（上接D48版）

第八部分 基金份额持有人大会	一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开集合计划份额持有人大会，法律法规、中国证监会或《资产管理合同》另有规定的除外： （1）终止《资产管理合同》（因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外）； （2）更换集合计划管理人（集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司除外）； （5）调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准； 2、在法律法规规定和《资产管理合同》约定的范围内且对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由集合计划管理人和集合计划托管人协商一致后修改，不需召开集合计划份额持有人大会： （2）调整本集合计划的申购费率、变更收费方式、增加、减少或调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整； （3）因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》、招募说明书进行修改； （5）调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管等业务的规则； （7）集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司； 四、集合计划份额持有人出席会议的方式 集合计划份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会或法律法规和监管机关允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。 2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人将其对表决事项的投票以召集人通知的非现场方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。 在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效： （1）会议召集人按《资产管理合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告，法律法规及监管机构另有规定的除外； 八、生效与公告 集合计划份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告集合计划份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。 九、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定 侧袋机制实施期间，集合计划份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的集合计划份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权；表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。	一、召开事由 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会，法律法规、中国证监会或《基金合同》另有规定的除外： （1）终止《基金合同》； （2）更换基金管理人； （5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准； 2、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商一致后修改，不需召开基金份额持有人大会： （2）调整本基金的申购费率、调低基金的赎回费率或变更收费方式，增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整； （3）因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改； （5）调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、转托管、收益分配等业务的规则； 四、基金份额持有人出席会议的方式 基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会或法律法规和监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。 2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或会议通知约定的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或会议通知约定的其他方式进行表决。 在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效： （1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告，法律法规及监管机构另有规定的除外； 八、生效与公告 基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将公证书全文、公证机构、公证员姓名等一同公告。 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定 侧袋机制实施期间，基金份额持有人大会审议事项涉及主袋账户和侧袋账户的，应分别由主袋账户、侧袋账户的基金份额持有人进行表决，同一主侧袋账户内同一类别的每份基金份额具有平等的表决权；表决事项未涉及侧袋账户的，侧袋账户份额无表决权。
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	二、集合计划管理人和集合计划托管人的更换程序 （一）集合计划管理人的更换程序 2、决议：集合计划份额持有人大会在集合计划管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经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）表决通过，决议自表决通过之日起生效；集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司，无需召开集合计划份额持有人大会审议； 3、新任或临时基金管理人接受集合计划管理或新任或临时集合计划托管人接受集合计划财产和集合计划托管业务前，原集合计划管理人或集合计划托管人应依据法律法规和《资产管理合同》的规定继续履行相关职责，并保证不对集合计划份额持有人的利益造成损害。原集合计划管理人或集合计划托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本集合计划的规定收取集合计划托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本集合计划托管费。	二、基金管理人和基金托管人的更换程序 （一）基金管理人的更换程序 2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需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（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效； 3、新任或临时基金管理人接收基金财产和基金托管业务前，原基金管理人或基金托管人应依据法律法规和《基金合同》的规定继续履行相关职责，并保证不对基金份额持有人的利益造成损害。原基金管理人或基金托管人在继续履行相关职责期间，仍有权按照本基金合同的规定收取基金管理费或基金托管费。
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、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、地方政府债等）、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产品进行评估为精准的定价，在控制风险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、授权代表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、地方政府债等）、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）债权类资产投资策略 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，具体资信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等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策略，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本公开募集证券投资基金（含QDII）合计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本基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的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。
第十三部分 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、集合计划管理费的计提方法、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的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，将应于披露的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《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基金定期报告“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、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，将应于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基金定期报告“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另有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。

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第一次提示性公告

中信证券资产管理有限公司已于2025年5月12日在管理人网站（www.citicsam.com）及《证券日报》披露了《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》，为了使本次集合计划份额持有人大会顺利召开，现发布《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第一次提示性公告》。

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”。

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