

关于国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划变更为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划及法律文件变更征询意见公告

尊敬的投资者：

根据《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）等规定及中国证券监督管理委员会《关于准予国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]1432号），作为国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划（以下简称“金贝壳8号”）的管理人，经与托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，国海证券股份有限公司（以下简称“我公司”、“管理人”）拟将金贝壳8号变更为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划（以下简称“国海量化优选”或“本集合计划”），并按照《国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划资产管理合同》、《国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划说明书》有关约定履行法律文件变更程序。

金贝壳8号变更为国海量化优选涉及法律文件全文变更，即由原金贝壳8号法律文件变更为国海量化优选的法律文件，包括《国海证券量化优选一年持有期股票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》”）、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划托管协议》、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划产品资料概要》等，前述法律文件和风险揭示书已同步在管理人网站披露，敬请投资者仔细阅读。本次金贝壳8号变更为国海量化优选涉及的主要变更和具体流程说明如下：

一、主要变更

（一）变更产品名称

产品名称由“国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划”变更为“国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划”。



（二）变更产品类型

产品类型由“非限定性集合资产管理计划”变更为“股票型集合资产管理计划”。

（三）增加份额类别设置

1、《资产管理合同》生效后，设国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划A类份额（代码：970041）、国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划C类份额（代码：970042）。原国海金贝壳8号（策略稳健）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，不设置锁定持有期，不开放申购，红利再投资份额除外。A类份额的持有人仅可在本集合计划的固定开放期和临时开放期申请赎回。

对于每份A类份额，固定开放期每季度开放一次，公历月2、5、8、11当月15日开始的5个工作日为开放日（开放日如遇非工作日，则自动顺延至下一工作日）。临时开放期的具体开放时间及开放方式以管理人公告为准。

C类份额开放日常申购业务，但对每份C类份额设置一年锁定持有期，锁定持有期内不办理赎回业务。红利再投资获得的C类份额持有期限与原持有的集合计划份额相同。

2、管理人对A类份额收取业绩报酬方式与金贝壳8号相同，即对份额持有人每笔认/申购份额年化收益率在5%（不含）至25%（含）的部分提取20%作为业绩报酬；对A类份额持有人每笔认/申购份额年化收益率超过25%（不含）的部分提取30%作为业绩报酬；业绩报酬在集合计划分红日、集合计划份额持有人赎回确认日和集合计划终止日计提。

对C类份额的业绩报酬收取方式为：在C类份额持有人赎回确认日和计划终止日，管理人将根据集合计划份额持有人持有本集合计划的期间年化收益率（R），对本集合计划份额期间年化收益率超过6%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。

（四）调整申购相关条款

1、申购费率

《资产管理合同》生效后，管理人仅办理C类份额的申购业务。集合计划C类份额的申购费用由申购C类份额的投资人承担，集合计划申购费用不列入集合计划财产，主要用于本集合计划的市场推广、销售、登记等各项费用。

C类份额在申购时收取申购费，申购费率随申购金额的增加而递减。

C类份额申购费率根据申购金额的不同收取不同的申购费用，C类的申购费率如下：

单笔申购金额 (M)	申购费率
M < 100万	1.0%
100万 ≤ M < 1000万	0.8%
M ≥ 1000万	每笔1000元

投资人如果有多笔申购，申购费按每笔申购申请单独计算。

2、调整最低申购金额

投资人首次申购的最低金额为【100】元（含申购费），单笔申购的最低金额为100元（含申购费）。各销售机构对本集合计划最低申购金额及交易级差有其他规定的，以各销售机构的业务规定为准。

（五）调整赎回相关条款

《资产管理合同》生效后，A类份额的持有人仅可在本集合计划的固定开放期和临时开放期申请赎回。A类份额赎回费率根据份额持有时间的不同收取不同的赎回费用，赎回费率如下：

份额持有时间 (N)	赎回费率
N < 180日	1.5%
180日 ≤ N < 365日	1.0%
N ≥ 365日	0.00%

（注：A类份额持有时间从登记机构确认投资人持有原国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划的份额期限连续计算。）

每份C类份额设置一年锁定持有期，锁定持有期内不办理赎回业务。C类份额不收取赎回费，赎回费率为0。

（六）调整投资相关条款

在投资条款上，根据公募基金相关规定相应调整原金贝壳8号的原条款。

	金贝壳8号	国海量化优选
投资	1、集合计划投资范围 本集合计划投资范围为中国证监	本集合计划主要投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的

<p>范围</p>	<p>会允许集合计划投资的所有金融产品。主要包括：固定收益类证券、权益类证券、现金及准现金类资产等。</p> <p>其中，固定收益类证券包括：剩余期限在1年以上的国债和央行票据、证券正回购、证券逆回购、地方政府债、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含大公募、小公募、非公开公司债、可转换债券、可交换债券等）、短期融资券、期限在7天以上的债券逆回购、资产支持证券、中期票据、债券型基金、分级基金A类份额、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划，以及其它法律法规或中国证监会认可的固定收益类投资品种；</p> <p>权益类证券包括：股票、股票型基金、混合型基金等；</p> <p>现金及准现金类资产包括：现金、银行存款、货币市场基金、剩余期限在1年以内（含1年）的国债和央行票据、期限在7天以内（含7天）的债券逆回购等。</p> <p>如本集合计划成立后出现新的投资品种，或者管理人根据市场情况认为需要变更本集合计划投资范围（例如增加股指期货投资标的）或投资比例的，管理人可以变更本集合计划的投资范围和投资比例。变更将按照本</p>	<p>股票（包含创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、债券（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、政府支持机构债券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及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相关规定）。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合计划投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>本集合计划的投资组合比例为：股票投资占集合计划资产的80%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本集合计划持有现金或到期日在1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、存出保证金和应收申购款等。</p> <p>如果法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。</p>
-----------	--	---

	<p>集合计划资产管理合同规定的程序办理。</p> <p>2、集合计划投资比例</p> <p>(1) 固定收益类证券占集合计划净值的比例：0%-95%。</p> <p>(2) 权益类证券占集合计划净值的比例：0-95%。</p> <p>(3) 现金及准现金类资产占集合计划净值比例：不低于5%。</p> <p>本集合计划申购新股，不设申购上限，但申报的金额不得超过集合计划的现金总额，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。</p>	
<p>投资策略</p>	<p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，从经济周期的角度判断经济形势，并根据各类资产在特定经济形势下的预期收益和预期风险特征，在本集合计划的投资范围内，确定各类资产的配置比例，追求绝对收益。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本集合计划运用先进的投资理念与估值方法，通过深入的基本面分析和全球视野下的A股估值比较，重点挖掘具有相对高成长性的行业、上市公司及个股作为投资对象，寻找并把</p>	<p>1、大类资产配置策略</p> <p>本集合计划通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、信用风险、证券市场估值水平等因素，从经济周期的角度判断经济形势，并根据各类资产在特定经济形势下的预期收益和预期风险特征，在本集合计划的投资范围内，确定各类资产的配置比例。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本集合计划将利用多因子策略研究框架，找到优质股票的共性（比如低估值、高成长、超预期、盈利稳定等），筛选出能持续稳定跑赢中证500指数的股票组合，并利用多种风险控制技术优化投资组合的收益与风险，在可控的风险</p>

<p>握投资机会。具体而言，本集合计划将以全球市场为参照系，首先运用相对估值的方法，分析行业、个股的合理估值区间，给出中国市场当前估值的折溢价水平。其次，再由研究员运用财务分析以及量化估值等手段，对折溢价水平进行调整和修正，寻找那些盈利增长、盈利恢复被低估的个股加入核心股票池。最后，投资经理以核心股票池为依据，进行行业、个股权重的设定和调整。</p> <p>3、普通债券投资策略</p> <p>本集合计划管理人在宏观经济形势、货币及财政政策研究的基础上，以预测未来市场利率的走势和债券市场供求关系为核心，结合收益率期限结构和利差分析，来构建债券组合，在运作过程中将实施积极的、动态的债券投资组合管理，获取较高的债券组合收益。</p> <p>(1) 利率策略。本集合计划通过全面研究国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测货币及财政政策等的取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以此来确定债券投资组合的综合持有期限。</p> <p>(2) 类属配置策略。通过对债</p>	<p>承受范围内力争获取较高收益。多因子模型因子主要包括价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)等。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>本集合计划管理人在宏观经济形势、货币及财政政策研究的基础上，以预测未来市场利率的走势和债券市场供求关系为核心，结合收益率期限结构和利差分析，来构建债券组合，在运作过程中将实施积极的、动态的债券投资组合管理，获取较高的债券组合收益。</p> <p>(1) 利率策略。本集合计划通过全面研究国民经济运行状况，分析宏观经济运行的可能情景，预测货币及财政政策等的取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构，在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势，以此来确定债券投资组合的综合持有期限。</p> <p>(2) 类属配置策略。通过对债券市场收益率期限结构进行分析，对不同类型债券品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、公司债等利差和变化趋势，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。</p> <p>(3) 单个券种选择。本集合计划将对影响个别债券定价的流动性、市场供</p>
--	---

<p>券市场收益率期限结构进行分析，对不同类别债券品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、公司债等利差和变化趋势，评定不同债券类属的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例。</p> <p>(3) 单个券种选择。本集合计划将对影响个别债券定价的流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。在风险收益特征等方面对组合进行进一步的优化，以达到在相同期限和类属的条件下，更进一步降低组合风险，提高组合收益的目的。</p> <p>4、基金投资策略</p> <p>本集合计划将主要利用管理人研发的基金评价系统对基金管理公司及其管理的基金进行评级，坚持从研究基金价值入手，采用定性分析与定量分析相结合的方法，按照自上而下和自下而上相结合的原则，悉心选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金。具体的选择标准包括以下三点：</p> <p>(1) 基金管理公司的选择标准：包括基金管理公司治理结构、管</p>	<p>求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。在风险收益特征等方面对组合进行进一步的优化，以达到在相同期限和类属的条件下，更进一步降低组合风险，提高组合收益的目的。</p> <p>4、资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构以及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究，预测资产池未来现金流变化，并通过研究标的证券发行条款，预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响。同时，集合计划管理人将密切关注流动性对标的证券收益率的影响，综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择以及把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，结合信用研究和流动性管理，考虑选择风险调整后收益高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>本集合计划将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行交易，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地实现投资目标。</p> <p>6、国债期货投资策略</p>
---	--

<p>理层和基金经理稳定、风险控制制度健全与规范、产品创新能力、研发实力以及市场知名度高、管理的基金资产的总规模、管理的基金资产年均增长率等。</p> <p>(2) 基金经理的选择标准：包括基金经理的投资理念与投资风格、投资管理能力、职业道德、历年投资收益率居于同类型基金管理者前列、基金业绩持续性等。</p> <p>(3) 基金的选择标准包含有：基金的年度、季度及月度净值增长率、基金净值波动率、基金选股与择时能力、专业基金评级机构对基金的排名等。</p> <p>5、可转换债券投资策略</p> <p>可转换债券市场以及未来可能出现的可交换债券市场主要受到股票市场走势、公司基本面、可转债条款、转股溢价水平等众多因素的影响。</p> <p>在投资策略方面，本集合计划将在充分降低投资品种风险和确保可以获得到期收益的基础上，把握价格上升带来的价差收益和转股价修正等期权条款触发带来的收益机会。</p> <p>此外，本集合计划还将根据新发可转换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与可转换债券新券的申购。</p>	<p>为有效控制债券投资的系统性风险，本集合计划将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。</p>
--	---

6、新股申购和增发策略

本集合计划将研究首次公开发行(IPO)股票及增发新股的上市公司基本面,根据股票市场整体定价水平,综合运用现金流量折现估值法

(DCF)、可比公司分析(CCA)估值法,估计股票上市后合理的估值区间,根据新股发行时的市场状况、资金供求和历史数据,估算新股一级市场发行价格、中签率、机会成本、申购与收益率及最大风险值,在严格控制风险的前提下,制定相应的新股申购策略。

7、现金及准现金类资产投资策略

本集合计划将在确定总体流动性要求的基础上,结合不同类型货币市场工具的流动性和货币市场预期收益水平、银行存款的期限、债券逆回购的预期收益率来确定现金类资产的配置,并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

8、量化投资策略

本集合计划将利用多因子策略研究框架,找到优质股票的共性(比如低估值、高成长、超预期、盈利稳定等),筛选出能持续稳定跑赢中证500指数的股票组合,并利用多种风

	<p>风险控制技术优化投资组合的收益与风险，在可控的风险承受范围内获取高额收益。多因子模型因子主要包括价值(value)、动量(momentum)、成长(growth)、情绪(sentiment)、质量(quality)等。</p>	
<p>投资限制</p>	<p>(1) 管理人所管理的客户资产(含本集合计划资产)投资于一家公司发行的证券，按证券面值计算，超过该证券发行总量的10%。</p> <p>(2) 投资于一家公司发行的证券不得超过集合计划资产净值的10%，集合计划投资于指数基金的除外。</p> <p>完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的，不受前两款限制。</p> <p>(3) 参与证券回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的40%。</p> <p>(4) 将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资、可能承担无限责任的投资或者对外担保等用途。</p> <p>本集合计划的委托人同意并授权，集合计划资产可以投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券以及管理人担任保荐人或者主承销商的股票/债券，但投资的资金不得超过本集合计划资产净值的3%。投资于指数基金</p>	<p>1、组合限制</p> <p>集合计划的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 股票投资占集合计划资产的比例范围为80%-95%；</p> <p>(2) 本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的保证金后，保持不低于集合计划资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；</p> <p>(3) 本集合计划持有一家发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；</p> <p>(4) 本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家发行的证券，不超过该证券的10%，完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划品种可以不受此条款规定的比例限制；</p> <p>(5) 本集合计划投资于同一原始权</p>

<p>或者完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的，不受比例限制。</p> <p>因证券市场波动、投资对象合并、集合计划规模变动等外部因素致使该集合计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，管理人将在3个工作日内进行调整。（如遇相关证券不能上市交易的，上述时间期限自动顺延；因一级市场申购而发生比例超标的情况时，应在该获配股票锁定期结束后3个工作日内将持仓比例降至许可范围内）。</p>	<p>益人的各类资产支持证券的比例，不得超过集合计划资产净值的10%；</p> <p>（6）本集合计划持有的全部资产支持证券，其市值不得超过集合计划资产净值的20%；</p> <p>（7）本集合计划持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；</p> <p>（8）本管理人管理的全部公开募集性质的集合计划投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；</p> <p>（9）本集合计划应投资于主体评级为AA及以上（含AA）的信用债券（含可转换债券、可交换债券）。本集合计划持有信用债券期间，如果其信用等级下降且不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</p> <p>（10）本集合计划投资于主体评级AAA的信用债券比例不低于全部信用债资产的30%；</p> <p>（11）本集合计划应投资于信用级别评级为AA+以上（含AA+）的资产支持证券。本集合计划持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；</p> <p>（12）本集合计划财产参与股票发行申购，所申报的金额不超过本集合计</p>
--	--

	<p>划的总资产，本集合计划申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>(13) 本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的40%，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；</p> <p>(14) 本集合计划管理人管理的全部开放式公开募集性质的集合计划（包括开放式公开募集性质的集合计划以及处于开放期的定期开放公开募集性质的集合计划）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式公开募集性质的集合计划以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制；</p> <p>(15) 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该集合计划资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的，管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(16) 本集合计划与私募类证券资</p>
--	--

管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与本合同约定的投资范围保持一致；

(17) 本集合计划的总资产不得超过集合计划净资产的140%；

(18) 本集合计划参与股指期货、国债期货投资，应遵循下列限制：

1) 集合计划在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的10%；

2) 集合计划在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的20%；

3) 集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的20%；集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于股票投资比例的有关约定；

4) 集合计划在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过集合计划资产净值的15%；

5) 集合计划在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的30%；

6) 集合计划在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交

	<p>金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的30%；集合计划所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合资产管理合同关于债券投资比例的有关约定；</p> <p>7) 任何交易日日终，本集合计划持有的买入国债期货和股指期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过集合计划资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；</p> <p>（19）法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除上述（2）、（9）、（15）、（16）情形之外，因证券市场波动、证券发行人合并、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，管理人应当在10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。</p> <p>管理人应当自资产管理合同生效之日起6个月内使集合计划的投资组合比例符合资产管理合同的有关约定。在上述期间内，本集合计划的投资范围、投资策略应当符合资产管理合同的约定。托管人对集合计划的投资的监督与检查自</p>
--	---

本合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本集合计划，管理人在履行适当程序后，则本集合计划投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护集合计划份额持有人的合法权益，集合计划财产不得用于下列投资或者活动：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他集合计划份额或基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；

(5) 向其管理人、托管人出资；

(6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

管理人运用集合计划财产买卖管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和投资策略，遵循集合计划份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估

		<p>机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交管理人董事会审议。管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>无</p>	<p>本集合计划的业绩比较基准为：中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率*5%</p> <p>中证500指数由中证指数有限公司编制并发布。它的样本选自沪深两个证券市场，其成份股包含了500只沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小市值股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体状况。</p> <p>如果指数编制单位更改以上指数名称、停止或变更以上指数的编制或发布，或以上指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致以上指数不宜继续作为业绩比较基准，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用于本集合计划的业绩比较基准时，本集合计划管理人可以根据本集合计划的投资范围和投资策略，调整集合计划的业绩比较基准，但应在取得托管人同意后报中国证监会备案，并及时公告，无须召</p>

	开集合计划份额持有人大会审议。
--	-----------------

（七）调整估值方法

在估值核算上，删除了不符合公募基金要求的资产的估值方法，根据公募基金相关规定调整原金贝壳8号的投资范围，根据投资范围的调整相应修改了估值方法，增加了实施侧袋机制期间的集合计划资产估值相关约定。

明确A类集合计划份额、C类集合计划份额分别计算份额净值。某类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入。

（八）调整信息披露条款

在信息披露上，按照中国证监会2019年7月26日颁布、同年9月1日实施的，并经2020年3月20日中国证监会《关于修改部分证券期货规章的决定》修正的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》调整原金贝壳8号的信息披露条款。

（九）增加份额持有人大会机制

根据《基金法》和《运作办法》的规定，在《国海证券量化优选一年持有期股票型集合计划资产管理合同》中设置集合计划份额持有人大会机制，约定须召开份额持有人大会的事项，并明确持有人大会会议召集人、召集方式；召开份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式；份额持有人出席会议的方式；议事内容与程序；表决和计票规则等。

二、相关流程安排

根据《证券期货投资者适当性管理办法》相关规定及《国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划资产管理合同》的约定，管理人在管理人网站公布本公告，并于征询意见公告发出后的二十个工作日内（即2021年7月26日至2021年8月20日）向投资者征询合同变更的意见。

投资者应在认真阅读“国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划”的法律文件后，确认是否接受合同变更，并重新确认适当性匹配意见。重新确认适当性匹配意见的具体程序按各销售机构的要求办理。投资者完成确认适当性匹配意见的全部程序的，视为同意合同变更。投资者在征询意见公告发出后的二十个工作日内

（即2021年8月20日前，含当日）未完成确认适当性匹配意见的全部程序的，视为不同意变更并申请退出。

投资者不同意变更的，应在征询意见公告发出后的二十个工作日内（即2021年7月26日至2021年8月20日前，含当日）申请退出金贝壳8号。

最终未完成确认适当性匹配意见的全部程序的投资者如未主动申请退出，管理人将统一于2021年8月20日做强制退出处理。

2021年7月26日至2021年8月20日，除管理人另行公告约定的开放安排外，管理人将暂停办理金贝壳8号的申购业务。

投资者自本公告发布之日起至《资产管理合同》生效日前（不含生效日）退出金贝壳8号的不收取赎回费。

截止本公告发布后的第二十二个工作日（即2021年8月20日）日终，若管理人按照有关约定履行完毕合同变更程序且满足法律法规的要求，本次变更拟于本公告发布后的第二十二个工作日（即2021年8月23日）起生效，《资产管理合同》等相关法律文件同时生效，原《国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划资产管理合同》终止。具体生效时间以管理人公告为准。

三、重要提示

1、敬请投资者注意，管理人将于2021年8月20日为最终未完成确认适当性匹配意见全部程序的投资者办理强制退出业务。2021年7月26日至2021年8月20日，除管理人另行公告约定的开放安排外，管理人将暂停办理金贝壳8号（策略稳健）的申购业务。

2、敬请投资者登录我公司网站<http://www.ghzq.com.cn/>仔细阅读变更后的《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划托管协议》和《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件。

3、原国海金贝壳8号（策略稳健）集合资产管理计划份额（代码：DE0008）在《资产管理合同》生效后同时转换为国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划A类份额（代码：970041）。

管理人自《资产管理合同》生效之日起不超过3个月开始办理国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划C类份额的申购业务，具体业务办理时间和办理规则另行公告。

4、如您需更详细了解金贝壳8号变更为国海证券量化优选集合计划相关事宜，请登录我公司网站<http://www.ghzq.com.cn/>或致电95563查询。

特此公告。

感谢您一直以来给予国海证券资产管理团队的关注和支持，祝您投资顺利、生活顺心！

附件：

- 1、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划资产管理合同》
- 2、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划托管协议》
- 3、《国海证券量化优选一年持有期股票型集合资产管理计划招募说明书》

