（上接B048版）

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第一次提示性公告

上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）已于2025年9月15日在《中国证券报》和管理人网站（www.htsamc.com）发布了《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》。为了使本次集合计划份额持有人大会顺利召开，现发布《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第一次提示性公告》。

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》”）等法律基金投资法律、行政法规及中国证监会的规定变更而来，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“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，提议审议本集合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，已经中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及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，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日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，中国证监会对本次持有人大会决议的备案，不表明其对本次集合计划变更方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。

二、本次变更涉及的《资产管理合同》等法律文件修改要点

本次变更的主要内容如下：

1、管理人变化：

由上海海通证券资产管理有限公司变更为上海国泰海通证券资产管理有限公司。

2、产品名称变化：

由海通策略优选混合型集合资产管理计划变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金。

3、产品类别变化：

由混合型集合资产管理计划变更为混合型证券投资基金。

4、产品投资经理变化：

由“上海海通证券资产管理有限公司旗下投资经理胡倩、张强”变更为“上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金经理刘晟、邓雅星”。

5、存续期限变化：

由“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。”变更为“不定期”。

6、费率变化：

投资者在申购A类基金份额时，对单笔小于100万元的申购金额适用的申购费率由【1.15%】变更为【1.2%】。

7、基金的存续变化：

由“《资产管理合同》生效后，连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等，并在6个月内召集集合计划份额持有人大会进行表决。”变更为“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续30个工作日、连续40个工作日及连续45个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人将对可能触发基金合同终止情形的情况发布提示性公告；连续50个工作日出现前述情形之一的，本基金将依据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。”

8、投资范围及投资限制变化：

投资范围删除“港股通标的股票”，并调整相应的投资组合比例和投资限制，同时删除投资限制中“本集合计划债券正回购资金余额或逆正回购资金余额不得超过本集合计划上一日存款产的40%；本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为1年，债券回购到期后不得展期”。

9、投资策略及业绩比较基准变化：

根据投资范围，补充“可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券投资策略”、删除“港股通标的股票投资策略”。同时，《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》生效后，本基金在策略配置和投资组合管理的框架下，精选中小市值股票中成长性良好且估值合理的上市公司股票构建投资组合，通过量化模型对投资组合中的行业配置及个股权重等进行主动调整，并调整大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、融资业务投资策略。

根据投资范围及投资策略的调整，相应调整业绩比较基准，由“中证800指数收益率×70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率×10%+商业银行活期存款利率（税后）×20%”变更为“中证全指指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%”。

10、估值方法变化：

根据中国证券投资基金业协会《关于固定收益品种的估值处理标准》等有关规定和议案修改估值方法。

11、会计师事务所变化：

会计师事务所由立信会计师事务所（特殊普通合伙）变更为华马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

最后，根据最新的法律法规的修订情况、基金实际运作情况、完善表述等，对法律文件的相关内容一并进行了修订。

具体修订内容请阅附件五：《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。

三、变更方案要点

1、赎回选择期

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、转换、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；……”、第八十六条规定，“……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。”

《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议的事项自表决通过之日起生效”。

因此，本次份额持有人大会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、执行持有人大会相关事宜。集合计划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，将由管理人上海国泰海通证券资产管理有限公司公告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理人所持表决权的三分之二以上（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，并采取相应的应对措施，以保障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	集合计划投资者、集合计划投入	基金投资者、基金投入
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管理人依照《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》及其他有关法律、法规、规定和《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》的规定，经中国证监会核准，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为本集合计划的批准，并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，也不表明投资于本集合计划的投资收益或风险。 六、本集合计划投资于内地与香港股票市场交易互联互通机制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”），会面临港股通机制下因投资环境、投资对象、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（如港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对集合计划的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市而香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股市场股票不能及时卖出，可能导致一定程度的流动性风险）等。其体风险请参见招募说明书的“风险揭示”章节。本集合计划将根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分集合计划资产投资于港股通标的股票或选择不将集合计划资产投资于港股通标的股票，集合计划资产并非必然投资港股通标的股票。 七、投资者依据原《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通半年升集合资产管理计划份额，自本集合资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合资产管理计划C类份额。原海通半年升集合资产管理计划份额在资产管理合同生效后变更为A类份额的，其持有期限从登记机构确认投资人持有原海通半年升集合资产管理计划份额之日起连续计算。 本集合计划入类份额和C类份额分别设置代码。由于集合计划费用的不同，本集合计划A类份额和C类份额将分别计算份额净值。计算公式为： T日基类集合计划份额净值＝T日该类集合计划份额资产净值/T日该类集合计划份额余额总数。	三、本集合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管理人依照《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》及其他有关法律、法规、规定和《国泰海通证券资产管理有限公司关于海通半年升集合资产管理计划变更方案的公告》的变更回复复函表明同意变更，为方有效决议，现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；如表决复函中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指定代码有误或有其他不符合要求的情况的，视为弃权表决。 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，先达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，方有效表决票投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长质方式表决、有效短信投票（非抵质方式）、有效录音电话投票（非抵质方式）和有效网络投票（非抵质方式）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）。 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或其代理人所持表决权的三分之二以上（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，中国证监会对本次持有人大会决议的备案，不表明其对本次集合计划变更方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。 二、本次变更涉及的《资产管理合同》等法律文件修改要点 本次变更的主要内容如下： 1、管理人变化： 由上海海通证券资产管理有限公司变更为上海国泰海通证券资产管理有限公司。 2、产品名称变化： 由海通策略优选混合型集合资产管理计划变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金。 3、产品类别变化： 由混合型集合资产管理计划变更为混合型证券投资基金。 4、产品投资经理变化： 由“上海海通证券资产管理有限公司旗下投资经理胡倩、张强”变更为“上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金经理刘晟、邓雅星”。 5、存续期限变化： 由“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。”变更为“不定期”。 6、费率变化： 投资者在申购A类基金份额时，对单笔小于100万元的申购金额适用的申购费率由【1.15%】变更为【1.2%】。 7、基金的存续变化： 由“《资产管理合同》生效后，连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等，并在6个月内召集集合计划份额持有人大会进行表决。”变更为“《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续30个工作日、连续40个工作日及连续45个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人将对可能触发基金合同终止情形的情况发布提示性公告；连续50个工作日出现前述情形之一的，本基金将依据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。”
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、基金管理人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：《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、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follow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类基金份额：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，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。 52、C类份额：从本类别集合计划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份额。 60、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经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，实现买卖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 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《海通证券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，但不从本类别基金资产中计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《海通证券升集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通策略优选混合型集合资产管理计划C类份额，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。 60、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经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，实现买卖范围内的香港联合交易所上市的股票
第三部分 基金的基本情况	投资者依据原《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通半年升集合资产管理计划份额，自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。原海通半年升集合资产管理计划份额在资产管理合同生效后变更为A类份额的，其持有期限从登记机构确认投资人持有原海通半年升集合资产管理计划份额之日起连续计算。 本集合计划入类份额和C类份额分别设置代码。由于集合计划费用的不同，本集合计划A类份额和C类份额将分别计算份额净值。计算公式为： T日基类集合计划份额净值＝T日该类集合计划份额资产净值/T日该类集合计划份额余额总数。	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 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《海通证券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：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，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别。对于投资者依据《海通证券升集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通策略优选混合型集合资产管理计划份额，自《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A类份额。 52、C类基金份额：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》获得的海通策略优选混合型集合资产管理计划C类份额，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。 本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算份额净值。计算公式为： T日基类基金份额净值＝T日该类基金份额资产净值/T日该类基金份额余额总数。
第四部分 基金的历史沿革	国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金由海通策略优选混合型集合资产管理计划变更而来。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为限定性集合资产管理计划，自2013年5月20日起向社会公众发行，2013年5月23日结束募集并于2013年5月29日成立。2013年6月5日获得中国证券业协会《中证协函【2013】581号》（关于上海海通证券资产管理有限公司发起设立海通半年升集合资产管理计划的备案确认函）。 根据中国证监会于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》的要求，经中国证监会批准，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，《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》自2022年10月31日起生效，《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 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》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，海通策略优选混合型集合资产管理计划经中国证监会2025年8月29日证监许可【2025】1892号文准予变更注册。 海通策略优选混合型集合资产管理计划以通讯方式召开集合计划份额持有人大会，并于【3年【1月【1日表决通过了《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》，同意“海通策略优选混合型集合资产管理计划”变更为“国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金”，并变更管理人、调整产品名称、存续期限、基金的存续、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值方法、调低申购费率等并修订合同等法律文件。集合计划份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。 自【3年【3月【3日起，《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，《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。海通策略优选混合型集合资产管理计划变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金，即本基金。	海通策略优选混合型集合资产管理计划变更自原大集合“海通半年升集合资产管理计划”（以下简称“原集合计划”）。 原集合计划为限定性集合资产管理计划，自2013年5月20日起向社会公众发行，2013年5月23日结束募集并于2013年5月29日成立，2013年6月5日获得中国证券业协会《中证协函【2013】581号》（关于上海海通证券资产管理有限公司发起设立海通半年升集合资产管理计划的备案确认函）。 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》的要求，经中国证监会批准，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，《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》自2022年10月31日起生效，《海通半年升集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 根据《基金法》、《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》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，海通策略优选混合型集合资产管理计划经中国证监会2025年8月29日证监许可【2025】1892号文准予变更注册。 海通策略优选混合型集合资产管理计划以通讯方式召开集合计划份额持有人大会，并于【3年【1月【1日表决通过了《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》，同意“海通策略优选混合型集合资产管理计划”变更为“国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金”，并变更管理人、调整产品名称、存续期限、基金的存续、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、估值方法、调低申购费率等并修订合同等法律文件。集合计划份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。 自【3年【3月【3日起，《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，《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。海通策略优选混合型集合资产管理计划变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金，即本基金。
第五部分 基金的存续	《资产管理合同》生效后，本集合计划登记机构将进行本集合计划份额的更名以及必要信息的变更。 《资产管理合同》生效后，连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，管理人应当在定期报告中予以披露；连续30个工作日出现前述情形的，管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等，并在6个月内召集集合计划份额持有人大会进行表决。 2、此授权委托书剪报、复印或登录集合计划管理人网站（http://www.htsamc.com/）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）下载并打印，在填写完整并签字盖章后均为有效。 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 一、声明 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》”）等法律基金投资法律、行政法规及中国证监会的规定变更而来，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“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，提议审议本集合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等有关事项。 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，提议审议本集合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等有关事项。现发布《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》。为了使本次集合计划份额持有人大会顺利召开，现发布《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第一次提示性公告》。 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》”）等法律基金投资法律、行政法规及中国证监会的规定变更而来，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“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，提议审议本集合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，已经中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及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，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日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，中国证监会对本次持有人大会决议的备案，不表明其对本次集合计划变更方案或本基金的投资价值、市场前景或投资者的收益做出实质性判断或保证。 二、本次变更涉及的《资产管理合同》等法律文件修改要点 本次变更的主要内容如下： 1、管理人变化： 由上海海通证券资产管理有限公司变更为上海国泰海通证券资产管理有限公司。 2、产品名称变化： 由海通策略优选混合型集合资产管理计划变更为国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金。 3、产品类别变化： 由混合型集合资产管理计划变更为混合型证券投资基金。 4、产品投资经理变化： 由“上海海通证券资产管理有限公司旗下投资经理胡倩、张强”变更为“上海国泰海通证券资产管理有限公司旗下基金经理刘晟、邓雅星”。 5、存续期限变化： 由“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。”变更为“不定期”。 6、费率变化： 投资者在申购A类基金份额时，对单笔小于100万元的申购金额适用的申购费率由【1.15%】变更为【1.2%】。 7、基金的存续变化： 由“《资产管理合同》生效后，连续20个工作日出现集合计划份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，管理人应当在定期报告中予以披露；连续30个工作日、连续40个工作日及连续45个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，管理人将对可能触发基金合同终止情形的情况发布提示性公告；连续50个工作日出现前述情形之一的，本基金将依据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。”	《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续30个工作日、连续40个工作日及连续45个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人将对可能触发基金合同终止情形的情况发布提示性公告；连续50个工作日出现前述情形之一的，本基金将依据《基金合同》的约定进入基金财产清算程序并终止，不需召开基金份额持有人大会。
第六部分 基金份额的申购与赎回	二、申购和赎回的开放日及时间 1、开放日及开放时间 投资人在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，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，若本集合计划参与港股通交易日时，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。但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本资产管理合同的约定公告暂停申购、赎回时除外，开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。 2、申购