

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安润 90 天滚动持有中短债债券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，海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会《关于准予海通月月财集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2022〕70 号）准予，由海通月月财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《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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 2 月 10 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”），集合计划托管人为上海银行股份有限公司（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《海通月月财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至 2025 年 12 月 31 日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。”，本集合计划将于 2025 年 12 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，管理人经与托管人上海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安润 90 天持有期中短债债券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：“海通安润 90 天滚动持有中短债债券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

《关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券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《关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券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应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人有效身份证件（指本人在销售机构开户或参与本集合计划时使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；如前述证件或证明有更新，需提供最新版本）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章或经有效授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（3）合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本机构公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件和取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（4）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供个人投资者有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件，以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单

位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（5）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供机构投资者的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等），以及填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（6）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件（详见附件三）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（包括使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的企业法人营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等）；

（7）以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等，以管理人的认可为准。

3、集合计划份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的授权委托书等相关文件在 2025 年 9 月 17 日起，至 2025 年 10 月 14 日 17:00 止（以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准）通过专人送交、邮寄送达至本公告第一条第 4 项所述的寄达地址，并在信封背面注明：“海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决专用”。

（二）网络投票（仅适用于个人投资者）

为方便集合计划份额持有人（个人投资者）参与大会投票，自 2025 年 9 月 17 日起，至 2025 年 10 月 14 日 17:00 以前（以管理人系统记录时间为准），集合计划份额持有人可登录管理人网站投票专区：（1）移动端：<https://ehtam.htsec.com/holdVote>；（2）PC 端：<https://ehtam.htsec.com/holdVote>，通

过前述投票专区进行网络投票。

通过网络方式进行投票的集合计划份额持有人，应按照管理人要求，准确填写姓名、证件号码等相关内容，并按系统要求操作，以核实集合计划份额持有人的身份，确保集合计划份额持有人权益。

集合计划份额持有人通过网络投票的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

（三）短信投票（仅适用于个人投资者）

为方便集合计划份额持有人参与本次大会，自 2025 年 9 月 17 日起，至 2025 年 10 月 14 日 17:00 以前（以管理人系统记录时间为准），管理人提供短信通道供投资者进行投票。

管理人或部分销售机构可向预留手机号码的个人投资者发送征集投票的短信，集合计划份额持有人回复短信表明表决意见。短信表决意见内容需包含三部分内容：投资者身份证件号码、本集合计划指定代码 A、投资者表决意见（同意/反对/弃权）；各部分内容无先后顺序要求，但需以空格、顿号或其他符号间隔；

“同意/反对/弃权”中必须选择一种且只能选择一种表决意见。如集合计划份额持有人对议案表示同意，短信表决意见示例为：“123456198001011234、A、同意”；如集合计划份额持有人对议案表示反对，短信表决意见示例为：

“123456198001011234、A、反对”；如集合计划份额持有人对议案表示弃权，短信表决意见示例为：“123456198001011234、A、弃权”。

集合计划份额持有人原预留手机号码已变更或已不再实际使用的，可选择其他方式进行投票。因电信运营商原因或通讯故障等不可抗力或非管理人人为因素，导致集合计划份额持有人无法获取短信进行投票或逾期接收到短信致使短信投票无效的，管理人不承担责任，请集合计划份额持有人采用管理人认可的其他投票方式进行投票。

集合计划份额持有人通过短信投票的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

（四）录音电话投票（仅适用于个人投资者）

为方便集合计划份额持有人参与本次大会，自 2025 年 9 月 17 日起，至 2025 年 10 月 14 日 17:00 以前（以管理人系统记录时间为准），管理人或部分销售机

构可通过各自的客户服务电话与集合计划份额持有人取得联系，在通话过程中以回答提问方式核实集合计划份额持有人身份后，集合计划份额持有人可在电话中对本次大会议案进行表决。

为保护集合计划份额持有人利益，上述整个通话过程将被录音。

集合计划份额持有人通过录音电话投票的方式仅适用于个人投资者，对机构投资者暂不开通。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由管理人授权的两名监督员在托管人（上海银行股份有限公司）授权代表的监督下于 2025 年 10 月 16 日进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。如托管人经通知但拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

2、本集合计划份额持有人所持有的每份集合计划份额享有一票表决权。

3、纸质表决票效力的认定如下：

（1）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达指定联系地址的，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大会的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。

（2）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

（3）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明集合计划份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达指定联系地址的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次大会的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。

（4）集合计划份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2) 送达时间为同一天的, 视为在同一表决票上作出了不同表决意见, 视为弃权表决票, 但计入参加本次大会的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数;

3) 送达时间按如下原则确定: 专人送达的以实际递交时间为准, 邮寄的以本公告指定的表决票收件人收到表决票时间为准。

4、网络投票表决的效力认定

如果同一集合计划份额持有人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的时间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的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指定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总份额的二分之一（含二分之一）。

本次会议表决的票数要求为：《关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券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或授权他人代表出具表决意见。

重新召开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：上海银行股份有限公司

住 所：上海市黄浦区中山南路688号

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号

联系电话：021—68475608

网址：<https://www.bosc.cn/zh/>

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：《关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金有关事项的议案》

附件二：《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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：《关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金有关事项的说明》

附件五：《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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：

关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金有关事项的议案
海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额持有人：

海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划（A 类集合计划份额代码：970134，C 类集合计划份额代码：970135，以下简称“本集合计划”）经中国证监会 2022 年 1 月 11 日《关于准予海通月月财集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2022〕70 号）准予，由海通月月财集合资产管理计划对标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”），集合计划托管人为上海银行股份有限公司。《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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 2 月 10 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《海通月月财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至 2025 年 12 月 31 日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。”，本集合计划将于 2025 年 12 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安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额持有人大会，提议按照《关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券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更换管理人和变更，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自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资金。

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20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受滚动运作期限限制且不收取赎回费。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。

本议案需根据《资产管理合同》成功召开集合计划份额持有人大会，并由参加大会的集合计划份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。本议案如获得集合计划份额持有人大会审议通过，为实施本集合计划变更管理人等变更方案，同意授权管理人办理本集合计划变更及法律文件修改的有关具体事宜，包括但不限于根据相关情况，决定采取相关集合计划变更的措施以及确定集合计划变更各项工作的具体时间，并授权管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见届时发布的相关公告。

以上议案，请予审议。

上海海通证券资产管理有限公司

2025年9月15日

附件二：

海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决票			
集合计划份额持有人姓名/名称：			
证件号码（身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码）：	基金账户号：		
代理人（受托人）姓名/名称：	代理人（受托人）证件号码（身份证件号/营业执照号/统一社会信用代码）：		
审议事项	同意	反对	弃权
《关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金有关事项的议案》			
集合计划份额持有人/代理人（受托人）签名或盖章			
年 月 日			
说明： 请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表集合计划份额持有人所持全部集合计划份额的表决意见。如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认、表决意见模糊不清或相互矛盾，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票，并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。 “基金账户号”仅指持有本集合计划份额的基金账户号，同一集合计划份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有集合计划份额分别行使表决权的，应当填写基金账户号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此集合计划份额持有人所持有的本集合计划所有份额。			

（本表决票可剪报、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，在填写完整并签字或盖章后方为有效）。

附件三：

海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额

持有人大会授权委托书

兹全权委托_____先生 / 女士 / 单位代表本人 / 本单位参加以通讯方式召开的投票截止日为____年__月__日的海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额持有人大会，并代为全权行使对所有议案的表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。本授权不得转授权。若海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划重新召开审议相同议案的持有人大会的，本授权继续有效。但如果授权方式发生变化或者份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准。

委托人（签字/盖章）：

委托人证件类型及证件号码：

委托人基金账户号：

受托人（或代理人）（签字/盖章）：

受托人（或代理人）证件类型及证件号码：

委托日期： 年 月 日

授权委托书填写注意事项：

1、本授权委托书中“基金账户号”，指集合计划份额持有人持有海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额的基金账户号。同一集合计划份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有集合计划份额分别行使表决权的，应当填写多个基金账户号，其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此集合计划份额持有人所持有的海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划的所有集合计划份额。

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：

**关于海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划
更换管理人并变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资
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，海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会《关于准予海通月月财集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2022〕70 号）准予，由海通月月财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变更而来，变更后的《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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 2 月 10 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”），集合计划托管人为上海银行股份有限公司（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《海通月月财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至 2025 年 12 月 31 日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。”，本集合计划将于 2025 年 12 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，管理人经与托管人上海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安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）等有关事项。

本次海通安润90天滚动持有中短债债券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，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。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：

由海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更为国泰海通安润90天持有期中短债债券型证券投资基金。

3、产品类别变化：

由债券型集合资产管理计划变更为债券型证券投资基金。

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肖彦”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李佳闻”。

5、存续期限变化：

由“自《海通月月财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至 2025 年 12 月 31 日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。”变更为“不定期”。

6、运作方式变化：

由对每笔份额设置90天滚动持有期变更为对每份基金份额设定90天的最短持有期。

即，由“对于每份集合计划份额，管理人仅在该集合计划份额的每个运作期到期日为集合计划份额持有人办理赎回。对于每份集合计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第90天（即第一个运作期到期日，如该日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第180天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。

对于每份集合计划份额，管理人仅在该集合计划份额的每个运作期到期日为集合计划份额持有人办理赎回。”

变更为“对于本基金每份基金份额设定90天的最短持有期。最短持有期到期日（含该日）起可以办理赎回或转换转出业务。

最短持有期指基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日后的第90天（即最短持有期到期日）止，如最短持有期到期日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金份额在最短持有期内不办理赎回及转换转出业务。

原海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划A类份额或C类份额自本基金合同生效后相应转换为本基金A类基金份额或C类基金份额，其持有期限从登记机构确认投资人持有原海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划A类份额或C类份额之日起连续计算。”

7、费率变化：

（1）C类份额销售服务费率由【0.3%】/年变更为【0.2%】/年。

（2）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【0.3%】变更为【0.4%】。

8、投资范围及投资限制变化：

投资范围删除“可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券”、增加“信用衍生品”、“可分离交易可转债的纯债部分”，并调整相应的中短债范围和投资限制，同时删除投资限制中“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。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；”、“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%；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；”，并在投资限制中新增“本基金参与信用衍生品投资，需遵守下列投资比例限制：本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品；不持有合约类信用衍生品；本基金持有的信用衍生品名义本金，不得超过本基金中所对应受保护债券面值的100%；本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的10%；

因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（13）项规定投资比例的，基金管理人应当在3个月内进行调整；”。

9、投资策略及业绩比较基准变化：

根据投资范围，补充“信用衍生品投资策略”、删除“证券公司短期公司债券投资策略”、“可转债投资策略”、调整“信用债投资策略”。

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“中债综合财富(1年以下)指数收益率*50%+中债综合财富(1-3年)指数收益率*35%+一年期定期存款利率(税后)*15%”变更为“中债总全价（1-3年）指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×20%”。

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》等相关规定相应调整估值方法，并根据投资范围的变化对应调整内容。

11、争议的处理变化：

由“应提交管理人所在地有管辖权的人民法院起诉”变更为“将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），按照上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）届时有效的仲裁规则进行仲裁”。

12、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)变更为毕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。

具体修订内容请见附件五：《海通安润90天滚动持有中短债债券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20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受滚动运作期限限制且不收取赎回费。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、《国泰海通安润90天持有期中短债债券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，《国泰海通安润90天持有期中短债债券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结转为国泰海通安润90天持有期中短债债券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。”

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，将由基金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，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：《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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	《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》条款	《国泰海通安润 90 天持有期中短债债券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	海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划	国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金
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	基金投资者
全文	集合计划份额、份额	基金份额
全文	集合计划份额登记机构	登记机构
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	一、订立本合同的目的、依据和原则 2、订立本合同的依据是《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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。 三、本集合计划由海通月月财集合资产管理计划变更而来，由管理	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《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》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。 三、国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金（以

	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》、《海通月月财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。 中国证监会对海通月月财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没有风险。 六、投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 A 类份额。 A 类份额：指投资人申购时收取申购费用，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。 C 类份额：指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的集合计划份额类别。	以下简称“本基金”或“基金”）由海通安润 90 天滚动持有中短债债券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。 海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划由海通月月财集合资产管理计划变更而来，海通月月财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》、《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券业协会备案。 中国证监会对海通月月财集合资产管理计划变更为海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划的批准、海通安润 90 天滚动持有中短债债券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没有风险。 六、对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通月月财集合资产管理计划份额，自《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额；以及对于投资者依据《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额，自本基金合同生效之日起均全部自动转换为本基金 A 类基金份额。 对于投资者依据《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通安润 90 天滚动持有中短债债券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。 七、为对冲信用风险，本基金可能投资于信用衍生品。信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。具体风险揭示烦请查阅本基金招募说明书“风险揭示”章节内容。
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：指海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 7、产品资料概要：指《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 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 22、集合计划销售业务：指管理人或销售机构宣传推介集合计划，办理集合计划份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 28、资产管理合同生效日：《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日，《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》同日失效 30、存续期：指《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》生效至《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资	1、基金或本基金：指国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金 7、基金产品资料概要：指《国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新 9、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自 2004 年 6 月 1 日起施行；经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改〈中华人民共和国港口法〉等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订 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 22、基金销售业务：指基金管理人或销售机构宣传推介基金，销售基金份额，办理基金份额的申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务 28、基金合同生效日：指《国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金基金合同》生效之日，《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日失效 30、存续期：指《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限

	产管理合同》终止之间的期限 31、运作期起始日：对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额，第一个运作期起始日指资产管理合同生效日；对于每份申购份额，第一个运作期起始日指该集合计划份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份集合计划份额的下一运作期起始日，指该集合计划份额上一运作期到期日后的下一日 32、运作期到期日：对于每份集合计划份额，第一个运作期到期日指资产管理合同生效日（对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额而言，下同）或集合计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）后的第 90 天（如该日为非工作日，则顺延到下一工作日），第二个运作期到期日为资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第 180 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日），以此类推	32、最短持有期：对于每份基金份额设置 90 天最短持有期，即自基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日后的第 90 天（即最短持有期到期日）止，如最短持有期到期日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金份额在最短持有期内不办理赎回及转换转出业务 原海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额或 C 类份额自本基金合同生效后相应转换为本基金 A 类基金份额或 C 类基金份额，其持有期限从登记机构确认投资人持有原海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份
--	---	---

	38、《业务规则》：指《上海海通证券资产管理有限公司公开募集集合资产管理计划注册登记业务规则》，是规范管理人所管理人的公开募集集合资产管理计划注册登记方面的业务规则，由管理人和投资人共同遵守 46、集合计划收益：指集合计划投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用集合计划财产带来的成本和费用的节约 52、集合计划份额的类别：指根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别，各集合计划份额类别代码不同，并分别公布集合计划份额净值和集合计划份额累计净值 53、A 类份额：指投资人申购时收取申购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 对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 A 类份额 54、C 类份额：指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的集合计划份额类别	额或 C 类份额之日起连续计算 37、《业务规则》：指《上海国泰海通证券资产管理有限公司基金注册登记业务实施细则（适用于自建 TA）》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金登记方面的业务规则，由基金管理人和投资人共同遵守 45、基金收益：指基金投资所得债券利息、买卖证券价差、银行存款利息、已实现的其他合法收入及因运用基金财产带来的成本和费用的节约 51、基金份额类别：指根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将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 52、A 类基金份额：指基金合同生效后投资人申购时收取申购费用，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。对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通月月财集合资产管理计划份额，自《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额；以及对于投资者依据《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额，自本基金合同生效之日起均全部自动转换为本基金 A 类基金份额 53、C 类基金份额：指基金合同生效后从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用的基金份额类别。 对于投资者依据《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通安润 90 天滚动持有中短
--	---	---

		债券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 59、信用衍生品：指符合证券交易所及银行间市场相关交易规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具 60、信用保护买方：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方 61、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方 62、名义本金：亦称交易名义本金，是一笔信用衍生品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基础
第三部分 基金的基本情况	二、集合计划的类别 债券型集合资产管理计划 三、集合计划的运作方式 1、对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 A 类份额。 2、对于每份集合计划份额，管理人仅在该集合计划份额的每个运作期到期日为集合计划份额持有人办理赎回。对于每份集合计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第 90 天（即第一个运作期到期日，如该日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至资产管理	二、基金的类别 债券型证券投资基金 三、基金的运作方式 对于本基金每份基金份额设定 90 天的最短持有期。最短持有期到期日（含该日）起可以办理赎回或转换转出业务。 最短持有期指基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）或基金份额转换转入确认日（对转换转入份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至基金份额申购确认日或基金份额转换转入确认日后的第 90 天（即最短持有期到期日）止，如最短持有期到期日为非工作日，则顺延至下一个工作日。基金份额在最短持有期内不办理赎回及转换转出业务。 原海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额或 C 类份额自本基金合同生效后相应转换为本基金 A 类基金份额或 C 类基金份额，其持有期限从登记机构确认投资人持有原海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额或 C 类份额之日起连续计算。

	合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第 180 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。 对于每份集合计划份额，管理人仅在该集合计划份额的每个运作期到期日为集合计划份额持有人办理赎回。 3、在每份集合计划份额的每个运作期到期日，集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回或赎回被确认失败，则该集合计划份额将在该运作期到期后自动进入下一个运作期。 集合计划份额持有人在运作期到期日申请赎回的，管理人按照《招募说明书》的约定为集合计划份额持有人办理赎回事宜。 六、集合计划的存续期限 自《海通月月财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至 2025 年 8 月 9 日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。 七、集合计划份额类别 A 类份额：投资人申购时收取申购费用但不从本类别集合计划资产中计提销售服务费的份额。对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起投资者持有的上述份额全部自动转换为本集合计划 A 类份额。	六、基金的存续期限 不定期。 七、基金份额类别 A 类基金份额：指基金合同生效后投资人申购时收取申购费用，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。对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通月月财集合资产管理计划份额，自《海通安润 90 天滚动持有中短债债券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安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额；以及对于投资者依据《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划 A 类份额，自本基金合同生效之日起均全部自动转换为本基金 A 类基金份额。
--	--	---

	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的份额。 本集合计划A类份额、C类份额分别设置代码，分别计算和公告各类集合计划份额净值。计算公式为： $T \text{ 日某类集合计划份额净值} = T \text{ 日该类集合计划份额的资产净值} / T \text{ 日该类集合计划份额余额总数。}$ 本集合计划有关份额类别的具体设置以及费率水平等由管理人确定，并在招募说明书及产品资料概要中公告。根据集合计划销售情况，在符合法律法规及中国证监会规定且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与托管人协商一致并在履行适当程序后，管理人可以增加新的集合计划份额类别、停止现有集合计划份额类别的销售等，或对集合计划份额分类办法及规则进行调整，并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，而无需召开集合计划份额持有人大会。	额。 C类基金份额：指基金合同生效后从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用的基金份额类别。对于投资者依据《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通安润 90 天滚动持有中短债债券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、C类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值。计算公式为： $T \text{ 日某类基金份额净值} = T \text{ 日该类基金份额的基金资产净值} / T \text{ 日该类基金份额余额总数。}$ 本基金办理A类基金份额、C类基金份额的申购业务，投资人在申购基金份额时可自行选择基金份额类别。 本基金有关基金份额类别的具体设置以及费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书、基金产品资料概要中公告。根据基金销售情况，在符合法律法规、本基金合同及中国证监会规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人经与基金托管人就清算交收、核算估值、系统支持等方面协商一致，并在履行适当程序后可以增加新的基金份额类别或者停止现有基金份额类别的销售等，或对基金份额分类办法及规则进行调整，而无需召开基金份额持有人大会，但调整实施前基金管理人需依照《信息披露办法》的规定在规定媒介上及时公告。
第四部分 基金的历史沿革	海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更自原大集合“海通月月财集合资产管理计划”（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，于 2013 年 5 月 31 日取得中国证券业协会《关于上海海通证券资产管理有限公司发起设立海	国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金由海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更而来。海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划由海通月月财集合资产管理计划变更而来。

	通月月财集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]493号），自2013年1月14日向社会公众发行，于2013年1月17日结束募集并于2013年1月21日成立。 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，对原集合计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。 经中国证监会批准，《海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日起生效，《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。	海通月月财集合资产管理计划为限定性集合资产管理计划，于2013年5月31日取得中国证券业协会《关于上海海通证券资产管理有限公司发起设立海通月月财集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]493号），自2013年1月14日向社会公众发行，于2013年1月17日结束募集并于2013年1月21日成立。 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，海通月月财集合资产管理计划变更为海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划，《海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》自2022年2月10日起生效，《海通月月财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，海通安润90天滚动持有中短债债券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〕1888号文准予变更注册。 海通安润90天滚动持有中短债债券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【】年【】月【】日表决通过了《关于海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通安润90天持有期中短债债券型证券投资基金有关事项的议案》，同意海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更为国泰海通安润90天持有期中短债债券型证券投资基金并变更管理人、调整产品名称、运作方式、存续期限、投资范围、投资策略、投资限制、业
--	--	---

		绩比较基准、申购费率、销售服务费率、估值方法、争议的处理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【】年【】月【】日起，《国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金基金合同》生效，《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划变更为国泰海通安润 90 天持有期中短债债券型证券投资基金，即本基金。
第五部分 基金的存续	《资产管理合同》生效后，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 60 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。 本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至 2025 年 8 月 9 日。本集合计划到期后，按照中国证监会相关规定执行。如本集合计划到期后，不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的，无须召开集合计划份额持有人大会。	《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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 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、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集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 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 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 A 类份额/C 类份额的申购业务，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。资产管理合同剩余存续期限不足 90 天时，份额的申购届时根据管理人公告办理。 对于每份集合计划份额，管理人仅在该集合计划份额的每个运作期	二、申购和赎回的开放日及时间 2、申购、赎回开始日及业务办理时间 基金合同生效后，基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在相关公告中规定。对于每份基金份额，自最短持有期到期日（含该日）起，基金管理人开始办理赎回业务，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。如果投资人多次申购 A 类基金份额/C 类基金份额，则其持有

	到期日为集合计划份额持有人办理赎回。对于每份集合计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对于投资者依据原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的海通月月财集合资产管理计划份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第 90 天（即第一个运作期到期日，如该日为非工作日，则顺延到下一工作日）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一日起，至资产管理合同生效日或集合计划份额申购申请日后的第 180 天（如该日为非工作日，则顺延至下一工作日）止。以此类推。 管理人自资产管理合同生效之日后的第 90 天（如该日为非工作日，则顺延到下一工作日）开始办理 A 类份额/C 类份额的赎回业务，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。 原海通月月财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。 三、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算； 4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照持有集合计划份额登记日期的先后次序进行顺序赎回； 管理人可在法律法规允许的情况下，对上述原则进行调整。管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。	的 A 类基金份额/C 类基金份额的赎回开放时间可能不同。 三、申购与赎回的原则 1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的该类基金份额净值为基准进行计算； 4、赎回遵循“先进先出”原则，即按照持有基金份额登记日期的先后次序进行顺序赎回，基金份额持有人持有原海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额的持有期限连续计算； 基金管理人可在法律法规允许且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，对上述原则进行调整。基金管理人必须在新规则开始实施前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。
--	---	---

	五、申购和赎回的数量限制 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本集合计划 A 类份额和 C 类份额分别设置代码，分别计算和公告集合计划份额净值。各类本集合计划份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T 日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本集合计划申购份额的计算详见《招募说明书》。本集合计划 A 类份额的申购费率由管理人决定，并在招募说明书及产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本集合计划赎回金额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的赎回费率由管理人决定，并在招募说明书及产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类集合计划份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。 5、赎回费用由赎回集合计划份额的持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。赎回费用归入集合计划财产的比例	五、申购和赎回的数量限制 4、基金管理人可以规定本基金单日的申购金额上限或单日净申购比例上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 5、基金管理人可以规定本基金的总规模限额、单个投资人单日/单笔申购金额上限，具体规定请参见招募说明书或相关公告。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、本基金 A 类基金份额、C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值。各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。 2、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金 A 类基金份额的申购费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。申购的有效份额为净申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书及基金产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类基金份额净值并扣除相应的费用（如有），赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例依
--	--	--

	依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 7、当本集合计划发生大额申购或赎回情形时，管理人可以采用摆动定价机制，以确保集合计划估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。 8、管理人可以在不违反法律法规规定及资产管理合同约定且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情形下根据市场情况制定促销计划，定期或不定期地开展促销活动。在促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，管理人可以适当调低集合计划的销售费率。 七、拒绝或暂停申购的情形 发生上述第 1、2、3、5、6、8 项暂停申购情形之一且管理人决定暂停接受投资人申购申请时，管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7 项情形时，管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，管理人应及	照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。 7、其他 （1）当本基金发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定，具体见基金管理人届时的相关公告； （2）基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下根据市场情况制定基金促销计划，针对基金投资者定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对基金投资者适当调低基金申购费率、赎回费率和转换费率。 七、拒绝或暂停申购的情形 8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致销售系统、注册登记系统或会计系统无法正常运行。 9、当日申购申请超出基金管理人规定的总规模限制、单日的申购金额上限或单日净申购比例上限、单个投资人单日/单笔申购金额上限、单个投资人累计持有份额上限的情形。 发生上述第 1、2、3、5、6、8、10 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第 7、9 项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝的申购款项将退
--	---	--

	时恢复申购业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生上述情形之一且管理人决定暂停赎回或延缓支付赎回款项时，管理人应及时报中国证监会备案，已确认的赎回申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按资产管理合同的相关条款处理。集合计划份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （3）如发生单个开放日内单个集合计划份额持有人申请赎回的集合计划份额超过前一开放日的集合计划总份额的20%时，管理人有权先行对该单个集合计划份额持有人超出20%以上的部分赎回申请实施延期办理，管理人只接受其集合计划总份额20%部分作为当日有效赎回申请，而对该单个集合计划份额持有人20%以内（含20%）的赎回申请与当日其他投资者的赎回申请按前述“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”条款处理，对单个集合计划份额持有人超过集合计划总份额20%以上的赎回申请延期赎回。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。延期部分如选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择，投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。	还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。 八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形 发生上述情形之一且基金管理人决定暂停接受赎回申请或延缓支付赎回款项时，基金管理人应及时报中国证监会备案，已确认的赎回申请，基金管理人应足额支付；如暂时不能足额支付，应将可支付部分按单个账户申请量占申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分可延期支付。若出现上述第4项所述情形，按基金合同的相关条款处理。基金份额持有人在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理并公告。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （3）若本基金发生巨额赎回，在出现单个基金份额持有人超过上一开放日基金总份额20%的赎回申请（以下简称“大额赎回申请人”）情形下，基金管理人可以延期办理。基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额10%的前提下，优先确认其他赎回申请人（以下简称“小额赎回申请人”）的赎回申请：若小额赎回申请人的赎回申请在当日予以全部确认，则基金管理人在仍可接受赎回申请的范围内对大额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对大额赎回申请人未予确认的赎回申请延期办理；若小额赎回申请人的赎回申请在当日无法被全部确认，则基金管理人在可接受赎回申请的范围内对小额赎回申请人的赎回申请按比例确认，对未确认的赎回申请（含小额赎回申请人的其余赎回申请与大额赎回申请人的全部赎回申请）延期办理。延期办理的赎回申请适用本条规定的延期赎回或取消赎回的规则，选
--	--	--

	十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、如发生暂停的时间为1日，管理人应于重新开放日，在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公布最近1个开放日的各类集合计划份额净值。 3、如发生暂停的时间超过1日但少于2周（含2周），暂停结束，集合计划重新开放申购或赎回时，管理人应提前2日在规定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的各类集合计划份额净值。 4、如发生暂停的时间超过2周，暂停期间，管理人应每2周至少刊登暂停公告1次。暂停结束，集合计划重新开放申购或赎回时，管理人应提前2日在规定媒介上连续刊登集合计划重新开放申购或赎回公告，并公告最近1个开放日的各类集合计划份额净值。	择延期赎回的，当日未获处理的赎回申请将自动转入下一开放日继续赎回，直到全部赎回为止。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的该类基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推。同时，基金管理人应当对延期办理的事宜在规定媒介上进行公告。 十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告 2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间，依照《信息披露办法》的有关规定，最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告；也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间，届时不再另行发布重新开放的公告。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	一、管理人 （一） 管理人简况 名称：上海海通证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区广东路689号第32层01-12室单元 法定代表人：路颖 成立日期：2012年6月26日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可[2012]418号 组织形式：有限责任公司（非自然人投资或控股的法人独资） 注册资本：22亿元	一、基金管理人 （一） 基金管理人简况 名称：上海国泰海通证券资产管理有限公司 住所：上海市黄浦区中山南路888号8层 邮政编码：200011 法定代表人：陶耿 成立日期：2010年8月27日 批准设立机关及批准设立文号：中国证券监督管理委员会；证监许可【2010】631号

	存续期限：持续经营 联系电话：021-23219000 （二） 管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的权利包括但不限于： （11）依照法律法规为集合计划的利益对被投资公司行使股东权利，为集合计划的利益行使因集合计划财产投资于证券所产生的权利； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，管理人的义务包括但不限于： （2）办理资产管理合同变更申请或变更注册为公募基金手续； 二、托管人 （一） 托管人简况 法定代表人：金煜 （二） 托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于： （16）按照法律法规和《资产管理合同》、托管协议的规定监督基金管理人的投资运作；	组织形式：有限责任公司 注册资本：20 亿元人民币 存续期限：持续经营 联系电话：021-38676999 （二） 基金管理人的权利与义务 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于： （11）依照法律法规为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利； 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于： （2）办理基金备案手续； 二、基金托管人 （一） 基金托管人简况 法定代表人：顾建忠 批准设立机关及批准设立文号：中国人民银行银复[1995]469 号《关于上海城市合作银行开业的批复》，中国人民银行银复[1998]215 号《关于上海城市合作银行更改行名的批复》 传真：021-68476936 （二） 基金托管人的权利与义务 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于： （16）按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作；
--	---	--

第八部分 基金份额持有人大会	本集合计划份额持有人大会未设立日常机构。在本集合计划存续期内，根据本集合计划的运作需要，集合计划份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开集合计划份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定或本合同另有约定的除外： （1）终止《资产管理合同》（因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外）； （5）调整管理人、托管人的报酬标准或提高销售服务费； 2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由管理人和托管人协商后修改，不需召开集合计划份额持有人大会： （2）调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率、调低销售服务费或变更收费方式； （4）对《资产管理合同》的修改对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《资产管理合同》当事人权利义务关系发生变化； （5）集合计划推出新业务或服务； 三、召开集合计划份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次集合计划份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的	基金份额持有人大会不设日常机构。在本基金存续期内，根据本基金的运作需要，基金份额持有人大会可以设立日常机构，日常机构的设立与运作应当根据相关法律法规和中国证监会的规定进行。 一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，但法律法规、中国证监会另有规定或本基金合同另有约定的除外： （1）终止《基金合同》； （5）调整基金管理人、基金托管人的报酬标准或提高销售服务费； 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人、基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会： （2）调整本基金的申购费率、调低赎回费率、销售服务费或变更收费方式； （4）对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生重大变化； （5）经履行适当程序后，基金推出新业务或服务； 三、召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式 2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、表决意见寄交的
------------------------------	--	--

	截止时间和收取方式。 3、如召集人为管理人，还应另行书面通知托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为托管人，则应另行书面通知管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为集合计划份额持有人，则应另行书面通知管理人和托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。管理人或托管人拒不派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。 四、集合计划份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或资产管理合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或资产管理合同约定的其他方式进行表决。 在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效： （2）召集人按资产管理合同约定通知托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取集合计划份额持有人的书面表决意见；托管人或管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力； （3）本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见集合计划份额持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一，召集人可以在原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	截止时间和收取方式。 3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。 四、基金份额持有人出席会议的方式 2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或基金合同约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或基金合同约定的其他方式进行表决。 在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效： （2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力； （3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内，就原
--	--	--

	个月以内，就原定审议事项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有代表三分之一以上（含三分之一）集合计划份额的持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见； （4）上述第（3）项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的集合计划份额持有人持有集合计划份额的凭证及集合计划份额持有人的代理投票授权委托书证明符合法律法规、《资产管理合同》和会议通知的规定，并与集合计划登记机构记录相符。 六、表决 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。 七、计票 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，并由公证机关对其计票过程予以公证。管理人或托管人拒派代表对书面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 若本集合计划实施侧袋机制，则相关集合计划份额或表决权的比例	定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见； （4）上述第（3）项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的基金份额持有人持有基金份额的凭证及基金份额持有人的代理投票授权委托书证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。 六、表决 采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。 七、计票 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基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。 十、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋
--	--	--

	指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例，但若相关集合计划份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例； 3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面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集合计划份额的二分之一（含二分之一）； 5、现场开会由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名集合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人； 6、一般决议须经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二分之一以上（含二分之一）通过； 7、特别决议应当经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。	份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例； 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基金份额持有人所持有的基金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）； 5、如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，现场开会由出席大会的相关基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人； 6、一般决议须经参加大会的相关基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过； 7、特别决议应当经参加大会的相关基金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。
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	二、管理人和托管人的更换程序 （一） 管理人的更换程序 6、交接：管理人职责终止的，管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时管理人或新任管理人应及时接收。新任管理人或临时管理人应与托管人核对集合计划资产总值和净值；	二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一） 基金管理人的更换程序 6、交接：基金管理人职责终止的，基金管理人应妥善保管基金管理业务资料，及时向临时基金管理人或新任基金管理人办理基金管理业务的移交手续，临时基金管理人或新任基金管理人应及时接收。临时基金管理人或新任基金管理人应与基金托管人核对基金资产总值和净值； 四、本部分关于基金管理人、基金托管人更换条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调

		整，无需召开基金份额持有人大会审议。
第十一部分 基金份额的登记	二、集合计划登记业务办理机构 本集合计划的登记业务由管理人或管理人委托的其他符合条件的机构办理。管理人委托其他机构办理本集合计划登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确管理人和代理机构在投资者集合计划基金账户管理、集合计划份额登记、清算及集合计划交易确认、发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等事宜中的权利和义务，保护集合计划份额持有人的合法权益。 四、集合计划登记机构的义务 集合计划登记机构承担以下义务： 3、妥善保存登记数据，并将集合计划份额持有人名称、身份信息及集合计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自集合计划基金账户销户之日起不得少于 20 年； 4、对集合计划份额持有人的集合计划基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或集合计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《资产管理合同》约定的其他情形除外；	二、基金登记业务办理机构 本基金的登记业务由基金管理人或基金管理人委托的其他符合条件的机构办理。基金管理人委托其他机构办理本基金登记业务的，应与代理人签订委托代理协议，以明确基金管理人和代理机构在投资者基金账户管理、基金份额登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等事宜中的权利和义务，保护基金份额持有人的合法权益。 四、基金登记机构的义务 基金登记机构承担以下义务： 3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限不低于法律法规规定的最低期限； 4、对基金份额持有人的基金账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对投资者或基金带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查情形及法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他情形除外；
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 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、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具。 本集合计划不投资于股票等权益类资产，但可持有因可转换债券和	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、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、信用衍生品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。 本基金不直接投资于股票，也不投资于可转换债券（可分离交易

	可交换债券转股所形成的股票等权益类资产。因上述原因持有的股票，本集合计划将在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。 本集合计划的投资组合比例为：债券资产的投资比例不低于集合计划资产的 80%，其中投资于中短债的比例不低于非现金资产的 80%；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，持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得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。 本集合计划所指的中短债是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等金融工具。 三、投资策略 1、固定收益类资产投资策略 5) 证券公司短期公司债券投资策略 本集合计划将根据内部的信用分析方法对可选的证券公司短期公司债券品种进行筛选，并严格控制单只证券公司短期公司债券的投资比例。此外，由于证券公司短期公司债券整体流动性相对较差，本集合计划将对拟投资或已投资的证券公司短期公司债券进行流动性分析和监测，尽量选择流动性相对较好的品种进行投资。 6) 信用债券评级 本集合计划所投资的信用债（不含可交换债券、可分离交易可转换债券、可转换债券）主体评级或债项评级不低于 AA+（含），在综合考虑信用风险、信用利差、流动性风险等因素的基础上，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平，且所投资的信用债应当	可转债的纯债部分除外）、可交换债券。 本基金的投资组合比例为：本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的 80%；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，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不得低于基金资产净值的 5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 本基金所指的中短债是指剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可分离交易可转债的纯债部分等金融工具。 三、投资策略 2、信用债投资策略 信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企
--	---	--

	遵守下列要求： ①本集合计划投资于 AAA 信用评级的信用债的比例不低于本集合计划信用债资产的 50%； ②本集合计划投资于 AA+信用评级的信用债的比例不高于本集合计划信用债资产的 50%。 信用评级参照评级机构（中债资信除外）评定的最新债项评级，无债项评级的参照主体评级。 （2）可转债投资策略 可转债主要筛选正股优良、估值合理及具备明显条款博弈价值的个券。根据转债估值及定价模型，结合权益市场预期进行择时判断，在市场估值及隐含波动率的不同阶段采用不同的投资策略； 个券筛选方面，择券主要抓手为正股资质，形成“行业-个股”的综合分析框架，并结合财务健康度识别信用风险，同时挖掘条款博弈价值；关注正股的右侧机会、绝对价格相对低位的优质标的的中长期配置、权益市场启动后低价个券的下修博弈价值。 本集合计划投资于可转换债券（含可分离交易可转换债券）、可交换债券的比例占资产总值的 0%-20%。 （3）资产支持证券投资策略	业的基本面，以确定信用债的实际信用状况。获取信用利差超额收益。基金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和配置。 本基金将投资于信用等级不低于 AA+的信用债（含资产支持证券，下同），其中投资于评级 AA+的信用债比例不超过本基金投资于信用债资产的 50%；投资于评级 AAA 的信用债比例不低于本基金投资于信用债资产的 50%。上述评级为该债券的最新债项评级（不含外资控股的评级机构、不含中债资信），无债项评级或者债项评级为 A-1 的以最新主体评级为准（不含外资控股的评级机构，不含中债资信）。基金持有信用债券期间，如果其信用评级下降、基金规模变动、变现信用债支付赎回款项等使得投资评级或投资比例不再符合上述约定，应在评级报告发布之日或不再符合上述约定之日起 3 个月内调整至符合约定（流动性受限资产除外）。 3、资产支持证券投资策略
--	---	--

	本集合计划投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本公司在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指本公司运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。 2、衍生产品投资策略 （2）本集合计划将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许本集合计划投资前述衍生工具，本集合计划将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本集合计划投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。 四、投资限制 1、组合限制 集合计划的投资组合应遵循以下限制： （1）本集合计划债券资产的投资比例不低于计划资产的 80%，其中	本基金投资资产支持证券将采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指基金管理人在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化或定性分析方法对资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对收益率走势及其收益和风险进行判断。自下而上投资策略指基金管理人运用数量化或定性分析方法对资产池信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。 6、金融衍生产品投资策略 （2）本基金将关注其他金融衍生产品的推出情况，如法律法规或监管机构允许本基金投资其他金融衍生产品，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估金融衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。 7、信用衍生品投资策略 本基金按照风险管理原则，以风险对冲为目的，参与信用衍生品交易。本基金将根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，审慎开展信用衍生品投资，合理确定信用衍生品的投资金额、期限等。同时，本基金将加强基金投资信用衍生品的交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。 四、投资限制 1、组合限制 基金的投资组合应遵循以下限制： （1）本基金债券资产的投资比例不低于基金资产的 80%，其中投
--	--	--

	投资于中短债的比例不低于非现金资产的 80%； （4）本管理人管理的全部公开募集性质的集合计划持有一家公司发行的证券，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； （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%； （9）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。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； （10）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%；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； 除上述第（2）、（9）、（11）、（12）项外，因证券、期货市场波动、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本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	投资于中短债的比例不低于非现金基金资产的 80%； （4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，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基金品种可以不受此条款规定的比例限制； （8）本基金管理人管理的全部基金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%； （13）本基金参与信用衍生品投资，需遵守下列投资比例限制：本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品；不持有合约类信用衍生品；本基金持有的信用衍生品名义本金，不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%；本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%； 因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述第（13）项规定投资比例的，基金管理人应当在 3 个月内进行调整； 除上述第（2）、（9）、（10）、（13）项外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使本基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除
--	--	---

	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。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。 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: (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; 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。 五、业绩比较基准 中债综合财富(1年以下)指数收益率*50%+中债综合财富(1-3年)指数收益率*35%+一年期定期存款利率(税后)*15% 中债综合财富(1年以下)指数是中债金融估值中心有限公司编制	外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。 法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定为准。 2、禁止行为 为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动: (4)买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外; 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金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,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金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机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。 法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按调整后的规定执行。 五、业绩比较基准 中债总全价(1-3年)指数收益率×80%+银行活期存款利率(税后)×20%。 中债总全价(1-3年)指数是综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场中短期债券的指数,对中短期债券价格变
--	--	--

	的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的短期债券指数，旨在反映短期债券的整体价格和投资回报情况。中债综合财富（1-3 年）指数由中央国债登记结算有限公司编制，该指数旨在综合反映中短期债券市场价格和投资回报情况，指数涵盖了银行间市场和交易所市场，具有广泛的市场代表性，适合作为本集合计划的业绩比较基准。本集合计划债券投资比例不低于计划资产的 80%，且主要投资于剩余期限不超过三年的债券资产，主要包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券、证券公司短期公司债券等金融工具。基于本集合计划的投资范围和投资组合比例，选用上述业绩比较基准能够较好地反映本集合计划的风险收益特征。 若未来法律法规发生变化，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集合计划的业绩基准的指数，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布时，本集合计划管理人在与托管人协商一致并在按照监管部门要求履行适当程序后，可调整或变更业绩比较基准并及时公告。 六、风险收益特征 本集合计划属于债券型集合资产管理计划，预期风险和收益水平低于股票型集合资产管理计划、股票型基金、混合型集合资产管理计划和混合型基金、高于货币型集合资产管理计划和货币市场基金。 七、管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法 1、管理人按照国家有关规定代表集合计划独立行使股东或债权人权利，保护集合计划份额持有人的利益； 2、不谋求对上市公司的控股；	动趋势有很强的代表性，能较好的反映本基金的投资策略，能够较为科学、合理的评价本基金的业绩表现。基于本基金主要投资债券类资产，选取该业绩比较基准能够忠实的反映本基金的风险收益特征。 若未来法律法规发生变化，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比较基准的指数，或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用或本业绩比较基准停止发布时，本基金管理人在与基金托管人协商一致并在按照监管部门要求履行适当程序后，可调整或变更业绩比较基准并及时公告。 六、风险收益特征 本基金属于债券型基金，预期风险和收益水平理论上低于股票型基金和混合型基金、高于货币市场基金。 七、基金管理人代表基金行使债权人权利的处理原则及方法 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
--	---	---

第十四部分 基金资产估值	二、估值对象 集合计划所拥有的各类证券、国债期货合约、资产支持证券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 四、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 （1）交易所上市的有价证券（包括股票等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； （2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值； （3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价进行估值； （4）交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价； （5）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值； （6）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对	二、估值对象 基金所拥有的债券、国债期货合约、资产支持证券、信用衍生品和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。 四、估值方法 1、证券交易所上市的有价证券的估值 （1）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值； （2）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值； （3）交易所上市不存在活跃市场的有价证券，采用估值技术确定公允价值； （4）对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允
----------------------------	--	---

	市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，应采用估值技术确定其公允价值。 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理： （1）送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值； （2）首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值； （3）在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。 3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。	价值； （5）对在交易所市场挂牌转让的资产支持证券，选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。 2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。 3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，采用当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。 4、对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售
--	---	--

	5、同业存单按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。 7、中国金融期货交易所上市的国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。 根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。 五、估值程序 1、集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，各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。管理人可以设立大额赎回情形下的	登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响；回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。 6、存款的估值方法 7、国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。 8、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值全价估值。 9、信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价进行估值，但基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规、行业协会的相关规定及企业会计准则要求采用合理估值技术确定公允价值。 根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金净值信息的计算结果对外予以公布。 五、估值程序 1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金资产净值除以当日该类基金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。基金管理人可以设立大额赎回情形下
--	---	--

	净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。 2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将各类集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人对外公布。 六、估值错误的处理 管理人和托管人将采取必要、适当、合理的措施确保集合计划资产估值的准确性、及时性。当任一类集合计划份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为集合计划份额净值错误。 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下： （2）错误偏差达到集合计划份额净值的 0.25%时，管理人应当通报托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到集合计划份额净值的 0.5%时，管理人应当公告，并报中国证监会备案。 八、集合计划净值的确认 集合计划资产净值和各类集合计划份额净值由管理人负责计算，托管人负责进行复核。管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值并发送给托管人。托管人对净值计算结果复核确认后发送给管理人，由管理人对外公布。 九、特殊情形的处理 1、管理人或托管人按估值方法的第 8 项进行估值时，所造成的误差不得作为集合计划资产估值错误处理。 2、由于不可抗力原因，或由于证券、期货交易所及登记结算公司发	的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。 2、基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金资产净值及各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。 六、估值错误的处理 基金管理人和基金托管人将采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性、及时性。当任一类基金份额净值小数点后 4 位以内（含第 4 位）发生估值错误时，视为该类基金份额净值错误。 4、基金份额净值估值错误处理的方法如下： （2）错误偏差达到该类基金份额净值的 0.25%时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类基金份额净值的 0.5%时，基金管理人应当公告，并报中国证监会备案。 八、基金净值的确认 基金资产净值和各类基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个开放日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对外公布。 九、特殊情形的处理 1、基金管理人或基金托管人按估值方法的第 10 项进行估值时，所造成的误差不得作为基金资产估值错误处理。 2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所及登记结算公司
--	---	---

	送的数据错误等，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的集合计划资产估值错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。	等第三方机构发送的数据错误等，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的基金资产估值错误，基金管理人、基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。
第十五部分 基金费用与税收	二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式 1、管理人的管理费 集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。托管人与管理人核对一致后，由托管人根据管理人划款指令或者双方约定方式，在月初第3个工作日按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。集合计划终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。 2、托管人的托管费 集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，托管人与管理人核对一致后，由托管人根据管理人划款指令或者双方约定方式，在月初第3个工作日按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。集合计划终止后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。 3、销售服务费 本集合计划A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0.3%。 C类份额的销售服务费按前一日C类份额资产净值的0.3%年费率计提，计算方法如下： $H=E \times 0.3\% \div \text{当年天数}$	二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式 1、基金管理人的管理费 基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人与基金管理人核对一致后，由基金托管人根据基金管理人划款指令或者双方约定方式，在月初10个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。 2、基金托管人的托管费 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人与基金管理人核对一致后，由基金托管人根据基金管理人划款指令或者双方约定方式，在月初10个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。 3、销售服务费 本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.2%。 C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.2%年费率计提，计算方法如下： $H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$

	H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值 销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，托管人与管理人核对一致后，由托管人根据管理人划款指令或者双方约定方式，在月初第 3 个工作日按照指定的账户路径从计划资产划出。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。销售服务费由管理人代收，管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。 4、上述“一、集合计划费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由托管人从集合计划财产中支付。 三、不列入集合计划费用的项目 下列费用不列入集合计划费用： 3、《资产管理合同》生效前的相关费用，按当时有效的《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》的约定支付；	H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值 销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，基金托管人与基金管理人核对一致后，由基金托管人根据基金管理人划款指令或者双方约定方式，在月初 10 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。销售服务费由基金托管人按照相关合同规定根据基金管理人出具的划款指令支付给基金销售机构，或一次性支付给基金管理人并由基金管理人代付给各基金销售机构。 上述“一、基金费用的种类”中第 4—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。 三、不列入基金费用的项目 下列费用不列入基金费用： 3、《基金合同》生效前的相关费用，按当时有效的《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》的约定支付；
第十六部分 基金的收益与分配	三、集合计划收益分配原则 1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 12 次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的 10%，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配； 2、本集合计划收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资	三、基金收益分配原则 1、在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配； 2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者

	者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的集合计划份额进行再投资；若投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是现金分红；因红利再投资转换的份额类别，与集合计划份额持有人在收益分配基准日持有的份额同属一个类别；如集合计划份额持有人持有多个类别份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资份额。由红利再投资而来的 A 类或 C 类份额，其运作期起始日和运作期到期日与原份额相同； 4、由于本集合计划 A 类份额和 C 类份额的费用收取方式存在不同，各类集合计划份额对应的可供分配收益将有所不同。本集合计划同一类别每一集合计划份额享有同等分配权； 五、收益分配方案的确定、公告与实施 本集合计划收益分配方案由管理人拟定，并由托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。	可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；因红利再投资所得基金份额类别，与基金份额持有人在收益分配基准日持有的基金份额同属一个类别；如基金份额持有人持有多个类别基金份额的，则根据不同类别收益分配方案分别计算该类别红利再投资基金份额；红利再投资所形成的基金份额的最短持有期与对应申购/转换转入份额最短持有期保持一致； 4、由于本基金 A 类基金份额、C 类基金份额的费用收取方式存在不同，各类基金份额对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权； 五、收益分配方案的确定、公告与实施 本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在 2 日内在规定媒介公告。
第十七部分 基金份额的折算	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。	六、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。
第十八部分 基金的会计与审计	一、集合计划会计政策 1、管理人为本集合计划的会计责任方；	一、基金会计政策 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
第十九部分 基金的信息披露	五、公开披露的集合计划信息 公开披露的集合计划信息包括： （一）集合计划招募说明书、《资产管理合同》、集合计划托管协议、产品资料概要 1、《资产管理合同》是界定《资产管理合同》当事人的各项权利、义务关系，明确集合计划份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明集合计划产品的特性等涉及集合计划投资者重大利益的事项	五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括： （一）基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要 1、《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。

	的法律文件。 《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》变更为《海通安润90天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》的申请经中国证监会批准后，管理人应将集合计划招募说明书提示性公告、《资产管理合同》提示性公告登载在规定报刊上，将集合计划招募说明书、产品资料概要、《资产管理合同》和集合计划托管协议登载在规定网站上；托管人应当同时将《资产管理合同》、集合计划托管协议登载在网站上。 （二）《资产管理合同》生效公告 管理人应当在规定媒介上登载《资产管理合同》生效公告。 （六）临时报告 前款所称重大事件，是指可能对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的下列事件： 5、管理人委托服务机构代为办理集合计划的份额登记、核算、估值等事项，托管人委托服务机构代为办理集合计划的核算、估值、复核等事项； 8、管理人的高级管理人员、集合计划投资经理和托管人专门托管部门负责人发生变动； 9、管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，管理人、托管人专门托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十； 11、管理人或其高级管理人员、集合计划投资经理因集合计划管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，托管人或其专门托管部门负责人因托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚； 15、任一类集合计划份额净值估值错误达该类集合计划份额净值百	基金管理人应及时将基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在规定网站上。 （五）临时报告 前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件： 5、基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项； 8、基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动； 9、基金管理人的董事在最近12个月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近12个月内变动超过百分之三十； 11、基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚； 15、任一类别基金份额净值估值错误达该类基金份额净值百分之
--	---	--

	分之零点五； 22、调整集合计划份额类别设置、集合计划份额折算情形； 23、启用侧袋机制、处置特定资产、终止侧袋机制以及发生其他可能对投资者利益产生重大影响的事项； （七）澄清公告 在《资产管理合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对集合计划份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害集合计划份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清，并将有关情况立即报告中国证监会。 （十）投资资产支持证券的信息披露 管理人在集合计划年报及中期报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。管理人在集合计划季度报告中披露其持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占集合计划净资产的比例和报告期末按市值占集合计划净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。 （十一）投资国债期货的信息披露 管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对集合计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。	零点五； 22、调整基金份额类别设置； 23、本基金实施基金份额折算； （六）澄清公告 在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。 （九）投资资产支持证券的信息披露 基金管理人在基金年度报告及中期报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人在基金季度报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。 （十）投资国债期货的信息披露 基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和交易目标。 （十一）投资信用衍生品的信息披露 基金管理人应当在定期报告及招募说明书（更新）等文件中详细
--	---	---

	六、信息披露事务管理 托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《资产管理合同》的约定，对管理人编制的集合计划资产净值、集合计划份额净值、集合计划份额申购赎回价格、集合计划定期报告、更新的招募说明书、产品资料概要、集合计划清算报告等相关集合计划信息进行复核、审查，并向管理人进行书面或电子确认。 八、暂停或延迟信息披露的情形 当出现下述情况时，管理人和托管人可暂停或延迟披露集合计划相关信息：	披露信用衍生品的投资情况，包括投资策略、持仓情况等，并充分揭示投资信用衍生品对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资目标及策略。 （十二）清算报告 基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。 六、信息披露事务管理 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。 八、暂停或延迟信息披露的情形 当出现下述情况时，基金管理人和基金托管人可暂停或延迟披露基金相关信息： 3、发生暂停基金估值的情形时；
第二十部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算	一、《资产管理合同》的变更 1、变更资产管理合同涉及法律法规规定或本合同约定应经集合计划份额持有人大会决议通过的事项的，应召开集合计划份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和资产管理合同约定可不经集合计划份额持有人大会决议通过的事项，由管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。 四、清算费用 清算费用是指集合计划财产清算小组在进行集合计划清算过程中	一、《基金合同》的变更 1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。 四、清算费用 清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的

	发生的所有合理费用，清算费用由集合计划财产清算小组优先从集合计划财产中支付。	所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金剩余财产中支付。
第二十一部分 违约责任	二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护集合计划份额持有人利益的前提下，《资产管理合同》能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。	二、在发生一方或多方违约的情况下，在最大限度地保护基金份额持有人利益的前提下，《基金合同》能够继续履行的应当继续履行。非违约方当事人在职责范围内有义务及时采取必要的措施，尽力防止损失的扩大。没有采取适当措施致使损失进一步扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。非违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。
第二十二部分 争议的处理和适用的法律	各方当事人同意，因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交管理人所在地有管辖权的人民法院起诉。 《资产管理合同》受中国法律管辖。	各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，基金合同当事人应通过协商途径解决，如经友好协商未能解决的，任何一方均应当将争议提交上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心），按照上海国际经济贸易仲裁委员会（上海国际仲裁中心）届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁地点为上海市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有决定，仲裁费用由败诉方承担。 《基金合同》受中国（为基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区和台湾地区法律）法律管辖。
第二十三部分 基金合同的效力	1、《资产管理合同》经管理人、托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字，并经管理人向中国证监会提交《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》变更为《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》的申请经中国证监会批准后，自管理人公告的生效之日起生效，原《海通月月财集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 4、《资产管理合同》正本一式四份，除上报有关监管机构一式二份外，管理人、托管人各持有一份，每份具有同等的法律效力。	1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签章，并经海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划份额持有人大会表决通过后，自基金管理人公告的生效之日起生效，原《海通安润 90 天滚动持有中短债债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 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。