上海海通证券资产管理有限公司关于以通讯方式召开海通策略优选混合型集合资产管理计划份额持有人大会的公告

一、召开会议基本情况

根据中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）于2018年11月28日发布的《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》”）的规定，海通策略优选混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会《关于准予海通半年升集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]1650号）准予，由海通半年升集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，变更后的《海通策略优选混合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》”或“资产管理合同”）于2022年10月31日生效。

本集合计划管理人为上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”或“管理人”），集合计划托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“集合计划托管人”或“托管人”）。根据《操作指引》的规定及《资产管理合同》对本集合计划存续期限的约定“自《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》生效至本合同终止之间的期限。本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年”，本集合计划将于2025年10月31日到期。

鉴于以上情况，为充分保护集合计划份额持有人利益，根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《操作指引》等法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，管理人经与托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本集合计划份额持有人大会，审议本集合计划更换管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司，并相应变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金等有关事项，会议的具体安排如下：

1、会议召开方式：通讯方式

2、会议投票表决起止时间：自2025年9月17日起至2025年10月14日17:00止（以本公告列明的表决票收件人收到表决票的时间为准或以集合计划管理人指定系统记录时间为准）。

3、会议计票日：表决截止日后2个工作日内

4、会议纸质表决票的寄达地点：

收件人：上海海通证券资产管理有限公司

地址：上海市黄浦区广东路689号第32层01-12室单元

邮政编码：200001

联系人：胡嘉炜

联系电话：95521

请在信封背面注明：“海通策略优选混合型集合资产管理计划份额持有人大会表决专用”。

5、网络表决票的提交（仅适用于个人投资者）

网络投票形式的会议通讯表决票按本公告规定的网络投票方式进行。

6、短信表决票的提交（仅适用于个人投资者）

短信投票形式的会议通讯表决票按本公告规定的方式回复至管理人指定的短信平台。

7、录音电话表决票的提交（仅适用于个人投资者）

录音电话投票形式的会议通讯表决票提交按本公告规定的录音电话投票方式进行。

8、投资人如有任何疑问，可致电管理人客户服务电话95521咨询。

二、会议审议事项

《关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的议案》（详见附件一）。

上述议案的说明详见《关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的说明》（详见附件四）。

三、集合计划份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为2025年9月17日，即该日交易时间结束后，在本集合计划登记机构登记在册的本集合计划全体份额持有人均有权参加本次集合计划份额持有人大会并投票表决。

四、投票方式

（一）纸质表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件二。集合计划份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印或登录管理人网站（http://www.htsamc.com/）下载并打印表决票。

2、集合计划份额持有人可以网络投票方式进行多次表决的，以最后一次有效投票结果为准。网络投票需经集合计划份额持有人在规定时间之内成功提交并经投票系统记载后方可视为有效。

5、短信投票表决的效力认定

集合计划份额持有人通过短信表决方式投票的，需在表决短信里明确选择同意、反对或是弃权的一种并提供正确的身份证件号码与本集合计划指定代码。集合计划份额持有人在规定期间内按照本公告的要求回复短信表明表决意见的，为有效表决票；仅提供正确的身份证件号码与本集合计划指定代码，但表决意见回复不符合要求的，视为弃权表决，计入有效表决票；如表决短信里仅有表决意见而未提供身份证件号码、未填写本集合计划指定代码、提供的身份证件号码或填写的本集合计划代码有误或有其他不符合要求的情况的，视为表决无效。

集合计划份额持有人通过短信表决通道重复提交有效短信表决票的，以管理人收到的最后一次有效投票结果为准，先送达的表决短信视为被撤回。

6、录音电话表决的效力认定

在会议投票表决规定期间内由管理人或部分销售机构主动与预留联系方式的集合计划份额持有人电话联系，该等通话内容形成录音资料，录音内容完整涵盖集合计划份额持有人身份确认及对所有议题进行的明确表决意见，为有效表决票，有效表决票按表决意见计入相应的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次持有人大会表决的集合计划份额总数；能够核实身份但未发表明确表决意见的，视为弃权表决票，计入有效表决票；无法核实身份的为无效表决票。

7、如果同一集合计划份额持有人存在包括有效纸质方式表决、有效短信投票（非纸质方式）、有效录音电话投票（非纸质方式）和有效网络投票（非纸质方式）表决的，如不同途径的有效表决意见相同，则视为同一表决票；如不同途径的有效表决意见不相同，则以最后送达的有效的表决票为准，若无法判断收到时间先后的，则视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票。

六、决议生效条件

本次会议召开的条件为：本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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集合计划份额总数的二分之一（含二分之一）。

本会议表决的票数要求为：《关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的议案》应当由前述参加大会的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数的三分之二以上（含三分之二）通过；

集合计划份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，集合计划管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。集合计划份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人应当执行生效的集合计划份额持有人大会的决议。生效的集合计划份额持有人大会决议对全体集合计划份额持有人、集合计划管理人、集合计划托管人均有约束力。

七、重新召集集合计划份额持有人大会及重新授权

根据《基金法》和《资产管理合同》的规定，本次集合计划份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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集合计划总份额的二分之一（含二分之一）方可召开。如果本次集合计划份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，管理人可在本次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个月以内就同一议案重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会，应当由代表三分之一以上（含三分之一）集合计划份额的持有人直接出具表决意见。

重新召开本集合计划份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次集合计划份额持有人大会授权期间集合计划份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者集合计划份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集集合计划份额持有人大会的通知。

若在规定时间内就同一议案重新召开集合计划份额持有人大会，除非集合计划份额持有人作出新的有效表决，集合计划份额持有人依据本公告为参与本次集合计划份额持有人大会做出的各类表决依然有效，详细说明见届时发布的重新召集集合计划份额持有人大会的通知。

八、本次大会相关机构

1、召集人：上海海通证券资产管理有限公司

联系地址：上海市黄浦区广东路689号第32层01-12室单元

联系电话：021-23219000

客户服务电话：95521

网址：http://www.htsamc.com/

邮政编码：200001

2、托管人：中国民生银行股份有限公司

住 所：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

联系电话：010-58560666

网址：https://www.cmbc.com.cn/

3、公证机构：上海市东方公证处

联系人：林奇

联系电话：021-62178903

4、律师事务所：上海市通力律师事务所

联系地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

联系电话：021-31358666

联系人：丁媛

九、重要提示

1、请集合计划份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票，确保表决票于表决截止时间（2025年10月14日17:00）前送达。

2、本次集合计划份额持有人大会相关费用包括公证费、律师费，上述费用可从集合计划财产中列支。

3、上述集合计划份额持有人大会有关公告可通过上海海通证券资产管理有限公司网站（http://www.htsamc.com/）查阅，投资人如有任何疑问，可致电管理人客户服务电话95521咨询。

4、本公告的有关内容由上海海通证券资产管理有限公司负责解释。

上海海通证券资产管理有限公司

2025年9月15日

附件一：《关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的议案》

附件二：《海通策略优选混合型集合资产管理计划份额持有人大会通讯表决票》

附件三：《授权委托书》

附件四：《关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的说明》

附件五：《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后条文对照表

附件一：

关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的议案

海通策略优选混合型集合资产管理计划份额持有人：

海通策略优选混合型集合资产管理计划（A类集合计划份额代码：852200，C类集合计划份额代码：852289，以下简称“本集合计划”）经中国证监会2022年10月8日《关于准予海通半升集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]1650号）准予，由海通半年升集合资产管理计划对拟公开募集证券投资基金法律法规的要求整改规范及合同变更而来，本集合计划管理人为上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”），集合计划托管人为中国民生银行股份有限公司。《海通策略优选混合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”或“《资产管理合同》”）于2022年10月31日生效。

根据《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》”）的规定及资产管理合同第三部分“集合计划的基本情况”对本集合计划存续期限的约定“自《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》生效至本合同终止之间的期限。本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年”，本集合计划将于2025年10月31日到期。鉴于以上情况，为充分保护份额持有人利益，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》、《操作指引》等法律法规的规定及资产管理合同的约定，集合计划管理人与集合计划托管人协商一致，决定以通讯方式召开海通策略优选混合型集合资产管理计划份额持有人大会，提议按照《关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的说明》（详见附件四）的方案对本集合计划管理人和受更，同时对《资产管理合同》的相应条款进行修改。

同时，为保证顺利实施本集合计划变更的方案，本次持有人大会议案通过后，集合计划管理人可根据相应要求暂停本集合计划的申购、赎回业务，暂停申购、赎回的具体安排以后续公告为准，请投资者注意查看。修改后的基金合同等法律文件日基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司公告的生效之日起生效，后续重新开放申购赎回业务办理时间亦以基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司公告为准，请投资者注意登录上海国泰海通证券资产管理有限公司网站查看并合理安排投资。

本次集合计划份额持有人大会决议生效后，管理人将在变更正式实施前安排不少于5个交易日的赎回选择期，以供集合计划份额持有人做出选择（如赎回、转换转出等），赎回选择期内赎回或转换转出不收取赎回费。具体时间安排详见管理人届时发布的相关公告。在赎回选择期期间，由于需应对赎回、转换转出等情况，集合计划份额持有人同意豁免《资产管理合同》中约定的投资组合比例限制等条款。

2、管理人提请集合计划份额持有人大会授权管理人办理相关事项，并授权管理人可根据实际情况做相应调整，以及根据实际情况可暂停申购、赎回、转入、转出等。

3、《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》的生效

赎回选择期结束后，管理人将根据集合计划份额持有人大会决议执行本集合计划的正式变更，《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》的生效时间届时将由上海国泰海通证券资产管理有限公司另行发布相关公告。赎回选择期间未赎回、未转出的持有人，其持有的份额将默认转转为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金对应类别的基金份额。

4、本集合计划将于本次集合计划份额持有人大会决议生效后启动办理变更管理人及变更的相关交接手续。

四、变更方案可行性

（一）法律层面

《基金法》第四十七条规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：……（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同；（三）决定更换基金管理人、基金托管人……”。第十六条规定，“……转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。”

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

因此，本次份额持有人大会审议事项属于特别决议，需经参加大会的份额持有人或其代理人所持表决票的三分之二以上（含三分之二）通过，决议方可生效。本次变更管理人以及修改资产管理合同有关事项的事宜符合相关法律法规要求，修订方案不存在法律层面上的障碍。

（二）技术层面

为了保障本次持有人大会的顺利召开，集合计划管理人成立了工作小组，筹备、执行持有人大会决议生效并公告后，将由基金管理人与投资者进行了充分沟通，保证持有人大会可以顺利召开。本次持有人大会决议生效并公告后，将由基金管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司修订后的基金合同及托管协议，并在法律法规规定的时间内更新招募说明书。管理人、托管人已就本集合计划变更有关事项进行了充分沟通和细致准备，技术可行。因此，变更方案不存在运营技术层面的障碍。

五、主要风险及预备措施

（一）集合计划份额持有人大会不能成功召集或议案被否决的风险

根据《基金法》的相关规定及资产管理合同的相关约定，本次大会召开需满足本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，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集合计划总份额的二分之一（含二分之一）的召集成功条件，以及参加大会的集合计划份额持有人或其代表出具表决意见的三分之二以上（含三分之二）通过的表决通过条件。

为防范本次集合计划份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召集或议案未获得集合计划份额持有人大会表决通过等情况，管理人将在会前尽可能与集合计划份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加集合计划份额持有人大会。

（二）集合计划份额持有人集中赎回集合计划份额的流动性风险及预备措施

在会议召开通知公告后，部分集合计划份额持有人可能选择赎回其持有的集合计划份额。为应对可能引发的大规模集中赎回，本集合计划管理人将提前做好流动性安排，保持投资组合流动性，以应对可能发生的规模赎回对集合计划运作的影响，尽可能降低净值波动率。管理人将根据赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制本集合计划的市场风险。

附件五：《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后条文对照表

章节	《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》条款	《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》条款
管理人	上海海通证券资产管理有限公司	上海国泰海通证券资产管理有限公司
全文	海通策略优选混合型集合资产管理计划	国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金
全文	集合资产管理计划、集合计划、本集合计划、计划	基金、本基金
全文	管理人	基金管理人
全文	托管人	基金托管人
全文	持有人、份额持有人、集合计划份额持有人	基金份额持有人
全文	集合计划资者、集合计划投资人	基金投资者、基金投资人
全文	集合计划份额、份额	基金份额
全文	资产管理合同、《资产管理合同》、本合同	基金合同、《基金合同》、本基金合同
全文	产品资料概要	基金产品资料概要
第一部分前言	三、本集合计划由海通证券资产管理计划变更而来，海通半年升集合资产管理计划由管理人依照《证券公司集合资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）批准。 中国证监会对海通半年升集合资产管理计划变更的回函（机构部函[2022]1650号）准予，由海通半年升集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，变更后的《海通策略优选混合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》”或“资产管理合同”）于2022年10月31日生效。 本集合计划管理人为上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”或“管理人”），集合计划托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“集合计划托管人”或“托管人”）。根据《操作指引》的规定及《资产管理合同》对本集合计划存续期限的约定“自《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》生效至本合同终止之间的期限。本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年”，本集合计划将于2025年10月31日到期。鉴于以上情况，为充分保护集合计划份额持有人利益，根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《操作指引》等法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，管理人经与托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本集合计划份额持有人大会，审议本集合计划更换管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司，并相应变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金等有关事项，会议的具体安排如下：	三、本集合计划由海通证券资产管理计划变更而来，海通半年升集合资产管理计划由管理人依照《证券公司集合资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）批准。 中国证监会对海通半年升集合资产管理计划变更的回函（机构部函[2022]1650号）准予，由海通半年升集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）等公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定进行变更，变更后的《海通策略优选混合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》”或“资产管理合同”）于2022年10月31日生效。 本集合计划管理人为上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”或“管理人”），集合计划托管人为中国民生银行股份有限公司（以下简称“集合计划托管人”或“托管人”）。根据《操作指引》的规定及《资产管理合同》对本集合计划存续期限的约定“自《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》生效至本合同终止之间的期限。本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过3年”，本集合计划将于2025年10月31日到期。鉴于以上情况，为充分保护集合计划份额持有人利益，根据《基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《操作指引》等法律法规的规定和《资产管理合同》的约定，管理人经与托管人中国民生银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开本集合计划份额持有人大会，审议本集合计划更换管理人为上海国泰海通证券资产管理有限公司，并相应变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金等有关事项。 本次海通策略优选混合型集合资产管理计划变更管理人等事宜属于对原注册事项的实质性调整，经管理人向中国证监会申请，已经今国证监会准予变更注册。中国证监会准予此次变更注册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。 本次议案须经参加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所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在无法获得集合计划份额持有人大会表决通过的可能。 集合计划份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效，集合计划管理人应当自通过之日起5日内报中国证监会备案。集合计划份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划份额持有人应当执行生效的集合计划份额持有人大会的决议。生效的集合计划份额持有人大会决议对全体集合计划份额持有人、集合计划管理人、集合计划托管人均有约束力。 七、重新召集集合计划份额持有人大会及重新授权 根据《基金法》和《资产管理合同》的规定，本次集合计划份额持有人大会需要本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决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集合计划总份额的二分之一（含二分之一）方可召开。如果本次集合计划份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，管理人可在本次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个月以内就同一议案重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会，应当由代表三分之一以上（含三分之一）集合计划份额的持有人直接出具表决意见。 重新召开本集合计划份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，本次集合计划份额持有人大会授权期间集合计划份额持有人作出的各类授权依然有效，但如果授权方式发生变化或者集合计划份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集集合计划份额持有人大会的通知。 若在规定时间内就同一议案重新召开集合计划份额持有人大会，除非集合计划份额持有人作出新的有效表决，集合计划份额持有人依据本公告为参与本次集合计划份额持有人大会做出的各类表决依然有效，详细说明见届时发布的重新召集集合计划份额持有人大会的通知。 八、本次大会相关机构 1、召集人：上海海通证券资产管理有限公司 联系地址：上海市黄浦区广东路689号第32层01-12室单元 联系电话：021-23219000 客户服务电话：95521 网址：http://www.htsamc.com/ 邮政编码：200001 2、托管人：中国民生银行股份有限公司 住 所：北京市西城区复兴门内大街2号 办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号 联系电话：010-58560666 网址：https://www.cmbc.com.cn/ 3、公证机构：上海市东方公证处 联系人：林奇 联系电话：021-62178903 4、律师事务所：上海市通力律师事务所 联系地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼 联系电话：021-31358666 联系人：丁媛 九、重要提示 1、请集合计划份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票，确保表决票于表决截止时间（2025年10月14日17:00）前送达。 2、本次集合计划份额持有人大会相关费用包括公证费、律师费，上述费用可从集合计划财产中列支。 3、上述集合计划份额持有人大会有关公告可通过上海海通证券资产管理有限公司网站（http://www.htsamc.com/）查阅，投资人如有任何疑问，可致电管理人客户服务电话95521咨询。 4、本公告的有关内容由上海海通证券资产管理有限公司负责解释。 上海海通证券资产管理有限公司 2025年9月15日 附件一：《关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的议案》 附件二：《海通策略优选混合型集合资产管理计划份额持有人大会通讯表决票》 附件三：《授权委托书》 附件四：《关于海通策略优选混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金有关事项的说明》 附件五：《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后条文对照表 附件一：	三、国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由海通策略优选混合型集合资产管理计划变更而来，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）准予变更注册。 海通策略优选混合型集合资产管理计划由海通半年升集合资产管理计划变更而来，海通半年升集合资产管理计划由上海海通证券资产管理有限公司依照《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证监会批准。 中国证监会对海通半年升集合资产管理计划变更为海通策略优选混合型集合资产管理计划的批准，海通策略优选混合型集合资产管理计划变更为本基金的注册，并不表明其对本基金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会有风险。 六、对于投资者依据《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划份额的海通半年升集合资产管理计划份额，《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》生效之日起全部自动转换为海通策略优选混合型集合资产管理计划份额，自本基金合同生效之日起全部自动转换为本基金A类基金份额。 对于投资者依据《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日起全部自动转换为海通策略优选混合型集合资产管理计划份额，自本基金合同生效之日起全部自动转换为本基金C类基金份额。 七、计算 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，并由公证机关对计票过程予以公证，管理人或托管人若拟代表持有表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。 十、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定 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基金份额的二分之一（含二分之一）。	三、基金收益分配原则 4、由于本基金小划入类份额不收取销售服务费，C类份额收取销售服务费，各类别集合计划份额对应的可分配收益将有所不同，本集合计划同一份额类别的每一份集合计划份额享有同等分配权； 六、份额折算的公告 管理人应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告，并报中国证监会备案。 第十七部分基金的信息披露 七、基金份额折算的公告 基金管理人应按照《信息披露办法》的规定在规定媒介公告。
第二部分释义	1.集合资产管理计划、集合计划或本集合计划：指海通策略优选混合型集合资产管理计划 4.集合资产管理合同、资产管理合同、《资产管理合同》或本合同：指《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》及对本资产管理合同的任何有效修订和补充 15.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 26.集合计划基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、集合计划所管理的集合计划份额余额及其变动情况的账户 28.资产管理合同生效日：指《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》同日失效 29.集合资产管理合同终止日：指资产管理合同规定的合同终止事由出现后，集合计划资产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期 30.存续期：指《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》生效至本合同终止之间的期限 35.开放时间：指开放日集合计划接受申购、赎回或其他交易的时间段（若本集合计划参与港股通交易日该工作日为非港股通交易日时，则管理人可根据实际情况决定本集合计划是否开放申购、赎回及转换等业务，具体以届时提前发布的公告为准） 50.集合计划份额类别：指根据申购/赎回规则，申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本集合计划份额分为不同的类别，各集合计划份额类别分别设置代码，并分别计算和公告集合计划份额净值和集合计划份额累计净值 51.A类集合计划份额、A类份额：指在投资人申购时收取申购费用、赎回时根据持有期限收取赎回费用，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 对于投资者依据《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》其持有的海通半年升集合资产管理计划份额，日本资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划A类份额。 52.C类集合计划份额、C类份额：指从本类别集合计划资产中计提销售服务费用收取申购费用、赎回费用，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 56.港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所或者投中国证监会认可的机构在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，实现交易范围内的香港联合交易所上市的股票	1.基金成本基金：指国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金 4.基金合同、《基金合同》或本基金合同：指《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充 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 26.基金账户：指登记机构为投资人开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户 28.基金合同生效日：指《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》生效之日，《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日失效 29.基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期 30.存续期：指《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》生效至基金合同终止之间的不定期期限 35.开放时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段 50.基金份额类别：指根据申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的不同将本基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，并分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值 51.A类基金份额：指在投入申购时收取申购费用，赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不从本类别基金资产中提销售服务费的基金份额类别 52.C类基金份额：指从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用，投资人赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别，对于投资者依据《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》其持有的海通策略优选混合型集合资产管理计划A类份额，日本基金合同生效之日起全部自动转换为本基金A类基金份额。 对于投资者依据《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》其持有的海通策略优选混合型集合资产管理计划C类份额，日本基金合同生效之日起全部自动转换为本基金C类基金份额 56.港股通标的股票：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所或者投中国证监会认可的机构在香港设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，实现交易范围内的香港联合交易所上市的股票	二、投资范围 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含主板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府债、地方政府债、政府支持机构债、可转换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但投资合法投资品种相关规定）。 本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票资产（含存托凭证）的比例占集合计划资产的60%-95%（投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一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 本集合计划在投资中将以集合计划的权益类资产和固定收益类资产配置作为基础，采用量化模型，并辅以基金经理的观点和风险控制进行投资，力求集合计划资产长期、稳定的增值。投资策略主要包括但不限于以下方面： 1.大类资产配置策略 通过定量分析和定性分析相结合的方法，综合分析宏观经济周期、货币供应量、市场资金量、政策调导向、市场氛围等多种因素以及证券市场的深度趋势，评估权益类资产、固定收益类资产、现金类资产等各类资产的收益、风险特征、流动性、估值水平等因素，确定或调整投资组合中股票、债券等各类资产的比例。 在实际执行上，本集合计划将依据上述宏观经济因子的变化情况，实施即时性的动态资产配置调整，通过持仓比例的实时调整，有效增强集合计划收益，并降低组合系统性风险。 2.股票投资策略 运用量化选股模型，力求寻找基本面良好、并具有安全边际的成长型股票投资机会，另一方面，本集合计划将对集合计划整体的风险控制和流动性风险进行控制，力求在风险可控的情况下追求集合计划资产长期、稳定的增值。主要包括但不限于以下投资策略： （1）多因子选股策略 本集合计划基于国内证券市场特征，结合国内证券市场的实证研究，建立多因子选股模型，以期在市场中的超额收益中，通过优化量化投资模型实现超额绝带来的负面影响，力图获得超越业绩基准的投资回报。 本集合计划基于实证检验，选取出符合A股投资逻辑的因子，并根据经济周期和资本市场发展的不同阶段的分析和判断动态调整因子权重，从而构建多因子选股体系。 策略组合构建方法： （1）筛选有效因子 基于对国内外证券市场运行特征的长期跟踪研究以及大量历史数据的实证检验，选取具有合A股投资逻辑的因子，因子库主要包括成长类因子、估值类因子、财务质量类因子、流动性因子、市场预期类因子等。 其中成长因子包括但不限于主营收入增长率、净利润增长率、净资产增长率、一致预期净利润增长率、PEG等；估值因子包括但不限于市盈率、市净率、市现率、市销率等；质量因子包括但不限于总资产收益率、净资产收益率、销售毛利率、营业利润率、总资产周转率等；流动性因子包括但不限于成交量、换手率、流通市值等。 投研团队将定期或不定期地对多因子选股体系进行复核与检验，适时剔除失效因子，配增纳入潜在有效作用的有效因子或者市场上新出现的投资逻辑时纳用来的有效因子，通过不断改善多因子选股体系的有效性与稳定性，使得产品能够持续的完成投资目标。 （2）动态优化因子权重 作为在投资决策因子的可观测指标，不同因子从不同的侧面反映了投资标的真实运行状态，同一时点多个因子（及其记录值）所形成的向量，是影响证券市场表现的重要因素，这也因素的综合影响有方式可能非常复杂，但是随着时间的推移也许有迹可循，数量模式的一个工作重点就在于动态追查这些规律，并从过往的轨迹中总结出有可能带来收益的量化投资模式开展研究等，从而有效避免主观情绪可能带来的负面影响，严格执行投资纪律，整个过程体系讲就是，通过历史数据建立因子矩阵和权重矩阵，并根据最新数据不断进行修正。 3）生成股票组合并优化投资权重 在因子权重确定后，多因子选股体系对全市场股票进行综合评分，根据最新数据筛选出各选股策略组合，同时综合风险收益目标、风险敞口等约束条件，在权利和义务对称的原则下，以基准指数为参照，形成组合权重，并以市场流动性、交易成本、估值水平、基本面等因素为参考，以期在风险可控的情况下追求超额收益。 4.期货对冲策略 本集合计划将根据市场情况，以对冲股票组合的市场风险为目的，在股指期货合约的范围内，根据市场情况，以期货合约价值与股票组合市值的比例，实时调整期货合约的多空头寸，以期实现对冲风险的目的。 5.固定收益投资策略 本集合计划将根据市场情况，以期获得与风险相匹配的收益为目的，在国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、政府债、地方政府债、政府支持机构债、可转换债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、银行存款、同业存单、债券回购、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但投资合法投资品种相关规定）。 本集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于股票资产（含存托凭证）的比例占集合计划资产的60%-95%（投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一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