（上接B29版）

第十三部分 基金的财产	一、集合计划资产总值 集合计划资产总值是指购买的各类证券及票据价值、银行存款本息和集合计划应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和。	一、基金资产总值 基金资产总值是指购买的各类证券、基金份额及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购款以及其他投资所形成的价值总和。
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 (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唯一估值净价或推荐估值净价进行估值； (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全价或推荐估值全价进行估值； (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； 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。 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、全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。 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净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。 管理人于每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。 六、估值错误的处理 本合同的当事人应按照以下约定处理： 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下： (2)错误偏差达到该类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；错误偏差达到该类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。 七、暂停估值的情形 1、集合计划投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时； 八、集合计划份额净值的确认 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，由管理人对各类集合计划净值予以公布。 九、特殊情形的处理 1、管理人或托管人按估值方法的第10项进行估值时，所造成的误差不作为集合计划资产估值错误处理。	二、估值对象 基金所拥有的各类证券、基金份额、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（不含证券投资基金） (2)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； (3)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； (4)对于交易所上市交易的可转换债券，若为末行全价交易的债券，选取估值日收盘价作为估值全价进行估值；若为末行净价交易的债券，选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价进行估值； (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； (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价值。 (7)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、处于未上市期间的有价证券（不含证券投资基金）应区分如下情况处理： (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，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，按照第三方估值基准服务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估值。对银行间市场未上市，且第三方估值基准服务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、对于查投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第二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、本基金投资同业存单，按估值日第三方估值基准服务机构提供的估值全价估值。 8、本基金持有的国债期货合约，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。 11、对于未在交易所上市的证券投资基金的估值 本基金投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的基金份额净值估值。 12、对于在交易所上市的证券投资基金的估值 (1)本基金投资的交易型开放式指数基金(ETF)，按所投资基金估值日的收盘价估值。 (2)本基金投资的境内上市开放式基金(LOF)，按所投资基金估值日的份额净值估值。 (3)本基金投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。 上述LOF基金及11中所述未在交易所上市的证券投资基金，份额净值由管理人以约定的方式发送托管人。管理人应确保净值的准确性，因所投资基金的份额净值不准确导致本基金估值错误的，相关责任由责任方承担。 13、对于证券投资基金特殊情况的估值处理 如遇所投资的证券投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，基金管理人根据以下原则进行估值： (1)以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值。 (2)以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值。 (3)若所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人将根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。 14、基金管理人可以委托中国证券投资基金业协会引入的估值基准服务机构提供估值服务，基金管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。对信用衍生品的估值方法如下：
第十五部分 基金费用与税收	一、集合计划费用的种类 3、销售服务费： 7、集合计划的证券、期货交易费用； 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 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下： H=E×0.6%÷当年天数 H为每日应计提的集合计划管理费 E为前一日的集合计划资产净值 集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第3个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。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 本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下： H=E×0.05%÷当年天数 H为每日应计提的集合计划托管费 E为前一日的集合计划资产净值 集合计划托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第3个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，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 销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初第3个工作日按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，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。 销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及管理人的集合计划行销广告费、促销活动费、集合计划份额持有人服务费等。 4、上述“一、集合计划费用的种类”中第4—11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。 二、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、《海通年年升集合资产管理计划资产管理合同》生效前的相关费用，按当时有效的《海通年年升集合资产管理计划》的约定支付；	一、基金费用的种类 3、C类基金份额的销售服务费； 7、基金的证券、期货、信用衍生品交易费用； 11、基金投资其他基金产生的相关费用（包括但不限于申购费、赎回费等），但法律法规禁止从基金财产中列支的除外； 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 本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提，但本基金投资于基金管理人所管理的其他基金的部分不收取管理费。管理费的计算方法如下： H=E×0.60%÷当年天数 H为每日应计提的基金管理费 E为前一日的基金资产净值（扣除本基金持有的基金管理人自管理的其他基金部分（若为负数，则取0）） 基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。 2、基金托管人的托管费 本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提，但本基金投资于基金托管人所托管的其他公开募集证券投资基金的部分不收取托管费。托管费的计算方法如下： H=E×0.05%÷当年天数 H为每日应计提的基金托管费 E为前一日的基金资产净值（扣除本基金持有的基金托管人自身托管的其他公开募集证券投资基金部分（若为负数，则取0）） 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。 3、销售服务费 销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。 上述“一、基金费用的种类”中第4—12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《海通鑫悦债券型集合资产管理计划资产管理合同》约定执行； 基金管理人运用基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、招募说明书约定应当收取并计入基金财产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用。
第十六部分 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。
第十七部分 基金信息披露	一、本集合计划的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《资产管理合同》及其他有关规定。 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、《资产管理合同》、集合计划托管协议、《产品资料概要》 《海通年年升集合资产管理计划资产管理合同》变更为《海通鑫悦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，并将产品资料概要登载在集合计划销售机构网站或营业网点；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。 (三)集合计划净值信息 在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、集合计划销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。 (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； 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。 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： 2、集合计划投资所涉及的证券/期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；	一、本基金的信息披露应符合《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、《流动性风险管理规定》、《基金合同》及其他有关规定。相关法律法规关于信息披露的规定发生变化时，本基金从其最新规定。 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 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网站上。 (二)基金净值信息 在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。 (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； 23、本基金连续30、40、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； (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。 (十)参与国债期货交易的信息披露 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投资政策和投资目标。 (十二)投资证券投资基金的信息披露 基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露所持有基金以下相关情况： 1、投资政策、持仓情况、损益情况、净值披露时间等； 2、交易及持有基金产生的费用，包括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等； 3、持有的基金发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等； 4、基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方所管理基金的情况； 基金管理人应在定期报告中披露本基金参与基金的基金份额持有人大会的表决意见。 (十三)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。 (十四)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、基金清算报告等公开披露的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： 2、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基金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。 三、集合计划财产的清算 5、集合计划财产清算的期限为6个月，但因本集合计划所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限可相应顺延。 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。 七、集合计划财产清算账册及文件的保存 集合计划财产清算账册及有关文件由托管人保存不低于法律法规规定的最低期限。	一、《基金合同》的变更 1、变更基金合同涉及法律法规规定或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，由基金管理人和托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。 三、基金财产的清算 5、基金财产清算的期限为6个月，但因本基金所持证券的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。 四、清算费用 清算费用是指基金财产清算小组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用，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。 七、基金财产清算账册及文件的保存 基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存，保存期限不低于法律法规规定的最低期限。

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（为本资产管理合同之目的，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区法律）管辖，并按其解释。	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，基金合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决，如经友好协商、调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际仲裁中心，按照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》受中国法律（为基金合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区法律和台湾地区有关规定）管辖，并按其解释。
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《海通年年升集合资产管理计划资产管理合同》变更为《海通鑫悦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《海通年年升集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 2、《资产管理合同》的有效期自其生效之日起至集合计划财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。 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字，并经海通鑫悦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《海通鑫悦债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。 2、《基金合同》的有效期自基金合同生效之日起至基金财产清算结果报中国证监会备案并公告之日止。 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。

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核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划份额持有人大会的第一次提示性公告

上海海通证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）已于2025年9月15日在《证券时报》和管理人网站（www.htsamc.com）发布了《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核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划份额持有人大会的公告》。为了使本次集合计划份额持有人大会顺利召开，现发布《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核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划份额持有人大会的第一次提示性公告》。

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，海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会《关于准予海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2020]535号）准予，由海通新兴成长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《海通核心优势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》”或“资产管理合同”）于2020年4月8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”），集合计划托管人为交通银行股份有限公司（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《海通新兴成长集合资产管理计划合同》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，管理人经与托管人交通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核心优势混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）等有关事项。

本次海通核心优势一年持有期混合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：

由海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划变更为国泰海通核心优势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于志浩”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煜”。

5、运作方式变化：

对新设份额（A类、C类基金份额）不再设置1年锁定持有期，原份额转型后（D类、F类基金份额）保留1年锁定持有期设置。

本基金对每份D类基金份额和F类基金份额均设定1年的锁定持有期。本基金D类基金份额或F类基金份额的锁定持有期为自投资者申购海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划A类份额或C类份额的申购申请日（即锁定持有期起始日）起（含）至该日次年的年度对日的前一日（即锁定持有期到期日）止（含）的期间。在锁定持有期内，每份D类基金份额或F类基金份额不能赎回。每份D类基金份额和F类基金份额自锁定持有期结束后即进入开放持有期，自其开放持有期首日起的开放日可以办理赎回业务。

每份D类基金份额或F类基金份额的开放持有期首日为锁定持有期起始日次年的年度对日，若该年度对日为非工作日或不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日。

基金份额持有人持有原海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划的期限连续计算。

6、存续期限变化：

由“自《海通新兴成长集合资产管理计划合同》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”。

7、份额类别变化：

《国泰海通核心优势混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）生效后，根据申购费用、赎回费用、销售服务费、业绩报酬收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。

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、赎回时根据持有期限收取赎回费用，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。

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，投资人赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额类别。

D类基金份额：指对于投资者依据《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划A类份额，自基金合同生效之日起，投资者持有的上述份额全部自动转换为本基金D类基金份额，D类基金份额只开放赎回，不开放申购业务，红利再投资份额除外。本基金D类基金份额设置一年锁定持有期，在锁定持有期内不办理赎回业务。

E类基金份额：指对于投资者依据原《海通新兴成长集合资产管理计划合同》获得的海通新兴成长集合资产管理计划份额，自《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效之日起已全部自动转换为海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划B类份额，自基金合同生效之日起，投资者持有的上述份额全部自动转换为本基金E类基金份额，E类基金份额不设置锁定持有期，只开放赎回，不开放申购业务，红利再投资份额除外。

F类基金份额：指对于投资者依据《海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》获得的海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划C类份额，自基金合同生效之日起，投资者持有的上述份额全部自动转换为本基金F类基金份额，F类基金份额只开放赎回，不开放申购业务，红利再投资份额除外。本基金F类基金份额设置一年锁定持有期，在锁定持有期内不办理赎回业务。

8、基金的存续的变化：

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个月内召开集合计划份额持有人大会进行表决。……法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

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。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。”

9、投资范围及投资限制变化：

投资范围新增“存托凭证”、删除“中小板”，并调整相应的投资组合比例和投资限制，投资于股票资产（含存托凭证）占基金总资产的比例由“50%-95%”调整为“60%-95%”，同时删除投资限制中“投资于本集合计划界定的核心优势相关证券的比例不低于非现金集合计划资产的80%”以及“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”，此外，所投资于资产支持证券的信用级别评级限制由“AA以上（含AA）”调整为“BBB以上（含BBB）”。

10、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”以及“存托凭证投资策略”、删除“具有核心优势的公司股票的界定标准”。

根据投资策略的调整，相应调整业绩比较基准，由“中证800指数收益率×50%＋中证港股通综合指数收益率×20%+中证全债指数收益率×30%”变更为“中证800指数收益率×65%＋中证港股通综合指数（CNY）收益率×20%+商业银行活期存款利率（税后）×15%”。

11、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。

12、费率结构变化

原份额转型后（D类、E类、F类基金份额）费率结构保持不变，新设份额（A类、C类基金份额）管理费率1.2%、托管费率0.12%、C类基金份额销售服务费率0.4%。

13、争议的处理方式变化

由“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。”

变更为

“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，如经友好协商或者调解未能解决的，任何一方均有权将争议提交上海仲裁委员会，按照该会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。仲裁费用、律师费用由败诉方承担。”

14、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。

具体修订内容请阅附件五：《海通核心优势一年持有期混合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锁定持有期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。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

附件一：

附件二：

海通核心优势一年持有期混合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
《关于海通核心优势一年持有期混合型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通核心优势混合型证券投资基金的议案》			
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