（上接B14版）

第三部分 基金的基本情况

三、集合计划的运作方式

本集合计划A类计划份额只开放赎回，不开放申购（红利再投资除外）。

本集合计划B类或C类计划份额每个开放日开放申购，但本集合计划对集合计划份额持有人持有的B类或C类计划份额均设置两年的最短持有期限。在最短持有期限内，B类或C类计划份额不能赎回；在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），B类或C类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。

对于每份B类或C类计划份额，最短持有期限为自B类或C类计划份额申购确认日起（含）至B类或C类计划份额申购确认日的两年后对日（如不存在该对日或该对日为非工作日的，则顺延至下一工作日）的前一日的期间。

六、集合计划存续期限

本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期至2025年6月30日。

七、集合计划份额类别设置

本集合计划根据申购、赎回规则、销售费用及业绩报酬收取方式的不同，将份额分为不同的类别。

对于投资者依据原《中信证券理财优选集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的中信证券理财优选集合资产管理计划份额，自本资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划A类计划份额。在本集合计划存续期间，A类计划份额只开放赎回，不开放申购（红利再投资除外），在赎回时收取赎回费，但不从本类别计划资产中计提销售服务费。A类计划份额的业绩报酬收取方式与B类和C类计划份额不同。

对于投资者依据本资产管理合同申购的计划份额，在投资者申购时收取申购费用，并设置两年的最短持有期限，在两年最短持有期限后赎回不收取赎回费用，且不从本类计划资产中计提销售服务费的份额，称为B类计划份额。B类计划份额的业绩报酬收取方式与A类计划份额不同，与C类计划份额相同。

对于投资者依据本资产管理合同申购的计划份额，在投资者申购时不收取申购费用，并设置两年的最短持有期限，在两年最短持有期限后赎回不收取赎回费用，但从本类别计划资产中计提销售服务费的份额，称为C类计划份额。C类计划份额的业绩报酬收取方式与A类计划份额不同，与B类计划份额相同。

……

投资者在申购份额时可自行选择B类或C类计划份额类别。本集合计划不同份额类别之间不得互相转换。

根据集合计划实际运作情况，在不违反法律法规、资产管理合同的约定以及对集合计划份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与集合计划托管人协商一致，集合计划管理人可增加、减少或调整集合计划份额类别设置，对集合计划份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开集合计划份额持有人大会。

三、基金的运作方式

六、基金存续期限

不定期

七、基金份额类别设置

本基金根据申购、赎回规则、销售费用的不同，将基金份额分为不同的类别。

在本基金存续期间，A类基金份额只开放赎回，不开放申购（红利再投资除外），但不从本类别基金资产中计提销售服务费。

本基金存续期间，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费，且不从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为B类基金份额。

本基金存续期间，在投资者申购时不收取申购费用，在赎回时收取赎回费，但从本类别基金资产中计提销售服务费的份额，称为C类基金份额。

……

投资者在申购份额时可自行选择B类或C类基金份额类别。

有关基金份额类别的具体设置、费率水平等由基金管理人确定，并在招募说明书中公告。根据基金销售情况，基金管理人可在不损害已有基金份额持有人权益的情况下，经与基金托管人协商一致，调整现有基金份额类别的费率水平、销售方式或者停止现有基金份额类别的销售等，不需召开基金份额持有人大会，调整前基金管理人需及时公告。

根据基金实际运作情况，在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，经与基金托管人协商一致，基金管理人可增加、减少或调整集合计划份额类别设置，对基金份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告，不需要召开基金份额持有人大会。有关基金份额类别的具体规则等相关事项届时将另行公告。

第四部分 基金的历史沿革

华夏臻选回报混合型证券投资基金由中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划变更而来。中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划由中信证券理财优选集合资产管理计划变更而来。

根据《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》，中信证券理财优选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2020年8月31日取得中国证监会证券基金机构监管部（关于准于中信证券理财优选集合资产管理计划合同变更的回函）（机构部函【2020】2379号），并将原集合计划名称变更为“中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划”，变更后的《中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》自2020年10月15日起生效。

根据《基金法》、《运作办法》、《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》等相关法律、行政法规及中国证监会的规定，中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划变更管理人，中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划变更为华夏臻选回报混合型证券投资基金。中信证券臻选回报两年持有期混合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27日证监许可[2025]936号文准予变更注册。

20**年**月**日，中信证券臻选回报两年持有期混合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《关于中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏臻选回报混合型证券投资基金有关事项的议案》，同意中信证券臻选回报两年持有期混合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，中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划变更为华夏臻选回报混合型证券投资基金，即本基金；并调整投资范围、投资策略、投资比例、投资限制、基金费用设置、估值方法、运作方式等内容。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。

自20**年**月**日起，《华夏臻选回报混合型证券投资基金基金合同》生效，《中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。

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个工作日出现前述情形的，集合计划管理人应当在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、与其他集合计划合并或者终止资产管理合同等，并在6个月内召集集合计划份额持有人大会进行表决。

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。

《基金合同》生效后，连续20个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续60个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在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。

第六部分 基金份额的申购与赎回

二、申购和赎回的开放日及时间

1、开放日及开放时间

投资者在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，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、赎回除外。

资产管理合同生效后，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，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》的有关规定在规定媒介上公告。若本集合计划参与港股通交易且该交易日为非港股通交易日，则本集合计划有权不开放申购、赎回，并按规定进行公告。

2、申购、赎回开始日及业务办理时间

集合计划管理人自资产管理合同生效之日起不超过3个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

集合计划管理人自资产管理合同生效之日起不超过3个月开始办理A类计划份额赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

B类或C类计划份额在最短持有期限到期后的下一个工作日起（含），B类或C类计划份额持有人方可就该计划份额提出赎回申请。如果投资人多次申购本集合计划B类或C类计划份额，则其持有的B类或C类计划份额因申购确认日的不同导致对应的赎回开放时间可能不同。

三、申购与赎回的原则

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；

4、赎回遵循“先进先出”原则，即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；

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；

四、申购与赎回的程序

2、申购和赎回的款项支付

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集合计划管理人及集合计划托管人所能控制的因素影响了业务流程，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。

3、申购和赎回申请的确认

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，集合计划管理人、集合计划托管人、集合销售机构不承担由此造成的损失或不利后果。

六、申购和赎回的价格、费用及其用途

1、本集合计划A类、B类和C类计划份额分别设置代码，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。本集合各类基金份额净值的计算，均保留到小数点后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。

2、申购份额的计算及余额的处理方式：本集合申购份额的计算详见《招募说明书》。本集合B类基金份额的申购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。申购的有效份额为净申购金额除以当日的B类基金或C类基金基金份额净值，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。

3、赎回金额的计算及处理方式：本集合计划赎回金额的计算详见《招募说明书》。本集合计划赎回费率由基金管理人决定，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。

4、申购费用由申购相应类别基金计划份额的投资者承担，不列入基金财产。申购费可在投资者申购基金份额和/或在投资者赎回基金份额时收取。在申购时收取的申购费称为前端申购费，在赎回时收取的申购费称为后端申购费。实际执行的收费方式在招募说明书中载明。C类基金份额不收取申购费用。A类基金份额只开放赎回，不开放申购（红利再投资除外）。

5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用归入基金财产的比例依照相关法律法规设定，具体见招募说明书的规定，未归入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。其中，对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

6、投资者申购本基金B类基金份额需缴纳申购费，申购本基金C类基金份额不需缴纳申购费用。本基金基金份额的申购费率、申购份额具体的计算方法、赎回费率、赎回金额具体的计算方法和收费方式由基金管理人根据基金合同的规定确定，并在招募说明书或相关公告中列示。集合计划管理人可以在资产管理合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

7、集合计划管理人可以在不违反法律法规规定及资产管理合同约定的情形下根据市场情况适当调低销售费率，并按相关监管部门要求履行必要手续。

七、拒绝或暂停申购的情形

6、当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。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

6、当前一估值日基金资产净值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。

八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形

6、当前一估值日基金资产净值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。

九、巨额赎回的情形及处理方式

3、巨额赎回的公告

当发生上述巨额赎回并延期办理时，集合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，并按规定在规定媒介上刊登公告。

十二、集合计划的非交易过户

集合计划的非交易过户是指集合计划登记机构受理继承、捐赠和司法强制执行等情形而产生的非交易过户以及登记机构认可、符合法律法规的其他非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是依法可以持有本基金基金份额的投资者。

十五、集合计划的冻结和解冻

一、集合计划管理人

（一）集合计划管理人简况

名称：中信证券资产管理有限公司

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

法定代表人：杨冰

设立日期：2023年3月1日

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

组织形式：有限责任公司(法人独资)

注册资本：10亿元人民币

存续期限：持续经营

联系电话：95548转5

（二）集合计划管理人的权利与义务

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：

（11）在《资产管理合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回或转换申请；

（12）依照法律法规为集合计划的利益行使因集合计划资产投资于证券所产生的权利；

（15）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关集合计划申购、赎回、转换、非交易过户、转托管和定期定额投资等业务规则；

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：

（10）编制季度、中期和年度集合计划报告；

（16）按规定保存集合计划资产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上；

二、集合计划托管人

（一）集合计划托管人简况

名称：中国工商银行股份有限公司（简称：中国工商银行）

注册资本：人民币35,640,625.7089万元

（二）集合计划托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，集合计划托管人的权利包括但不限于：

（4）根据相关市场规则，为集合计划开设资金账户、证券账户等投资所需账户，为集合计划办理证券交易资金清算；

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：

（6）按规定开设集合计划资产的资金账户和证券账户等投资所需账户，按照《资产管理合同》的约定，根据集合计划管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

（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；

（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；

（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；

（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监管机构，并通知集合计划管理人；

三、集合计划份额持有人

集合计划投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《资产管理合同》的承认和接受，集合计划投资者自依据《资产管理合同》取得集合计划份额，即成为本集合计划份额持有人和《资产管理合同》的当事人，直至其不再持有本集合计划的份额。集合计划份额持有人作为《资产管理合同》当事人并不以在《资产管理合同》上书面签章或签字为必要条件。

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：

（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；

第七部分 基金合同当事人及权利义务

一、召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开集合计划份额持有人大会，法律法规、中国证监会或《资产管理合同》另有规定的除外：

（1）终止《资产管理合同》（因不符合法律法规或中国证监会的要求而须终止本集合计划的除外）；

（2）更换集合计划管理人（集合计划管理人更换为本集合计划管理人独资或控股设立的子公司除外）；

（5）调整集合计划管理人、集合计划托管人的报酬标准（因法规政策调整而需要修订业绩报酬相关基准比例的情形除外），提高销售服务费；

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：

（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；

（8）因法规政策调整而需要修订业绩报酬相关基准比例；

四、集合计划份额持有人出席会议的方式

集合计划份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会或法律法规和监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。

2、通讯开会。通讯开会系指集合计划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。通讯开会应以召集人通知的非现场方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《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；

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

八、生效与公告

基金份额持有人大会决议自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

如果采用通讯方式进行表决，在公告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。

第八部分 基金份额持有人大会

二、集合计划管理人和集合计划托管人的更换程序

（一）集合计划管理人的更换程序

2、决议：集合计划份额持有人大会在集合计划管理人职责终止后6个月内对被提名的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。

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。

第九部分 基金托管人的更换条件和程序

一、基金管理人和基金托管人的更换程序

（一）基金管理人的更换程序

2、决议：基金份额持有人大会在基金管理人职责终止后6个月内对被提名的基金管理人形成决议，该决议需经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）表决通过，决议自表决通过之日起生效；

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。

第十一部分 基金份额的登记

四、基金登记机构的义务

1、配备足够的专业人员办理本基金基金份额的登记业务；

第十二部分 基金的投资

二、投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括主板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会允许投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许证券基金投资基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据相关法律法规和《基金合同》的约定，参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的60%-95%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0-50%。每个交易日日终扣除股指期货合约、国债期货合约、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人在依法履行适当程序后，可对本基金的投资比例做相应调整。

三、投资策略

1、大类资产配置

在大类资产配置上，本基金主要采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。本基金主要考虑的因素为：

通过对以上各种因素的分析，结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中大类资产的比例。

2、股票投资策略

（1）行业配置策略

在大类资产配置上，本基金计划首先参考管理人投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，管理人投资决策委员会主要采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。本基金计划主要考虑的因素为：

通过对以上各种因素的分析，结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中大类资产的比例。

2、股票投资策略

（1）行业配置策略

在大类资产配置上，本基金计划首先参考管理人投资决策委员会所形成的大类资产配置范围，管理人投资决策委员会主要采取“自上而下”的方式进行大类资产配置，根据对宏观经济、市场面、政策面等因素进行定量与定性相结合的分析研究，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。本基金计划主要考虑的因素为：

通过对以上各种因素的分析，结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中大类资产的比例。

5、可转债投资策略

本集合计划管理人主要投资于那些债性强（到期收益率不低于无风险利率）、转债条款好、基础股票具有可持续竞争能力和成长性的可转债。

对于可分离转债，严格遵守认股权证的投资规模限制，按照稳健原则分别评估认股权证价值和企业债价值，在可分离转债整体预期评估价值高于本金的基础上对可分离转债进行价值投资。

7、衍生品投资策略

四、投资限制

（一）组合限制

本集合计划的投资组合将遵循以下比例限制：

（1）本集合计划的股票资产投资比例为集合计划资产的50%-95%，其中投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%；

（2）每个交易日日终扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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、应收申购款等；

（3）本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的10%；

（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%；

（11）本集合计划管理人管理的全部开放式大集合计划（包含开放式大集合计划以及处于开放期的采取定期开放方式运作的大集合计划）持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；

（13）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%；本集合计划在全国银行间同业市场中的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

除上述第（2）、（9）、（14）、（15）项情形之外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并，集合计划规模变动等集合计划管理人之外的因素致使集合计划投资比例不符合上述规定投资比例的，集合计划管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的10个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。

五、业绩比较基准

本集合计划的业绩比较基准为：沢深300指数收益率×50%+恒生指数收益率×10%+中债综合财富指数收益率×40%。

本集合计划选择上述业绩比较基准的原因：本集合计划的业绩比较基准根据本集合计划配置和策略特点设置，能够准确反映本集合计划的风险收益特征，便于集合计划管理人合理衡量比较本集合计划的业绩表现。其中恒生指数收益率为不经汇率调整。

六、风险收益特征

七、集合计划管理人代表集合计划行使股东或债权人权利的处理原则及方法

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代表或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

第十三部分 基金的财产

三、集合计划财产的账户

集合计划托管人根据相关法律法规、规范性文件为本集合计划开立资金账户，证券账户以及投资所需的其他专用账户。开立的集合计划专用账户与集合计划管理人、集合计划托管人、集合计划销售机构和集合计划登记机构自有的财产账户以及其他集合计划财产账户相独立。

三、基金财产的账户

基金托管人根据相关法律法规、规范性文件为本基金开立资金账户、证券账户和期货账户以及投资所需的其他专用账户。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金登记机构自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

第十四部分 基金资产估值

二、估值对象

集合计划所拥有的股票、衍生工具、债券、银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。

四、估值方法

1、证券交易所上市的有价证券的估值

（1）交易所上市的有价证券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。

（2）交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

（3）交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。

（4）交易所上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券以估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券以估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（2）首次公开发行未上市的股票、债券，采用估值技术确定公允价值。

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。

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。

5、人民币对主要外汇的汇率应当以估值日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价为准。若本基金现行估值汇率不再发布或发生重大变更，或市场上出现更为公允、更适合本基金的估值汇率时，基金管理人与基金托管人协商一致后可根据实际情况调整本基金的估值汇率，并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

7、本基金投资股票期权，根据相关法律法规以及监管部门的规定估值。

8、本基金投资存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行。

9、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。

10、本基金参与融资业务的，按照相关法律法规、监管部门和行业协会的相关规定进行估值。

11、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。

12、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。

15、其他资产按法律法规或监管机构有关规定进行估值。

16、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。

五、估值程序

（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。

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。

（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。

八、集合计划净值的确认

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。

九、特殊情况的处理

1、集合计划管理人或集合计划托管人按“四、估值方法”的第6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。

十、实施侧袋机制期间的集合计划资产估值

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。

第十五部分 基金费用与税收

一、集合计划费用的种类

4、集合计划管理人的业绩报酬；

8、集合计划的证券、期货交易费用；

二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、集合计划管理人的管理费

本集合计划A类、B类和C类计划份额的管理费年费率为0.8%。本集合计划各类计划份额的管理费按前一日该类计划份额对应资产净值以对应的管理费年费率分别计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×I÷当年天数

H为各类计划份额每日应计提的集合计划管理费

E为该类计划份额对应的前一日的集合计划资产净值

I 为该类计划份额的管理费年费率

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令并进行复核后，于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

2、集合计划托管人的托管费

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令并进行复核后，于次月前5个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

3、销售服务费

销售服务费用于支付销售机构佣金、营销费用以及集合计划份额持有人服务费等。本集合计划A、B类计划份额不收取销售服务费，C类计划份额的销售服务费按年费率为0.7%。C类计划份额的销售服务费按前一日 C类计划份额的集合计划资产净值的0.7%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.7%÷当年天数

H 为 C 类计划份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类计划份额前一日集合计划资产净值

销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月底，按月支付，由托管人根据管理人的指令并进行复核后，于次月前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

4、在本集合计划委托人赎回确认日和计划终止日，管理人将根据委托人的期间年化收益率（R），对A类、B类或C类计划份额期间年化收益率超过8%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。在本集合计划分红确认日，管理人将根据委托人的期间年化收益率（R），对A类计划份额期间年化收益率超过8%以上部分按照20%的比例收取业绩报酬。如因法规政策调整而需要修订业绩报酬相关基准比例，不需召开集合计划份额持有人大会。

（1）业绩报酬计提原则

①按委托人每笔申购份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

②在符合业绩报酬计提条件时，在本集合计划分红确认日（仅涉及A类计划份额）、委托人赎回确认日或计划终止日计提业绩报酬。

③在委托人赎回或本集合计划终止时计提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金或清算资金中扣除。集合计划分红确认日提取业绩报酬的（仅涉及A类计划份额），业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。

④在委托人赎回或计划终止时，业绩报酬按委托人赎回份额或计划终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔申购份额的一部分，则将该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔申购的剩余部分不受影响。

⑤如本集合计划在计划终止时有未能流通变现的资产需要延期清算的，为了准确地体现本集合计划最终的投资业绩表现，则管理人在计划终止日应计提的管理人业绩报酬相应顺延至本集合计划全部资产变现后计算，投资者本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值相应采用在本集合计划全部资产变现后最终清算日当日的份额累计净值。

⑥管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

管理人根据期间年化收益率对A类、B类或C类计划份额期间年化收益率超过8%以上部分按照20%的比例收取管理人业绩报酬。具体计算方式如下：

A类、B类或C类计划份额期间年化收益率	提取比例	管理人业绩报酬计算公式
R≤8%	0	E＝0
R>8%	20%	E＝N×(Max(R,8%)−8%)×20%×(T÷365)

E＝ 该笔申购对应的管理人业绩报酬

N＝ 委托人该笔申购在上一个业绩报酬计提日的份额数

③将所有申购笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬（∑E）。

∑E=E1+E2+E3+……+En

其中的n为所对应的申购笔数。

上述“一、集合计划费用的种类”中第5—12项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由集合计划托管人从集合计划财产中支付。

四、实施侧袋机制期间的集合计划费用

本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费和业绩报酬（如有），详见招募说明书的规定。

五、集合计划税收

本集合计划支付给管理人、托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

一、基金费用的种类

7、基金的证券、期货交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、相关账户费用及其他类似性质的费用等）；

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.8%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.8%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理