分基金基金合同中业绩比较基准的相关条款予以修改，同时根据基金管理人基本信息更新等对基金合同进行其他必要的修改。现将相关事项公告如下：

## 一、调整业绩比较基准

### 1、涉及基金明细

序号	基金主代码	基金全称
1	001862	东方红收益增强债券型证券投资基金
2	007262	东方红聚利债券型证券投资基金

### 2、调整方案

#### （1）东方红收益增强债券型证券投资基金

目前的业绩比较基准：中债综合指数收益率\*90%+沪深 300 指数收益率\*10%。

调整为：中债综合指数收益率×15%+中证可转换债券指数收益率×70%+沪深 300 指数收益率×15%。

#### （2）东方红聚利债券型证券投资基金

目前的业绩比较基准：中债综合全价指数收益率\*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率（税后）\*5%。

调整为：中债综合全价指数收益率×30%+中证可转换债券指数收益率×70%。

## 二、基金合同的修改

本次因业绩比较基准调整以及基金管理人基本信息更新等而对基金合同作出的修改，对基金份额持有人利益无实质性不利影响，根据上述基金基金合同的约定，无需召开基金份额持有人大会，可由基金管理人和基金托管人协商后修改。本次修改已履行规定程序，符合相关法律法规规定及基金合同的约定。

上述基金基金合同的修改内容详见附件 1《东方红收益增强债券型证券投资基金基金合同修改对照表》、附件 2《东方红聚利债券型证券投资基金基金合同修改对照表》。

### 三、重要提示

1、修改后的上述基金基金合同自 2024 年 12 月 2 日起（含）生效。根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》，本公司将在规定媒介上披露更新后的上述基金基金合同、招募说明书及基金产品资料概要。

2、投资者可通过以下途径咨询有关详情：上海东方证券资产管理有限公司客户服务热线：4009200808，公司网址：[www.dfham.com](http://www.dfham.com)。

### 四、风险提示

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金投资需谨慎，敬请投资者注意投资风险。投资者投资于本基金前应认真阅读基金最新的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要及相关业务公告。敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

上海东方证券资产管理有限公司

2024 年 12 月 2 日

附件 1：东方红收益增强债券型证券投资基金基金合同修改对照表

位置	原条款	修改后条款
第七部分 基金合同当事人及权利 义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称：上海东方证券资产管理有 限公司</p> <p>住所：上海市黄浦区中山南路 109 号 7-11 层</p> <p>法定代表人：<b>宋雪枫</b></p> <p>设立日期：2010 年 7 月 28 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号： 中国证监会证监许可字[2010]518 号</p> <p>开展公开募集证券投资基金管理 业务批准文号：证监许可[2013]1131 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：3 亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：（021）53952888</p> <p>联系人：彭轶君</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称：上海东方证券资产管理有 限公司</p> <p>住所：上海市黄浦区中山南路 109 号 7-11 层</p> <p>法定代表人：<b>杨斌</b></p> <p>设立日期：2010 年 7 月 28 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号： 中国证监会证监许可[2010]518 号</p> <p>开展公开募集证券投资基金管理 业务批准文号：证监许可[2013]1131 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：3 亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：（021）53952888</p> <p>联系人：彭轶君</p>
第十二部分 基金的 投资	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中债 综合指数收益率*<b>90%</b>+沪深 300 指数收 益率*<b>10%</b>。</p> <p>中债综合指数由中央国债登记结 算有限责任公司编制，其样本范围涵 盖银行间市场和交易所市场，成份债 券包括国家债券、企业债券、央行票 据等所有主要 债券种类，具有广泛的 市场代表性，能够反应中国债券市场 的总体走势。</p> <p>沪深 300 指数是由上海证券交易 所和深圳证券交易所授权，由中证指 数有限公司开发的中国 A 股市场指 数，它的样本选自沪深两个证券市 场，覆盖了大部分流通市值，其成份</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准为：中债 综合指数收益率×<b>15%</b>+<b>中证可转换债 券指数收益率×70%</b>+沪深 300 指数收 益率×<b>15%</b>。</p> <p>中债综合指数由中央国债登记结 算有限责任公司编制，其样本范围涵 盖银行间市场和交易所市场，成份债 券包括国家债券、企业债券、央行票 据等所有主要 债券种类，具有广泛的 市场代表性，能够反应中国债券市场 的总体走势。</p> <p><b>中证可转换债券指数由中证指数 有限公司编制，其样本由在沪深交易 所上市的可转换债券组成，以反映沪 深交易所可转换债券的整体表现。</b></p> <p>沪深 300 指数是由上海证券交易 所和深圳证券交易所授权，由中证指 数有限公司开发的中国 A 股市场指 数，它的样本选自沪深两个证券市 场，覆盖了大部分流通市值，其成份</p>

	<p>股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。</p> <p>若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致，<b>并在更新的招募说明书中列示，报中国证监会备案，且无需召开基金份额持有人大会。</b></p>	<p>股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。</p> <p>若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致<b>且履行适当程序后，在中国证监会指定媒介上及时公告</b>，无需召开基金份额持有人大会。</p>
<p>第二十二部分 基金合同的效力</p>	<p>4、《基金合同》正本一式三份，<b>除上报有关监管机构一份外</b>，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。</p>	<p>4、《基金合同》正本一式二份，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。</p>

附件 2：东方红聚利债券型证券投资基金基金合同修改对照表

位置	原条款	修改后条款
第七部分 基金合同当事人及权利义务	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称：上海东方证券资产管理有 限公司</p> <p>住所：上海市黄浦区中山南路 109 号 7-11 层</p> <p>法定代表人：宋雪枫</p> <p>成立日期：2010 年 7 月 28 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号： 中国证监会证监许可字[2010]518 号</p> <p>开展公开募集证券投资基金管理 业务批准文号：证监许可[2013]1131 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：3 亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：(021) 53952888</p> <p>联系人：彭轶君</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况</p> <p>名称：上海东方证券资产管理有 限公司</p> <p>住所：上海市黄浦区中山南路 109 号 7-11 层</p> <p>法定代表人：杨斌</p> <p>成立日期：2010 年 7 月 28 日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号： 中国证监会证监许可[2010]518 号</p> <p>开展公开募集证券投资基金管理 业务批准文号：证监许可[2013]1131 号</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：3 亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：(021) 53952888</p> <p>联系人：彭轶君</p>
第十二部分 基金的投资	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准=中债综合全价指数收益率*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率（税后）*5%。</p> <p>其中，中债综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反应中国债券市场的总体走势。</p> <p>本基金的投资范围中包含的债券种类广泛，且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，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。因此中债综合全价指数收益率*95%+同期中国人民银行公布的一年期银行定期存款利率（税后）*5%能较好的体现本基金的投资目标和风险收益特征。</p>	<p>五、业绩比较基准</p> <p>本基金的业绩比较基准=中债综合全价指数收益率×30%+中证可转换债券指数收益率×70%。</p> <p>其中，中债综合全价指数由中央国债登记结算有限责任公司编制，其样本范围涵盖银行间市场和交易所市场，成份债券包括国家债券、企业债券、央行票据等所有主要债券种类，具有广泛的市场代表性，能够反应中国债券市场的总体走势。</p> <p>中证可转换债券指数由中证指数有限公司编制，其样本由在沪深交易所上市的可转换债券组成，以反映沪深交易所可转换债券的整体表现。</p>

	<p>如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与基金托管人协商一致，<b>在履行适当程序后报中国证监会备案</b>，并在中国证监会指定的媒介上及时公告，无需召开基金份额持有人大会。</p>	<p>如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与基金托管人协商一致<b>且</b>履行适当程序后，在中国证监会指定媒介上及时公告，无需召开基金份额持有人大会。</p>
<p>第二十二部分 基金合同 的效力</p>	<p>4、《基金合同》正本一式三份，<b>除上报有关监管机构一份外</b>，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。</p>	<p>4、《基金合同》正本一式二份，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。</p>