

关于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相关业务安排的公告

依据《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》《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）等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，上海海通证券资产管理有限公司旗下的海通策略优选混合型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）经中国证监会证监许可〔2025〕1892号文准予变更注册。集合计划以通讯方式召开了份额持有人大会，并于2025年10月16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》。

自本公告日起（即2025年10月29日），“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”（以下简称“本基金”），管理人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（以下简称“本基金管理人”）。

一、集合计划份额持有人大会会议情况

集合计划以通讯方式召开了份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自2025年9月17日起至2025年10月14日17:00止。会议审议了《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》（以下简称“本次会议议案”），并由参与本次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对本次会议议案进行表决。根据《海通策略优选混合型集合资产管理计划份额持有人大会表决结果暨决议生效公告》，本次集合计划份额持有人大会于2025年10月16日表决通过了本次会议议案，本次大会决议自该日起生效。

二、本次变更主要内容

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、邓雅琨”。

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【1.5%】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。”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”。

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，本基金在量化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、资产支持证券投资策略、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 $\times$ 70%+中证港股通综合指数（人民币）收益率 $\times$ 10%+商业银行活期存款利率（税后） $\times$ 20%”变更为“中证全指指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 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、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。

三、其他需要提示的事项

1、自本公告日起（即2025年10月29日），《海通策略优选混合型集合资产管理计划资产管理合同》失效且《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

2、自《国泰海通新锐量化选股混合型证券投资基金基金合同》生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

3、自2025年11月3日起，本基金开放申购、赎回、定期定额投资业务。基金管理人不再另行公告。

4、投资者如对上述事项有任何疑问，可以通过本基金管理人的网站（www.gthtzg.com）或客服电话（95521）了解详情。

风险提示：基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基

金财产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本基金《基金合同》、《招募说明书》及其更新、基金产品资料概要及其更新等信息披露文件，全面认识本基金的风险收益特征，自主判断本基金的投资价值，并应充分考虑自身的风险承受能力，选择适合自己的基金产品。

特此公告。

上海国泰海通证券资产管理有限公司

2025 年 10 月 29 日