

中信证券资管可转债 2 号集合资产管理计划销售公告

一、重要提示

(一) 投资者承诺以真实身份参与集合资产管理计划, 保证委托资产的来源及用途合法, 所披露或提供的信息和资料真实、准确、完整, 没有使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金参与本集合计划, 并已阅知集合资产管理合同和集合计划说明书全文, 了解相关权利、义务和风险, 自行承担投资风险和损失。管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产, 但不保证本集合计划本金不受损失, 也不保证最低收益。

(二) 本公告仅对本集合计划募集的有关事项和规定予以说明。投资者如欲了解本集合计划的详细情况, 请阅读本公司网站 (www.citicsam.com) 备置的《中信证券资管可转债 2 号集合资产管理计划资产管理合同》、《中信证券资管可转债 2 号集合资产管理计划说明书》、《中信证券资管可转债 2 号集合资产管理计划风险揭示书》。

(三) 为保护投资者的利益, 管理人郑重提示投资者: 在每次参与本集合计划 (无论募集期参与还是存续期参与) 时, 投资者应及时通过原销售机构网点、原销售机构指定网络系统查询参与结果。

销售机构应当了解本集合计划、了解客户的投资需求和风险偏好, 详细介绍产品特点并充分揭示风险, 不得通过电视、报刊、广播、互联网及其他公共媒体向不特定对象宣传集合计划, 禁止



通过保本保底、虚假宣传、夸大宣传、商业贿赂等不正当竞争手段推广集合计划。

(四) 本公司可根据募集期间的具体情况对募集事宜做适当调整。

(五) 特别约定：《中信证券资管可转债 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”或“集合资产管理合同”）以电子签名方式签订，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；投资者（中信证券资管可转债 2 号集合资产管理计划的投资者）作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

投资者、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意自投资者签署《电子签名约定书》之日起，投资者以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书）、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。

如果投资者违反适当性、资金来源或其他投资者承诺与声明的，管理人有权强制退出其持有的份额，且管理人有权以投资者参与金额与以管理人确定的强制赎回日份额净值为基础计算的

投资者持有份额对应资产净值两者孰低原则强制退出该投资者持有的全部份额。

二、本集合计划概况

(一) 名称: 中信证券资管可转债 2 号集合资产管理计划

类别: 固定收益类集合资产管理计划

运作方式: 开放式

(二) 存续期: 本集合计划存续期满日为成立日满 10 年对日的前一日, 若该日为非工作日, 则顺延至下一工作日。存续期届满前, 本集合计划可展期变更。出现集合资产管理合同约定的终止情形时, 终止清算。

(三) 资产管理计划份额的初始募集面值为 1 元。

(四) 目标规模: 本集合计划最低初始募集规模不低于 1000 万元, 无募集规模上限。本集合计划投资者数量为 2 人以上(含) 200 人以下(含)。

在集合计划规模接近或达到上限(如有)时, 管理人将有权暂停接受集合计划参与申请, 并对当日已提交的参与申请, 管理人将采取金额优先(参与金额较大者优先确认, 如部分确认, 确认后的金额应满足本合同对于参与金额的相关要求)、同等金额时间优先的原则处理, 并及时向投资者披露。

在集合计划人数达到上限时, 管理人将有权拒绝接受初次参与申请, 但继续接受本集合计划份额持有人的追加参与申请, 并对当日已提交的初次参与申请, 管理人将采取金额优先(参与金

额较大者优先确认，如部分确认，确认后的金额应满足本合同对于参与金额的相关要求）、同等金额时间优先的原则处理，并及时向投资者披露。

（五）最低参与金额：本集合计划接受合格投资者最低参与金额为人民币 50 万元（扣除参与费）且仅接受货币资金参与，具体支付方式以销售机构的安排为准。对于本集合计划份额的持有人，其新增参与资金的最低金额为 1 元人民币（扣除参与费）。投资者将红利再投资不受上述限制。

（六）参与和退出的开放日和时间

1、**开放期：**本集合计划成立后，每周一为参与开放日（如遇非工作日不开放、不顺延），投资者可以在参与开放日办理参与业务（管理人通告暂停参与时除外）；每周一、三、五为退出开放日（如遇非工作日不开放、不顺延），投资者符合退出条件的份额可在每个运作期到期日及之后的五个工作日内的退出开放日办理相应份额的退出业务（管理人通告暂停退出时除外）。

运作期：

（1）每个运作期到期日前，投资者不能提出赎回申请

对于募集期认购参与的投资者，第一个运作期指集合计划成立日起，至集合计划成立日满 6 个月对应的月度对日（即第一个运作期到期日；如无对日的，则为该月最后一日，下同）止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起，至集合计划份额成立日满 12 个月对应的月度对日止，第三个运作期指第二个

运作期到期日的次一工作日起,至集合计划成立日满 18 个月对应的月度对日止; 以此类推。

对于每份申购的集合计划份额, 第一个运作期指集合计划份额申购确认日(对申购份额而言, 下同)起(即第一个运作期起始日), 至集合计划份额申购确认日满 6 个月对应的月度对日(即第一个运作期到期日)止。第二个运作期指第一个运作期到期日的次一工作日起, 至集合计划份额申购确认日满 12 个月对应的月度对日止, 第三个运作期指第二个运作期到期日的次一工作日起, 至集合计划份额申购确认日满 18 个月对应的月度对日止; 以此类推。

(2) 运作期到期日当日及之后的五个工作日内的退出开放日(避免歧义, 若在运作期到期日当日提出赎回申请, 则该日应满足为退出开放日, 下同), 集合计划份额持有人可提出赎回申请

每个运作期到期日当日及之后的五个工作日内的退出开放日, 集合计划份额持有人可提出赎回申请。如果集合计划份额持有人在当期运作期到期日及之后的五个工作日内的退出开放日未申请赎回, 则自该运作期到期日下一工作日起该集合计划份额进入下一个运作期。

为更好地体现法定节假日、休息日的真实影响, 举例说明:

(1) 如本计划募集期为 2025 年 4 月 1 日至 4 月 11 日, 于 2025 年 4 月 15 日成立。投资者募集期内认购成功一笔集合计划

份额，该笔份额于 2025 年 4 月 15 日确认（即集合计划成立日），则该笔份额的第一个运作期为自 2025 年 4 月 15 日起至 2025 年 10 月 15 日，第一个运作期到期日当日及之后的五个工作日为 2025 年 10 月 15、16、17、20、21、22 日，投资者可在该六个工作日中的四个退出开放日即 2025 年 10 月 15、17、20、22 日办理该笔份额的退出业务；如投资者未在上述四个退出开放日办理该笔份额的退出业务，则该笔份额的第二个运作期为自 2025 年 10 月 16 日起至 2026 年 4 月 15 日，第二个运作期到期日当日及之后的五个工作日为 2026 年 4 月 15、16、17、20、21、22 日，投资者可在该六个工作日中的四个退出开放日即 2026 年 4 月 15、17、20、22 日办理该笔份额的退出业务；以此类推。

（2）如投资者于 2025 年 4 月 21 日（即参与申请日）申购成功一笔集合计划份额，该笔份额于 2025 年 4 月 22 日确认（即参与确认日），则该笔份额的第一个运作期为自 2025 年 4 月 22 日起至 2025 年 10 月 22 日，第一个运作期到期日当日及之后的五个工作日为 2025 年 10 月 22、23、24、27、28、29 日，投资者可在该六个工作日中的四个退出开放日即 2025 年 2025 年 10 月 22、24、27、29 日办理该笔份额的退出业务；如投资者未在上述四个退出开放日办理该笔份额的退出业务，则该笔份额的第二个运作期为自 2025 年 10 月 23 日起至 2026 年 4 月 22 日，第二个运作期到期日当日及之后的五个工作日为 2026 年 4 月 22、23、24、27、

28、29 日，投资者可在该六个工作日中的四个退出开放日即 2026 年 4 月 22、24、27、29 日办理该笔份额的退出业务；以此类推。

2、封闭期：本集合计划除开放期外原则上都是封闭期。封闭期内原则上不办理参与、退出业务（管理人公告临时开放的情况除外）。

封闭期内管理人有权依据本合同的约定增加临时开放期，具体开放安排以管理人公告为准。

3、流动性安排：管理人在开放期将根据组合的具体情况安排适当比例的现金类资产，并确保资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。同时，管理人将安排本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不超过该资产管理计划资产净值的 20%。

4、开放时间：具体业务办理时间以销售机构公布时间为准（管理人通告暂停参与、退出时除外）。

（七）投资范围及比例

本产品的投资范围为：

（1）银行存款、同业存单，以及符合《指导意见》规定的标准化债权类资产，包括在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所交易的可以划分为均等份额、具有合理公允价值和完善流动性机制的国债、中央银行票据、地方政府债券、金融债券、政府支持机构债券、企业债券、公司债券（包括公开发行公司债券和非公开发行公司债券；含可转换公司债券（含分离交

易可转债）、可交换公司债券）、经银行间市场交易商协会批准注册发行的各类债务融资工具（如短期融资券、超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、非公开定向债务融资工具（PPN）、项目收益票据（PRN）等）、项目收益债；上述债权类资产亦包括位于次级偿付顺序（即其受清偿/偿付顺序位于发行人普通债/其他债务之后）的前述各类品种；资产支持票据（ABN）、资产支持证券（ABS）；债券逆回购等；

（2）上市公司股票：可转换公司债券转股、可交换公司债券交换转股等；

（3）公开募集证券投资基金（可以通过基金公司直销平台、第三方基金销售平台等渠道进行购买）：货币市场基金、债券基金；

（4）参与债券借贷，债券正回购业务。

若本集合计划出现需要改变投资范围的情形（因法律法规强制性规定而改变投资范围的除外），管理人在履行合同变更程序后，方可按照变更后的投资范围执行。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

本产品的投资比例为：

（1）本集合计划投资于债权类资产（含银行存款、同业存单等）的比例不低于集合计划总资产的 80%；

(2) 本集合计划投资于股权类资产的比例不超过集合计划总资产的 20%;

(3) 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 200%; 除国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种外, 如集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产的 50%, 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 120%;

(4) 本集合计划投资于同一资产的资金不得超过本集合计划资产净值的 25%, 银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外;

(5) 本集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时, 所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产, 所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量;

全体投资者同意并授权管理人为规避特定风险, 存续期内将本集合计划投资于债权类资产的比例可以低于本集合计划总资产的 80%, 但不得持续 6 个月低于本集合计划总资产 80%。前述“特定风险”指参与退出导致仓位大幅变动、市场大幅波动、投资标的价值大幅波动等风险以及其他管理人认为可能对本资产管理计划产生不利影响的风险。

本集合计划投资于其他资产管理产品的, 大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算。本集合计

划投资于其他私募资产管理产品的，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。

本集合计划按照《运作规定》等规定的要求进行组合投资。

若本集合计划出现需要改变投资比例的情形（因法律法规强制性规定而改变投资比例的除外），管理人在履行合同变更程序后，方可按照变更后的投资比例执行。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合本合同或法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例和投资限制的，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 20 个交易日内调整至符合要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，应当按照相关规定及时报告。

（八）收益分配

本资产管理计划可供分配利润为截至收益分配基准日计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

集合计划收益由债券利息、股息、基金红利、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入构成。

集合计划收益分配原则如下：

1、每份集合计划份额享有同等分配权（若存在管理人业绩报酬，每份额集合计划实际得到的分红金额可能有所不同）；

2、本集合计划收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；

3、本集合计划每年收益分配次数最多为 12 次，每份集合计划份额每次集合计划收益分配比例不得低于集合计划收益分配基准日每份集合计划份额可供分配利润的 10%，若资产管理计划成立不满 3 个月可不进行收益分配；

4、在符合上述有关分红条件的前提下，本集合计划可以进行收益分配。集合计划的分红权益登记日和收益分配基准日由管理人确定，分红除息日和分红权益登记日为同一天，分红确认日为分红权益登记日的下一工作日。集合计划红利发放日距离收益分配基准日（即可供分配利润计算截至日）的时间不得超过 15 个工作日；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。在法律法规和监管机构允许的范围内，管理人、托管人协商一致，可以对上述收益分配条件和时间进行调整，并在管理人网站上公告。

集合计划收益分配方式如下：

1、集合计划默认分红方式为现金分红，投资者可以选择现金分红或红利再投资分红方式。投资者同意遵守登记结算机构的业务规则（包括但不限于现有规则、对现有规则的修订、以及以后新制订的规则）。管理人分红时以登记结算机构登记的分红方式为准。

2、投资者可以选择将所获红利再投资于集合计划，选择采取红利再投资形式的，分红资金在扣除管理人业绩报酬（如有）后，按分红除息日的集合计划每份额净值转成集合计划份额。集合计划份额数计算要保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

（九）费率：

- 1、参与费（认购/申购费率）：0.5%；
- 2、退出费：0%；
- 3、托管费（年费率）：0.01%；
- 4、管理费（年费率）：0.6%；

（十）业绩报酬：

在本集合计划分红确认日、投资者退出确认日和计划终止日，将根据投资者的期间年化收益率（R），对期间年化收益率超过5%（即业绩报酬计提基准）的部分按照20%的比例提取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”），但若分红确认日距本集合计划的成立日或上一个计提业绩报酬的分红确认日的间隔期间不足6个月的，管理人在本次分红确认日不得提取业绩报酬。

管理人有权根据市场情况调低业绩报酬收取比例或调高业绩报酬计提基准，并及时通过公告形式向投资者披露，无须另行征询投资者、托管人的意见；但若调高业绩报酬收取比例或调低业绩报酬计提基准，应事先按照资产管理合同的约定履行合同变更程序。业绩报酬计提基准仅用于计算管理人的业绩报酬，不构成

管理人、托管人保证投资者参与资金不受损失或取得最低收益的承诺。

如本集合计划开通份额转让，管理人可在投资者转出其份额时收取业绩报酬，具体规定以管理人公告为准。

（十一）风险收益特征：本计划属于 R3-中风险等级产品，适合专业投资者以及风险识别、评估、承受能力在 C3 及以上的普通投资者。

三、募集期

本集合计划的募集期为 2025 年 5 月 12 日至 2025 年 5 月 30 日，管理人有权根据本集合计划的募集情况对募集期进行调整。

投资者可在本集合计划的各销售机构营业网点参与本集合计划。办理业务的具体时间，由各销售机构约定。

四、募集对象

本集合计划募集对象为：中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者（法律法规禁止的除外），以及法律法规或中国证监会允许参与本集合计划的其他投资者。投资者在参与本集合计划之前，已经是销售机构的客户。

投资者应确保自身具备合格投资者条件。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本集合计划不低于本合同约定的最低参与金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织：

（1）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：

家庭金融资产不低于 300 万元,家庭金融资产不低于 500 万元,或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元;

(2) 最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位;

(3) 依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构,包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、商业银行理财子公司、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构;

(4) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品;

(5) 基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金,慈善基金等社会公益基金,合格境外机构投资者(QFII)、人民币合格境外机构投资者(RQFII);

(6) 金融管理部门视为合格投资者的其他情形。

投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划。如未来法律法规或监管机构对合格投资者有新规定的,本集合计划将按新规定执行。

投资者如为管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方的,应在参与本集合计划时特别告知管理人,并在此同意并授权管理人可以按照相关规定对其此次投资行为进行披露、监控以及向有权机构报告。

本集合计划面向特定的投资者募集，对于不符合法律法规规定或本合同约定的投资者以及未经管理人认可的投资者，管理人有权拒绝其参与申请，已经参与的，管理人有权强制退出其持有的份额（如果投资者违反适当性、资金来源或其他投资者承诺与声明的，管理人有权以投资者参与金额与以管理人确定的强制赎回日份额净值为基础计算的投资者持有份额对应资产净值两者孰低原则强制退出该投资者持有的全部份额）。

五、销售机构

中信证券资产管理有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京度小满基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司

募集结算专用账户（清算汇总户）：

银行户名：中信证券资产管理有限公司

账号：8110701012102581375

开户行：中信银行北京瑞城中心支行

大额支付号：302100011681

销售机构委托募集账户如下：

账户名称：中信证券资产管理有限公司

账号：8110701013102581524

开户银行：中信银行北京瑞城中心支行

大额支付号：302100011681

账户名称：上海天天基金销售有限公司私募基金销售监督专户

账号：630637510

开户银行：中国民生银行上海分行营业部

大额支付号：305290002012

账户名称：北京度小满基金销售有限公司

账号：91270078801300000369

开户银行：浦发银行北京菜户营支行

大额支付号：310100000261

账户名称：南京苏宁基金销售有限公司

账号：699978133

开户银行：中国民生银行股份有限公司南京江宁支行

大额支付号：305301008127

六、本集合计划的成立

（一）资产管理计划的成立条件：在本集合计划的募集期内，集合计划的初始募集规模(扣除参与费)不低于 1000 万元人民币，投资者数量为 2 人（含）以上，且不超过 200 人，募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。

（二）资产管理计划募集失败的处理方式：各方一致同意，募集期届满，本集合计划未达到成立条件的，或募集期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力事件，则本集合计划募集失败。如本集合计划设立募集失败，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在募集期届满后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。利息具体金额以登记结算机构确认结果为准。

（三）集合计划的募集金额缴足之日起 10 个工作日内，由管

理人公告资产管理计划成立。

七、本集合计划的当事人

(一) 管理人

中信证券资产管理有限公司

(二) 托管人

中信银行股份有限公司北京分行

(三) 销售机构

中信证券资产管理有限公司、上海天天基金销售有限公司、
北京度小满基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司

(四) 注册登记机构

中信证券资产管理有限公司

中信证券资产管理有限公司

2025年5月9日



为
部
局

