

## 中国国际金融股份有限公司

# 关于以通讯方式召开中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会的第二次提示性公告

中国国际金融股份有限公司已于 2025 年 9 月 24 日在管理人网站 (<http://www.cicc.com>) 及《上海证券报》披露了《中国国际金融股份有限公司关于以通讯方式召开中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会的公告》，并于 2025 年 9 月 25 日在上述网站和报刊上发布了《中国国际金融股份有限公司关于以通讯方式召开中金安心回报灵活配置混合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》，为了使本次集合计划份额持有人大会顺利召开，现发布《中国国际金融股份有限公司关于以通讯方式召开中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会的第二次提示性公告》。

### 一、召开会议基本情况

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，中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“集合计划”）经中国证监会 2020 年 1 月 14 日《关于准予中金安心回报集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函〔2020〕102 号）准予，中金安心回报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《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《集合计划合同》或《资产管理合同》）于 2020 年 4 月 30 日生效。本集合计划管理人为中国国际金融股份有限公司（以下简称“集合计划管理人”或“管理人”），集合计划托管人为华夏银行股份有限公司（以下简称“集合计划托管人”或“托管人”）。根据《操作指引》及《集合计划合同》对本集合计划存续期限的约定，本集合计划将于 2025 年 11 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中金安心回报混合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 9 月 25 日起，至 2025 年 10 月 28 日 17:00 止（投票表决时间以本公告指定的表决票收件人收到表决票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、会议表决票的寄达地点：

集合计划管理人：中国国际金融股份有限公司

地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 B 座 42 层

邮政编码：100004

联系人：中金公司资产管理部客服组

联系电话：800-810-8802（固话用户免费）| (010)6505-0105（直线）

请在信封表面注明“中金安心回报灵活配置混合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

《关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合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《关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合型证券投资基金有关事项的说明》

(见附件二)

### 三、集合计划份额持有人大会的权益登记日

本次大会的权益登记日为 2025 年 9 月 24 日,即在 2025 年 9 月 24 日交易时间结束后,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、表决票的填写和寄交方式

1、本次会议表决票见附件三。集合计划份额持有人可从相关报纸上剪裁、复印表决票或登陆本集合计划管理人网站(<http://www.cicc.com>)下载并打印表决票。

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授权的业务章或集合计划管理人认可的其他印章(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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);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身份证件(包括使用的身份证、护照或其他身份证明文件)正反面复印件,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和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,并提供个人投资者身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明文件)正反面复印件,以及填妥的授权委托书原件(参照附件四)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其

身份的有效证件或证明)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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(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,并提供持有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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等),以及填妥的授权委托书原件(参照附件四)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等)。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,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,以及填妥的授权委托书原件(参照附件四)。如代理人为个人,还需提供代理人的身份证件(包括使用的身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明)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有权部门的批文、开户证明或登记证书复印件等);

(5) 以上(1)、(2)、(3)、(4)项及本公告全文中的有效身份证明文件、公章、业务章、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在自2025年9月25日起,至2025年10月28日17:00止的期间内通过专人送交、快递或邮寄挂号信的方式送达至本公告指定的表决票收件人,请在信封表面注明:“中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会表决专用”。

送达时间以指定地址收到表决票时间为准,即:专人送达的以实际递交时间为准;快递送达的,以指定地址签收时间为准;以邮寄挂号信方式送达的,以挂号信回执上注明的收件日期为送达日期。

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 9 月 25 日起,至 2025 年 10 月 28 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,反馈的内容出现模糊不清或相互矛盾等不符合要求的情况视为弃权票。

#### 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 9 月 25 日起,至 2025 年 10 月 28 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://holdmeet.cicc.com/cicc/h5/index.html>】(2)PC端:【<https://holdmeet.cicc.com/cicc/pc/index.html>】。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,反馈的内容出现模糊不清或相互矛盾等不符合要求的情况视为弃权票。

#### 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、会议召开的条件和表决票数要求

1、本次会议召开的条件为：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）。

2、本次会议表决的票数要求为：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。本次议案按特别决议处理，《关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合型证券投资基金有关事项的议案》须经前述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。

3、本次集合计划份额持有人大会决议，本集合计划管理人自通过之日起五日内报中国证监会备案，集合计划份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。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。

## 六、计票

1、本次通讯会议的计票方式为：由集合计划管理人授权的两名监督员在托管人（华夏银行股份有限公司）授权代表的监督下于本次通讯会议的表决截止日期（即 2025 年 10 月 28 日）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 9 月 25 日前及 2025 年 10 月 28 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，且在规定时间内送达指定地址的，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填、多填、字迹模糊不清、无法辨认、意愿无法判断或相互矛盾，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，或未能在规定时间之内送达指定地址的，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，以最后送达日所填写的有效的表决票为准，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；

③送达时间确定原则见“四、表决票的填写和寄交方式”中相关说明。

## 七、二次召集集合计划份额持有人大会及二次授权

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》等法律法规以及《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》的规定，本次集合计划份额持有人大会需要有效表决票所代表的集合计划份额不少于本集合计划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成功召开，根据《中华人民共和国证券投资基金法》的规定及《中金安心回报灵活配置混合

型集合资产管理计划资产管理合同》的约定，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。重新召开集合计划份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，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作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：中国国际金融股份有限公司

联系地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦B座42层

客服电话：800-810-8802（固话用户免费） | （010）6505 0105（直线）

网址：[www.cicc.com](http://www.cicc.com)

2、托管人：华夏银行股份有限公司

办公地址：北京市东城区建国门内大街22号

联系人：朱绍纲

客服电话：（010）85238309

3、公证机构：北京市方圆公证处

办公地址：北京市东城区朝阳门内大街东水井胡同5号

邮政编码：10010

联系人：崔军

联系电话：010-85197622

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

## 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服电话 800-810-8802（固话用户免费） | (010) 6505 0105（直线）咨询。

3、本公告的有关内容由中国国际金融股份有限公司负责解释。

附件一：《关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合型证券投资基金有关事项的议案》

附件二：《关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合型证券投资基金有关事项的说明》

附件三：《中金安心回报灵活配置混合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：《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后对照表

中国国际金融股份有限公司

2025 年 9 月 26 日

## 附件一

# 关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合型证券投资基金有关事项的议案

中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划集合计划份额持有人：

中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是中国国际金融股份有限公司（以下简称“集合计划管理人”或“管理人”）管理的一只混合型集合资产管理计划，于2020年4月30日完成公募化改造，托管人为华夏银行股份有限公司。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操作指引》等法律法规规定和《中金安心回报灵活配置混合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，管理人经与托管人协商一致，决定以通讯方式召开中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会，提议按照《关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合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。

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中金基金管理有限公司（以下简称“中金基金”）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中金基金公告为准，请投资者注意登录中金基金网站（[www.ciccfund.com](http://www.ciccfund.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、转换转出等），赎回选择期内赎回或转换转出不受持有期限限制且不收取赎回费。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、转换转出等情况，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：中国国际金融股份有限公司

2025年9月26日

## 附件二

# 关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合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,中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)经2020年1月14日《关于准予中金安心回报集合资产管理计划合同变更的回函》(机构部函〔2020〕102号)准予,由中金安心回报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《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“《集合计划合同》”)于2020年4月30日生效。

本集合计划管理人为中国国际金融股份有限公司(以下简称“我司”或“中金公司”),集合计划托管人为华夏银行股份有限公司(以下简称“华夏银行”)。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11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国国际金融股份有限公司变更为中金基金管理有限公司(以下简称“中金基金”),中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划相应变更注册为中金安心回报混合型证券投资基金有关事项的议案。

(二)本次中金安心回报灵活配置混合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

产品名称由“中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划”更名为“中金安心回报混合型证券投资基金”。

### (二) 变更产品管理人

产品管理人由“中国国际金融股份有限公司”变更为“中金基金管理有限公司”。

### (三) 变更产品基金经理

产品投资经理由“中国国际金融股份有限公司旗下投资经理顾柔刚”变更为“中金基金管理有限公司旗下基金经理于质冰、丁杨、骆毅”。

### (四) 变更产品类型

产品类型由灵活配置混合型集合资产管理计划变更为偏债混合型证券投资基金。投资比例相应由“股票资产占集合计划资产比例为 0%-85%”调整为“投资于权益类资产及可转换债券、可交换债券资产的比例合计占基金资产的 10%-30%”, 并明确权益类资产包含范围。同时增加“本基金投资于可转换债券及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%”、“本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金投资比例不超过基金资产净值的 10%”、“本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%”投资比例。

### (五) 删除合同自动终止条款

删除合同自动终止条款, 由“集合计划合同生效后, 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 50 个工作日出现前述情形的, 本集合计划将根据集合计划合同的约定清算并终止, 且无需召开集合计划份额持有人大会。”调整为“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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当于 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、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。”

#### （六）调整投资目标

对应产品类型调整，投资目标调整为“本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。”

#### （七）调整投资范围及投资限制

投资范围新增“国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括全市场公开募集的股票型 ETF、基金管理人管理的股票型基金和计入权益类资产的混合型基金，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非基金中基金、货币市场基金）、存托凭证、证券公司短期公司债券、政府支持债券、政府支持机构债券、股票期权、信用衍生品”，明确基金可参与融资业务并增加相应的投资限制。

#### （八）调整投资策略

根据产品类型调整及新增投资范围，对应调整相关投资策略。

#### （九）调整业绩比较基准

由“中债新综合全价指数收益率×65%+中证 800 指数收益率×25%+恒生指数收益率×5%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%”调整为“中债新综合全价指数收益率×75%+中证 800 指数收益率×15%+恒生指数收益率（使用估值汇率调整）×5%+金融机构人民币活期存款基准利率（税后）×5%”。

#### （十）调整费率结构

产品年管理费由 1.00%调整为 0.60%，年托管费率保持 0.15%不变，C 类年销售服务费率保持 0.40%不变。

#### （十一）调整赎回费率及计入基金财产比例

A 类基金份额赎回费率由“T < 7 日，收取 1.50%；7 日 ≤ T < 30 日，收取 0.75%；30 日 ≤ T < 365 日，收取 0.50%；T ≥ 365 日，不收取”调整为“T < 7 日，收取 1.50%；7 日 ≤ T < 30 日，收取 0.75%；30 日 ≤ T < 180 日，收取 0.50%；T ≥ 180 日，不收取”。C 类基金份额赎回费率由“T < 7 日，收取 1.50%；7 日 ≤ T < 30 日，收取 0.50%；30 日 ≤ T < 365 日，收取 0.30%；T ≥ 365 日，不收取”调整为“T < 7 日，收取 1.50%；

7日 $\leq$ T<30日，收取0.50%；T $\geq$ 30日，不收取”。计入基金财产比例根据调整后费率按照法规要求对应调整。

#### （十二）变更产品会计师事务所

产品会计师事务所由“德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）”变更为“毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）”。

（十三）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。

具体修订内容请见附件五：《中金安心回报灵活配置混合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、转换转出等），赎回选择期内赎回或转换转出不受持有期限限制且不收取赎回费。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、转换转出等情况，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、转换转入、转换转出等。

#### 3、《中金安心回报混合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，《中金安心回报混合型证券投资基金基金合同》的生效时间届时将由中金基金另行发布相关公告。

**赎回选择期间未赎回、未转换转出的持有人，其持有的份额将默认结转为中金安心回报混合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。中金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，将由基金管理人中金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

中金安心回报灵活配置混合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或名称:			
证件号码 (身份证件号/营业执照号等)		基金账户号	
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	同意	反对	弃权
关于中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为中金安心回报混合型证券投资基金有关事项的议案			
集合计划份额持有人/代理人签字或盖章			
日期:       年   月   日			
说明: 1、请以打“√”方式在审议事项后注明表决意见。集合计划份额持有人必须选择一种且只能选择一种表决意见。表决意见代表集合计划份额持有人所填基金账户号的全部集合计划份额(以权益登记日所登记的集合计划份额为准)的表决意见。 2、如表决票上的表决意见未填、多填、字迹模糊不清、无法辨认、意愿无法判断或相互矛盾,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。 3、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,或未能在规定时间之内送达指定地址的,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。 4、本表决票中“基金账户号”,指持有中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划的基金账户号。同一集合计划份额持有人拥有多个此类基金账户号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,应当填写基金账户号,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份额。			

(本表决票可剪报、复印或登录本集合计划管理人网站(www.cicc.com)下载并打印,在填写完整并签字盖章后均为有效。)

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10月28日17:00的以通讯方式召开的中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会,并代为全权行使对议案的表决权。授权有效期自签署日起至本次集合计划份额持有人大会会议结束之日止。若中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划重新召开审议相同议案的集合计划份额持有人大会的,除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外,本授权继续有效。

委托人(签字/盖章):\_\_\_\_\_

委托人证件号码:\_\_\_\_\_

委托人基金账户号:\_\_\_\_\_

代理人(签字/盖章):\_\_\_\_\_

代理人证件号码:\_\_\_\_\_

委托日期: 年 月 日

附注:此授权委托书剪报、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。

授权委托书填写注意事项:

1、本授权委托书中“委托人基金账户号”,指集合计划份额持有人持有本集合计划的基金账户号。同一集合计划份额持有人拥有多个此类基金账户号且需要按照不同账户持有集合计划份额分别授权的,应当填写基金账户号,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份额。

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、此授权委托书剪报、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。

## 附件五

## 《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》

## 修改前后对照表

章节	《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》条款	《中金安心回报混合型证券投资基金基金合同》条款
管理人	中国国际金融股份有限公司	中金基金管理有限公司
全文	中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划	中金安心回报混合型证券投资基金
全文	集合计划、计划、集合资产管理计划、本集合计划、集合资产管理计划	证券投资基金、基金、本基金
全文	管理人、集合计划管理人、本集合计划管理人	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	集合计划份额、份额	基金份额
全文	集合资产管理计划资产管理合同、《集合计划合同》、本合同、合同、集合计划合同、资产管理合同、本集合计划合同	基金合同、《基金合同》、本基金合同
全文	产品资料概要	基金产品资料概要
全文	指定报刊、指定媒介、指定网站	规定报刊、规定媒介、规定网站
全文	登记机构、份额登记机构	基金份额登记机构、基金登记机构
第一部分 基金的历史沿革	<p>中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划由中金安心回报集合资产管理计划变更而来。</p> <p>根据中国证监会于2018年11月30日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》(证监会公告〔2018〕39号)的规定,中金安心回报集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。</p>	<p>基金的历史沿革:中金安心回报混合型证券投资基金由中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更注册而来,中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划由中金安心回报集合资产管理计划变更而来。</p> <p>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&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》(证监会公告〔2018〕39号)的规定,中金安心回报集合资产管理计划已完成产品的规范验收并向中国证监会申请合同变更。</p> <p>根据《基金法》、《运作办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定,中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划经中国证监会2025年8月28日证监许可〔2025〕【1885】号文准予变更注册,中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更管理人,管理人由中国国际金融股份有限公司变更为其全资控股子公司中金基金管理有限公司;中金安心回报灵活配</p>

		<p>置混合型集合资产管理计划变更为中金安心回报混合型证券投资基金，即本基金。《中金安心回报混合型证券投资基金基金合同》自 2025 年【】月【】日生效，《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。</p>
<p><b>第二部分 前言</b></p>	<p>一、订立本合同的目的、依据和原则</p> <p>1、订立本合同的目的是保护投资人合法权益，明确合同当事人的权利义务，规范中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划运作。</p> <p>二、集合资产管理计划资产管理合同(以下简称“集合计划合同”)是规定集合计划合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与集合资产管理计划相关的涉及集合计划合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与集合计划合同有冲突，均以集合计划合同为准。集合计划合同当事人按照《基金法》、集合计划合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>集合计划合同的当事人包括集合计划管理人(以下简称“管理人”)、集合计划托管人(以下简称“托管人”)和集合计划份额持有人。集合计划投资人自依本合同取得集合计划份额，即成为集合计划份额持有人和本合同的当事人，其持有集合计划份额的行为本身即表明其对集合计划合同的承认和接受。</p> <p>三、中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“集合计划”)由中金安心回报集合资产管理计划变更而来，中金安心回报集合资产管理计划由管理人依照《证券公司客户资产管理业务试行办法》(证监会令第 17 号)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(证监会公告[2008]26 号)、《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)核准设立。</p> <p>中国证监会对中金安心回报集合资产管理计划变更为本集合计划批准，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。</p> <p>六、集合计划参与内地与香港股票市场交易互联互通机制(以下简称“港股通机制”)下港股通相关业务，集合计划资产投资于港股，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</p>	<p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>1、订立本基金合同的目的是保护投资人合法权益，明确基金合同当事人的权利义务，规范基金运作。</p> <p>二、基金合同是规定基金合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与基金相关的涉及基金合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与基金合同有冲突，均以基金合同为准。基金合同当事人按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p> <p>基金合同的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资人自依本基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受。</p> <p>三、中国证监会对中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划变更为本基金的注册，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。</p> <p>六、本基金参与内地与香港股票市场交易互联互通机制(以下简称“港股通机制”)下港股通相关业务，基金资产投资于港股，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</p>

	<p>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。具体风险烦请查阅招募说明书的风险揭示章节的具体内容。</p> <p>七、本合同关于集合计划产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行。</p>	<p>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。具体风险烦请查阅本基金招募说明书的风险揭示章节的具体内容。</p> <p>本基金可投资存托凭证,除普通股票投资可能面临的宏观经济风险、政策风险、市场风险、流动性风险外,还将面临存托凭证持有人与持有基础股票的股东在法律地位享有权利等方面存在差异可能引发的风险、发行人采用协议控制架构的风险、增发基础证券可能导致的存托凭证持有人权益被摊薄的风险、交易机制相关风险、存托凭证退市风险等其他风险。</p> <p>为对冲信用风险,本基金可能投资于信用衍生品。信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险等。</p> <p>七、当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行相应程序后,可以启用侧袋机制,具体详见基金合同和招募说明书的有关章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,投资者不得办理侧袋账户份额的申购赎回等业务。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。</p>
<p><b>第三部分 释义</b></p>	<p>在本合同中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:</p> <p>1、集合资产管理计划:指中国国际金融股份有限公司设立管理的投资者人数不受 200 人限制的集合资产管理计划</p> <p>8、产品资料概要:指《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划产品资料概要》及其更新(本合同关于集合计划产品资料概要的编制、披露及更新等内容,将不晚于 2020 年 9 月 1 日起执行)</p> <p>16、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或中国银行保险监督管理委员会</p> <p>20、合格境外机构投资者:指符合相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的集合资产管理计划的中国境外的机构投资者</p>	<p>在本基金合同中,除非文意另有所指,下列词语或简称具有如下含义:</p> <p>7、基金产品资料概要:指《中金安心回报混合型证券投资基金基金产品资料概要》及其更新</p> <p>15、银行业监督管理机构:指中国人民银行和/或国家金融监督管理总局</p> <p>19、合格境外投资者:指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》(包括其不时修订)及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者,包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者</p>

<p>21、人民币合格境外机构投资者：指按照《人民币合格境外机构投资者境内证券投资试点办法》及相关法律法规规定，运用来自境外的人民币资金进行境内证券投资的境外法人</p> <p>22、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者以及法律法规或中国证监会允许购买集合资产管理计划的其他投资人的合称</p> <p>30、集合计划合同生效日：指《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》的生效日，原《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效</p> <p>32、存续期：指《中金安心回报灵活配置混合型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不定期期限</p> <p>36、开放日：指为投资人办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人有权根据实际情况决定本集合计划暂停申购、赎回及转换业务并公告）</p> <p>51、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的全国性报刊及指定互联网网站（包括管理人网站、托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介</p> <p>53、摆动定价机制：指当开放式集合资产管理计划遭遇大额申购赎回时，通过调整集合资产管理计划份额净值的方式，将集合资产管理计划调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量集合资产管理计划份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待</p> <p>55、A类份额：指在投资者申购时收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的集合计</p>	<p>20、投资人、投资者：指个人投资者、机构投资者、合格境外投资者以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资人的合称</p> <p>28、基金合同生效日：指《中金安心回报混合型证券投资基金基金合同》的生效日，原《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效</p> <p>30、存续期：指《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限</p> <p>34、开放日：指为投资人办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人有权根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回或其他业务，具体以届时发布的公告为准）</p> <p>49、规定媒介：指符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊及《信息披露办法》规定的互联网网站（包括基金管理人网站、基金托管人网站、中国证监会基金电子披露网站）等媒介</p> <p>50、销售服务费：指从基金财产中计提的，用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务的费用</p> <p>52、摆动定价机制：指当本基金遭遇大额申购赎回时，通过调整基金份额净值的方式，将基金调整投资组合的市场冲击成本分配给实际申购、赎回的投资者，从而减少对存量基金份额持有人利益的不利影响，确保投资人的合法权益不受损害并得到公平对待</p> <p>53、基金份额类别：指本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，各基金份额类别分别设置代码，分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值</p> <p>54、A类基金份额：指在投资者申购时收取申购费用，赎回时收取赎回费但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额 对于投资者依据《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》获得的中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划A类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金A类基金份额</p> <p>55、C类基金份额：指在投资者申购时不收取申购费</p>
--	--

	<p>划份额</p> <p>56、C类份额：指从本类别集合计划资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，但不收取申购费用的集合计划份额</p>	<p>用，赎回时收取赎回费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额</p> <p>对于投资者依据《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》获得的中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划C类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金C类基金份额</p> <p>56、内地与香港股票市场交易互联互通机制：指上海证券交易所、深圳证券交易所分别和香港联合交易所有限公司（以下简称“香港联合交易所”）建立技术连接，使内地和香港投资者可以通过当地证券公司或经纪商买卖规定范围内的对方交易所上市的股票。内地与香港股票市场交易互联互通机制包括沪港股票市场交易互联互通机制和深港股票市场交易互联互通机制</p> <p>57、港股通：指内地投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票</p> <p>58、信用衍生品：指符合证券交易所或银行间市场相关业务规则，专门用于管理信用风险的信用衍生工具</p> <p>59、信用保护买方：亦称信用保护购买方，指接受信用风险保护的一方</p> <p>60、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，是提供信用风险保护的一方</p> <p>61、名义本金：亦称交易名义本金，是一笔信用衍生产品交易提供信用风险保护的金额，各项支付和结算以此金额为计算基准</p> <p>62、侧袋机制：指将基金投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</p> <p>63、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产</p>
<p><b>第四部分</b> <b>基金的基本</b> <b>情况</b></p>	<p>二、集合计划的类别 混合型</p> <p>四、集合计划的投资目标 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券等大类资产中充分挖掘市场轮动机会、利用潜在投资价值，</p>	<p>二、基金的类别 混合型证券投资基金</p> <p>四、基金的投资目标 本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。</p>

	<p>力求实现集合计划资产的持续稳定增值。</p> <p>六、集合计划存续期限 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 11 月 30 日。本集合计划自 2025 年 11 月 30 日后，按照中国证监会有关规定执行。如 2025 年 11 月 30 日后，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，无须召开集合份额持有人大会。</p> <p>七、集合计划份额的类别 本集合计划根据申购费用、赎回费用收取方式的不同，将集合计划份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的集合计划份额，称为 A 类集合计划份额；从本类别集合计划资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用，而不收取申购费用的集合计划份额，称为 C 类集合计划份额。 本集合计划份额 A 类和 C 类集合计划份额分别设置代码。由于集合计划费用的不同，本集合计划 A 类份额和 C 类份额将分别计算份额净值，计算公式为计算日各别资产净值除以计算日发售在外的该类别集合计划份额总数。 投资者可自行选择申购的份额类别，但不同集合计划份额类别之间不得相互转换。 根据集合计划运作情况，集合计划管理人可以在不违反法律法规、集合计划合同约定以及对已有集合计划份额持有人权益无实质性不利影响的情况下，经与集合计划托管人协商一致，在履行适当程序后停止对现有集合计划份额类别的销售或者调整现有集合计划份额类别的费率水平或者增加新的集合计划份额类别等，调整前集合计划管理人需及时公告。</p>	<p>六、基金存续期限 不定期</p> <p>七、基金份额的类别 本基金根据申购费用、赎回费用收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，赎回时收取赎回费但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额；投资者申购时不收取申购费用，赎回时收取赎回费但从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。 本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算并公告基金份额净值，计算公式为计算日各别基金份额的基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。 投资者可自行选择申购的基金份额类别。 对于投资者依据《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》获得的中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划 A 类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金 A 类基金份额；对于投资者依据《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》获得的中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划 C 类份额，自基金合同生效之日起全部自动转换为本基金 C 类基金份额。A 类、C 类基金份额每个开放日开放申购、赎回业务。有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。根据基金销售情况，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与基金托管人协商一致，在履行适当程序后，可以增加、减少或调整基金份额类别，或者对基金份额分类办法及规则进行调整，或者在法律法规和基金合同规定的范围内调整现有基金份额类别的申购费率、调低销售服务费率或变更收费方式、或者停止现有基金份额类别的销售等，调整实施前基金管理人应依照《信息披露办法》的规定公告，不需要召开基金份额持有人大会。</p>
第五部分	集合计划合同生效后，连续 20 个工作日出现集合	基金合同生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持

<p><b>基金的存续</b></p>	<p>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 50 个工作日出现前述情形的，本集合计划将根据集合计划合同的约定清算并终止，且无需召开集合计划份额持有人大会。</p> <p>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 11 月 30 日。本集合计划自 2025 年 11 月 30 日后，按照中国证监会有关规定执行。如 2025 年 11 月 30 日后，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，无须召开集合计划份额持有人大会。</p>	<p>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 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当于 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、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会。</p>
<p><b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b></p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本集合计划的申购与赎回将通过销售机构进行，具体的销售机构将由管理人在招募说明书或其他相关公告中列明。管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在管理人网站公示。集合计划投资者应当在销售机构办理集合计划销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理集合计划份额的申购与赎回。</p> <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理集合计划份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本集合计划参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则管理人有权根据实际情况决定本集合计划暂停申购、赎回及转换业务并公告），但管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本集合计划合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>集合计划合同生效后，若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>管理人可根据实际情况依法决定本集合计划开始办理申购的具体日期，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。</p> <p>管理人自集合计划合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</p> <p>在确定申购开始与赎回开始时间后，管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规</p>	<p>一、申购和赎回场所</p> <p>本基金的申购与赎回将通过销售机构进行，具体的销售机构将由基金管理人在招募说明书或其网站列明。基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并在基金管理人网站公示。基金投资者应当在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金份额的申购与赎回。</p> <p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间</p> <p>投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间（若本基金投资港股通标的股票且该工作日为非港股通交易日，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回或其他业务，具体以届时发布的公告为准），但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>基金合同生效后，若出现新的证券/期货市场、证券/期货交易所交易时间变更或其他特殊情况，基金管理人将视情况对前述开放日及开放时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金合同生效后，基金管理人可根据实际情况依法决定本基金开始办理申购、赎回的具体日期，具体业务办理时间在相关公告中规定。</p>

<p>定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</p> <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>集合计划份额持有人递交赎回申请，赎回成立；登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，管理人将在 T+7 日(包括该日)内支付赎回款项。遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其他非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程时，赎回款项顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。在发生巨额赎回或本合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本集合计划合同有关条款处理。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本集合计划份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。T 日的各类集合计划份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本集合计划赎回金额的计算详见《招募说明书》。本集合计划的赎回费率由管理人决定，并在招募说明书、产品资料</p>	<p>三、申购与赎回的原则</p> <p>6、投资者办理申购、赎回等业务时，应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>1、申购和赎回的申请方式</p> <p>投资人在提交申购申请时须按销售机构规定的方式备足申购资金，投资人在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回申请不成立。</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>基金份额持有人递交赎回申请，赎回成立；基金份额登记机构确认赎回时，赎回生效。投资者赎回申请生效后，基金管理人将在 T+7 日（包括该日）内支付赎回款项。在发生巨额赎回或本基金合同载明的延缓支付赎回款项的情形时，款项的支付办法参照本基金合同有关条款处理。</p> <p>证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障、港股通交易系统或港股通资金交收规则限制或其他非基金管理人及基金托管人所能控制的因素影响业务处理流程，则赎回款项划付时间相应顺延。</p> <p>4、基金管理人可以在不违反法律法规的前提下，对上述业务办理时间进行调整，并提前公告。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本基金各类基金份额净值的计算，保留到小数点后 4 位，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的收益或损失由基金财产承担。T 日的各类基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，经履行适当程序，可以适当延迟计算或公告。</p> <p>3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金的赎回费率由基金管理人决定，并在招募说明书、基金产品资料概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当</p>
--	---

<p>概要中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日该类集合计划份额净值并扣除应计提的业绩报酬（如有）及其他相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由集合计划财产承担。</p> <p>4、申购费用由投资人承担，不列入集合计划财产。</p> <p>5、赎回费用由赎回集合计划份额的集合计划份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回集合计划份额时收取。赎回费用归入集合计划财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入集合计划财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入集合计划财产。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有集合计划份额持有人利益时。</p> <p>7、管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有集合计划份额的比例达到或者超过50%，或者变相规避50%集中度的情形。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、8项暂停申购情形之一且管理人决定暂停接受投资人申购申请时，管理人应当根据有关规定在指定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第7项情形时，管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>	<p>日该类基金份额净值并扣除相应的费用，赎回金额单位为元。上述计算结果均按四舍五入方法，保留到小数点后2位，由此产生的收益或损失由基金财产承担。</p> <p>4、本基金A类基金份额的申购费用由申购本基金A类基金份额的投资人承担，不列入基金财产。C类基金份额不收取申购费用。</p> <p>5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.50%的赎回费，并全额计入基金财产。</p> <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资人的申购申请：</p> <p>4、接受某笔或某些申购申请可能会影响或损害现有基金份额持有人利益或对存量基金份额持有人利益构成潜在重大不利影响时。</p> <p>7、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金销售支付结算机构或登记机构的异常情况导致基金销售系统、基金销售支付结算系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</p> <p>9、基金参与港股通交易且港股通交易每日额度不足。</p> <p>发生上述第1、2、3、5、6、7、9、10项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受投资人申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。发生上述第8项情形时，基金管理人可以采取比例确认等方式对该投资人的申购申请进行限制，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分申购申请。如果投资人的申购申请被全部或部分拒绝，被拒绝部分的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p>
--	---

<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(3) 在出现巨额赎回时,对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额 10% 以上的赎回申请,管理人可以对超过的部分全部进行延期办理,具体措施如下:延期的赎回申请将自动与下一个开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日的该类集合计划份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如该单个集合计划份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,未能赎回部分作自动延期赎回处理。对于此类持有人未超过上述比例的部分,管理人有权根据前述“(1)全额赎回”或“(2)部分延期赎回”的方式与其他持有人的赎回申请一并办理。但是,如此类持有人在提交赎回申请时选择取消赎回,则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。</p> <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>2、如发生暂停的时间为 1 日,管理人应于重新开放日,在指定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的各类集合计划份额净值。</p> <p>3、若暂停时间超过 1 日,则管理人可以根据《信息披露办法》的有关规定,最迟于重新开放申购或赎回日,在指定媒介上刊登集合计划重新开放申购或赎回公告,并公布最近 1 个开放日的各类集合计划份额净值;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。</p> <p>十五、集合计划份额的冻结和解冻</p> <p>登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计</p>	<p>2、巨额赎回的处理方式</p> <p>(3) 在出现巨额赎回时,对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金总份额 25% 以上的赎回申请,基金管理人可以对该单个基金份额持有人当日赎回申请中超过上一开放日基金总份额 25% 以上的部分进行延期办理。具体措施如下:延期的赎回申请将自动与下一个开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日该类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如该单个基金份额持有人在提交赎回申请时未作明确选择,未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>对于该单个基金份额持有人当日赎回申请中未超过上一开放日基金总份额 25% (含 25%) 的赎回申请与其他持有人的赎回申请,基金管理人应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例,确定当日受理的赎回份额;对于未能赎回部分,投资人在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的,将自动转入下一个开放日继续赎回,直到全部赎回为止;选择取消赎回的,当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理,无优先权并以下一开放日该类基金份额净值为基础计算赎回金额,以此类推,直到全部赎回为止。如投资人在提交赎回申请时未作明确选择,投资人未能赎回部分作自动延期赎回处理。</p> <p>十、暂停申购或赎回的公告和重新开放申购或赎回的公告</p> <p>2、基金管理人可以根据暂停申购或赎回的时间,最迟于重新开放日在规定媒介上刊登重新开放申购或赎回的公告;也可以根据实际情况在暂停公告中明确重新开放申购或赎回的时间,届时不再另行发布重新开放的公告。</p> <p>十五、基金份额的冻结和解冻</p> <p>基金登记机构只受理国家有权机关依法要求的基金</p>
---	--

	<p>划份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。</p> <p>十七、如相关法律法规允许管理人办理其他集合计划业务,管理人将制定和实施相应的业务规则。</p>	<p>份额的冻结与解冻,以及登记机构认可、符合法律法规的其他情况下的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的,被冻结基金份额所产生的权益一并冻结,法律法规、中国证监会或法院判决、裁定另有规定的除外。</p> <p>十七、实施侧袋机制期间本基金的申购与赎回本基金实施侧袋机制的,本基金的申购和赎回安排详见招募说明书或相关公告。</p> <p>十八、其他业务 在不违反法律法规及中国证监会规定的前提下,基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情形下,经与基金托管人协商一致后,办理基金份额的质押业务或其他基金业务,基金管理人可制定相应的业务规则,并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告。</p> <p>十九、基金管理人可在不违反相关法律法规、不对基金份额持有人利益产生不利影响的前提下,根据届时具体情况对上述申购和赎回等安排进行补充和调整并提前公告。</p>
<p><b>第七部分 基金合同 当事人及 权利义务</b></p>	<p>一、管理人</p> <p>(一) 管理人简况 名称:中国国际金融股份有限公司 住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层 法定代表人:陈亮 设立日期:1995年7月31日 组织形式:股份有限公司 注册资本:436866.7868万元人民币 联系电话:010-65061166</p> <p>(二) 管理人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,管理人的义务包括但不限于:</p> <p>(16)按规定保存集合计划财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;</p> <p>二、托管人</p> <p>(一) 托管人简况 法定代表人:李民吉</p>	<p>一、基金管理人</p> <p>(一) 基金管理人简况 名称:中金基金管理有限公司 住所:北京市朝阳区建国门外大街1号国贸写字楼2座26层05室 法定代表人:李金泽 设立日期:2014年2月10日 批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可[2014]97号 组织形式:有限责任公司 注册资本:人民币7亿元 联系电话:010-63211122</p> <p>(二) 基金管理人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,管理人的义务包括但不限于:</p> <p>(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限;</p> <p>二、基金托管人</p> <p>(一) 基金托管人简况</p>

	<p>(二) 托管人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(2) 设立专门的托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉托管业务的专职人员，负责集合计划财产托管事宜；</p> <p>(11) 保存集合计划托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；</p> <p>(12) 建立并保存集合计划份额持有人名册；</p> <p>三、集合计划份额持有人</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划份额持有人的义务包括但不限于：</p>	<p>法定代表人：杨书剑</p> <p>(二) 基金托管人的权利与义务</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：</p> <p>(2) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；</p> <p>(11) 保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不低于法律法规规定的最低期限；</p> <p>(12) 从基金管理人或其委托的登记机构处接收并保存基金份额持有人名册；</p> <p>三、基金份额持有人</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：</p> <p>(9) 遵守基金管理人、基金托管人、销售机构和登记机构的相关交易及业务规则；</p>
<p><b>第八部分</b></p> <p><b>基金份额持有人大会</b></p>	<p>一、召开事由</p> <p>2、在法律法规规定和《集合计划合同》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，以下情况可由管理人和托管人协商后修改，不需召开集合计划份额持有人大会：</p> <p>(2) 调整本集合计划的申购费率、调低赎回费率或变更收费方式；</p> <p>3、集合计划合同生效后，连续 50 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，本集合计划将根据集合计划合同的约定清算并终止，且无需召开集合计划份额持有人大会。</p> <p>四、集合计划份额持有人出席会议的方式</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指集合计划份额持有人</p>	<p>一、召开事由</p> <p>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后修改，不需召开基金份额持有人大会：</p> <p>(2) 调整本基金的申购费率、调低销售服务费率或变更收费方式；</p> <p>(3) 履行适当程序后，增加、减少或调整本基金的基金份额类别、对基金份额分类办法及规则进行调整、停止现有基金份额类别的销售；</p> <p>(6) 调整有关基金申购、赎回、转换、定期定额投资、非交易过户、转托管等业务规则；</p> <p>(7) 履行适当程序后，基金推出新业务或服务；</p> <p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对</p>

将其对表决事项的投票以书面形式或集合计划合同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集合计划合同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：

(2) 召集人按集合计划合同约定通知托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）到指定地点对书面表决意见的计票进行监督。会议召集人在托管人（如果托管人为召集人，则为管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取份额持有人的书面表决意见；托管人或管理人经通知不参加收取书面表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，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）；若本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见集合计划份额持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一，召集人可以在原公告的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项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）集合计划份额的集合计划份额持有人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具书面意见的集合计划份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有集合计划份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的集合计划份额持有人持有集合计划份额的凭证及集合计划份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《集合计划合同》和会议通知的规定，并与集合计划登记机构记录相符。

#### 六、表决

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的集合计划份额持有人所代表的集合计划份额总数。

表决事项的投票以书面形式或基金合同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基金合同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：

(2) 召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

(3) 本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）基金份额的基金份额持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的基金份额持有人持有基金份额的凭证及基金份额持有人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符。

#### 六、表决

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具表决意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## 七、计票

### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在托管人授权代表（若由托管人召集，则为管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。管理人或托管人拒派代表对书面表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 七、计票

### 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。基金管理人或基金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。

## 九、实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的特殊约定

若本基金实施侧袋机制，则相关基金份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例，但若相关基金份额持有人大会召集和审议事项不涉及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的基金份额或表决权符合该等比例：

- 1、基金份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关基金份额 10%以上（含 10%）；
- 2、现场开会的到会者在权益登记日代表的基金份额不少于本基金在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；
- 3、通讯开会的直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日相关基金份额的二分之一（含二分之一）；
- 4、在参与基金份额持有人大会投票的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日相关基金份额的二分之一、召集人在原公告的基金份额持有人大会召开时间的 3 个月以后、6 个月以内就原定审议事项重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关基金份额的持有人参与或授权他人参与基金份额持有人大会投票；
- 5、现场开会由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人；
- 6、一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；
- 7、特别决议应当经参加大会的基金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。

同一主侧袋账户内的每份基金份额具有平等的表决权。

<p><b>第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序</b></p>	<p>一、管理人和托管人职责终止的情形</p> <p>(一) 管理人职责终止的情形</p> <p>4、管理人在对本合同无实质性修改的前提下, 将本集合计划变更注册为其独资或控股的公募基金管理人管理的公募基金;</p> <p>二、管理人和托管人的更换程序</p> <p>(二) 管理人更换的特殊程序</p> <p>在管理人和托管人协商一致的基础上, 管理人有权在本合同无实质性修改的前提下, 将本计划变更注册为其独资或控股的公募基金管理人的公募基金, 前述管理人变更事项无需召开集合计划份额持有人大会审议, 但管理人应当按照法律法规和中国证监会的要求办理相关程序, 并按照《信息披露办法》的规定在指定媒介公告。</p> <p>三、新任或临时管理人接收集合计划管理业务前或新任或临时托管人接收集合计划财产和集合计划托管业务前, 原任管理人或原任托管人应依据法律法规和《集合计划合同》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。原任管理人或原任托管人在继续履行相关职责期间, 仍有权按照本合同的规定收取集合计划管理费、业绩报酬或集合计划托管费。</p>	<p>一、管理人和托管人职责终止的情形</p> <p>(一) 管理人职责终止的情形</p> <p>二、管理人和托管人的更换程序</p> <p>三、新任或临时基金管理人接收基金管理业务前或新任或临时基金托管人接收基金财产和基金托管业务前, 原任基金管理人或原任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。原任基金管理人或原任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。</p>
<p><b>第十二部分 基金的投资</b></p>	<p>一、投资目标</p> <p>在严格控制风险和保持资产流动性的基础上, 通过灵活的资产配置, 在股票、固定收益证券等大类资产中充分挖掘市场轮动机会、利用潜在投资价值, 力求实现集合计划资产的持续稳定增值。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具, 包括股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、企业债、公司债、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、股指期货、国债期货、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具等, 以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。</p>	<p>一、投资目标</p> <p>本基金在控制风险的前提下, 通过积极主动的投资管理, 力争实现基金资产的长期稳健增值。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具, 包括国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括全市场公开募集的股票型ETF、基金管理人管理的股票型基金和计入权益类资产的混合型基金, 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非基金中基金、货币市场基金)、国内依法发行上市的股票(包含主板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制下允许买卖的香港联合交易所上市股票(以下简称“港股通标的股票”)、债券(包括国债、央行票据、金融债、公开发行的次级债、地方政府债、证券公司短期公司债券、企业债、公司债、政府支持债券、政府支持机构债券、可转换债券(含分离交易可转换债券)、可交换债券、短期融资券(含超短期融资券)、中期票</p>

集合计划的投资组合比例为：股票资产占集合计划资产比例为 0%-85%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。同业存单占集合计划资产比例不超过 20%。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

### 三、投资策略

#### 1、大类资产配置策略

依靠对大类资产配置和趋势研判的丰富实践与投资能力，结合系统化策略模型体系以及严格的风险预算机制，长期获取优异的绝对回报。大类资产配置层面，主要基于风险平价理念、长期资本市场预期收益和周期性动态资产配置确定资产摆布，在此基础上依赖短期战术配置模型调整权益敞口、债券久期等获取交易收益。大类资产内部，主要挖掘相对市场指数的超额收益。其中，股票资产内部主要通过风格、行业配置模型以及定性和定量相结合的选股策略获取超额收益；债券内部通过对不同类型、期限、评级以及信用个体的研判挖掘超额收益。

#### 2、股票投资策略

权益风险溢价（Equity Risk Premium）是国内外资产配置中常用的衡量股债相对估值的指标，其计算公式为股票盈利收益率（Earning Yield，即 P/E 的

据及其他经中国证监会允许投资的债券）、股指期货、国债期货、股票期权、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、信用衍生品以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于权益类资产及可转换债券、可交换债券资产的比例合计占基金资产的 10%-30%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%，投资于可转换债券及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%。其中，权益类资产包括股票、存托凭证、股票型基金和满足下述条件之一的混合型基金：（1）基金合同约定投资的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 60%；（2）根据基金披露的定期报告，最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%。本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金投资比例不超过基金资产净值的 10%。本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

### 三、投资策略

#### （一）资产配置策略

本基金在综合分析国内外宏观经济和资本市场的基础上，通过定性和定量相结合的“自上而下”研究，形成对大类资产的预测，在基金合同约定的范围内确定债券、权益、现金等各类资产的配置比例，并随着各类证券风险收益特征的相对变化，动态调整大类资产的投资比例。

#### （二）债券投资策略

##### 1、债券类属配置策略

本基金将通过研究宏观经济运行状况、货币市场及资本市场资金供求关系，分析国债、金融债、公司债、企业债、短融和中期票据等不同债券板块之间的相对投资价值，确定组合资产在不同债券类属之间配置比例并根据市场变化进行调整。

##### 2、期限结构配置策略

本基金对同一类属收益率曲线形态和期限结构变动

倒数)减去债券收益率。权益风险溢价越高意味着股票相对债券的估值越低,长期投资价值越大,反之亦然。基于国内市场实际情况,我们采用沪深300的盈率收益率和中债5年AAA企业债到期收益率进行计算。

1)当权益风险溢价连续10个交易日处于近5年历史最高5%分位时,本集合计划股票资产占集合净资产的比例为20%-65%;

2)当权益风险溢价连续10个交易日处于近5年历史最低5%分位时,本集合计划股票资产占集合净资产的比例为0%-45%;

3)除上述两种情况意外,本集合计划股票资产占集合净资产的比例将根据中金公司资产管理部股票量化资产配置模型进行分档。中金公司资产管理部股票量化资产配置模型结合投研团队长期的实战经验和严格历史量化回测,综合考虑动能、估值、情绪、流动性、经济基本面、盈利基本面和外围因素等七大类因子对股市的影响,通过系统化、科学化的打分规则,对权益市场给出看多,中性或看空的观点。在运行过程中,每个因子都依据当期数据,单独对股市形成独立的多空判断,模型整体的多空观点由七类因子简单平均加权获得。模型考虑的七大类因子解释如下:1)动能,即股票市场过去一段时间的绝对收益和夏普比率。国内外的学术研究均证实,由于市场对新信息的定价有一定滞,股市表现出一定的动能效应,即过去一段市场上涨的情况下,未来上涨概率较高,反之亦然;2)估值,即市盈率、市净率和权益风险溢价等指标,估值越低,未来的长期回报越高;3)情绪,即期权隐含波动率,资金流入等指标,实践表明,市场情绪越乐观,股市对利好消息的定价越充分,未来市场短期回报往往会下降,反之亦然;4)流动性,即中央银行政策率和货币增速等,流动性越充裕,市场风险偏好往往越高,反之亦然;5)经济基本面,即PMI等指标,经济处于上行周期时,股票等风险资产回报往往较高,反之亦然;6)盈利基本面,即EPS增速,分析师盈利预期等指标,上市公司盈利向好时,股票市场回报往往较高,反之亦然;7)外围因素,即全球股市表现,人民币汇率等指标,全球股市向好,人民币升值期间,股票市场回报往往较高,反之亦然。当模型观点为看多时,本集合计划股票资产占集合净资产的比例为40%-85%;当模型观点为中性时,本集合计划股票资产占集合净资产的比例为20%-65%;当模

进行分析,在给定组合久期以及其他组合约束条件的情形下,确定最优的期限结构。本基金期限结构调整的配置方式包括子弹策略、哑铃策略和梯形策略等。

### 3、利率策略

本基金通过对经济运行状况,分析宏观经济运行可能情景的研判,预测财政政策、货币政策等宏观经济政策取向,分析金融市场资金供求状况变化趋势及结构,在此基础上预测金融市场利率水平变动趋势以及金融市场收益率曲线斜度变化趋势。组合久期是反映利率风险最重要的指标,根据对市场利率水平的变化趋势的预期,可以制定出组合的目标久期。如果预期利率下降,本基金将增加组合的久期,力争获得债券价格上升带来的收益;反之,本基金将缩短组合的久期,力争减小债券价格下降带来的风险。

### 4、信用债券投资策略

本基金通过自下而上的策略,在信用类固定收益金融工具中精选个券,结合适度分散的行业配置策略,构造并优化投资组合。

本基金投资的信用债券(包含资产支持证券,下同)中,其经国内依法成立并拥有证券评级资质的信用评级机构认定的债项评级须在AA+及以上,评级机构为中债资信评级除外,前述品种无债项评级或债项评级为短期信用评级的则参考担保方评级(若有)或主体评级。其中,信用评级为AAA的信用债投资占信用债资产的比例不低于50%;信用评级为AA+的信用债投资占信用债资产的比例不超过50%。如出现多家评级机构所出具信用评级不同的情况,基金管理人还需结合自身的内部信用评级进行独立判断与认定。本基金持有信用债期间,如果其信用评级下降不再符合前述标准,应在评级报告发布之日起3个月内调整至符合约定。

#### (1) 买入并持有策略

买入并持有策略是指选择信用风险可承担,期限与收益率相对合理的信用类产品持有到期,获取票息收益。选择买入并持有策略时,基金选券的原则包括:

1) 债券的信用风险可承担。通过对债券的信用风险和收益进行分析,选择收益率较高、信用风险可承担的债券品种。

2) 债券的信用利差合理。债券信用利差有明显的周期性变化,本基金可在信用利差较高并有减小趋势的情况下,加大买入并持有策略的力度。

3) 债券的期限合理。根据利率市场的波动性,在相对高利率环境下,选择期限较长的品种,在相对低利率环境下,选择期限较短的品种。

型观点为看空时,本集合计划股票资产占集合净资产的比例为0%-45%。

对于港股通投资,本集合计划通过自上而下及自下而上相结合的方法挖掘港股优质公司,构建股票投资组合:核心思路在于:自上而下地分析行业的增长前景、行业结构、商业模式、竞争要素等分析把握其投资机会;自下而上地评判企业的核心竞争力、管理层、治理结构等以及其所提供的产品和服务是否契合未来行业增长的大趋势,对企业基本面和估值水平进行综合的研判,深度挖掘优质的个股。

### 3、债券投资策略

债券方面,在战术调整久期基础上,结合投资经理对经济基本面、资金面及政策面的预期、对市场风险偏好变化的把握以及对收益率曲线形态变化的判断,制定债券资产在利率债、信用债、非公开等券种上的久期与信用等级摆布,并找寻收益率曲线上凸点、骑乘等交易型机会进行配置。在确定债券种类、评级、期限等多个组合条件基础上,借助管理人强大的全信用覆盖研究能力、内部评级打分体系与债券池管理制度,配置风险可控、票息合适的优秀标的。信用安全是我们债券配置的红线。同时通过对每日一级与二级的实时监测,充分挖掘市场潜在的 alpha 机会、找寻信用风险可控前提下定价错误的个债,提升组合 YTM 与资本利得收益。

可转换债券、可交换债券投资策略方面,主要包括:转债价值策略、正股趋势策略和条款博弈策略。转债价值策略:可转换债券的理论价值应等于普通债券的债券价值和可转换债券自身内含的期权价值之和核心期权价值定价结合定量模型和定性分析综合计算。正股趋势策略:转债核心驱动力还是依靠优秀的正股表现,买入持有处于中期上涨趋势的正股的转债。选择具有核心竞争力、具备持续成长能力且估值具有吸引力的上市公司,获取公司成长和估值提升带来的双重收益,进而通过正股的中期上涨趋势在转债上获得超越市场的超额回报。在选择个股时,主要关注公司的成长性和估值两方面因素。条款博弈策略:充分发掘各项条款博弈给可转换债券带来的套利机会。

### 4、股指期货投资策略

投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的期货合约,并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判,以及对股指期货合约的估值定价,与股票现货资产进行

### (2) 行业配置策略

基于深入的宏观信用环境、行业发展趋势等基本面研究,本基金将运用定性定量模型,在自下而上的个债精选策略基础上,采取适度分散的行业配置策略,从组合层面动态优化风险收益。

### (3) 利差轮动策略

信用债券的利差受到经济周期、行业周期等因素的影响具有周期性变化的特征,本基金将结合对经济周期和行业周期的判断,在预期利差将变大的情况下卖出此类债券,在预期利差缩小的情况下买入此类债券,以获取利差收益。

### 5、骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时,即相邻期限利差较大时,本基金将适当买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,即收益率水平处于相对高位的债券。随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券收益率的下滑,力争获得资本利得收益。

### 6、息差策略

息差策略是指利用回购等方式融入低成本资金,购买较高收益的债券,以期获取超额收益的操作方式。

### (三) 股票投资策略

#### 1、A 股投资策略

在资产配置基础上,本基金通过定性和定量相结合的分析方法构建股票投资组合。定性方法通过“自下而上”为主,“自上而下”为辅的研究方法挖掘基本面优质的上市公司,严选安全边际较高的股票。定量方法基于公司的基本面信息和交易类数据,综合盈利能力、成长空间、市场估值、价格动量等多维度表现来衡量股票投资价值,优选投资价值较高的股票。基于定性分析与定量研究的收益预测,权衡组合潜在风险,构建收益风险特征符合资产配置需要的股票投资组合。

#### 2、港股通标的股票投资策略

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港股票市场,不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。本基金投资港股通标的股票除适用上述 A 股投资策略外,还需关注:1)香港与内地股票市场存在的制度差异对股票投资价值的潜在影响;2)港股通每日额度应用情况;3)人民币与港币间的汇兑比率变化等。

#### 3、存托凭证投资策略

本基金投资存托凭证的策略依照上述股票投资策略执行。

匹配,实现多头或空头的套期保值操作,由此获得股票组合产生的超额收益。本集合计划在运用股指期货时,将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征,对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险,以改善投资组合的风险收益特性。

#### 5、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定,以套期保值为目的,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证资产安全的基础上,力求实现资产的长期稳定增值。

#### 6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本集合计划将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

#### (四)可转换债券、可交换债券投资策略

本基金在综合分析可转换债券、可交换债券的股性特征、债性特征、流动性等因素的基础上,审慎筛选其中安全边际较高、发行条款相对优惠、流动性良好,以及基础股票基本面优良的品种,并以合理的价格买入,争取稳健的投资回报。

#### (五)信用衍生品投资策略

本基金按照风险管理的原则,以风险对冲为目的参与信用衍生品交易。投资过程将结合账户内债券潜在信用风险、流动性等情况综合考量进行组合配置,通过购买对应信用衍生品全部或部分覆盖配置相应债券的信用风险。

#### (六)国债期货投资策略

本基金投资国债期货,以套期保值为主要目的,将根据风险管理的原则,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

#### (七)股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的量化研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,并与现货资产进行匹配,在法律法规允许的范围内,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

#### (八)股票期权投资策略

本基金投资股票期权将按照风险管理的原则,以套期保值为目的,结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求,确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。

#### (九)融资业务投资策略

本基金将在风险可控的前提下,本着谨慎原则,适度参与融资交易。本基金将利用融资买入证券作为组合流动性管理工具,提高基金的资金使用效率,以融入资金满足基金现货交易、期货交易、赎回款支付等流动性需求。

#### (十)基金投资策略

本基金投资于全市场公开募集的股票型ETF、基金管理人管理的股票型基金和计入权益类资产的混合型基金。上述应计入权益类资产的混合型基金需符合下列两个条件之一:

- 1)基金合同约定股票资产投资比例应不低于基金资产的60%;
- 2)最近四个季度定期报告披露的股票资产投资比例

<p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>集合计划的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 股票资产占集合计划资产比例为 0%-85%(其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%);</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;</p>	<p>均不低于基金资产的 60%。</p> <p>基金投资策略致力于选择能够较好满足资产配置需要和具备超额收益潜力的基金,通过采用定量与定性相结合的研究方法进行基金筛选并完成组合构建。基金投资策略具体包括定量评估、定性评估和基金投资。具体为:</p> <p>(1) 定量评估</p> <p>对于被动管理型基金,在满足资产配置需要的方向中,通过评估产品规模、费率、流动性、跟踪误差等因素选取较优基金进行配置。对于主动管理型产品,在对基金经理进行有效风格识别的前提下,优选具备长期可持续超额收益能力的产品进行配置。</p> <p>(2) 定性评估</p> <p>本基金将通过尽职调查对基金产品进行定性评估,作为对于定量分析的补充。尽职调查的重点包括了解基金经理的投资框架和理念,分析投资策略的有效性和适用性等。</p> <p>(3) 基金投资</p> <p>结合定量和定性研究结论,根据本基金的投资决策流程审慎选取投资标的,在权衡风险收益特征后,最终科学合理构建出投资组合并适时进行动态调整。</p> <p>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,本基金可以相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>(1) 本基金投资于权益类资产及可转换债券、可交换债券资产的比例合计占基金资产的 10%-30%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%,投资于可转换债券及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%。其中,权益类资产包括股票、存托凭证、股票型基金和满足下述条件之一的混合型基金: 1) 基金合同约定投资的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 60%; 2) 根据基金披露的定期报告,最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%;</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>(3) 本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开</p>	<p>均不低于基金资产的 60%。</p> <p>基金投资策略致力于选择能够较好满足资产配置需要和具备超额收益潜力的基金,通过采用定量与定性相结合的研究方法进行基金筛选并完成组合构建。基金投资策略具体包括定量评估、定性评估和基金投资。具体为:</p> <p>(1) 定量评估</p> <p>对于被动管理型基金,在满足资产配置需要的方向中,通过评估产品规模、费率、流动性、跟踪误差等因素选取较优基金进行配置。对于主动管理型产品,在对基金经理进行有效风格识别的前提下,优选具备长期可持续超额收益能力的产品进行配置。</p> <p>(2) 定性评估</p> <p>本基金将通过尽职调查对基金产品进行定性评估,作为对于定量分析的补充。尽职调查的重点包括了解基金经理的投资框架和理念,分析投资策略的有效性和适用性等。</p> <p>(3) 基金投资</p> <p>结合定量和定性研究结论,根据本基金的投资决策流程审慎选取投资标的,在权衡风险收益特征后,最终科学合理构建出投资组合并适时进行动态调整。</p> <p>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,本基金可以相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>基金的投资组合应遵循以下限制:</p> <p>(1) 本基金投资于权益类资产及可转换债券、可交换债券资产的比例合计占基金资产的 10%-30%,投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%,投资于可转换债券及可交换债券的比例合计不超过基金资产的 20%。其中,权益类资产包括股票、存托凭证、股票型基金和满足下述条件之一的混合型基金: 1) 基金合同约定投资的股票及存托凭证资产占基金资产的比例不低于 60%; 2) 根据基金披露的定期报告,最近四个季度中任一季度股票及存托凭证资产占基金资产比例均不低于 60%;</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;</p> <p>(3) 本基金对经中国证监会依法核准或注册的公开</p>
---	--	--

<p>(3) 本集合计划持有一家公司发行的证券, 其市值(同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算) 不超过集合计划资产净值的 10%;</p> <p>(4) 本集合计划管理人管理的全部集合资产管理计划持有一家公司发行的证券(同一家公司在境内和香港市场同时上市的 A+H 股合并计算), 不超过该证券的 10%, 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划品种可以不受此条款规定的比例限制;</p> <p>(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;</p> <p>(11) 本集合计划进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过集合计划资产净值的 40%, 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, 债券回购到期后不展期;</p> <p>(12) 本集合计划管理人管理的全部开放式集合资产管理计划(包括开放式集合资产管理计划以及处于开放期的定期开放集合资产管理计划)持有一家公司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%; 本管理人管理的全部投资组合持有一家公司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 30%;</p> <p>(13) 本集合计划投资股指期货、国债期货的, 应当遵守下列限制:</p> <p>2) 在任何交易日日终, 持有的买入股指期货和国债期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过集合计划资产净值的 95%。其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;</p> <p>3) 在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过集合计划持有的股票总市值的 20%; 在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的 20%; 本集合计划所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计(轧差计算)应当</p>	<p>募集证券投资基金投资比例不超过基金资产净值的 10%;</p> <p>(4) 本基金投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%;</p> <p>(5) 本基金持有一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额), 其市值(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算) 不超过基金资产净值的 10%;</p> <p>(6) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额), 其市值(同一家公司在内地和香港同时上市的 A+H 股合计计算) 不超过该证券的 10%, 完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制;</p> <p>(11) 本基金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;</p> <p>(13) 本基金参与股指期货、国债期货交易, 应当遵守下列要求:</p> <p>2) 在任何交易日日终, 持有的买入国债期货合约和股指期货合约价值与有价证券市值之和, 不得超过基金资产净值的 95%, 其中, 有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;</p> <p>3) 在任何交易日日终, 持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;</p> <p>4) 本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值, 合计(轧差计算) 应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定;</p> <p>5) 在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值</p>
---	---

<p>符合《集合计划合同》关于股票投资比例的有关约定;</p> <p>4) 在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过集合计划资产净值的15%;在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过集合计划持有的债券总市值的30%;本集合计划所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合《集合计划合同》关于债券投资比例的有关约定;在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日集合计划资产净值的30%;</p> <p>(14)本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、集合计划规模变动等管理人之外的因素致使集合计划不符合该比例限制的,管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(17) 同业存单占集合计划资产比例不超过20%;</p>	<p>的20%;</p> <p>6) 在任何交易日日终,本基金持有的买入国债期货合约价值,不得超过基金资产净值的15%;</p> <p>7) 在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的30%;</p> <p>8) 在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的30%;</p> <p>9) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;</p> <p>(14) 本基金参与股票期权交易的,应当遵守下列要求:</p> <p>1) 因未平仓的期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的10%;</p> <p>2) 开仓卖出认购期权的,应持有足额标的证券;开仓卖出认沽期权的,应持有合约行权所需的全额现金或交易所规则认可的可冲抵期权保证金的现金等价物;</p> <p>3) 未平仓的期权合约面值不得超过基金资产净值的20%。其中,合约面值按照行权价乘以合约乘数计算;</p> <p>(15) 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%;本基金管理人管理的全部投资组合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30%;完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受前述比例限制;</p> <p>(16) 本基金主动投资于流动性受限资产(含封闭运作基金及定期开放式基金等流通受限基金)的市值合计不得超过该基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;</p> <p>(18) 本基金参与信用衍生品交易的,应当遵守下列要求:</p> <p>1) 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;</p> <p>2) 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%;</p> <p>3) 本基金投资于同一信用保护卖方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%;</p>
--	---

除上述第(2)、(9)、(14)、(15)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,管理人应当在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。法律法规另有规定的,从其规定。

## 2、禁止行为

(4) 买卖其他集合资产管理计划份额或基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

## 五、业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为中债新综合全价指数收益率×益率×全中证 800 指数收益率×数收益率恒生指数收益率×生指数金融机构人民币活期存款基准利率(税后)后机构

本集合计划是混合型。本集合计划采用“中证 800 指数”、“中债新综合全价指数收益率”、“恒生指数收益率”和“金融机构人民币活期存款基准利率(税后)”分别作为股票、债券、港股和现金类资产投资的比较基准,并将业绩比较基准中股票指数、债券指数与现金类资产的权重确定为 30%、65%和 5%,基于指数的权威性和代表性以及本集合计划的投资范围和投资理念,选用该业绩比较基准能够真实、客观的反映本集合计划的风险收益特征。

## 六、风险收益特征

本集合计划为混合型集合资产管理计划,预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、债券型集合资产管理计划,低于股票型基金、股票型集

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不符合本款所规定比例限制的,基金管理人应在 3 个月之内进行调整;

(19) 本基金参与融资业务后,在任何交易日日终,本基金持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的 95%;

(20) 本基金投资存托凭证的比例限制依照内地上市交易的股票执行,与内地上市交易的股票合并计算;

(22) 本基金管理人管理的全部基金(ETF 联接基金除外)持有单只基金不超过被投资基金净资产的 20%,被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准;

(23) 本基金投资其他基金时,被投资基金的运作期限应当不少于 1 年,最近定期报告披露的基金净资产应当不低于 1 亿元;

除上述第(2)、(11)、(16)、(17)、(18)、(22)项外,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 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。因证券市场波动、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前款第(22)项规定的比例的,基金管理人应当在 20 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

## 2、禁止行为

(4) 买卖其他基金份额,但是中国证监会另有规定的除外;

## 五、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为中债新综合全价指数收益率×75%+中证 800 指数收益率×15%+恒生指数收益率(使用估值汇率调整)×使用估金融机构人民币活期存款基准利率(税后)×后机

本基金采用“中证 800 指数”、“中债新综合全价指数收益率”、“恒生指数收益率”和“金融机构人民币活期存款基准利率(税后)”分别作为股票、债券、港股和现金类资产投资的比较基准,并将业绩比较基准中股票指数、债券指数与现金类资产的权重确定为 20%、75%和 5%,基于指数的权威性和代表性以及本基金的投资范围和投资理念,选用该业绩比较基准能

	<p>合资产管理计划。</p> <p>七、管理人代表集合计划行使股票或债权人权利的处理原则及方法</p>	<p>够真实、客观的反映本基金的风险收益特征。</p> <p>六、风险收益特征 本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。 本基金投资于港股通标的股票，还需面临汇率风险、香港市场风险等境外证券市场投资所面临的特别投资风险。</p> <p>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</p> <p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排 当基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护基金份额持有人利益的原则，基金管理人经与基金托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及基金合同的约定启用侧袋机制。 侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。 侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规定。</p>
<p><b>第十四部分 基金资产估值</b></p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p>	<p>四、估值方法</p> <p>1、上市有价证券的估值</p> <p>(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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且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；</p> <p>(2) 对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值；</p> <p>(3) 对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种（另有规定的除外），选取估值日第三方估值基准服务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。对于含投资者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选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，同时充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。回售登记期截止</p>

<p>(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;</p> <p>(5) 交易所上市不存在活跃市场的有价证券, 采用估值技术确定公允价值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券, 采用估值技术确定公允价值;</p> <p>(6) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券, 对存在活跃市场的情况下, 应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值; 对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下, 应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值; 对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下, 应采用估值技术确定其公允价值。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(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;</p> <p>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。</p> <p>4、同一债券或股票同时在两个或两个以上市场交易的, 按债券或股票所处的市场分别估值。</p> <p>5、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。</p> <p>6、股指期货合约、国债期货合约一般以估值当日结算价进行估值, 估值日无结算价的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化的, 采用最近交易日结算价估值。</p> <p>7、估值计算中涉及港币对人民币汇率的, 以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率</p>	<p>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;</p> <p>(4) 对于在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, 实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价; 实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。</p> <p>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理:</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票, 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;</p> <p>(3) 对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种, 应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值;</p> <p>3、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。</p> <p>4、期货合约以估值日的结算价估值。估值当日无结算价的, 且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的, 采用最近交易日结算价估值。</p> <p>5、港股通投资持有外币证券资产估值涉及到港币、美元、英镑、欧元、日元等主要货币对人民币汇率的, 应当以基金估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。</p> <p>6、对于按照中国法律法规和基金投资内地与香港股票市场交易互联互通机制涉及的境外交易场所所在地的法律法规规定应交纳的各项税金, 本基金将按权责发生制原则进行估值; 对于因税收规定调整或其他原因导致基金实际交纳税金与估算的应交税金有差异的, 基金将在相关税金调整日或实际支付日进行相</p>
---	--

<p>中间价为准。</p> <p>8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>五、估值程序</p> <p>1、各类集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，该类集合计划资产净值除以当日该类集合计划份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点</p>	<p>应的估值调整。</p> <p>7、基金估值方法</p> <p>(1) 投资于非上市证券投资基金的估值： 投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的基金份额净值估值。</p> <p>(2) 投资于交易所上市基金的估值</p> <p>1) 投资的交易型开放式证券投资基金，按所投资的交易型开放式证券投资基金估值日的收盘价估值；</p> <p>2) 境内上市开放式基金（LOF）按其估值日的份额净值估值；</p> <p>3) 境内上市定期开放式基金、封闭式基金按其估值日的收盘价估值。</p> <p>(3) 如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情况，根据以下原则进行估值：</p> <p>①以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本基金估值频率一致但未公布估值日基金份额净值，按其最近公布的基金份额净值为基础估值；</p> <p>②以所投资基金的收盘价估值的，若估值日无交易，且最近交易日后市场环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后市场环境发生了重大变化的，可使用最新的基金份额净值为基础或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，确定公允价值；</p> <p>③如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分，基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位基金份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。</p> <p>8、本基金投资存托凭证的估值核算，依照境内上市交易的股票执行。</p> <p>9、信用衍生品的估值方法：信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价进行估值，但基金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、行业协会的相关规定及企业会计准则要求采用合理估值技术确定公允价值。</p> <p>10、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p> <p>五、估值程序</p> <p>1、各类基金份额净值是按照每个工作日闭市后，该类基金份额的基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5</p>
--	--

	<p>后第5位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>管理人每个工作日计算集合计划资产净值及各类集合计划份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将当日的集合计划资产净值和各类集合计划份额净值结果发送托管人，经托管人复核无误后，由管理人按规定对外公布。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>3、当前一估值日集合计划资产净值 50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停估值；</p> <p>九、特殊情况的处理</p> <p>(1) 管理人或托管人按集合计划合同约定的估值方法第8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；</p>	<p>位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人每个估值日计算基金资产净值及各类基金份额净值，并按规定公告。</p> <p>2、基金管理人应每个估值日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个估值日对基金资产估值后，将当日的基金资产净值和各类基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人按规定对外公布。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>3、当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，基金管理人应当暂停估值；</p> <p>九、特殊情况的处理</p> <p>(1) 基金管理人或基金托管人按基金合同约定的估值方法第10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；</p> <p>十、实施侧袋机制期间的基金资产估值</p> <p>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。</p>
<p><b>第十五部分 基金费用与税收</b></p>	<p>二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、管理人的管理费</p> <p>本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的【1.0】%年费率计提。管理费的计算方法如下：</p> $H = E \text{ 费 } 【1.0】\% \cdot \text{当年天数}$ <p>E 为前一日的集合计划资产净值</p> <p>2、托管人的托管费</p> <p>本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>E 为前一日的集合计划资产净值</p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p>1、基金管理人的管理费</p> <p>本基金投资于本基金管理人管理的其他基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.60%年费率计提。基金管理费的计算方法如下：</p> $H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$ <p>E 为前一日基金资产净值扣除基金所持有本基金管理人管理的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0。</p> <p>2、基金托管人的托管费</p> <p>本基金投资于本基金托管人所托管的其他基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金所持有本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分的 0.15%的年费率计</p>

<p>3、C类份额的销售服务费</p> <p>本集合计划A类份额不收取销售服务费,C类份额销售服务费年费率为【0.4】%。</p> <p>本集合计划销售服务费按前一日C类集合计划资产净值的【0.4】%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:</p> $H = E \text{ 费 } 【0.4】\% \cdot \text{当年天数}$ <p>C类份额的销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付,管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系托管人协商解决。</p> <p>三、不列入集合计划费用的项目</p> <p>3、《集合计划合同》生效前的相关费用;</p> <p>四、集合计划税收</p>	<p>提。基金托管费的计算方法如下:</p> <p>E为前一日的基金资产净值扣除基金所持有本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分,若为负数,则E取0。</p> <p>3、C类基金份额的销售服务费</p> <p>本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额销售服务费年费率为0.40%。</p> <p>本基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$ <p>C类基金份额的销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用按照《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》相关标准执行;</p> <p>基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的(ETF除外),应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费(按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取、并计入基金财产的赎回费用除外)、销售服务费等销售费用。</p> <p>四、基金税收</p> <p>本基金支付给基金管理人、基金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。</p> <p>五、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费,详见招募说明书的规定。</p>	<p>提。基金托管费的计算方法如下:</p> <p>E为前一日的基金资产净值扣除基金所持有本基金托管人托管的其他基金份额所对应资产净值后剩余部分,若为负数,则E取0。</p> <p>3、C类基金份额的销售服务费</p> <p>本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额销售服务费年费率为0.40%。</p> <p>本基金销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值的0.40%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:</p> $H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$ <p>C类基金份额的销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。</p> <p>三、不列入基金费用的项目</p> <p>3、《基金合同》生效前的相关费用按照《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》相关标准执行;</p> <p>基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的(ETF除外),应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费(按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取、并计入基金财产的赎回费用除外)、销售服务费等销售费用。</p> <p>四、基金税收</p> <p>本基金支付给基金管理人、基金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。</p> <p>五、实施侧袋机制期间的基金费用</p> <p>本基金实施侧袋机制的,与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支,但应待侧袋账户资产变现后方可列支,有关费用可酌情收取或减免,但不得收取管理费,详见招募说明书的规定。</p>
---	--	--

<p><b>第十六部分 基金的收益与分配</b></p>	<p>三、集合计划收益分配原则</p> <p>3、集合计划收益分配后集合计划份额净值不能低于面值，即集合计划收益分配基准日的某类集合计划份额净值减去每单位该类集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p>	<p>三、基金收益分配原则</p> <p>3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去相应类别的每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>七、实施侧袋机制期间的收益分配</p> <p>本基金实施侧袋机制的，侧袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。</p>
<p><b>第十七部分 基金的会计与审计</b></p>	<p>一、集合计划会计政策</p> <p>1、管理人为本集合计划的会计责任方；</p> <p>二、集合计划的年度审计</p> <p>1、管理人聘请与管理人、托管人相互独立的具有证券、期货相关业务资格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。</p>	<p>一、基金会计政策</p> <p>1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；</p> <p>二、基金的年度审计</p> <p>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《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基金的年度财务报表进行审计。</p>
<p><b>第十八部分 基金的信息披露</b></p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>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中国证监会指定的全国性报刊（以下简称“指定报刊”）及指定互联网网站（以下简称“指定网站”）等媒介披露，并保证集合计划投资者能够按照《集合计划合同》约定的时间和方式查阅或者复制公开披露的信息资料。</p> <p>五、公开披露的集合计划信息</p> <p>（五）集合计划定期报告，包括年度报告、中期报告和季度报告</p> <p>管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。年度报告中的财务会计报告应当经过具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计。</p> <p>（六）临时报告</p>	<p>二、信息披露义务人</p> <p>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符合中国证监会规定条件的用以进行信息披露的全国性报刊（以下简称“规定报刊”）及《信息披露办法》规定的互联网网站（以下简称“规定网站”）等媒介披露，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。</p> <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>（五）基金定期报告，包括年度报告、中期报告和季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。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。</p> <p>（六）临时报告</p> <p>20、本基金推出新业务或服务；</p> <p>21、调整基金份额类别设置；</p> <p>（九）证券投资基金的投资情况</p> <p>基金管理人在定期报告和招募说明书等文件中应设立专门章节披露投资于其他基金的相关情况并揭示相关风险：1、投资策略、持仓情况、损益情况、净值披露时间等；2、交易及持有基金产生的费用，包</p>

		<p>括申购费、赎回费、销售服务费、管理费、托管费等；</p> <p>3、本基金持有的基金发生的重大影响事件，如转换运作方式、与其他基金合并、终止基金合同以及召开基金份额持有人大会等；4、本基金投资于基金管理人以及基金管理人关联方管理基金的情况。</p> <p>（十四）投资股票期权的信息披露 基金管理人应在定期信息披露文件中披露参与股票期权交易的有关情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标、估值方法等，并充分揭示股票期权交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。</p> <p>（十五）参与融资业务的信息披露 基金管理人应当在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露参与融资情况，包括投资策略、业务开展情况、损益情况、风险及其管理情况等。</p> <p>（十六）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、基金中期报告、基金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。</p> <p>（十八）实施侧袋机制期间的信息披露 本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</p> <p>八、暂停或延迟披露基金相关信息的情形 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、基金暂停估值的情形； 3、法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情况。</p>
<p><b>第十九部分 基金合同的变更、终止与基金财产的清算</b></p>	<p>三、集合计划财产的清算</p> <p>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管理人、托管人、具有证券、期货相关业务资格的注册会计师、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。</p> <p>4、集合计划财产清算程序：</p>	<p>三、基金财产的清算</p> <p>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《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。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p> <p>4、基金财产清算程序：</p>

	<p>(1)《集合计划合同》终止情形出现时,由集合计划财产清算小组统一接管集合计划;</p> <p>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具有证券、期货相关业务资格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,集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上,并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。</p> <p>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托管人保存15年以上。</p>	<p>(1)《基金合同》终止情形出现时,由基金财产清算小组统一接管基金财产;</p> <p>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《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。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5个工作日内由基金财产清算小组进行公告,基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上,并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>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低于法律法规规定的最低期限。</p>
<b>第二十一部分 争议的处理和适用的法律</b>	<p>各方当事人同意,因《集合计划合同》而产生的或与《集合计划合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会并按其届时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,仲裁费用和律师费用由败诉方承担。</p>	<p>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,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会并按其届时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的,对各方当事人均有约束力,仲裁费用和律师费用由败诉方承担。</p>
<b>第二十二部分 基金合同的效力</b>	<p>1、《集合计划合同》经管理人向中国证监会提交变更《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》的申请并经中国证监会批准后,于2020年4月30日起生效,原《中金安心回报集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。</p> <p>4、《集合计划合同》正本一式六份,除上报有关监管机构一份外,管理人、托管人各持有一份,每份具有同等的法律效力。</p>	<p>《基金合同》是约定基金合同当事人之间权利义务关系的法律文件。</p> <p>1、《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名或盖章并经基金管理人向中国证监会提交变更申请、并经中国证监会注册,自基金管理人公告的生效之日起生效,《中金安心回报灵活配置混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效;</p> <p>4、《基金合同》正本一式三份,除上报有关监管机构一份外,基金管理人、基金托管人各持有一份,每份具有同等的法律效力。</p>