(上接D5版)

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,包括债券(含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持机构债券、地方政府债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、国债期货,以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种,集合计划管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 三、投资策略 (一)债权类资产投资策略 本集合计划在债权类资产上主要通过久期配置策略、类属配置策略、杠杆策略等层面进行投资组合管理。 2、类属配置策略 本集合计划将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化,以及信用债券的信用风险等因素进行分析,根据各债券类属的风险收益特征,对债券类属资产进行优化配置和调整,确定债券类属资产的最优权重。 本集合计划进行信用债投资时,所投资的信用债的信用评级范围和相应比例如下: 本集合计划主动投资信用债的债项信用评级范围为AA及以上,其中债项评级AA信用债的投资比例不超过集合计划信用债资产的20%,债项评级AA+信用债的投资比例不超过集合计划信用债资产的50%,债项评级AAA信用债的投资比例不低于集合计划信用债资产的50%。 短期融资券以及无债项评级的信用债以主体评级为准,相关评级不参考中债资信评估有限责任公司的评级。若在持有期间,本集合计划已投资的信用债的信用评级下降等原因,导致出现不符合上述信用评级范围和相应比例的情形,不视为违反资产管理合同上述关于信用评级范围和相应比例的约定。本集合计划开展逆回购交易的,可接受的信用债质押品的信用评级要求与上述约定一致。 (三)资产支持证券投资策略 本集合计划投资资产支持证券以一级市场申购为主,二级市场交易为辅。通过对标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析,根据估值模型对ABS产品进行更为精准的定价,在保障投资本金的前提下尽可能的增厚本集合计划的收益。 四、投资限制 (一)组合限制 本集合计划的投资组合将遵循以下比例限制: (4)本集合计划管理人管理的全部大集合计划持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%; (8)本集合计划管理人管理的全部大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。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; (11)本集合计划管理人管理的全部开放式大集合计划(包含开放式大集合计划以及处于开放期的采取定期开放方式运作的大集合计划)持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%; 除上述第(2)、(9)、(13)、(14)项情形之外,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集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的,集合计划管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的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。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。 五、业绩比较基准 本集合计划的业绩比较基准为:中债综合财富(1-3年)指数收益率*80%+一年期定期存款利率*20% 本集合计划选择上述业绩比较基准的原因: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短期信用债债券市场价格和投资回报情况,且该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。本集合计划的业绩比较基准适合用于衡量比较本集合计划的业绩表现。 七、集合计划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 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。	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,包括债券(含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、政府支持机构债券、地方政府债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、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,但须符合中国证监会的相关规定。 如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,基金管理人在依法履行适当程序后,可对本基金的投资比例做相应调整。 三、投资策略 (一)债券类资产投资策略 本基金在债券类资产上主要通过久期配置策略、类属配置策略、杠杆策略等层面进行投资组合管理。 2、类属配置策略 本基金将对宏观经济周期、市场利率走势、资金供求变化,以及信用债券的信用风险等因素进行分析,根据各债券类属的风险收益特征,对债券类属资产进行优化配置和调整,确定债券类属资产的最优权重。 本基金一般情况下投资信用债资产(含信用债和资产支持证券)的外部信用评级不低于AA级(含),其中投资于评级在AAA级及以上的信用资产比例不低于信用债资产的50%,投资于评级在AA+级的信用资产比例不高于信用资产的50%,投资于评级在AA级的信用资产比例不高于信用资产的20%。以上信用评级为债项评级,若无债项评级的依照其主体评级。其中短期融资券、超短期融资券的信用评级参照评级机构出具的主体信用评级。信用评级主要参考经中国证监会许可或备案的资信评级机构的评级结果,其具体评级机构名单以基金管理人确认为准。因资信评级机构调整评级等基金管理人之外的因素致使本基金投资信用资产比例不符合上述约定投资比例的,基金管理人应当在该信用资产可交易之日起3个月内调整至符合上述约定的投资比例,中国证监会规定的特殊情形除外。 (四)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需求,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、期限以及信用风险敞口等。 四、投资限制 (一)组合限制 本基金的投资组合将遵循以下比例限制: (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%; (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%; (10)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%; (15)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不符合上述规定投资比例的,基金管理人应在3个月内进行调整。 除上述第(2)、(12)、(13)、(15)项情形之外,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,基金管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的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。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。 五、业绩比较基准 本基金的业绩比较基准为:中债综合(全价)指数收益率*80%+一年期定期存款利率*20% 本基金选择上述业绩比较基准的原因:中债综合(全价)指数由中债金融估值中心有限公司编制,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,适合作为本基金的业绩比较基准。 七、基金管理人代表基金行使股东或债权人权利的处理原则及方法 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代表或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。
第十四部分 基金资产估值	二、估值对象 集合计划所拥有的股票、衍生工具、债券、资产支持证券、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,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,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,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,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; 2、处于未上市期间的有价证券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,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。 4、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。 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,集合计划资产净值除以当日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。集合计划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。 八、集合计划净值的确认 用于集合计划信息披露的集合计划净值信息由集合计划管理人负责计算,集合计划托管人负责进行复核。集合计划管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给集合计划托管人。集合计划托管人对净值计算结果复核确认后发送给集合计划管理人,由集合计划管理人对集合计划净值依据资产管理合同和相关法律法规的规定予以公布。 九、特殊情况的处理 1、集合计划管理人或集合计划托管人按"四、估值方法"的第6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。 十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值 本集合计划实施侧袋机制的,应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的集合计划资产净值和份额净值,暂停披露侧袋账户份额净值。	二、估值对象 基金所拥有的股票、金融衍生工具、债券、资产支持证券、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,选取估值日第三方估值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)交易所上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券,实行全价估值的债券以估值日收盘价作为估值全价;实行净价交易的债券以估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。 2、处于未上市期间的有价证券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; 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。对于银行间市场未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种,采用估值技术确定其公允价值。 4、对于含投资人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采用第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价。回售登记截止日(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。 5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的,按证券所处的市场分别估值。 7、存款的估值方法 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示,按协议或合同利率逐日确认利息收入。 8、信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值,但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,依照有关法律法规及企业会计准则要求采用合理估值技术确定公允价值。 9、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。 10、上述第三方估值机构提供的估值全价指第三方估值机构直接提供的估值全价或第三方估值机构提供的估值净价加每百元应计利息。 13、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。 14、税收按照相关法律法规、监管机构等的规定以及行业惯例进行处理。 五、估值程序 1、基金份额净值是按照每个工作日闭市后,基金资产净值除以当日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,由此产生的误差计入基金财产。基金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。 八、基金净值的确认 基金净值信息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工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和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,由基金管理人对基金净值依据基金合同和相关法律法规的规定予以公布。 九、特殊情况的处理 1、基金管理人或基金托管人按"四、估值方法"的第11项进行估值时,所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。 十、实施侧袋机制期间的基金资产估值 本基金实施侧袋机制的,应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的基金净值信息,暂停披露侧袋账户份额净值。
第十五部分 基金费用与税收	一、集合计划费用的种类 6、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、集合计划管理人的管理费 本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.7%÷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算,逐日累计至每月月底,按月支付,由托管人根据管理人的指令并进行复核后,于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。 2、集合计划托管人的托管费 集合计划托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由托管人根据管理人的指令并进行复核后,于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。 五、集合计划税收 本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。集合计划财产投资的相关税收,由集合计划持有人承担,集合计划管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。 本集合计划支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格,具体税率适用中国税务主管机关的规定。	一、基金费用的种类 6、基金的证券、期货、信用衍生品交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、相关账户费用及其他类似性质的费用等); 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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=E×0.3%÷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 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的指令并进行复核后,于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。 2、基金托管人的托管费 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人根据基金管理人的指令并进行复核后,于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。 四、《基金合同》生效前的相关费用按照《中信证券信盈一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》相关标准执行。 六、基金税收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。
第十六部分 基金的收益与分配	三、收益分配原则 在不影响投资者利益的情况下,集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则,此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会,但应于变更实施日前在规定媒介和集合计划管理人网站公告。	三、基金收益分配原则 5、红利再投资所形成的基金份额最短持有期限同享受该红利的对应基金份额最短持有期限。 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下,基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则,此项调整不需要召开基金份额持有人大会,但应于变更实施日前在规定媒介公告。
第十七部分 基金的会计与审计	一、集合计划会计政策 7、集合计划托管人每月与集合计划管理人就集合计划的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。 二、集合计划的年度审计 1、集合计划管理人聘请与集合计划管理人、集合计划托管人相互独立的符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。	一、基金会计政策 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面或电子方式确认。 二、基金的年度审计 1、基金管理人聘请与基金管理人、基金托管人相互独立的符合《证券法》规定的会计师事务所及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。
第十八部分 基金的信息披露	二、信息披露义务人 本集合计划信息披露义务人包括集合计划管理人、集合计划托管人、召集集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人及其日常机构(如有)等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。 本集合计划信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的集合计划信息通过符合中国证监会规定条件的全国性报刊(以下简称"规定报刊")和《信息披露办法》规定的互联网网站(以下简称"规定网站",包括集合计划管理人网站、集合计划托管人网站、中国证监会基金电子披露网站)等媒介披露,并保证集合计划投资者能够按照《资产管理合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。 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、集合计划产品资料概要、《资产管理合同》、集合计划托管协议 3、集合计划产品资料概要是集合计划招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的集合计划概要信息。集合计划管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新集合计划产品资料概要。 资产管理合同生效后,集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要的信息发生重大变更的,集合计划管理人应当在三个工作日内,更新集合计划招募说明书和集合计划产品资料概要,并登载在规定网站上,其中集合计划产品资料概要还应当登载在集合计划销售机构网站或营业网点;集合计划招募说明书、集合计划产品资料概要其他信息发生变更的,集合计划管理人至少每年更新一次。 资产管理合同终止的,除资产管理合同另有约定外,集合计划管理人可以不再更新集合计划招募说明书和集合计划产品资料概要。 关于集合计划产品资料概要编制、披露与更新的要求,自中国证监会规定之日起开始执行。 (四)集合计划定期报告,包括集合计划年度报告、集合计划中期报告和集合计划季度报告(含资产组合季度报告) 集合计划管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成集合计划年度报告,将年度报告登载于规定网站上,并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。 如报告期内出现单一投资者持有集合计划份额达到或超过集合计划总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,集合计划管理人至少应当在定期报告"影响投资者决策的其他重要信息"项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本集合计划的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。 (五)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: 3、延长《资产管理合同》期限; 4、转换集合计划运作方式、集合计划合并; 5、更换集合计划管理人、集合计划托管人; 8、集合计划管理人变更持有百分之五以上股权的股东、变更公司的实际控制人; 12、涉及大集合计划管理业务、大集合计划财产、大集合计划托管业务的重大诉讼或仲裁; 13、集合计划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,集合计划托管人或其专门基金托管部门负责人因集合计划托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚; (六)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资产净值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。 六、信息披露事务管理 集合计划托管人应当按照相关法律、行政法规、中国证监会的规定和《资产管理合同》的约定,对集合计划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、集合计划产品资料概要、集合计划清算报告等公开披露的相关集合计划信息进行复核、审查,并向集合计划管理人进行书面或电子确认。 七、信息披露文件的存放与查阅 依法必须披露的信息发布后,集合计划管理人、集合计划托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于公司住所,以供社会公众查阅、复制。 八、暂停或延迟集合计划净值信息披露的情形 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; 2、因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、集合计划托管人无法准确评估集合计划资产价值时; 3、《资产管理合同》约定的暂停估值的情形;	二、信息披露义务人 本基金信息披露义务人包括基金管理人、基金托管人、召集基金份额持有人大会的基金份额持有人等法律法规和中国证监会规定的自然人、法人和非法人组织。 本基金信息披露义务人应当在中国证监会规定时间内,将应予披露的基金信息通过中国证监会规定媒介披露,并保证基金投资者能够按照《基金合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。 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、基金产品资料概要、《基金合同》、基金托管协议 3、基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件,用于向投资者提供简明的基金概要信息。基金管理人应当依照法律法规和中国证监会的规定编制、披露与更新基金产品资料概要。 基金合同生效后,基金招募说明书、基金产品资料概要的信息发生重大变更的,基金管理人应当在三个工作日内,更新基金招募说明书和基金产品资料概要,并登载在规定网站上;基金招募说明书、基金产品资料概要其他信息发生变更的,基金管理人至少每年更新一次。 基金合同终止运作的,除基金合同另有约定外,基金管理人可以不再更新基金招募说明书和基金产品资料概要。 (四)基金定期报告,包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告(含资产组合季度报告) 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告登载于规定网站上,并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《证券法》规定的会计师事务所审计。 如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额20%的情形,为保障其他投资者的权益,基金管理人至少应当在定期报告"影响投资者决策的其他重要信息"项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特有风险,中国证监会认定的特殊情形除外。 (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: 3、转换基金运作方式、基金合并; 4、更换基金管理人、基金托管人; 7、基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更; 11、涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼或仲裁; 12、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; (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)投资信用衍生品的信息披露 基金管理人应当在基金季度报告、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。 六、信息披露事务管理 基金托管人应当按照相关法律、行政法规、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、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。 七、信息披露文件的存放与查阅 依法必须披露的信息发布后,基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所,以供社会公众查阅、复制。 八、暂停或延迟基金净值信息披露的情形 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: 1、不可抗力; 2、基金投资所涉及的证券、期货交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时; 3、发生暂停估值的情形; 九、法律法规或监管部门对信息披露另有规定的,从其规定。
第十九部分 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资产管理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,由集合计划管理人和集合计划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 2、集合计划财产清算小组组成:集合计划财产清算小组成员由集合计划管理人、集合计划托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。 六、集合计划财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告;集合计划财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告。 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集合计划托管人保存至少20年,法律法规另有规定的从其规定。	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。 三、基金财产的清算 2、基金财产清算小组组成:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、符合《证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。 六、基金财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告;基金财产清算报告经符合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后由基金财产清算小组进行公告。 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不少于法律法规规定的最低期限。
第二十一部分 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,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定,仲裁费用由败诉方承担。	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,如经友好协商未能解决的,任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则按普通程序进行仲裁,仲裁地点为北京市,按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的,对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定,仲裁费用由败诉方承担。
第二十二部分 基金合同的效力	1、《资产管理合同》经集合计划管理人、集合计划托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字(或盖章)并自集合计划管理人公告的生效之日起生效。 4、《资产管理合同》正本一式六份,除上报有关监管机构二份外,集合计划管理人、集合计划托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。	1、本《基金合同》由《中信证券信盈一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》变更注册而来。《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(或盖章),并经中国证监会办理变更注册手续获得中国证监会书面确认。经202X年XX月XX日中信证券信盈一年持有期债券型集合资产管理计划的份额持有人大会决议通过,并自202X年XX月*日起《基金合同》生效,原《中信证券信盈一年持有期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》正本一式五份,除上报有关监管机构一份外,基金管理人、基金托管人各持有二份,每份具有同等的法律效力。

中信证券资产管理有限公司 关于以通讯方式召开中信证券量化优选股票型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会的公告

一、会议基本情况

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》(证监会公告〔2018〕39号,以下简称"《操作指引》")的规定,中信证券量化优选股票型集合资产管理计划(以下简称"本集合计划")经中国证监会2020年5月6日《关于准予中信证券套利宝1号集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函【2020】994号)准予,由中信证券套利宝1号集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》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《中信证券量化优选股票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》")于2020年5月22日生效。

本集合计划管理人为中信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"),集合计划托管人为中信银行股份有限公司(以下简称"集合计划托管人"或"托管人")。根据《操作指引》及《资产管理合同》对本集合计划存续期限的约定,本集合计划将于2025年6月30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《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,管理人经与托管人中信银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开集合计划份额持有人大会,审议本集合计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票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5月15日起至2025年6月20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、纸质表决票的寄达地点

收件人:中信证券资产管理有限公司客户服务中心

地址:浙江省杭州市滨江区东信大道66号东方通信城D座3层

邮政编码:310000

联系人:邱宏学

联系电话:0571-86078183

请在信封背面注明:"中信证券量化优选股票型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会表决专用"。

5、短信授权的提交(仅适用于个人投资者)

短信授权按本公告规定的方式回复至集合计划管理人指定的短信平台。

6、网络授权的提交(仅适用于个人投资者)

网络授权按本公告规定的方式回复至集合计划管理人指定的网络平台。

二、会议审议事项

《关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的议案》(以下简称"议案")(见附件一)。

上述议案的内容说明见《关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的说明》(见附件二)。

三、权益登记日

本次会议的权益登记日为2025年5月12日,即该日在登记机构登记在册的本集合计划全体集合计划份额持有人享有本次会议的表决权。

四、投票方式

1、本次会议表决票见附件三。集合计划份额持有人可通过剪报、复印或登录集合计划管理人网站(www.citicsam.com)下载并打印等方式填制表决票。

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)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单位公章或经有效授权书等形式授权的业务公章(以下合称"公章"),并提供加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等);合格境外机构投资者自行投票的,需在表决票上加盖本单位公章(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(指本人使用的有效身份证、护照或其他能够表明其身份的有效证件或证明)的复印件,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,以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件;

(3)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,代理人应提供由个人投资者填妥并签署的授权委托书原件(详见附件四),并提供个人投资者的有效身份证件(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)正反面复印件。如代理人为个人,还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件;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事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等);

(4)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,代理人应提供由机构投资者填妥的授权委托书原件(详见附件四)并在授权委托书上加盖该机构公章,并提供该机构投资者加盖公章的营业执照复印件(事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等)。如代理人为个人,还需提供代理人的有效身份证件(指本人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)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事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等);

(5)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,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(详见附件四),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。如代理人为个人,还需提供代理人的有效身份证件(指本人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)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事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等);

(6)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文件,以集合计划管理人的认可为准。

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相关文件自2025年5月15日起,至2025年6月20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)通过专人送交、邮寄送达至下述收件人:

收件人:中信证券资产管理有限公司客户服务中心

地址:浙江省杭州市滨江区东信大道66号东方通信城D座3层

邮政编码:310000

联系人:邱宏学

联系电话:0571-86078183

请在信封背面注明:"中信证券量化优选股票型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会表决专用"。

4、短信授权(仅适用于个人投资者)

为方便集合计划份额持有人参与会议,集合计划管理人提供指定短信平台供份额持有人进行授权。集合计划管理人和本集合计划部分销售机构可通过指定短信平台向预留手机号码的个人投资者发送征集授权短信,持有人可根据征集授权短信的要求回复短信表明授权意见,回复时间自2025年5月15日起,至2025年6月20日17:00止(以集合计划管理人指定系统记录的短信接收时间为准)。

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

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或授权。如因电信运营商等不可抗力或非管理人人为原因导致持有人无法获取短信进行授权,管理人不承担责任,请投资者采用纸质方式进行投票或选择管理人认可的其他方式进行授权。

通过短信方式进行授权的,应当按照管理人的要求进行反馈,反馈的内容不符合要求的视为弃权票。

5、网络授权(仅适用于个人投资者)

为方便集合计划份额持有人参与会议,自2025年5月15日起,至2025年6月20日17:00止(以集合计划管理人指定系统记录时间为准),管理人和本集合计划部分销售机构会设立网络授权专区供个人投资者进行授权,由管理人或销售机构根据授权人的表决意见代为行使表决权。通过网络授权专区进行授权的集合计划份额持有人,应使用姓名、有效身份证件号等信息进行验证,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的权益。网络授权专区的访问方式为:(1)移动端:https://m.citicsam.com/holdmeet/ ;(2)PC端:https://m.citicsam.com/holdmeetweb/ 。

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

通过网络方式进行授权的,应当按照管理人的要求进行反馈,反馈的内容不符合要求的视为弃权票。

6、授权的确定原则

(1)直接表决优先规则

如果集合计划份额持有人进行了授权委托,又存在直接投票表决,则以直接表决为有效表决,授权委托无效。

(2)最后授权优先规则

如果同一集合计划份额持有人在不同时间多次进行有效授权,无论表决意见是否相同,均以最后一次授权为准。如最后时间收到的授权委托有多次,不能确定最后一次授权的,按以下原则处理:若多次授权的表决意见一致的,按照该表决意见计票;若多次授权但授权意见不一致的,视为委托人授权受托人投弃权票。

7、上述授权有效期自授权之日起至本次集合计划份额持有人大会会议结束之日止。但是,若本集合计划重新召集审议相同议案的集合计划份额持有人大会的,除非授权文件另有载明,否则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做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做出授权,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。

五、计票

1、本次通讯会议的计票方式为:由本集合计划管理人授权的两名监督员在托管人(中信银行股份有限公司)授权代表的监督下在表决截止日期后2个工作日内进行计票,并由公证机关对其计票过程予以公证。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。

2、集合计划A类和C类计划份额的每一集合计划份额拥有平等的投票权,集合计划份额持有人所持每份集合计划份额享有一票表决权。

3、表决票效力的认定如下:

(1)表决票通过专人送交、邮寄送达本公告规定的收件人的,表决时间以本公告列明的表决票收件人收到表决票的时间为准。表决时间在2025年5月15日前及2025年6月20日17:00时以后的,为无效表决。

(2)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本公告指定联系地址的,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)如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认,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。投资者不能修改表决票的内容(包括但不限于:通过增加任何文字对表决意见进行限制或增加前提),否则均视为"弃权"。

(4)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本公告规定的收件人的,均为无效表决票;无效表决票不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。

(5)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:全体有效的参与表决的(含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)。

本会议表决的票数要求为:本次议案按特别决议处理,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三分之二以上(含三分之二)通过方为有效。

集合计划份额持有人大会的决议,自表决通过之日起生效。集合计划份额持有人大会决定的事项,集合计划管理人应当自决定作出之日起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。

七、重新召集集合计划份额持有人大会及重新授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》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全体有效的参与表决(含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)方可举行。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,本集合计划管理人可在规定时间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有代表三分之一以上(含三分之一)集合计划份额的持有人参加(含本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见),方可召开。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,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:中信证券资产管理有限公司

联系地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦16层

联系电话:95548-5

联系人:统一客户联络中心

网址:www.citicsam.com

2、托管人:中信银行股份有限公司

3、公证机构:北京市方圆公证处

联系地址:北京市东城区东水井胡同5号北京inn大厦北京市方圆公证523

联系电话:13671278926

联系人:叶欢江

4、见证律师事务所: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6月20日17:00)前送达。

2、本次集合计划份额持有人大会有关公告可通过集合计划管理人网站查阅,投资者如有任何疑问,可致电集合计划管理人客户服务电话95548转5咨询。

集合计划管理人将在发布本公告后,在2个工作日内连续公布相关提示性公告,就持有人大会相关情况做必要说明,请予以留意。

3、若《资产管理合同》有效期限内管理人获得中国证监会批复的公募基金管理人资格或在符合监管要求的前提下《资产管理合同》可以继续延长期限,即使本次持有人大会表决通过,中信证券资产管理有限公司仍有权不进行上述变更管理人和变更注册事项。

4、本公告的有关内容由中信证券资产管理有限公司负责解释。

中信证券资产管理有限公司

2025年5月12日

附件一:《关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的议案》

附件二:《关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的说明》

附件三:《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会表决票》

附件四:《授权委托书》

附件五:《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后对照表

附件一:

关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的议案

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划集合计划份额持有人:

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划(以下简称"本集合计划")是中信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")管理的一只股票型集合资产管理计划,于2020年5月22日完成公募化改造,托管人为中信银行股份有限公司。

为充分保护集合计划份额持有人利益,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》、《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》等法律法规规定和《中信证券量化优选股票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》")的有关约定,管理人经与托管人中信银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开中信证券量化优选股票型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会,提议按照《关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的说明》(详见附件二)的方案对本集合计划进行管理人变更和变更注册,同时对《资产管理合同》的相关条款进行修改。若《资产管理合同》有效期限内管理人获得中国证监会批复的公募基金管理人资格或在符合监管要求的前提下《资产管理合同》可以继续延长期限,则中信证券资产管理有限公司仍有权不进行上述变更管理人和变更注册事项。

同时,为保证顺利实施本集合计划的变更注册方案,本次持有人大会议案通过后,集合计划管理人可视情况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华夏基金管理有限公司(以下简称"华夏基金")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华夏基金公告为准,请投资者注意登录华夏基金网站(www.chinaamc.com)查看。

本次集合计划份额持有人大会决议生效后,管理人将在正式变更前安排不少于5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、转出等),赎回选择期内赎回或转出不收取赎回费。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,为实施产品变更管理人等变更注册方案,同意授权管理人办理本集合计划变更注册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。

集合计划管理人:中信证券资产管理有限公司

附件二:

关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的说明

一、重要提示

(一)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》(证监会公告〔2018〕39号,以下简称"《操作指引》")的规定,中信证券量化优选股票型集合资产管理计划(以下简称"本集合计划")经中国证监会2020年5月6日《关于准予中信证券套利宝1号集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函【2020】994号)准予,由中信证券套利宝1号集合资产管理计划参照《中华人民共和国证券投资基金法》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《中信证券量化优选股票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》")于2020年5月22日生效。

本集合计划管理人为中信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"),集合计划托管人为中信银行股份有限公司。根据《操作指引》及《资产管理合同》对本集合计划存续期限的约定,本集合计划将于2025年6月30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《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,管理人经与托管人中信银行股份有限公司协商一致,决定以通讯方式召开集合计划份额持有人大会,审议集合计划管理人由中信证券资产管理有限公司变更为华夏基金管理有限公司(以下简称"华夏基金"),中信证券量化优选股票型集合资产管理计划相应变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的议案。若《资产管理合同》有效期限内管理人获得中国证监会批复的公募基金管理人资格或在符合监管要求的前提下《资产管理合同》可以继续延长期限,则中信证券资产管理有限公司有权不进行上述变更管理人和变更注册事项。

(二)本次中信证券量化优选股票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。

(三)本次议案需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。

(四)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,并需在通过之日起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。

二、本次变更涉及的《资产管理合同》等法律文件修改要点

(一)变更产品名称

由"中信证券量化优选股票型集合资产管理计划"变更为"华夏量化选股股票型证券投资基金"。

(二)变更产品管理人

由"中信证券资产管理有限公司"变更为"华夏基金管理有限公司"。

(三)变更产品投资经理

由"中信证券资产管理有限公司旗下投资经理魏孛"变更为"华夏基金旗下基金经理金安达"。

(四)变更产品类型

由"股票型集合资产管理计划"变更为"股票型证券投资基金"。

(五)变更产品存续期限

由"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6月30日"变更为"不定期"。

(六)调整产品费率结构

将原A类计划份额持有期大于等于180日但小于365日的集合计划份额的赎回费取消;将原C类计划份额的销售服务费年费率由"0.8%"调整至"0.6%"。

(七)调整投资范围及投资限制

投资范围新增"存托凭证、股票期权、港股通标的股票",明确基金可参与融资业务,明确港股通标的股票投资占股票资产的比例,并增加相应的投资限制。

(八)调整投资策略

对应新增的投资品种,补充"存托凭证投资策略、港股通标的股票投资策略、股票期权投资策略"。

(九)调整估值方法

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,并补充新增投资品种的估值方法。

最后,根据最新的法律法规的修订情况,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:《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后对照表。

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,管理人将在正式变更前安排不少于5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、转出等),赎回选择期内赎回或转出不收取赎回费。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、《华夏量化选股股票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,《华夏量化选股股票型证券投资基金基金合同》的生效时间届时将由华夏基金另行发布相关公告。

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华夏量化选股股票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注册的相关交接手续。华夏基金将另行发布相关公告。

四、变更方案可行性

(一)法律依据

《中华人民共和国证券投资基金法》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,不存在法律层面上的障碍。

(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,将由基金管理人华夏基金通过官网等形式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注册的有关事项进行了充分沟通和细致准备,技术可行。因此,本次变更注册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未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的风险

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《资产管理合同》的规定,集合计划份额持有人大会应当满足由权益登记日代表集合计划总份额的二分之一以上(含二分之一)集合计划份额的持有人参加的召集成功条件,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份额的流动性风险

为应对可能引发的大规模集中赎回,本集合计划会尽可能提前做好流动性安排,保持投资组合的流动性以应对可能的赎回,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。

附件三:

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

集合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:

份额持有人证件号码(有效身份证件号/统一社会信用代码号等):

基金账号(选填):

代理人姓名/名称:

代理人证件号码(有效身份证件号/统一社会信用代码号等):

表决事项:《关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的议案》

表决结果:同意□　　反对□　　弃权□

集合计划份额持有人(代理人)签字(盖章)

日期:

说明:

1、请就表决内容表示"同意"、"反对"或"弃权",并在相应"□"内画"√",同一议案只能表示一项意见。

2、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认,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。

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本公告规定的收件人的,均为无效表决票;无效表决票不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。

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,否则上述表决票中的有效表决意见继续有效。

3、"份额持有人有效身份证件"指份额持有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。

4、"基金账号"仅指持有本集合计划份额的基金账号,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,应当准确填写基金账号;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集合计划份额。

5、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件四:

授权委托书

兹全权委托　　　　代表本人(或本机构)参加投票截止日为2025年6月20日17:00的以通讯方式召开的中信证券量化优选股票型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会,并代为行使表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。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,除授权方式发生变化或本人(或本机构)重新作出授权外,本授权继续有效。

委托人签字/盖章:

委托人有效身份证件号或统一社会信用代码号等:

基金账号(选填):

受托人(或代理人)签字/盖章:

受托人(或代理人)有效身份证件号或统一社会信用代码号等:

委托日期:　年　月　日

说明:

1、本授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制,在填写完整并签字盖章后均为有效。

2、"委托人有效身份证件"指委托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。

3、"基金账号",仅指持有本集合计划份额的基金账号,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授权的,应当准确填写基金账号;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集合计划份额。

附件五:

《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》

修改前后对照表

章节	《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》条款	《华夏量化选股股票型证券投资基金基金合同》条款
管理人	中信证券资产管理有限公司	华夏基金管理有限公司
全文	中信证券量化优选股票型集合资产管理计划	华夏量化选股股票型证券投资基金
全文	集合计划、计划	基金、本基金
全文	管理人、集合计划管理人	基金管理人
全文	托管人、集合计划托管人	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	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	集合计划产品资料概要	基金产品资料概要
全文	指定媒介、指定网站、指定报刊	规定媒介、规定网站、规定报刊
第一部分 前言	一、订立本资产管理合同的目的、依据和原则 2、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国合同法》(以下简称"《合同法》")、《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》")、《证券投资基金销售管理办法》(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》")、《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》和其他有关法律法规。 三、中信证券量化优选股票型集合资产管理计划由集合计划管理人依照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定变更,并经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")备案。 中国证监会对本集合计划的备案,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。 投资者应当认真阅读集合计划招募说明书、资产管理合同、集合计划产品资料概要等信息披露文件,自主判断集合计划的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。 关于集合计划产品资料概要编制、披露与更新的要求,自中国证监会规定之日起开始执行。	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法》(以下简称"《证券法》")、《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、华夏量化选股股票型证券投资基金(以下简称"本基金")由中信证券量化优选股票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。中信证券量化优选股票型集合资产管理计划由中信证券套利宝1号集合资产管理计划(以下简称"原集合计划")变更而来,原集合计划由中信证券股份有限公司(以下简称"中信证券")依法募集,并经中国证监会核准设立。根据中信证券2023年11月1日发布的公告《关于中信证券股份有限公司的资产管理计划变更管理人的公告》,中信证券根据监管要求及相应资产管理合同的有关约定,将原中信证券管理的19只集合资产管理计划的管理人变更为中信证券资产管理有限公司。 中国证监会对原集合计划变更为中信证券量化优选股票型集合资产管理计划的批准、中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更为本基金的变更注册,并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。 投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。投资者应当认真阅读并完全理解基金合同第二十部分规定的免责条款、第二十一部分规定的争议处理方式。 六、本基金资产投资于港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称"港股通标的股票"),会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票,基金资产并非必然投资港股通标的股票。

(下转D7版)