

### 【上接D49版】

(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《关于准予中信证券量化优选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,由中信证券量化优选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法律法规、行政法规及中国证监会规定进行变更,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持有人大会,审议修改资产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。《资产管理合同》有效期限自管理人获得中国证监会批准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》可以继续长期限,则中信证券资产管理有限公司有权进行上述变更管理人及变更注册事项。

(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,已经中国证监会核准。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)本次以通讯方式召开集合计划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)通过方可有效,存在无法获得集合计划持有人大会表决通过的可能。

(四)集合计划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。集合计划持有人大会决议自生效之日起2日内在指定媒介上公告。

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)变更产品投资范围

由“股票型集合资产管理计划”变更为“股票型证券投资基金”。

(四)变更产品存续期限

由“本集合计划自资产管理合同变更生效之日起起算至2025年6月30日”变更为“不定期”。

(五)调整产品费率结构

将原A类计划份额持有人于等于180日且小于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费率由“0.8%”调整至“0.6%”。

(六)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融券,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。

(七)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”。

(八)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。

具体修订内容详见附件五:《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

本集合计划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》中约定的投资比例限制等条款。

2.管理人提请集合计划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赎回、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,其持有的份额默认结转认定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;……”第八十六条规定:“……转换基金的运作方式、更换基金管理人或基金托管人、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,本次的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权的三分之二以上(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》有关内容的事宜符合相关法律法规要求,不存在法律层面的障碍。

(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,保证持有人充分知情。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网银等形式签订修订后的基金合同及托管协议,并在法律法规规定的时间范围内更新招募说明书。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、主要风险和预防措施

(一)集合计划持有人大会未能成功召集或议案未获得集合计划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,集合计划持有人大会应当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)集合计划份额持有人参加,由权益登记日持有有效表决权,且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)通过方可生效。若无法获得集合计划持有人大会表决通过而不能成功召集或议案未获得集合计划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持有人进行协商沟通,争取更多的持有人参加集合计划持有人大会。

(二)集合计划持有人集中赎回份额的流动性风险

为应对可能发生的较大规模集中赎回,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。管理人将根据市场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。

附注三:

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(有效身份证件号码-社会信用代码等):

基金账号(选项):

代理人姓名/名称:

代理人证件号码(有效身份证件号码-社会信用代码等):

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“口”内“√”,同一议案只能表示一项意见。

2.如表决票上表示意见未选,或未作明确声明,但其各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决权并计入对表决票统计。

3.如表决票上表示意见不清楚,或不清晰,但其各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决权并计入对表决票统计。

4.如表决票上表示意见填写不完整,或不清晰,或未提供能有效证明集合计划份额持有人身份的有效授权证明文件的,或未能在截止日前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持有人大会表决的集合计划份额总数。

若在截止时间前同一议案重新召开集合计划持有人大会,除非集合计划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。

5.份额持有人有效身份证件“指”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件以及其他能够证明其身份的有效证件或证明,如更新,需提供最新。

6.“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号且需要按照不同账号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。

7.本集合计划可从相关网站下载,从根址上剪裁、复印或按此格式打印。

附件四:

授权委托书

兹委托  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持有人大会,除授权委托书签载的事项外,其他授权事项均无效。

委托人(或代理人)有效身份证件号码-社会信用代码等:

受托人(或代理人)有效身份证件号码-社会信用代码等:

基金账号(选项):

受托人姓名/名称:

受托人证件号码(有效身份证件号码-社会信用代码等):

说明:

1.请就表决内容表示“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应“口”内“√”,同一议案只能表示一项意见。

2.如表决票上表示意见未选,或未作明确声明,但其各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决权并计入对表决票统计。

3.如表决票上表示意见不清楚,或不清晰,但其各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决权并计入对表决票统计。

4.如表决票上表示意见填写不完整,或不清晰,或未提供能有效证明集合计划份额持有人身份的有效授权证明文件的,或未能在截止日前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持有人大会表决的集合计划份额总数。

若在截止时间前同一议案重新召开集合计划持有人大会,除非集合计划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。

5.份额持有人有效身份证件“指”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件以及其他能够证明其身份的有效证件或证明,如更新,需提供最新。

6.“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号且需要按照不同账号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。

7.本集合计划可从相关网站下载,从根址上剪裁、复印或按此格式打印。

附件四:

授权委托书

兹委托  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持有人大会,除授权委托书签载的事项外,其他授权事项均无效。

委托人(或代理人)有效身份证件号码-社会信用代码等:

受托人(或代理人)有效身份证件号码-社会信用代码等:

基金账号(选项):

受托人姓名/名称:

受托人证件号码(有效身份证件号码-社会信用代码等):

说明:

1.请就表决内容表示“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应“口”内“√”,同一议案只能表示一项意见。

2.如表决票上表示意见未选,或未作明确声明,但其各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决权并计入对表决票统计。

3.如表决票上表示意见不清楚,或不清晰,但其各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决权并计入对表决票统计。

4.如表决票上表示意见填写不完整,或不清晰,或未提供能有效证明集合计划份额持有人身份的有效授权证明文件的,或未能在截止日前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持有人大会表决的集合计划份额总数。

若在截止时间前同一议案重新召开集合计划持有人大会,除非集合计划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。

5.份额持有人有效身份证件“指”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件以及其他能够证明其身份的有效证件或证明,如更新,需提供最新。

6.“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号且需要按照不同账号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。

7.本集合计划可从相关网站下载,从根址上剪裁、复印或按此格式打印。

附件四:

授权委托书

兹委托  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持有人大会,除授权委托书签载的事项外,其他授权事项均无效。

委托人(或代理人)有效身份证件号码-社会信用代码等:

受托人(或代理人)有效身份证件号码-社会信用代码等:

基金账号(选项):

受托人姓名/名称:

受托人证件号码(有效身份证件号码-社会信用代码等):

说明:

1.请就表决内容表示“同意”、“反对”或“弃权”,并在相应“口”内“√”,同一议案只能表示一项意见。

2.如表决票上表示意见未选,或未作明确声明,但其各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决权并计入对表决票统计。

3.如表决票上表示意见不清楚,或不清晰,但其各项符合本公告规定的,视为弃权表决,计入有效表决权并计入对表决票统计。

本人会,除授权方式发生变化或本人(或本机构)重新授权外,本授权继续有效。

委托签字盖章:

受托人有效身份证件号码或统一社会信用代码等:

基金账号(选项):

受托人(或代理人)签字/盖章:

受托人(或代理人)有效身份证件号码或统一社会信用代码等:

委托日期: 年 月 日

说明:

1.本授权委托书可复印,复印或按以上格式印制,在填写完整并签字盖章后均为有效。

2.“委托人有有效身份证件”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件或其他能够证明其身份的有效证件或证明,如更新,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号且需要按照不同账号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、申购持有人、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 基金份额持有人

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 指定媒介、指定网站、指定报刊

全文 指定媒介、指定网站、指定报刊 指定媒介、指定网站、指定报刊