

上海海通证券资产管理有限公司

旗下参公集合资产管理计划转换业务规则说明

上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“本公司”）现将参公集合资产管理计划转换业务规则说明如下：

一、适用的集合计划范围

适用于本公司旗下已开通转换业务，并已按照《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》的规定完成规范及合同变更或后续变更注册为公募基金的集合资产管理计划。

二、集合计划转换业务

集合计划转换指集合计划份额持有人按照资产管理合同和管理人届时有效公告规定的条件，申请将其持有管理人管理的、某一集合计划的份额转换为管理人管理的其他集合计划的份额的行为。

转换的两只集合计划必须都是由同一销售机构销售的同一管理人管理的、在同一集合计划注册登记机构处注册登记的集合计划。投资者办理集合计划转换业务时，转出份额需是可用份额，转出方的集合计划必须处于可赎回状态，转入方的集合计划必须处于可申购状态。

一般情况下，同一集合计划的不同集合计划份额之间不可转换，在集合计划资产管理合同、招募说明书中特别约定的情况除外。

三、转换费用及计算公式

1、集合计划转换费用

集合计划转换费用由转出集合计划赎回费及转入集合计划的申购补差费组成，具体收取情况视申购费率和赎回费率的差异情况而定。集合计划转换费用由集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人转换集合计划份额时收取。

在进行集合计划转换时，如涉及的转出集合计划在转换时收取业绩报酬，则计提该笔份额的业绩报酬。本公司旗下集合计划的业绩报酬计算方法和比例详见各集合计划的资产管理合同及招募说明书。同一笔转换业务中包含不同持有时间的集合计划份额，分别按照份额明细计提业绩报酬。

为更好服务投资者，本公司可对投资者申购补差费率进行折扣优惠，转出集合计划的赎回费无优惠。另本公司将不对代销机构申购补差费率设折扣限制，具体申购补差费折扣以销售机构为准。

(1) 赎回费

转出集合计划视同赎回申请，如涉及的转出集合计划有赎回费率，则收取该集合计划的赎回费用。本公司旗下集合计划的赎回费率及相应赎回费用计入集合计划财产的比例详见各集合计划的招募说明书。同一笔转换业务中包含不同持有时间的集合计划份额，分别按照持有时间收取相应的赎回费用。

(2) 申购补差费

转换申购补差费按照转入集合计划与转出集合计划的申购费率的差额收取，当转入集合计划的申购费率高于转出集合计划的申购费率时，应缴纳转入集合计划和转出集合计划的申购费差额，反之则不收取申购补差费。以外扣法计费。本公司旗下集合计划的原申购费率详见各集合计划的招募说明书以及相关公告。

2、转换份额的计算公式及举例：

转出集合计划确认金额=转出集合计划份额×转换申请当日转出集合计划的份额净值

申购补差费=(转出集合计划确认金额-转出集合计划的赎回费)×申购补差费率×折扣率/(1+申购补差费率×折扣率)

(具体转出集合计划的赎回费的计算方法详见各集合计划的招募说明书)

转入确认金额=转出集合计划确认金额-转出集合计划的赎回费-申购补差费-转出集合计划计提的业绩报酬(如有)

转入集合计划份额=(转入确认金额+A)/转换申请当日转入集合计划的集合计划份额净值

其中：

A为转出集合计划份额对应的未支付收益，若转出基金为非货币类集合计划，则A=0。

举例：一投资者将持有的15个月的10,000.00份海通核心优势A类份额转换到海通安裕中短债A类份额，假设转换申请日海通核心优势A类份额和海通安裕中短债A类份额净值分别为1.1000元和1.0500元，该持有期限赎回核心优势

A 类份额对应的赎回费率为 0.2%，申购补差费率为 1.2%，海通核心优势 A 类份额转出产生的业绩报酬为 100 元，则有：

转出核心优势 A 类份额确认金额=10000*1.1000=11000

转出核心优势 A 类份额赎回费=11000*0.2%=22

申购补差费=（11000-22）*1.2%/（1+1.2%）=130.17

业绩报酬=100 元

转入海通安裕中短债 A 类份额确认金额=（11000-22-130.17-100）=10747.83

转入海通安裕中短债 A 类份额确认份额=10747.83/1.05=10236.03

集合计划具体份额以注册登记机构的记录为准。上述集合计划转出金额以四舍五入的方式保留至小数点后两位，由此产生的误差在转出资金的集合计划资产中列支；转入份额以四舍五入的方式保留至小数点后两位，由此产生的误差在转入的集合计划资产中列支。

四、转换业务规则

1、“未知价”原则，即转换价格以申请当日收市后计算的集合计划转出、转入的份额净值为基准进行计算。

2、集合计划转换以份额为单位进行申请，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转换转出。如果转换申请当日，同时有赎回申请的情况下，则遵循先赎回后转换的处理原则。集合计划转换申请转出的集合计划份额必须是可用的份额，转出方的集合计划必须处于可赎回状态，转入方的集合计划必须处于可申购状态；如果涉及转换的集合计划有一方不满足本状态要求，集合计划转换申请处理为失败。

3、转换费用的计算采用单笔计算法。即投资者在 T 日多次转换的，按照分笔计算各笔的转换费用。

4、管理人应以交易时间结束前受理有效转换申请的当天作为转换申请日（T 日），在正常情况下，集合计划登记机构在 T+1 日内对该交易的有效性进行确认。T 日提交的有效申请，投资人可在 T+2 日后（包括该日）到销售网点柜台或以销售机构规定的其他方式查询申请的确认情况。管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。

销售机构对转换申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确

实接收到转换申请。转换的确认以登记机构的确认结果为准。对于转换申请及转换份额的确认情况，投资人应及时查询并妥善行使合法权利。

5、管理人规定单笔转换份额不得低于 100 份。各销售机构可根据各自情况设定单笔最低转换转出份额，除集合计划管理人另有公告外，不得低于集合计划管理人规定的上述最低份额限制。投资者在各销售机构进行投资时应以销售机构的公告为准。若转入集合计划有大额申购限制的，则需遵循相关大额申购限制的约定。

6、当某笔转换业务导致集合计划份额持有人在销售机构（网点）保留的集合计划份额余额小于转出集合计划的《资产管理合同》和《招募说明书》中“最低持有份额”的相关条款规定时，在转换时需一次全部转换。如果转换后剩余份额低于集合计划最低持有份额，则管理人有权将低于最低持有份额部分进行强赎。

7、发生巨额赎回时，集合计划转出与集合计划赎回具有相同的优先级，由集合计划管理人按照资产管理合同规定的处理程序进行受理。

8、集合计划转换后，转入集合计划份额的持有时间将重新计算，即转入集合计划份额的持有期将自转入集合计划份额被确认日起重新开始计算。

五、暂停集合计划转换

集合计划转换视同为转出集合计划的赎回和转入集合计划的申购，因此有关转出集合计划和转入集合计划关于暂停或拒绝申购、暂停赎回的有关规定也一般适用于暂停集合计划转换。具体暂停或恢复集合计划转换的相关业务请详见届时本公司发布的相关公告。

六、业务咨询

如有疑问，投资者可拨打客服电话咨询或登录相关网址进行查询：

上海海通证券资产管理有限公司

客户服务电话：021-23154762

公司网站：<http://www.htsamc.com>

七、重要提示

1、本公告仅对集合计划转换业务的有关事项予以说明。投资者欲了解集合计划的详细情况，可通过本公司网站（<http://www.htsamc.com>）查阅集合计划的资产管理合同、招募说明书（更新）、产品资料概要（更新）等法律文件以及

相关业务公告。

2、本公司管理的集合计划如开通集合计划转换业务，则适用于本公告规则；如根据具体情况不适用于本公告规则，或存在与本公告规则特殊规定的，则以本公司届时公告为准。

3、本公司可以根据市场情况调整集合计划转换业务的具体规则，届时本公司将另行公告。

八、风险提示

1、本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

2、投资需谨慎，敬请投资者注意投资风险。投资者请于投资前应认真阅读集合计划的资产管理合同、招募说明书（更新）、产品资料概要（更新）等法律文件以及相关业务公告，充分认识产品的风险收益特征和产品特性，认真考虑产品存在的各项风险因素，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等因素充分考虑自身的风险承受能力，在了解产品情况、销售机构适当性意见的基础上，理性判断并谨慎做出投资决策。

3、敬请投资者关注适当性管理相关规定，提前做好风险测评，并根据自身的风险承受能力购买风险等级相匹配的产品。

本公告的解释权归上海海通证券资产管理有限公司所有。

特此公告。

上海海通证券资产管理有限公司

2022年3月30日