

公告编号：临2021-0809

**关于海通海蓝宝银集合资产管理计划变更为海通量化成长精选一年  
持有期混合型集合资产管理计划及法律文件变更的  
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《关于准予海通海蓝宝银集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2021]3697号），作为海通海蓝宝银集合资产管理计划（以下简称“海通海蓝宝银”）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，本公司拟将海通海蓝宝银变更为海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“海通量化成长精选一年持有”或“本集合计划”），并按照《海通海蓝宝银集合资产管理计划资产管理合同》、《海通海蓝宝银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。

海通海蓝宝银变更为海通量化成长精选一年持有涉及法律文件全文变更，即由原海通海蓝宝银的法律文件变更为海通量化成长精选一年持有的法律文件，包括《海通量化成长精选一年持有期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》”）、《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》、《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）等，上述法律文件已同步在管理人网站披露，敬请投资者仔细阅读。本次海通海蓝宝银变更为海通量化成长精选一年持有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“海通海蓝宝银集合资产管理计划”变更为“海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划”。



## （二）变更产品类型

产品类型由“限定性集合资产管理计划”变更为“契约型开放式集合资产管理计划”。

## （三）增加份额类别设置

1、《资产管理合同》生效后，份额类别设置情况如下：

（1）原海通海蓝宝银份额自《资产管理合同》生效之日变更为海通量化成长精选一年持有B类份额，不设置最短持有期限。B类份额仅开放日常赎回业务不开放申购，红利再投资份额除外。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

（2）增设海通量化成长精选一年持有A类份额和C类份额。海通量化成长精选一年持有A类份额和C类份额开放日常申购与赎回业务，但A类份额和C类份额持有人持有的每份份额最短持有期限为一年，在最短持有期限内该类集合计划份额不可赎回或转换转出。A类份额和C类份额持有人持有的每份集合计划份额需在集合计划份额申购确认日（对申购份额而言）或集合计划份额转换转入确认日（对转换转入份额而言）一年后的年度对应日（含当日，若该对应日期为非工作日或该公历年不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日）起方可办理赎回或转换转出业务。开放日的具体业务办理时间在届时相关公告中载明。

2、海通量化成长精选一年持有B类份额的固定管理费由1.2%/年降低至0.7%/年；在本集合计划投资者赎回日和集合计划终止日，延续《海通海蓝宝银集合资产管理计划资产管理合同》对老客户的业绩报酬计提基准和计提比例，即对B类份额期间年化收益率超过6%以上部分按照25%的比例收取管理人业绩报酬。

海通量化成长精选一年持有A类份额和C类份额的固定管理费为0.8%/年；在本集合计划投资者赎回日和集合计划终止日，管理人将根据投资者的期间年化收益率，对海通量化成长精选一年持有A类份额或C类份额期间年化收益率8%以上部分按照20%的比例收取业绩报酬。

即，在本集合计划投资者赎回日和集合计划终止日，管理人对符合业绩报酬提取条件的份额提取业绩报酬如下：

A类或C类计划份额 期间年化收益率（R）	计提比例	业绩报酬（Y）的计提公式
-------------------------	------	--------------

$R < 8\%$	0	$Y = 0$
$R \geq 8\%$	20%	$Y = A \times (R - 8\%) \times 20\% \times D$
<b>B类计划份额期间年 收益率 (R)</b>	<b>计提比例</b>	<b>业绩报酬 (Y) 的计提公式</b>
$R < 6\%$	0	$Y = 0$
$R \geq 6\%$	25%	$Y = A \times (R - 6\%) \times 25\% \times D$

### 3、C类份额的销售服务费

海通量化成长精选一年持有A类份额、B类份额不收取销售服务费，C类份额的销售服务费年费率为0.5%。C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.5%年费率计提。

#### (四) 调整申购相关条款

##### 1、申购费率

《资产管理合同》生效后，投资人在申购本集合计划集合计划份额时，收取申购费用；投资人可以多次申购本集合计划，申购费用按每日累计申购金额确定申购费率，以每笔申购申请单独计算费用。

本集合计划B类份额不开放申购。本集合计划A类份额在申购时收取申购费用，C类份额不收取申购费用。

本集合计划A类份额的申购费率如下表所示：

单笔申购金额（含申购费）(M)	申购费率
$M < 100$ 万元	1.2%
$100$ 万元 $\leq M < 500$ 万元	0.8%
$M \geq 500$ 万元	每笔 1000 元

申购费用由A类集合计划份额的投资人承担，不列入集合计划资产，申购费用用于本集合计划的市场推广、注册登记和销售。

##### 2、调整最低申购金额

海通量化成长精选一年持有A类份额、C类份额在其他销售机构（网点）每个集合计划基金账户单笔申购最低金额为1元人民币（含申购费），其他销售机构另有规定的，从其规定；管理人直销柜台每个集合计划基金账户首次最低申购金额、单笔申购最低金额均为1元人民币（含申购费）；通过管理人网上交易平台申购本

集合计划时，最低申购金额、定投最低金额均为1元人民币（含申购费）。

（五）调整赎回相关条款

《资产管理合同》生效后，本集合计划 A 类份额和 C 类份额的赎回费率按持有时间递减。投资者在一天之内如果有多笔赎回，适用费率按单笔分别计算。

A 类份额和 C 类份额的具体赎回费率如下表所示：

持有期限 (T) (天指自然日、年指 365 天)	赎回费率 (%)
T < 7 天	1.5
7 天 ≤ T < 30 天	0.75
T ≥ 30 天	0

B□ 如下表所示：

持有期限 (T) (天指自然日、年指 365 天)	赎回费率 (%)
T < 7 天	1.5
7 天 ≤ T < 30 天	0.75
30 天 ≤ T < 365 天	0.5
T ≥ 365 天	0

本集合计划的赎回费用由赎回集合计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。

本集合计划对于持有期少于 30 天的集合计划份额所收取的赎回费，赎回费用全额归入集合计划财产，对于持有期大于等于 30 天但少于 90 天的赎回费用 75% 归入集合计划财产，对于持有期大于等于 90 天但少于 180 天的赎回费用 50% 归入集合计划财产，对于持有期大于等于 180 天但少于 365 天的赎回费用 25% 归入集合计划财产，未归入集合计划财产的部分作为本集合计划用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

（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海通海蓝宝银的原条款。

	海通海蓝宝银	海通量化成长精选一年持有
投资目标	分析市场、跟踪市场、检验市场；发现并遵循规则；度量并控制风险；在分散风险的基础上实现稳定的资产保值增值。 注重集合计划的安全性和流动性，在较低风	本集合计划通过数量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求实现集合计划资产的增值。

	<p>险的基础上追求适度收益。</p>	
<p>投资范围和投资比例</p>	<p>1、投资范围：  本集合计划的投资范围为国内依法发行的金融工具，包括股票、权证、证券投资基金（包括且不限于股票型、混合型、指数型、交易所交易型基金（ETF）、债券型、货币市场基金等）、银行存款、银行理财产品、国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离债、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、不低于 A-1 级的短期融资券、资产支持受益凭证、债券正、逆回购、股指期货、期权以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的金融工具。</p> <p>本集合计划可投资于债券型基金和具有固定收益特征的分级股票型和混合型证券投资基金的优先级份额，也可以投资于分级证券投资基金的进取级份额。</p> <p>2、资产配置比例：  （1）固定收益类资产：0%-100%，固定收益类资产包括国债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债、可转换债券、可分离债、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、资产支持受益凭证、不低于 A-1 级的短期融资券、超过 7 天的债券逆回购、银行理财产品等。</p> <p>（2）现金类资产：0%-100%，现金类资产包括现金、银行存款、货币市场基金、不超过 7 天的债券逆回购等。</p> <p>（3）权益类资产：0%-100%，权益类资产包括股票、证券投资基金（股票型、混合型、指数型、交易所交易型基金（ETF））。</p> <p>（4）债券正回购融入资金余额不超过计划资产净值的 40%。</p> <p>（5）股指期货投资：本集合计划以套期保值和套利为目的投资股指期货，在任一时点，</p>	<p>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、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、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）。</p> <p>本集合计划根据法律法规的规定参与融资业务。在法律法规允许的情况下并履行适当程序后，本集合计划可以参与融券业务和转融通证券出借业务。在法律法规允许的情况下，本集合计划可以投资各类期权品种。</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：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合计占股票资产的 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。本集合计划将港股通标的股票投资的比例下限设为零，本集合计划可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。</p>

	<p>持有股指期货的风险敞口不得超过计划资产净值的 80%，股指期货的投资须依从相关法律法规规定。</p> <p>(6) 在任何交易日日终，在扣除股指期货合约占用的交易保证金后，现金和到期日在 1 年以内的国债不低于计划资产净值的 5%。</p> <p>(7) 任何时刻期货空头合约价值不得超过计划财产总值的 100%。</p> <p>(8) 其他金融衍生品：包括期权、权证及其他中国证监会许可投资的其他金融衍生品，投资比例需依从法律、法规、行政政策的相关规定。</p>	
投资策略	<p><b>(二) 资产配置策略</b></p> <p>本计划通过深入的国内外宏观经济、政策研究以及各大类资产的风险收益度量，在符合相应投资比例规定的前提下，决定各类资产的配置比例。</p> <p>本集合计划通过对宏观经济趋势、金融货币政策和利率趋势的判断，将集合资产在银行存款等货币市场工具及短期债券等低风险资产间进行合理配置，在满足安全性和流动性基础上，尽可能提高投资组合收益。</p> <p><b>(三) 债券投资策略</b></p> <p>1、利率预期策略</p> <p>管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>管理人通过对债券市场微观因素的分析判断，形成对未来收益率曲线形状变化的预期，获取收益率曲线形变带来的投资收益。</p> <p>3、久期管理策略</p> <p>久期是衡量债券利率风险的主要指标，反映了债券价格对于收益率变动的敏感程度。当预期市场利率上升时，通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方</p>	<p>1、资产配置策略</p> <p>大类资产配置不作为本集合计划的核心策略。一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在综合考虑系统性风险、各类资产收益风险比、流动性要求、申购赎回以及分红等因素后，对集合计划资产配置做出适当调整。</p> <p>2、以超越业绩基准为目的的股票投资策略</p> <p>本集合计划基于长期量化研究构建投资模型，坚持数据驱动，挖掘市场中的潜在逻辑，通过优化量化投资模型来规避情绪带来的负面影响，力图获得超越业绩基准的投资回报。</p> <p>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，并根据对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。</p> <p>策略组合构建方法：</p> <p>(1) 筛选有效因子</p> <p>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，选取出符合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。</p> <p>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</p>

式降低组合久期，以降低组合跌价风险；在预期市场收益率下降时，通过增持剩余期限较长债券等方式提高组合久期，以分享债券价格上升的收益。

#### 4、类属替换策略

管理人研究宏观、微观经济，观察公司债等信用债券品种与同期限国债之间信用利差状况，形成信用利差将收窄或扩大预期，相应调整信用债券类属品种与同期限国债的投资比例。

#### 5、个券优选策略

管理人根据债券市场收益率数据，对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

### （四）股票投资策略

本计划运用定量工具与模式，研究影响股票收益率的因子，寻求建立因子与收益率之间的稳定联系，最终构建并持有预期收益较好的投资组合，在有效控制风险的前提下，力争实现资产稳定的正向回报。

本计划运用的定量模型包含但不限于以下几个方面：

#### 1、收益率预期模型

大量搜集并清洗各类信息，长期跟踪、测试并不断扩展因子数据库，建立包含投资者行为、上市公司行为、分析师行为、财务报表、交易数据、经济数据等多维度的因子库，建立因子与未来收益率的稳定关联，并根据市场的状况变化评估模型的适用性。

#### 2、风险测算模型

本计划将利用风险预测模型和适当的控制措施，有效管理投资组合的预期风险，并力求将投资组合风险暴露控制在合理范围内。

#### 3、绩效分析评价模型

本计划将建立的绩效分析与评价模型，客观评价策略的风险收益特征，建立策略监控、

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、营业总收入、每股收益、资产负债率、总资产周转率等；市场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、酌情纳入重新发挥作用的有效因子或者由市场上新出现的投资逻辑归纳而来的有效因子，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

作为在投资决策时的可观测指标，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（及其近期值）所形成的向量，是影响这只股票市场表现的重要因素，这些因素的综合影响方式可能非常复杂，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痕迹，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并固定下来，从而有效避免主观情绪可能带来的负面影响，严格执行投资逻辑。整个过程具体来讲就是，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股票权重

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备选股票组合，同时综合风险收益目标、风险敞口约束和换仓成本优化备选组合内的个股权重。

在实际运行过程中，管理人将紧密追踪组合和市场的互动表现，及时对多因子选股体系定期或不定期地进行修正，优化股票投资组合。为控制组合风险，在个股偏离度和行业偏离度上也会设置阈值。

评价、反馈与改进之间的循环模式。

#### 4、组合优化模型

本计划将根据拟实现的投资目标，综合考虑收益、风险、成本等因素，进行组合的优化管理。

#### （五）金融衍生品投资策略

在法律法规允许的范围内，本计划可运用股票指数期货、股票期权等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以控制投资组合风险、提高投资效率、实现投资收益，从而更好地达到资产保值增值的投资目标。

#### （六）基金投资策略

本计划坚持从研究基金价值入手，结合市场投资方向，选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金构建备选基金池。

#### （4）港股投资策略

本集合计划将仅通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本集合计划重点投资于基本面良好、主要收入来自于中国内地、相对A股市场估值合理，具有持续领先优势或核心竞争力及注重现金分红的上市公司进行长期投资。

#### 3、债券投资策略

本集合计划债券投资将以优化流动性管理、分散投资风险为主要目标，同时有效利用集合资产提高集合计划收益。通过研究国内外宏观经济、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响，进行合理的利率预期，采取自上而下的方式确定组合久期，进而根据期限结构配置、信用利差、信用风险评估、现金管理等手段进行个券选择。

#### 4、股指期货投资策略

本集合计划进行股指期货投资的主要目的是对股票组合进行套期保值，通过对国内外宏观经济运行趋势、财政以及货币政策、市场资金供需状况、股票市场估值水平、固定收益类资产收益水平等因素进行分析，结合对股票头寸的流动性、风险程度等因素的测评，以确定需要进行套期保值的股票组合和套期保值期限。根据公募基金相关法规和资产管理合同的规定，管理人可以使用股指期货进行加减仓位的投资操作。

若相关法律法规发生变化，管理人在进行股指期货投资管理时遵从最新规定。

#### 5、股票期权投资策略

本集合计划投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，选择流动性好的期权合约进行投资。本集合计划将结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与期权交易的投资时机和投资比例。



		<p>6、存托凭证投资策略</p> <p>本集合计划将根据本集合计划的投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本集合计划投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p> <p>8、融资业务投资策略</p> <p>本集合计划将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资业务。</p> <p>9、其他金融衍生产品的投资策略</p> <p>本集合计划将根据集合计划的特点和要求，结合该类金融衍生产品的特征，在进行充分风险控制和遵守法律法规的前提下，制定合适的投资策略，以控制并降低投资组合风险，提高投资效率，降低跟踪误差，从而更好地实现本集合计划的投资目标。</p>
<p>投资限制</p>	<p>为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划禁止从事下列投资行为：</p> <p>1、海通海蓝宝银集合资产管理计划可投资于债券正回购，债券正回购融入资金余额不超过计划资产净值的 40%；</p> <p>2、将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；</p> <p>3、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投資；</p> <p>4、将集合计划资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券超过集合计划资产净值的 7%（按市值计算）；</p> <p>5、证券法律法规和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资；</p> <p>6、如相关法律法规对投资限制有新规定的，本集合计划的投资限制将按照新规定执行。</p>	<p>集合计划的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>（1）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合计占股票资产的 0%-50%）；</p> <p>（2）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，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、应收申购款等；</p> <p>（3）本集合计划持有一家上市公司的证券（同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算），其市值不超过集合计划资产净值的 10%；</p> <p>（4）管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家上市公司发行的证券</p>

(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算), 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;

(5) 本集合计划投资于股指期货的投资限制: 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%; 在任何交易日日终, 持有的买入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; 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%; 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%; 本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;

(6) 本集合计划投资于股票期权的投资限制: 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过集合计划资产净值的 10%; 开仓卖出认购期权的, 应持有足额标的证券; 开仓卖出认沽期权的, 应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物; 未平仓的期权合约面值不得超过集合计划资产净值的 20%, 其中, 合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;

(7) 本集合计划投资于同一原始权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%;

(8) 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%;

(9) 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%；

(10) 管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理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%；

(11) 本集合计划应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。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；

(12) 集合计划财产参与股票发行申购，本集合计划所申报的金额不超过本集合计划的总资产，本集合计划所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；

(13) 本集合计划债券正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过本集合计划上一日净资产的 40%；

(14) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为 1 年，债券回购到期后不展期；

(15) 管理人管理的全部公开募集性质的开放式集合资产管理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%；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；

(16) 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；

(17) 本集合计划与私募类证券资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资产管理合同约定的投资范围保持一

		<p>致；</p> <p>(18) 本集合计划仅在参与融资时遵守下列要求：本集合计划参与融资的每个交易日日终，本集合计划持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过集合资产管理计划资产净值的 95%；</p> <p>(19) 本集合计划资产总值不超过计划资产净值的 140%；</p> <p>(20) 本集合计划投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行；</p> <p>(21) 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>
业绩比较基准	无	$80\% \times \text{中证 500 指数收益率} + 20\% \times \text{商业银行活期存款利率 (税后)}$

#### (七) 调整估值方法

在估值核算上，根据公募基金相关规定调整原海通海蓝宝银的投资范围，相应删除了不符合公募基金要求的资产的估值方法。

#### (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》调整原海通海蓝宝银的信息披露条款。

#### (九) 增加基金份额持有人大会

根据《基金法》和《运作办法》的规定，在海通量化成长精选一年持有《资产管理合同》中设置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《海通海蓝宝银集合资产管理计划资产管理合同》的约定，管理人在管理人指定网站公布本公告，向投资者征询合同变更的意见。投资者不同意变更的，

应在征询意见函发出后的5个工作日内（即2021年12月15日至2021年12月21日）提出退出海通海蓝宝银的申请。投资者在前述期间内退出海通海蓝宝银的，不收取赎回费。**敬请投资者注意，在上述征询意见期间（即2021年12月15日至2021年12月21日），管理人将暂停办理投资者申请参与海通海蓝宝银的业务，仅办理投资者申请退出海通海蓝宝银的业务。**

对于明确答复不同意变更但逾期未退出海通海蓝宝银的投资者，管理人将统一在变更生效日即《资产管理合同》生效日前一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的份额净值），且不收取赎回费。**敬请投资者注意，《资产管理合同》生效日前一工作日，管理人将暂停办理投资者申请参与、退出海通海蓝宝银的业务，仅为前述明确答复不同意变更但逾期未退出海通海蓝宝银的投资者办理强制退出业务。**

投资者未在前述时间回复意见或回复意见不明确，也未退出海通海蓝宝银的，视为投资者同意海通海蓝宝银变更为海通量化成长精选一年持有以及相关法律文件的变更；同意按照《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。

截止本公告发布后的第六个工作日（即2021年12月22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，本次变更将于本公告发布后的第七个工作日（即2021年12月23日）起生效，《资产管理合同》及相关法律文件同时生效，原《海通海蓝宝银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，在本次合同变更征询意见期间（即2021年12月15日至2021年12月21日），管理人将暂停办理投资者申请参与海通海蓝宝银的业务，仅办理投资者申请退出海通海蓝宝银的业务；《资产管理合同》生效日前一工作日，管理人将暂停办理投资者申请参与、退出海通海蓝宝银的业务，仅为前述明确答复不同意变更但逾期未退出海通海蓝宝银的投资者办理强制退出业务。**

2、敬请投资者登录我公司网站[www.htsamc.com](http://www.htsamc.com)，仔细阅读变更后的《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》、《海通量化成

长精选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》和《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》等法律文件。

3、原海通海蓝宝银集合资产管理计划份额在《资产管理合同》生效后变更为海通量化成长精选一年持有B类份额。管理人自《资产管理合同》生效之日起不超过3个月开始办理海通量化成长精选一年持有A类份额、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、如您需更详细了解海通海蓝宝银变更为海通量化成长精选一年持有相关事宜，请登录我公司网站[www.htsamc.com](http://www.htsamc.com)或致电021-23154328查询。

特此公告。

感谢您一直以来给予海通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、《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 2、《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 3、《海通量化成长精选一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》。

上海海通证券资产管理有限公司

2021年12月14日