

---

# 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 六个月滚动持有债券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](http://www.citicsam.com)）及《中国证券报》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六个月滚动持有债券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六个月滚动持有债券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，中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会 2019 年 8 月 13 日《关于同意中信证券假日理财集合资产管理计划合同变更的函》（机构部函【2019】1982 号）准予，由中信证券假日理财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《中信证券六个月滚动持有债券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 2019 年 8 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六个月滚动持有债券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：“中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会表决专用”。

- 5、短信授权的提交（仅适用于个人投资者）

短信授权按本公告规定的方式回复至集合计划管理人指定的短信平台。

- 6、网络授权的提交（仅适用于个人投资者）

网络授权按本公告规定的方式回复至集合计划管理人指定的网络平台。

## 二、会议审议事项

《关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》（以下简称“议案”）（见附件一）。

上述议案的内容说明见《关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的说明》（见附件二）。

---

### 三、权益登记日

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

### 四、投票方式

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

2、集合计划份额持有人应当按照表决票的要求填写相关内容，其中：

（1）个人投资者自行投票的，需在表决票上签字，并提供本人有效身份证件（指本人在销售机构开户或参与本集合计划时使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；如前述证件或证明有更新，需提供最新）正反面复印件；

（2）机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章或经有效授权书等形式授权的业务公章（以下合称“公章”），并提供加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等）；合格境外机构投资者自行投票的，需在表决票上加盖本单位公章（如有）或由授权代表在表决票上签字（如无公章），并提供该授权代表的有效身份证件（指本人使用的有效身份证、护照或其他能够表明其身份的有效证件或证明）的复印件，该合格境外机构投资者所签署的授权委托书或者证明该授权代表有权代表该合格境外机构投资者签署表决票的其他证明文件，以及该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件；

（3）个人投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由个人投资者填妥并签署的授权委托书原件（详见附件四），并提供个人投资者的有效身份证件（指本人在销售机构开户或参与本集合计划时使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；如前述证件或证明有更新，需提供最新）正反面复印件。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有

---

权部门的批文或开户证明复印件等）；

（4）机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，代理人应提供由机构投资者填妥的授权委托书原件（详见附件四）并在授权委托书上加盖该机构公章，并提供该机构投资者加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等）。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（指本人使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；如前述证件或证明有更新，需提供最新）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等）；

（5）合格境外机构投资者委托他人投票的，应由代理人在表决票上签字或盖章，以及取得合格境外机构投资者资格的证明文件的复印件和填妥的授权委托书原件（详见附件四），并提供该合格境外机构投资者的营业执照、商业登记证或者其他有效注册登记证明复印件。如代理人为个人，还需提供代理人的有效身份证件（指本人使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；如前述证件或证明有更新，需提供最新）正反面复印件；如代理人为机构，还需提供代理人的加盖公章的营业执照复印件（事业单位、社会团体或其他单位可使用加盖公章的事业单位法人登记证书、有权部门的批文或开户证明复印件等）；

**（6）以上各项及本公告正文全文中的公章、批文、开户证明及登记证书等文件，以集合计划管理人的认可为准。**

3、集合计划份额持有人或其代理人需将填妥的表决票和所需的相关文件自2025年5月15日起，至2025年6月20日17:00止（以本公告列明的表决票收件人收到表决票的时间为准）通过专人送交、邮寄送达至下述收件人：

收件人：中信证券资产管理有限公司客户服务中心

地址：浙江省杭州市滨江区东信大道66号东方通信城D座3层

邮政编码：310000

联系人：邱宏学

联系电话：0571-86078183

请在信封背面注明：“中信证券六个月滚动持有债券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持有人大会的，除非授权文件另有载明，否则本次集合计划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持有人大会的通知。

### 五、计票

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

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

3、表决票效力的认定如下：

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

（2）表决票填写完整清晰，所提供文件符合本公告规定，且在截止时间之前送达本公告指定联系地址的，为有效表决票；有效表决票按表决意见计入相应

---

的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

（3）如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。投资者不能修改表决票的内容（包括但不限于：通过增加任何文字对表决意见进行限制或增加前提），否则均视为“弃权”。

（4）如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明集合计划份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

（5）集合计划份额持有人重复提交表决票的，如各表决票表决意见相同，则视为同一表决票；如各表决票表决意见不相同，则按如下原则处理：

1）送达时间不是同一天的，以最后送达的填写有效的表决票为准，先送达的表决票视为被撤回；

2）送达时间为同一天的，视为在同一表决票上做出了不同表决意见，计入弃权表决票。

## **六、决议生效条件**

本次会议召开的条件为：全体有效的参与表决的（含本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见）的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一（含二分之一）。

本会议表决的票数要求为：本次议案按特别决议处理，须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效。

集合计划份额持有人大会的决议，自表决通过之日起生效。集合计划份额持有人大会决定的事项，集合计划管理人应当自决定作出之日起5日内报中国证监会备案。集合计划份额持有人大会决议自生效之日起2日内在规定媒介上公告。

---

## 七、重新召集集合计划份额持有人大会及重新授权

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《资产管理合同》的规定，本次集合计划份额持有人大会需要全体有效的参与表决（含本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见）的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日集合计划总份额的二分之一（含二分之一）方可举行。如果本次集合计划份额持有人大会不符合前述要求而不能够成功召开，本集合计划管理人可在规定时间内就同一议案重新召集集合计划份额持有人大会。重新召集的集合计划份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）集合计划份额的持有人参加（含本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见），方可召开。**重新召开集合计划份额持有人大会时，除非授权文件另有载明，集合计划份额持有人依据本公告为参与本次集合计划份额持有人大会做出的各类授权依然有效。**但如果授权方式发生变化或者集合计划份额持有人重新作出授权，则以最新方式或最新授权为准，详细说明见届时发布的重新召集集合计划份额持有人大会的通知。

若在规定时间内就同一议案重新召开集合计划份额持有人大会，除非集合计划份额持有人作出新的有效表决，集合计划份额持有人依据本公告为参与本次集合计划份额持有人大会做出的各类表决依然有效，详细说明见届时发布的重新召集集合计划份额持有人大会的通知。

## 八、本次大会相关机构

1、召集人：中信证券资产管理有限公司

联系地址：北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层

联系电话：95548-5

联系人：统一客户联络中心

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

2、托管人：中信银行股份有限公司

3、公证机构：北京市方圆公证处

联系地址：北京市东城区东水井胡同 5 号北京 inn 大厦北京市方圆公证 523

联系电话：13671278926

---

联系人：叶欢江

4、见证律师事务所：上海市通力律师事务所

联系地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

联系电话：021-31358666

联系人：丁媛

## 九、重要提示

1、请集合计划份额持有人在提交表决票时，充分考虑邮寄在途时间，提前寄出表决票，确保表决票于表决截止时间（2025 年 6 月 20 日 17:00）前送达。

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

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

4、本公告的有关内容由中信证券资产管理有限公司负责解释。

中信证券资产管理有限公司

2025 年 5 月 13 日

附件一：《关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》

附件二：《关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的说明》

附件三：《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会表决票》

附件四：《授权委托书》

附件五：《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》修改前后对照表

---

附件一：

**关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册  
为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案**

中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划集合计划份额持有人：

中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是中信证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”或“管理人”）管理的一只债券型集合资产管理计划，于 2019 年 8 月 22 日完成公募化改造，托管人为中信银行股份有限公司。

为充分保护集合计划份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》等法律法规规定和《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的有关约定，管理人经与托管人中信银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会，提议按照《关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的说明》（详见附件二）的方案对本集合计划进行管理人变更和变更注册，同时对《资产管理合同》的相关条款进行修改。若《资产管理合同》有效期限内管理人获得中国证监会批复的公募基金管理人资格或在符合监管要求的前提下《资产管理合同》可以继续延长期限，则中信证券资产管理有限公司有权不进行上述变更管理人和变更注册事项。

同时，为保证顺利实施本集合计划的变更注册方案，本次持有人大会议案通过后，集合计划管理人可视情况暂停本集合计划的申购、赎回业务，暂停申购、赎回的具体安排以后续公告为准，请投资者注意查看。修改后的基金合同等法律文件自基金管理人华夏基金管理有限公司（以下简称“华夏基金”）公告的生效之日起生效，后续重新开放申购赎回业务办理时间亦以基金管理人华夏基金公告为准，请投资者注意登录华夏基金网站（[www.chinaamc.com](http://www.chinaamc.com)）查看。

---

本次集合计划份额持有人大会决议生效后，管理人将在正式变更前安排不少于 5 个交易日的赎回选择期，以供集合计划份额持有人做出选择（如赎回等），赎回选择期内赎回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，由于需应对赎回等情况，集合计划份额持有人同意豁免《资产管理合同》中约定的投资组合比例限制等条款。

本议案需根据《资产管理合同》成功召开集合计划份额持有人大会，并由参加大会的集合计划份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。本议案如获得集合计划份额持有人大会审议通过，为实施产品变更管理人等变更注册方案，同意授权管理人办理本集合计划变更注册及法律文件修改的有关具体事宜，包括但不限于根据相关情况，决定采取相关集合计划变更的措施以及确定集合计划变更各项工作的具体时间，并授权管理人可根据实际情况做相应调整。具体安排详见届时发布的相关公告。

以上议案，请予审议。

集合计划管理人：中信证券资产管理有限公司

---

附件二：

关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册  
为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的说明

一、重要提示

（一）根据中国证监会于 2018 年 11 月 28 日发布的《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》（证监会公告〔2018〕39 号，以下简称“《操作指引》”）的规定，中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）经中国证监会 2019 年 8 月 13 日《关于同意中信证券假日理财集合资产管理计划合同变更的函》（机构部函【2019】1982 号）准予，由中信证券假日理财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《中信证券六个月滚动持有债券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 2019 年 8 月 22 日生效。

本集合计划管理人为中信证券资产管理有限公司（以下简称“集合计划管理人”或“管理人”），集合计划托管人为中信银行股份有限公司。根据《操作指引》及《资产管理合同》对本集合计划存续期限的约定，本集合计划将于 2025 年 6 月 30 日到期。

鉴于以上情况，为充分保护集合计划份额持有人利益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《操作指引》等法律法规的规定及《资产管理合同》的约定，管理人经与托管人中信银行股份有限公司协商一致，决定以通讯方式召开集合计划份额持有人大会，审议集合计划管理人由中信证券资产管理有限公司变更为华夏基金管理有限公司（以下简称“华夏基金”），中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划相应变更注册为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案。若《资产管理合同》有效期限内管理人获得中国证监会批复的公募基金管理人资格或在符合监管要求的前提下《资产管理合同》可以继续延长期限，则中信证券资产管理有限公司有权不进行上述变更管理人和变更注册事项。

---

（二）本次中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人等事宜属于对原注册事项的实质性调整，经管理人向中国证监会申请，已经中国证监会准予变更注册。中国证监会准予此次变更注册不表明其对本集合计划的投资价值及市场前景做出实质性判断或保证。

（三）本次议案需经参加集合计划份额持有人大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方为有效，存在无法获得集合计划份额持有人大会表决通过的可能。

（四）集合计划份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，并需在通过之日起 5 日内报中国证监会备案。集合计划份额持有人大会决议自生效之日起 2 日内在规定媒介上公告。

## 二、本次变更涉及的《资产管理合同》等法律文件修改要点

### （一）变更产品名称

由“中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”变更为“华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金”。

### （二）变更产品管理人

由“中信证券资产管理有限公司”变更为“华夏基金管理有限公司”。

### （三）变更产品投资经理

由“中信证券资产管理有限公司旗下投资经理李天颖”变更为“华夏基金旗下基金经理武文琦”。

### （四）变更产品类型

由“债券型集合资产管理计划”变更为“债券型证券投资基金”。

### （五）变更产品存续期限

由“本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至 2025 年 6 月 30 日”变更为“不定期”。

### （六）调整投资范围及投资限制

投资范围新增“国债期货、信用衍生品”，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“国债期货投资策略”和“信用衍生品投资策略”；调整信用资产相关投资策略。

#### （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。

#### （九）调整业绩比较基准

由“中债综合财富(1年以下)指数收益率\*80%+一年期定期存款利率(税后)\*20%”调整为“中债综合（全价）指数收益率\*80%+一年期定期存款利率(税后)\*20%”。

最后，根据最新的法律法规的修订情况，对法律文件的相关内容一并进行了修订。

具体修订内容请见附件五：《中信证券六个月滚动持有债券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（如赎回等），赎回选择期内赎回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、赎回等。

#### 3、《华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》的生效

赎回选择期结束后，管理人将根据集合计划份额持有人大会决议执行本集合计划的正式变更，《华夏六个月滚动持有债券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的持有人，其持有的份额将默认结转为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金对应类别的基金份额。

4、本集合计划将于本次集合计划份额持有人大会决议生效后启动办理变更管理人及变更注册的相关交接手续。华夏基金将另行发布相关公告。

## 四、变更方案可行性

### （一）法律依据

《中华人民共和国证券投资基金法》第四十七条规定，“基金份额持有人大会由全体基金份额持有人组成，行使下列职权：……（二）决定修改基金合同的重要内容或者提前终止基金合同；（三）决定更换基金管理人、基金托管人……”。第八十六条规定，“……转换基金的运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止基金合同、与其他基金合并，应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上通过。”

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十八条的规定，“基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效”。

因此，本次份额持有人大会审议事项属于特别决议，需经参加大会的份额持有人或其代理人所持表决票的三分之二以上（含三分之二）通过，决议方可生效。本次变更管理人及修改《资产管理合同》有关事项的事宜符合相关法律法规要求，不存在法律层面的障碍。

### （二）技术层面

为了保障本次持有人大会的顺利召开，集合计划管理人成立了工作小组，筹备、执行持有人大会相关事宜。集合计划管理人与投资者进行了充分沟通，保证持有人大会可以顺利召开。本次持有人大会决议生效并公告后，将由基金管理人华夏基金通过官网等形式公告修订后的基金合同及托管协议，并在法律法规规定的时间内更新招募说明书。管理人、托管人已就本集合计划变更注册的有关事项进行了充分沟通和细致准备，技术可行。因此，本次变更注册方案不存在运营技术层面的障碍。

## 五、主要风险及预备措施

---

（一）集合计划份额持有人大会未能成功召集或议案未获得集合计划份额持有人大会表决通过的风险

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《资产管理合同》的规定，集合计划份额持有人大会应当满足由权益登记日代表集合计划总份额的二分之一以上（含二分之一）集合计划份额的持有人参加的召集成功条件，以及参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过的表决通过条件。为防范本次集合计划份额持有人大会不符合上述要求而不能成功召集或议案未获得集合计划份额持有人大会表决通过等情况，管理人将在会前尽可能与集合计划份额持有人进行预沟通，争取更多的持有人参加集合计划份额持有人大会。

（二）集合计划份额持有人集中赎回份额的流动性风险

为应对可能引发的大规模集中赎回，本集合计划会尽可能提前做好流动性安排，保持投资组合的流动性以应对可能的赎回，降低净值波动率。管理人将根据赎回情况及时对可能存在的市场投资风险进行有效评估，保持相对合理的仓位水平，科学有效地控制本集合计划的市场风险。

---

附件三：

**中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划  
集合计划份额持有人大会表决票**

集合计划份额持有人姓名/名称：

份额持有人证件号码（有效身份证件号/统一社会信用代码号等）：

基金账号（选填）：

代理人姓名/名称：

代理人证件号码（有效身份证件号/统一社会信用代码号等）：

表决事项：《关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》

表决结果：同意☐

反对☐

弃权☐

集合计划份额持有人（代理人）签字（盖章）

日期：

说明：

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

2、如表决票上的表决意见未选、多选或无法辨认，但其他各项符合本公告规定的，视为弃权表决，计入有效表决票；并按“弃权”计入对应的表决结果，其所代表的集合计划份额计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

如表决票上的签字或盖章部分填写不完整、不清晰的，或未能提供有效证明集合计划份额持有人身份或代理人经有效授权的证明文件的，或未能在截止时间之前

---

送达本公告规定的收件人的，均为无效表决票；无效表决票不计入参加本次集合计划份额持有人大会表决的集合计划份额总数。

若在规定时间内就同一议案重新召开集合计划份额持有人大会，除非集合计划份额持有人作出新的有效表决，否则上述表决票中的有效表决意见继续有效。

3、“份额持有人有效身份证件”指份额持有人在销售机构开户或参与本集合计划时使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；如前述证件或证明有更新，需提供最新。

4、“基金账号”仅指持有本集合计划份额的基金账号，同一集合计划份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有集合计划份额分别行使表决权的，应当准确填写基金账号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别等情况的，将被默认为代表此集合计划份额持有人所持有的本集合计划所有集合计划份额。

5、本表决票可从相关网站下载、从报纸上剪裁、复印或按此格式打印。

附件四：

## 授权委托书

兹全权委托 代表本人（或本机构）参加投票截止日为 2025 年 6 月 20 日 17:00 的以通讯方式召开的中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划集合计划份额持有人大会，并代为行使表决权。表决意见以受托人的表决意见为准。若在规定时间内就同一议案重新召开集合计划份额持有人大会，除授权方式发生变化或本人（或本机构）重新作出授权外，本授权继续有效。

委托人签字/盖章:

委托人有效身份证件号或统一社会信用代码号等:

基金账号（选填）：

受托人（或代理人）签字/盖章：

受托人（或代理人）有效身份证件号或统一社会信用代码号等：

委托日期:      年    月    日

说明:

- 1、本授权委托书可剪报、复印或按以上格式自制，在填写完整并签字盖章后均为有效。
- 2、“委托人有效身份证件”指委托人在销售机构开户或参与本集合计划时使用的有效身份证或其他能够表明其身份的有效证件或证明；如前述证件或证明有更新，需提供最新。
- 3、“基金账号”，仅指持有本集合计划份额的基金账号，同一集合计划份额持有人拥有多个此类账户且需要按照不同账户持有集合计划份额分别授权的，应当准确填写基金账号；其他情况可不必填写。此处空白、多填、错填、无法识别

---

等情况的，将被默认为代表此集合计划份额持有人所持有的本集合计划所有集合计划份额。

附件五：

《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》

修改前后对照表

| 章节      | 《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》条款                                                               | 《华夏六个月滚动持有债券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      | 中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划                                                                         | 华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金                                                                         |
| 全文      | 集合计划、计划、集合资产管理计划、本集合计划                                                                         | 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、集合计划份额持有人、集合计划持有人                                                                          | 基金份额持有人                                                                                    |
| 全文      | 集合计划投资者                                                                                        | 投资者、基金投资者、基金投资人                                                                            |
| 全文      | 集合计划销售机构、销售机构                                                                                  | 基金销售机构                                                                                     |
| 全文      | 集合计划份额、份额                                                                                      | 基金份额                                                                                       |
| 全文      | 资产管理合同、《资产管理合同》、本合同                                                                            | 基金合同、《基金合同》、本基金合同                                                                          |
| 全文      | 集合计划产品资料概要                                                                                     | 基金产品资料概要                                                                                   |
| 全文      | 指定媒介、指定网站、指定报刊                                                                                 | 规定媒介、规定网站、规定报刊                                                                             |
| 第一部分 前言 | <p>一、订立本资产管理合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以</p> | <p>一、订立本基金合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》（以下简称“《证券法》”）、《中华人民</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用&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》和其他有关法律法规。</p> <p>三、中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划由集合计划管理人依照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定变更，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）备案。</p> <p>中国证监会对本集合计划的备案，并不表明其对本集合计划的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。</p> | <p>共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）和其他有关法律法规。</p> <p>三、华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更而来，并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）准予变更注册。中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划由中信证券假日理财集合资产管理计划变更而来，中信证券假日理财集合资产管理计划由中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）依法募集，并经中国证监会核准设立。根据中信证券2023年11月1日发布的公告《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，中信证券根据监管要求及相应资产管理合同的有关约定，将原中信证券管理的19只集合资产管理计划的管理人变更为中信证券资产管理有限公司。</p> <p>中国证监会对中信证券假日理财集合资产管理计划变更为中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划的批准、中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更为本基金的变更注册，并不表明其对本基金的投资价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                |                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                 |
|----------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                | <p>投资者应当认真阅读集合计划招募说明书、资产管理合同、集合计划产品资料概要等信息披露文件，自主判断集合计划的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。</p> <p>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。</p>                                                                                  | <p>投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。投资者应当认真阅读并完全理解基金合同第二十部分规定的免责条款、第二十一部分规定的争议处理方式。</p> <p>六、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>八、投资者同意，按反洗钱与反恐怖融资等相关规定，基金管理人可将投资者信息提供给基金托管人。</p> |
| <b>第二部分 释义</b> | <p>在本资产管理合同中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：</p> <p>4、资产管理合同或《资产管理合同》：指《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》及对本资产管理合同的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书：指《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》及其更新</p> <p>8、《基金法》：指 2003 年 10 月 28 日经第十届全国人民代表大会</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>4、基金合同、《基金合同》或本基金合同：指《华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》及对本基金合同的任何有效修订和补充</p> <p>6、招募说明书或《招募说明书》：指《华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》及其更新</p> <p>8、《基金法》：指《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机</p>                                         |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>常务委员会第五次会议通过，经 2012 年 12 月 28 日第十一届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议修订，自 2013 年 6 月 1 日起实施，并经 2015 年 4 月 24 日第十二届全国人民代表大会常务委<br/>员会第十四次会议《全国人民代表大会常务委员会关于修改&lt;中华人民共和国港口法&gt;等七部法律的决定》修正的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>9、《销售办法》：指中国证监会 2013 年 3 月 15 日颁布、同年 6 月 1 日实施的《证券投资基金销售管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>10、《信息披露办法》：指中国证监会 2019 年 7 月 26 日颁布、同年 9 月 1 日实施的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《运作办法》：指中国证监会 2014 年 7 月 7 日颁布、同年 8 月 8 日实施的《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>12、《流动性风险管理规定》：指中国证监会 2017 年 8 月 31 日颁布、同年 10 月 1 日实施的《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>14、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>16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于基金的自然人</p> <p>18、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券</p> | <p>关对其不时做出的修订</p> <p>9、《销售办法》：指《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>10、《信息披露办法》：指《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>11、《运作办法》：指《公开募集证券投资基金运作管理办法》及颁布机关对其不时做出的修订</p> <p>12、《流动性风险管理规定》：指《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及颁布机关对其不时做出的修订</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p>投资管理办法》及相关法律法规规定可以投资于在中国境内依法募集的证券投资基金的中国境外的机构投资者</p> <p>19、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>20、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证券投资基金的其他投资者的合称</p> <p>23、销售机构：指集合计划管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与集合计划管理人签订了销售服务协议，办理销售业务的机构</p> <p>24、登记业务：指集合计划登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者集合计划账户的建立和管理、集合计划份额登记、销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管集合计划份额持有人名册和办理非交易过户等</p> <p>26、集合计划账户：指登记机构为投资者开立的、记录其持有的、集合计划管理人所管理的集合计划份额余额及其变动情况的账户</p> <p>27、集合计划交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资等业务而引起的集合计划份额变动及结余情况的账户</p> <p>28、资产管理合同生效日：指根据《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》变更后的《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》生效日</p> | <p>14、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等对银行业金融机构进行监督和管理的机构</p> <p>16、个人投资者：指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人</p> <p>18、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》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>19、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者的合称</p> <p>22、销售机构：指基金管理人以及符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金销售业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务协议，办理基金销售业务的机构</p> <p>23、登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括投资者基金账户的建立和管理、基金份额登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册和办理非交易过户等</p> |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>30、存续期：指资产管理合同生效至终止之间的期间</p> <p>31、运作期起始日：对于本资产管理合同生效前相应计划份额而言，第一个运作期起始日指资产管理合同生效日；对于每份申购份额而言，第一个运作期起始日指该计划份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份计划份额的下一运作期起始日，指该计划份额上一运作期到期日后的下一工作日</p> <p>32、运作期到期日：对于每份计划份额，第一个运作期到期日指资产管理合同生效日（对本资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）满 6 个月对应的月度对日，第二个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 12 个月对应的月度对日，第三个运作期到期日为资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满 18 个月对应的月度对日，以此类推</p> <p>33、月度对日：指资产管理合同生效日（对本资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或计划份额申购申请日（对申购份额而言，下同）在后续日历月中的对应日期，如没有对应日期或该日为非工作日的，则顺延至下一工作日</p> | <p>25、基金账户：指登记机构为投资者开立的、记录其持有的、由该登记机构登记的基金份额余额及其变动情况的账户</p> <p>26、基金交易账户：指销售机构为投资者开立的、记录投资者通过该销售机构办理基金申购、赎回、转换、转托管、定期定额投资等业务而引起的基金份额变动及结余情况的账户</p> <p>27、基金合同生效日：指《华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》生效日，《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》自同一日起失效</p> <p>29、存续期：指《中信证券假日理财集合资产管理计划资产管理合同》生效至本基金合同终止之间的不定期期限</p> <p>30、运作期起始日：对于每份申购份额而言，第一个运作期起始日指该基金份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份基金份额的下一运作期起始日，指该基金份额上一运作期到期日后的下一工作日。对于投资者在本基金基金合同生效日前持有的原中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额，第一个运作期起始日为原登记机构确认投资者持有原资产管理计划份额之日</p> <p>31、运作期到期日：对于每份申购的基金份额，第一个运作期到期日指基金份额申购申请日（对申购份额而言，下同）满 6 个月对应的月度对日，第二个运作期到期日为基金份额申购申请日满 12 个月对应的月度对日，第三个运作期到期日为基金份额申购申请日满 18 个月对应的月度对日，以此类推。对于投资者在本基金基金合同生效日前持有的原中信证券六个月滚动持有债券型集合</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>52、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的媒介</p> <p>53、集合计划份额的类别：本集合计划分设两类计划份额：A 类计划份额和 C 类计划份额。两类计划份额分设不同的代码，收取不同的销售服务费并分别计算公布集合计划份额净值</p> <p>54、A 类计划份额：指按照【0.3%】年费率计提销售服务费的集合计划份额</p> <p>55、C 类计划份额：指按照【0.01%】年费率计提销售服务费的集合计划份额</p> <p>62、大集合计划：指《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》规范的大集合产品</p> | <p>资产管理计划份额，第一个运作期起始日为原登记机构确认投资者持有该资产管理计划份额之日，运作期到期日为按原《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》约定的规则计算的运作期到期日</p> <p>32、月度对日：指某一日（对申购份额而言，下同）在后续日历月中的对应日期，如没有对应日期或该日为非工作日的，则顺延至下一工作日</p> <p>51、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>52、A 类基金份额：指按照【0.3%】年费率计提销售服务费的基金份额。原中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划 A 类计划份额，自本基金《基金合同》生效之日起亦将全部自动转换为本基金 A 类基金份额</p> <p>53、C 类基金份额：指按照【0.01%】年费率计提销售服务费的基金份额。原中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划 C 类计划份额，自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金 C 类基金份额</p> <p>61、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，</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | <p>专门用于管理信用风险的信用衍生工具。</p> <p>62、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>63、信用保护卖方：亦称信用保护提供方，指提供信用风险保护的一方</p> <p>64、信用衍生品名义本金：亦称交易名义本金，指一笔信用衍生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>                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 第三部分 基金的基本情况 | <p>三、集合计划的运作方式</p> <p>契约型开放式</p> <p>（1）每个运作期到期日前，集合计划份额持有人不能提出赎回申请对于每份计划份额，第一个运作期指资产管理合同生效日（对本资产管理合同生效前相应计划份额而言，下同）或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），至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满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，至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满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，至资产管理合同生效日或计划份额申购申请日满18个月对应的月度对日止。以此类推。</p> | <p>三、基金的运作方式</p> <p>契约型开放式</p> <p>（1）每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请对于每份申购的基金份额，第一个运作期指基金份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即第一个运作期起始日），至基金份额申购申请日满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，至基金份额申购申请日满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，至基金份额申购申请日满18个月对应的月度对日止。以此类推。对于投资者在本基金基金合同生效日前持有的原中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划份额，运作期安排按原《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》约定的规则连续计算：第一个运作期起始日为原登记机构确认投资者持有该资产管理计划份额之日，运作期到期日为按原《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》约定的规则计算的运作期到期日。</p> |

|              |                                                                                                                                                                                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|              | <p>六、集合计划存续期限</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 6 月 30 日。本集合计划自 2025 年 6 月 30 日后，按照中国证监会有关规定执行。</p> <p>七、集合计划份额类别设置</p> <p>1、集合计划份额分类</p> <p>本集合计划根据销售方式或投资者申购本集合计划金额的不同，对投资者持有的计划份额按照不同的费率计提销售服务费，因此形成不同的集合计划份额类别。本集合计划设 A 类计划份额、C 类计划份额两类计划份额，两类计划份额单独设置代码，并分别计算公布集合计划份额净值。</p> | <p>六、基金存续期限</p> <p>不定期</p> <p>七、基金份额类别设置</p> <p>1、基金份额分类</p> <p>本基金根据销售服务费收取方式或其他条件的不同，将基金份额分为不同的类别。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算和公告各类基金份额净值和各类基金份额累计净值。</p>                                                                                                                                                                                                     |
| 第四部分 基金的历史沿革 | <p>根据《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》，本集合计划参照《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，并将集合计划名称变更为“中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”，变更后的资产管理合同自集合计划管理人公告的生效之日起生效。</p>                                                                                                             | <p>华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金由中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更而来。中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划由中信证券假日理财集合资产管理计划变更而来。</p> <p>根据《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》，将中信证券假日理财集合资产管理计划参照《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，于 2019 年 8 月 13 日取得中国证监会证券基金机构监管部《关于同意中信证券假日理财集合资产管理计划合同变更的函》（机构部函【2019】1982 号），并将集合计划名称变更为“中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”，变更后的《中信证券六个月滚动持有债券型集</p> |

|            |                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|            |                                                                                                      | <p>合资产管理计划资产管理合同》自 2019 年 8 月 22 日起生效。</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，中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人，中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金。中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划的变更注册已经中国证监会 2025 年 4 月 16 日证监许可〔2025〕832 号文准予变更注册。</p> <p>20**年**月**日，中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划的集合计划份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议通过了《关于中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金有关事项的议案》，同意中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更管理人，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，中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划变更为华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金，即本基金；并调整投资范围、投资策略、投资限制、估值方法、业绩比较基准等。上述集合计划份额持有人大会决议事项自表决通过之日起生效。</p> <p>自 20**年**月**日起，《华夏六个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》生效，《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。</p> |
| 第五部分 基金的存续 | 《资产管理合同》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，集合计划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 | 《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，                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |

|                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                        | <p>述情形的，集合计划管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等，并召开集合计划份额持有人大会进行表决。</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6月30日。本集合计划自2025年6月30日后，按照中国证监会有关规定执行。如2025年6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>基金管理人应当在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>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <b>第六部分 基金份额的申购与赎回</b> | <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>集合计划管理人在开放日办理集合计划份额的申购，在每个运作期到期日办理集合计划份额的赎回，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，但集合计划管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本资产管理合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。</p> <p>资产管理合同生效后，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，集合计划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>集合计划份额每个运作期到期日，集合计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。如该到期日为非工作日，则顺延至下一工作日，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</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>基金管理人在开放日办理基金份额的申购，在基金份额每个运作期到期日，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。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，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、期货交易市场、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》的有关规定在规定媒介上公告。</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金份额每个运作期到期日，基金份额持有人方可就该基金份额提出赎回申请。如该到期日为非工作日，则顺延至下一工作日，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。如果投资人多次申购本基金，则其持有的基金份额因申购申请日的不同导致对应的运作期到期日可能不同。</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的集合计划份额净值为基准进行计算；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即对该集合计划份额持有人在销售机构持有的且赎回申请日为运作期到期日的集合计划份额，按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>四、申购与赎回的程序</p> <p>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>如遇证券交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障或其他非集合计划管理人及集合计划托管人所能控制的因素影响业务流程，则赎回款项划付时间相应顺延至上述情形消除后的下一个工作日划往集合计划份额持有人银行账户。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并妥善行使合</p> | <p>三、申购与赎回的原则</p> <p>1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日收市后计算的各类基金份额净值为基准进行计算；</p> <p>4、赎回遵循“先进先出”原则，即对该基金份额持有人在销售机构持有的且赎回申请日为运作期到期日的基金份额，按照投资者持有基金份额登记日期的先后次序进行顺序赎回；</p> <p>5、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>2、申购和赎回的款项支付</p> <p>如遇证券、期货交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障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流程，则赎回款项划付时间相应顺延至上述情形消除后的下一个工作日划出。</p> <p>3、申购和赎回申请的确认</p> <p>基金销售机构对申购和赎回申请的受理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到申请。申购和赎回的确认以登记机构的确认结果为准。对于申请的确认情况，投资者应及时查询并</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>法权利。因投资者怠于行使权利，致使其相关权益受损的，集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。</p> <p>六、申购和赎回的价格、费用及其用途</p> <p>1、本集合计划各类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，并按照资产管理合同的约定公告。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、申购份额的计算及余额的处理方式：本集合计划申购份额的计算详见《招募说明书》。申购的有效份额为申购金额除以当日的集合计划份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入，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、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集合计划管理人决定，并在招募说明书中列示。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日集合计划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，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>妥善行使合法权利。因投资者怠于行使权利，致使其相关权益受损的，基金管理人、基金托管人、基金销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。</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和各类基金份额累计净值在当天收市后计算，并按照基金合同的约定公告。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、申购份额的计算及余额的处理方式：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。申购的有效份额为申购金额除以当日的该类基金份额净值，有效份额单位为份，上述计算结果均按四舍五入，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、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，并在招募说明书及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，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>5、基金管理人可以在不违反法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金销售费用。</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p>发生下列情况时，集合计划管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：</p> <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值或者无法办理申购业务。</p> <p>6、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，经与集合计划托管人协商确认后，集合计划管理人应当暂停接受集合计划申购申请。</p> <p>9、为了保障集合计划份额持有人的利益，集合计划管理人可在集合计划到期前 6 个月内视情况暂停本集合计划的日常申购和转换转入业务。</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集合计划管理人决定暂停接受申购申请时，集合计划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。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资者。在暂停申购的情况消除时，集合计划管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，集合计划管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</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者的申购申请：</p> <p>3、证券/期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理申购业务。</p> <p>6、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接受基金申购申请。</p> <p>发生上述第 1、2、3、5、6、7、9 项暂停申购情形之一且基金管理人决定暂停接受申购申请时，基金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。如果投资者的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项（无利息）将退还给投资者。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>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p>发生下列情形时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请或延缓支付赎回款项：</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                          | <p>3、证券交易所交易时间非正常停市，导致集合计划管理人无法计算当日集合计划资产净值或者无法办理赎回业务。</p> <p>6、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，经与集合计划托管人协商确认后，集合计划管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受集合计划赎回申请。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延期办理时，集合计划管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知集合计划份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定媒介上刊登公告。</p> | <p>3、证券、期货交易所交易时间非正常停市，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值或者无法办理赎回业务。</p> <p>6、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，基金管理人应当延缓支付赎回款项或暂停接受基金赎回申请。</p> <p>九、巨额赎回的情形及处理方式</p> <p>3、巨额赎回的公告</p> <p>当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在 3 个交易日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，并按规定在规定媒介上刊登公告。</p> <p>十九、基金管理人可在法律法规允许的范围内，在不影响基金份额持有人实质利益的前提下，根据市场情况对上述申购和赎回的安排进行补充和调整并提前公告。</p> |
| <b>第七部分 基金合同当事人及权利义务</b> | <p>一、集合计划管理人</p> <p>（一） 集合计划管理人简况</p> <p>名称：中信证券资产管理有限公司</p> <p>住所：北京市丰台区金丽南路3号院2号楼1至16层01内六层1-288室</p> <p>法定代表人：杨冰</p> <p>设立日期：2023年3月1日</p>                                                                                                                                                                          | <p>一、基金管理人</p> <p>（一） 基金管理人简况</p> <p>名称：华夏基金管理有限公司</p> <p>住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院</p> <p>法定代表人：张佑君</p> <p>设立日期：1998年4月9日</p> <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16号</p>                                                                                                                                                                                            |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监许可（2022）3254号</p> <p>组织形式：有限责任公司（法人独资）</p> <p>注册资本：10 亿元人民币</p> <p>存续期限：持续经营</p> <p>联系电话：95548 转 5</p> <p>（二） 集合计划管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划管理人的权利包括但不限于：</p> <p>（13）以集合计划管理人的名义，代表集合计划份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（10）编制季度、中期和年度集合计划报告；</p> <p>（12）保守集合计划商业秘密，不泄露集合计划投资计划、投资意向等。除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；</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、</p> | <p>文</p> <p>组织形式：有限责任公司</p> <p>注册资本：2.38 亿元人民币</p> <p>存续期限：100 年</p> <p>联系电话：400-818-6666</p> <p>（二） 基金管理人的权利与义务</p> <p>1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：</p> <p>（13）在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；</p> <p>（14）以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p> <p>2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：</p> <p>（10）编制基金季度、中期和年度报告；</p> <p>（12）保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；</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</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>记录和其他相关资料 15 年以上；</p> <p>二、集合计划托管人</p> <p>（二） 集合计划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，集合计划托管人的义务包括但不限于：</p> <p>（7）保守集合计划商业秘密，除《基金法》、《资产管理合同》及其他有关规定另有规定外，在集合计划信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；</p> <p>（8）复核、审查集合计划管理人计算的集合计划资产净值、集合计划份额申购、赎回价格；</p> <p>（10）对集合计划财务会计报告、季度、中期和年度集合计划报告出具意见，说明集合计划管理人在各重要方面的运作是否严格按照《资产管理合同》的规定进行；如果集合计划管理人有未执行《资产管理合同》规定的行为，还应当说明集合计划托管人是否采取了适当的措施；</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>（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中</p> | <p>录和其他相关资料不少于法律法规规定的最低期限；</p> <p>二、基金托管人</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>（7）保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露，但依法向监管机构、司法机关及审计、法律等外部专业顾问提供的除外；</p> <p>（8）复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、各类基金份额净值、基金份额申购、赎回价格；</p> <p>（10）对基金财务会计报告、基金季度、中期和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；</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少于法律法规规定的最低期限；</p> <p>（18）面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行业监督管理机构，并通知基金管理人；</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|-----------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                       | <p>国证监会和银行监管机构，并通知集合计划管理人；</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>（1）认真阅读并遵守《资产管理合同》、招募说明书等信息披露文件；</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>（1）认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书、基金产品资料概要等信息披露文件；</p>                                                                                                                                                                                                          |
| <b>第八部分 基金份额持有人大会</b> | <p>一、召开事由</p> <p>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：</p> <p>（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）；</p> <p>（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）；</p> <p>（5）调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准，提高销售服务费；</p> <p>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：</p> <p>（2）调低销售服务费或变更收费方式，增加、减少或调整集合计划</p> | <p>一、召开事由</p> <p>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：</p> <p>（1）终止《基金合同》；</p> <p>（2）更换基金管理人；</p> <p>（5）提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，提高销售服务费；</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一致后修改，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、调低基金的赎回费率、调低销售服务费或变更收费方式，增加、减少或调整基金份额类别设置及对</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>四、集合计划份额持有人出席会议的方式</p> <p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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；</p> <p>六、表决</p> <p>集合计划份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：</p> <p>2、特别决议，特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过方可做出。除法律另有规定外，转换集合计划运作方式、更换集合计划管理人</p> | <p>基金份额分类办法、规则进行调整；</p> <p>（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；</p> <p>四、基金份额持有人出席会议的方式</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：</p> <p>（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；</p> <p>六、表决</p> <p>基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：</p> <p>2、特别决议，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）通过方可做出。除法律法规另有规定外，转换基金运作方式、更换基金管理人或</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|----------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                        | <p>或者集合计划托管人、终止《资产管理合同》、本集合计划与其他集合计划合并以特别决议通过方为有效。</p> <p>八、生效与公告</p> <p>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》的有关规定在指定媒介上公告。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。</p>                                                                                                                                                                                                                                | <p>者基金托管人、终止《基金合同》、本基金与其他基金合并以特别决议通过方为有效。</p> <p>八、生效与公告</p> <p>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》的有关规定在指定媒介上公告。</p>                                                                                                                                                                                                               |
| <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>二、集合计划管理人和集合计划托管人的更换程序</p> <p>（一）集合计划管理人的更换程序</p> <p>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个月内对被提名的集合计划管理人形成决议，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；</p> <p>三、新任或临时集合计划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，仍有权按照本合同的规定收取集合计划管理费或集合计划托管费。</p> | <p>二、基金管理人和基金托管人的更换程序</p> <p>（一）基金管理人的更换程序</p> <p>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；</p> <p>三、新任或临时基金管理人接收基金管理业务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。</p> |

|                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|-----------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
| <p><b>第十二部分</b></p> <p><b>基金的投资</b></p> | <p><b>二、投资范围</b></p> <p>本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括债券（含国债、金融债、企业债、公司债、次级债、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、银行存款，以及法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。</p> <p>集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于债券资产比例不低于集合计划资产的 <b>80%</b>；本集合计划保持不低于集合计划资产净值 <b>5%</b>的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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><b>三、投资策略</b></p> <p><b>3、信用品种的投资策略与信用风险管理</b></p> <p>本集合计划对金融债、企业债、公司债和短期融资券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本集合计划在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化分析方法对信用产品的信用风险溢价、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对利差走势及其收益和风险进行判断。自下</p> | <p><b>二、投资范围</b></p> <p>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、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、债券逆回购、同业存单、银行存款、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。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产比例不低于基金资产的 <b>80%</b>；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 <b>5%</b>的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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>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。</p> <p><b>三、投资策略</b></p> <p><b>（三）信用品种的投资策略与信用风险管理</b></p> <p>本基金对金融债、企业债、公司债和短期融资券等信用品种采取自上而下和自下而上相结合的投资策略。自上而下投资策略指本基金在平均久期配置策略与期限结构配置策略基础上，运用数量化分析方法对信用产品的信用风险溢价、流动性风险溢价、税收溢价等因素进行分析，对利差走势及其收益和风险进行判断。自</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>而上投资策略指本集合计划运用行业研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。</p> <p><b>4、资产支持证券投资策略</b></p> <p>本集合计划投资资产支持证券以一级市场申购为主，二级市场交易为辅。通过对标的资产的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行分析，根据估值模型对 ABS 产品进行更为精准的定价，在控制风险的前提下尽可能的增厚本集合计划的收益。</p> | <p>下而上投资策略指本基金运用行业研究方法和公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行配置。</p> <p>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。</p> <p><b>（四）国债期货投资策略</b></p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的国债期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货定价模型寻求其合理估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行操作。</p> <p><b>（五）信用衍生品投资策略</b></p> <p>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</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>四、投资限制</p> <p>(一) 组合限制</p> <p>本集合计划的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(2) 本集合计划保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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>(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%；</p> <p>(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%；</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>(10) 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</p> | <p>限以及信用风险敞口等。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，或当市场通行的债券信用评级体系规则等发生变化，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> <p>四、投资限制</p> <p>(一) 组合限制</p> <p>本基金的投资组合将遵循以下比例限制：</p> <p>(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(12) 本基金参与国债期货交易，应当遵守下列要求：本基金在</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>除上述第（2）、（9）、（11）、（12）项情形之外，因证券市场波动、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。</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>本集合计划的业绩比较基准为：【中债综合财富(1 年以下)指数收益率*80%+一年期定期存款利率(税后)*20%】</p> | <p>任何交易日日终，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%；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%；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；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>（13）本基金参与信用衍生品投资，需遵守下列投资比例限制：本基金不持有具有信用保护卖方属性的信用衍生品，不持有合约类信用衍生品；本基金持有的信用衍生品名义本金不得超过本基金中所对应受保护债券面值的 100%；本基金投资于同一信用保护卖方的各类信用衍生品名义本金合计不得超过基金资产净值的 10%；因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应在 3 个月内进行调整；</p> <p>除上述第（2）、（9）、（10）、（13）项情形之外，因证券/期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p>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(税后)*20%】</p> <p>本基金选择上述业绩比较基准的原因为：中债综合（全价）指数</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                                       |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|---------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                       | <p>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 年以下）指数是中债金融估值中心有限公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的短期债券指数，旨在反映短期债券的整体价格和投资回报情况，本集合计划资产配置以一年内到期的信用债为主，与该指数的期限相匹配；银行一年期定期存款税后利率为中国人民银行公开发布，具有较强的权威性和市场影响力。基于本集合计划的投资范围和投资比例限制，该业绩比较基准能够较好地反映本集合计划的风险收益特征。</p>                                                                                 | <p>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；银行一年期定期存款税后利率为中国人民银行公开发布，具有较强的权威性和市场影响力。基于本基金的投资范围和投资比例限制，该业绩比较基准能够较好地反映本基金的风险收益特征。</p>                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <p><b>第十四部分</b><br/><b>基金资产估值</b></p> | <p>二、估值对象</p> <p>集合计划所拥有的债券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</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>（2）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>（3）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>2、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值，在估</p> | <p>二、估值对象</p> <p>基金所拥有的债券、资产支持证券、衍生工具、信用衍生品、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</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）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值；</p> <p>（2）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；</p> <p>（3）交易所市场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、首次公开发行未上市的债券，采用估值技术确定公允价值。</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，采用估值技术确定其公允价值。</p> <p>4、对于含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间采用第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价估值。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。</p> <p>5、同一证券同时在两个或两个以上市场交易的，按证券所处的市场分别估值。</p> <p>6、存款的估值方法<br/>持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。</p> <p>7、本基金投资国债期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，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>8、信用衍生品按第三方估值机构提供的当日估值价格进行估值，但管理人依法应当承担的估值责任不因委托而免除。选定的第三方估值机构未提供估值价格的，依照有关法律法规及企业会计准则要求采用合理估值技术确定公允价值。</p> <p>9、本基金可以采用第三方估值机构按照上述公允价值确定原则提供的估值价格数据。</p> <p>10、上述第三方估值机构提供的估值全价指第三方估值机构直接提供的估值全价或第三方估值机构提供的估值净价加每百元应计利息。</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>13、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。</p> <p>14、税收按照相关法律法规、监管机构等的规定以及行业惯例进行处理。</p> <p>根据有关法律法规，基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，基金托管人承担复核责任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金净值信息的计算结果对外予以公布。</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，各类基金资产净值除以当日该类基金份额的余额数量计算，均精确到0.0001元，小数点后第5位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。基金管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>基金管理人应每个工作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）基金管理人应每个工作日对基金资产估值。但基金管理人根据法律法规或基金合同的规定暂停估值时除外。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将基金资产净值、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，由基金管理人依据基金合同和相关法律法规的规定对外公布。</p> |
|--|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和集合计划会计核算的义务由集合计划管理人承担。本集合计划的集合计划会计责任方由集合计划管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照集合计划管理人对集合计划净值信息的计算结果对外予以公布。</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，小数点后第5位四舍五入。集合计划管理人可以设立大额赎回情形下的净值精度应急调整机制。国家另有规定的，从其规定。</p> <p>集合计划管理人应每个工作日计算集合计划资产净值及集合计划份额净值，并按规定公告。</p> <p>（2）集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值。但集合计划管理人根据法律法规或资产管理合同的规定暂停估值时除外。集合计划管理人每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划份额净值结果发送集合计划托管人，经集合计划托管人复核无误后，由集合计划管理人依据资产管理合同和相关法律法规的规定对外公布。</p> <p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、集合计划投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因</p> | <p>七、暂停估值的情形</p> <p>1、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；</p> <p>八、基金净值的确认</p> <p>基金净值信息由基金管理人负责计算，基金托管人负责进行复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值和各类基金份额净值并发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核确认后发送给基金管理人，由基金管理人对基金净值依据基金合同和相关法律法规的规定予以公布。</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“四、估值方法”的第11项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理。</p> <p>2、由于不可抗力原因，或由于证券/期货交易所、登记结算公司等发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非基金管理人或基金托管人原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人免除赔偿责任。但基金管理人、基金托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</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</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |            |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
|  | <p>暂停营业时；</p> <p>八、集合计划净值的确认<br/>用于集合计划信息披露的集合计划净值信息由集合计划管理人负责计算，集合计划托管人负责进行复核。集合计划管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的集合计划资产净值和集合计划份额净值并发送给集合计划托管人。集合计划托管人对净值计算结果复核确认后发送给集合计划管理人，由集合计划管理人对集合计划净值依据资产管理合同和相关法律法规的规定予以公布。</p> <p>九、特殊情况的处理<br/>1、集合计划管理人或集合计划托管人按“四、估值方法”的第4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。<br/>2、由于不可抗力原因，或由于证券交易所、登记结算公司等发送的数据错误，或国家会计政策变更、市场规则变更等非集合计划管理人与集合计划托管人原因，集合计划管理人和集合计划托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但未能发现错误的，由此造成的集合计划资产估值错误，集合计划管理人和集合计划托管人免除赔偿责任。但集合计划管理人、集合计划托管人应当积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。</p> <p>十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值<br/>本集合计划实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的集合计划资产净值和份额净值，暂停披露侧袋账户份额净值。</p> | <p>净值。</p> |
|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|

|                                         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-----------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <p><b>第十五部分</b><br/><b>基金费用与税收</b></p>  | <p>一、集合计划费用的种类</p> <p>7、集合计划的证券交易费用；</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、集合计划管理人的管理费<br/>本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值 <b>0.3%</b>年费率计提。</p> <p>五、集合计划税收<br/>本集合计划运作过程中涉及的各项纳税主体，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。<br/>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。</p> | <p>一、基金费用的种类</p> <p>7、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、证券/期货账户相关费用及其他类似性质的费用等）；</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<br/>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 <b>0.3%</b>的年费率计提。</p> <p>四、《基金合同》生效前的相关费用按照《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》相关标准执行。</p> <p>六、基金税收<br/>本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，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。</p> |
| <p><b>第十六部分</b><br/><b>基金的收益与分配</b></p> | <p>三、收益分配原则</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>三、基金收益分配原则</p> <p>5、基金份额持有人持有的基金份额（原份额）所获得的红利再投资份额的运作期，按原份额的运作期计算，即红利再投资份额的运作期到期日与原份额的运作期到期日相同。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                     |

|                                |                                                                                                                                                                                                                                                |                                                                                                                                                                                                   |
|--------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                | 在不影响投资者利益的情况下，集合计划管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上集合计划收益分配原则，此项调整不需要召开集合计划份额持有人大会，但应于变更实施日前在指定媒介公告。                                                                                                                                                       | 在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整以上基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。                                                                                              |
| <b>第十七部分<br/>基金的会计与<br/>审计</b> | <p>一、集合计划会计政策</p> <p>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。</p> <p>二、集合计划的年度审计</p> <p>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>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电子或书面方式确认。</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《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>                                    |
| <b>第十八部分<br/>基金的信息披<br/>露</b>  | <p>二、信息披露义务人</p> <p>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。</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”）和指定互联网网站（以下简称“指定网站”，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</p> | <p>二、信息披露义务人</p> <p>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。</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中国证监会等规定媒介披露，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。</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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。</p> <p>五、公开披露的集合计划信息</p> <p>公开披露的集合计划信息包括：</p> <p>（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</p> <p>2、集合计划招募说明书应当最大限度地披露影响集合计划投资者决策的全部事项，说明集合计划申购和赎回安排、集合计划投资、集合计划特性、风险揭示、信息披露及集合计划份额持有人服务内容。</p> <p>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。</p> <p>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，并登载在指定网站上，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。</p> <p>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。</p> <p>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</p> | <p>五、公开披露的基金信息</p> <p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>（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</p> <p>2、基金招募说明书应当根据法律法规最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务内容。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>会规定之日起开始执行。</p> <p>（二）集合计划份额净值和集合计划份额累计净值</p> <p>在开始办理集合计划份额申购或者赎回后，集合计划管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、集合计划销售机构网站或者营业网点披露开放日的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>集合计划管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在指定网站披露半年度和年度最后一日的集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。</p> <p>（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）</p> <p>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，将年度报告登载于指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。集合计划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>如报告期内出现单一投资者持有集合计划份额达到或超过集合计划总份额 20%的情形，为保障其他投资者的权益，集合计划管理人至少应当在定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本集合计划的特有风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>（五）临时报告</p> <p>前款所称重大事件，是指可能对集合计划份额持有人权益或者集合</p> | <p>（二）基金份额净值和基金份额累计净值</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>（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）</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指定报刊上。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。</p> <p>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。</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>计划份额的价格产生重大影响的下列事件：</p> <p>7、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；</p> <p>8、集合计划管理人高级管理人员、集合计划投资经理和集合计划托管人专门基金托管部门负责人发生变动；</p> <p>11、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；</p> <p>12、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；</p> <p>（六）澄清公告</p> <p>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，并将有关情况立即报告中国证监会。</p> | <p>（五）临时报告</p> <p>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：</p> <p>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；</p> <p>8、基金管理人高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>（六）澄清公告</p> <p>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。</p> <p>（九）投资国债期货的信息披露</p> <p>基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和更新的招募说明书等文件中披露国债期货的交易情况，包括交易政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交</p> |
|--|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>六、信息披露事务管理</p> <p>集合计划托管人应当按照相关法律法规、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。</p> <p>集合计划管理人、集合计划托管人应当在指定报刊中选择披露信息的报刊，单只集合计划只需选择一家报刊。</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅</p> <p>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。</p> <p>八、暂停或延迟集合计划净值信息披露的情形</p> <p>1、集合计划投资所涉及的证券交易市场遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；</p> <p>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</p> | <p>易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的交易政策和投资目标等。</p> <p>（十）投资信用衍生品的信息披露</p> <p>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。</p> <p>六、信息披露事务管理</p> <p>基金托管人应当按照相关法律法规、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、各类基金份额净值、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。</p> <p>基金管理人、基金托管人应当在指定报刊中选择一家报刊披露本基金信息。</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅</p> <p>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。</p> |
|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|----------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                        | <p>法准确评估集合计划资产价值时；</p> <p>3、法律法规、中国证监会或《资产管理合同》认定的其他情形。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | <p>八、暂停或延迟基金净值信息披露的情形</p> <p>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：</p> <p>1、不可抗力；</p> <p>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；</p> <p>3、发生暂停估值的情形；</p> <p>4、法律法规、基金合同或中国证监会规定的情况。</p> <p>九、法律法规或监管部门对信息披露另有规定的，从其规定。</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>一、《资产管理合同》的变更</p> <p>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。</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集合计划管理人、集合计划托管人、具有从事证券、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>六、集合计划财产清算的公告</p> <p>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</p> | <p>一、《基金合同》的变更</p> <p>1、变更基金合同涉及法律法规规定或本基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和基金合同约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告。</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《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>六、基金财产清算的公告</p> <p>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</p> |

|                                    |                                                                                                                                                                                      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                    | <p>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。</p> <p>七、集合计划财产清算账册及文件的保存<br/>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 15 年以上。</p>       | <p>合《证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告。</p> <p>七、基金财产清算账册及文件的保存<br/>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。</p>                                                                                                                                                  |
| <b>第二十一部分<br/>争议的处理和<br/>适用的法律</b> | <p>各方当事人同意，因《资产管理合同》而产生的或与《资产管理合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为北京市，按照中国国际经济贸易仲裁委员会届时有效的仲裁规则进行仲裁。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。</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，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会届时有效的仲裁规则按普通程序进行仲裁，仲裁地点为北京市。仲裁裁决是终局的，对当事人均有约束力。除非仲裁裁决另有规定，仲裁费用由败诉方承担。</p>                                                                                                                                                              |
| <b>第二十二部分<br/>基金合同的效力</b>          | <p>1、《资产管理合同》经集合计划管理人、集合计划托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并自集合计划管理人公告的生效之日起生效。</p> <p>4、《资产管理合同》正本一式六份，除上报有关监管机构二份外，集合计划管理人、集合计划托管人各持有二份，每份具有同等的法</p>                                         | <p>1、本《基金合同》由《中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》变更注册而来。本《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字（或盖章），并经向中国证监会办理变更注册手续获得中国证监会书面确认。经 202X 年 XX 月 XX 日中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划的份额持有人大会决议通过，自 202*年 XX 月 XX 日起《基金合同》生效，原《中信证券六个月滚动持有债券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》正本一式五份，除上报有关监管机构一份外，基金管理人、基金托管人各持有二份，每份具有同等的法律效力。</p> |

---

|  |      |  |
|--|------|--|
|  | 律效力。 |  |
|--|------|--|