

关于海通鑫悦债券型集合资产管理计划 变更为国泰海通鑫悦债券型 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管理法》《公开募集证券投资基金管理办法》《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鑫悦债券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〕1901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《关于海通鑫悦债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通鑫悦债券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),“海通鑫悦债券型集合资产管理计划”变更为“国泰海通鑫悦债券型证券投资基金”(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《关于海通鑫悦债券型集合资产管理计划更换管理人并变更为国泰海通鑫悦债券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《海通鑫悦债券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:

由海通鑫悦债券型集合资产管理计划变更为国泰海通鑫悦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. 存续期限变化:

由“自《海通年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至2025年12月31日。”变更为“不定期”。

5. 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”。

6. 费率变化:

投资者在赎回A类基金份额时,去除持有期限大于等于7日且小于30日,持有期限大于等于30日且小于90日,持有期限大于等于90日的基金份额适用的赎回费率,增加持有期限大于等于7日的基金份额适用的赎回费率为【0%】。

7. 投资范围及投资限制变化:

投资范围增加“信用衍生品”和“经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(不包括QDII基金、香港互认基金、基金中基金,其他可投资公募基金的基金、货币市场基金、非本基金管理人管理的基金(股票型ETF除外))”,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“本集合计划应投资于信用级别评级为BBB(含)以上的资产支持证券。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乎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”。

8. 投资策略及业绩比较基准变化:

根据投资范围,补充“基金投资策略、信用衍生品投资策略”。同时,《国泰海通鑫悦债券型证券投资基金基金合同》生效后,本基金将密切关注债券市场的运行状况与风险收益特征,分析宏观经济运行状况和金融市场运行趋势,自上而下决定类属资产配置及组合久期,并依据内部信用评级系统,深入挖掘价值被低估的标的券种。本基金采取的投资策略主要包括类属资产配置策略、利率策略、信用策略等。在谨慎投资的基础上,力争实现组合的稳健增值,并调整资产配置策略、信用债投资策略,可转债投资策略、国债期货投资策略。

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-综合全价(总值)指数收益率×80%+中证可转换债券指数*10%+沪深300指数收益率×5%+银行活期存款利率(税后)×5%”变更为“中债-综合全价(总值)指数收益率*80%+中证可转换债券指数收益率*5%+中证800指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*5%”。

9. 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。

10. 公开披露的基金信息变化

根据投资范围及投资策略的调整,在公开披露的基金信息增加“投资证券投资基金的信息披露”、“投资信用衍生品的信息披露”、“清算报告”。

11. 纠议的处理变化:

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、调解未能解决的,由“提交人民法院起诉”修改为“由上海国际仲裁中心进行仲裁”。

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),《海通鑫悦债券型集合资产管理计划资产管理合同》失效且《国泰海通鑫悦债券型证券投资基金基金合同》同时生效。

2. 自《国泰海通鑫悦债券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于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