（上接B22版）

第五部分 基金的存续	第五部分 集合计划的存续 《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。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。	第五部分 基金的存续 《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。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	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： (14)在遵循集合计划份额持有人利益优先原则的前提下，以集合计划管理人名义直接行使因集合计划财产投资于其他基金份额所产生的权利，包括但不限于参加本集合计划持有基金的基金份额持有人大会并行使相关投票权利，法律法规另有规定或《资产管理合同》另有约定的除外； 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： (5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的集合计划财产和集合计划管理人的财产相互独立，对所管理的不同集合计划分别管理，分别记账，进行证券投资； (16)按规定保存集合计划财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料至少20年，法律法规另有规定的从其规定； 二、集合计划托管人 （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： (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； (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至少20年，法律法规另有规定的从其规定； (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；	一、基金管理人 （一）基金管理人简况 名称：华夏基金管理有限公司 住所：北京市顺义区安庆大街甲3号院 法定代表人：张佑君 设立日期：1998年4月9日 批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[1998]16号文 组织形式：有限责任公司 注册资本：2.38亿元人民币 存续期限：100年 联系电话：400-818-6666 （二）基金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，基金管理人的权利包括但不限于： (14)在遵循基金份额持有人利益优先原则的前提下，以基金管理人名义直接行使因基金财产投资于证券、其他基金份额所产生的权利，包括但不限于参加本基金持有基金的基金份额持有人大会并行使相关投票权利，法律法规另有规定或《基金合同》另有约定的除外； 本基金持有的基金召开基金份额持有人大会时，基金管理人应当代表本基金份额持有人的利益，根据《基金合同》约定的方式参与所持有基金的份额持有人大会，在遵循本基金的基金份额持有人利益优先原则的前提下行使相关投票权利，本基金管理人需将表决意见事先征求基金托管人的意见，并将表决意见在定期报告中予以披露。本基金管理人可以代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金所持基金的基金份额持有人大会； 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： (5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券、基金投资； (16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低年限； 二、基金托管人 （二）基金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，基金托管人的权利包括但不限于： (8)复核、审查基金计划管理人计算的基金份额净值、基金份额申购、赎回价格； (9)保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料，保存期限不低于法律法规规定的最低年限； (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，并通知基金管理人；
第八部分 基金份额持有人大会	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，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： (2)调整本集合计划的申购费率、调低集合计划的赎回费率、调低销售服务费或变更收费方式，增加、减少或调整集合计划份额类别设置及对集合计划份额分类办法、规则进行调整； (3)因相应的法律法规发生变动而应当对《资产管理合同》、招募说明书进行修改； (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； (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； 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。 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： (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； 五、议事内容与程序 2、议事程序 (2)通讯开会 在通讯开会的情况下，首先由召集人提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。 八、生效与公告 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。 九、集合计划管理人代表本集合计划出席本集合计划持有的基金的份额持有人大会并参与表决的特别约定 集合计划投资者持有本集合计划份额的行为即视为同意本集合计划管理人参与本集合计划所持基金的基金份额持有人大会并行使相关投票表决权利。集合计划管理人无需就表决事项事先召开本集合计划的份额持有人大会。法律法规另有规定的从其规定。	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： (1)终止《基金合同》； (2)更换基金管理人； (5)提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，提高销售服务费率； 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： (2)调整本基金的申购费率、调低基金的赎回费率、调低销售服务费率或变更收费方式，增加、减少或调整基金份额类别设置及对基金份额分类办法、规则进行调整； (3)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改； (5)调整有关基金申购、赎回、转换、非交易过户、收益分配、转托管、定期定额投资等业务的规则； 四、基金份额持有人出席会议的方式 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。 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。 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； 五、议事内容与程序 2、议事程序 (2)通讯开会 在通讯开会的情况下，首先由召集人至少提前30日公布提案，在所通知的表决截止日期后2个工作日内在公证机关监督下由召集人统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。 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。 九、基金管理人代表本基金出席本基金持有的基金的份额持有人大会并参与表决的特别约定 基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为同意本基金管理人参与本基金所持基金的基金份额持有人大会并行使相关投票表决权利。基金管理人无需就表决事项事先召开本基金的份额持有人大会。法律法规另有规定的从其规定。
第九部分 基金管理人、基金托管人的更换条件和程序	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。	二、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、集合计划登记机构的义务 集合计划登记机构承担以下义务： 3、妥善保存登记数据，并将集合计划份额持有人名称、身份信息及集合计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自集合计划账户销户之日起不得少于二十年；	四、基金登记机构的义务 基金登记机构承担以下义务： 3、妥善保存登记数据，并将基金份额持有人名称、身份信息及基金份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自基金账户销户之日起不得少于法律法规规定的最低年限；
第十二部分 基金的投资	二、投资范围 本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额(包括QDII基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)、香港互认基金)、国内依法发行的股票(包括主板、创业板以及其他中国证监会允许投资的股票)、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(含分离交易可转债)、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)、同业存单以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。 本集合计划为基金中基金集合计划，集合计划的投资组合比例为：本集合计划投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额投资比例不低于集合计划资产的80%，其中股票、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)投资占集合计划资产的比例合计为60%-95%(此处混合型基金还应至少满足以下标准之一：(1)基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于60%；(2)最近四个季度报告披露的持有股票资产占基金资产比例均不低于60%。)；货币市场基金投资占集合计划资产的比例不得超过15%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 三、投资策略 (一)大类资产配置策略 在大类资产配置上，本集合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，确定组合中各类基金、股票、债券及其他金融工具的比例。 本集合计划主要考虑： (二)基金类资产投资策略 1.基金研究体系 本集合计划将根据市场环境和不同类型基金管理人优劣势，定量和定性有机结合，从全市场筛选基金。首先从公司平台、投资经理、产品三个角度对基金进行定量和定性的全方位评估，对基金进行画像分析，把握其市值、因子、行业等风格，评价其所适用的环境。其次，在收益率、最大回撤、夏普比率等传统筛选指标之外，通过因子拆解基金的每日收益率，找出收益来源，进一步刻画基金的风格及稳定性，并用分析结果与基金经理的市场观点做印证，形成基金的深度画像。 在综合考虑基金的业绩持续性、风格偏好、可交易性等因素后，结合当前市场风格，自上而下和自下而上相结合地选择投资标的及持有期限。 (三)权益类资产投资策略 (四)债权类资产投资策略 本集合计划的债权类资产投资主要分为： 1、流动性管理 首先根据集合计划的合同约定、整体资产配置和客户退出规模的预期，确定高流动性债券资产的基本规模，选择信用好、期限短的高等级债券为主要投资对象。	二、投资范围 本集基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额(包括QDII基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)、香港互认基金)、国内依法发行的股票、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(含分离交易可转债)、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)、同业存单以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。 本基金为基金中基金，基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额投资比例不低于基金资产的80%，其中股票、股票型基金、混合型基金还应至少满足以下标准之一：(1)基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于60%；(2)最近四个季度报告披露的持有股票资产占基金资产比例均不低于60%。)；货币市场基金投资占集合计划资产的比例不得超过15%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。 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 (一)大类资产配置策略 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，确定组合中各类基金、股票、债券及其他金融工具的比例。 (二)基金类资产投资策略 1.基金研究体系 本基金将根据市场环境和不同类型基金管理人优劣势，定量和定性有机结合，从全市场筛选基金。首先从公司平台、基金经理、产品三个角度对基金进行定量和定性的全方位评估，对基金进行画像分析，把握其市值、因子、行业等风格，评价其所适用的环境。其次，在收益率、最大回撤、夏普比率等传统筛选指标之外，通过因子拆解基金的每日收益率，找出收益来源，进一步刻画基金的风格及稳定性，并用分析结果与基金经理的市场观点做印证，形成基金的深度画像。 在综合考虑基金的业绩持续性、风格偏好、可交易性等因素后，结合当前市场风格，自上而下和自下而上相结合地选择投资标的及持有期限。 5.公募REITs深度研究 本基金可投资公募REITs。本基金将综合考量宏观经济运行情况、基金资产配置策略、底层资产运营情况、流动性及估值水平等因素，对公募REITs的投资价值进行深入研究，精选出具有较高投资价值的公募REITs进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化，可选择将部分基金资产投资于公募REITs，但本基金并非必然投资公募REITs。 (三)权益类资产投资策略 对于港股通标的股票投资，本基金将重点关注在香港市场上市、具备投资价值的优质公司。基金可根据投资需要或市场环境变化，选择将部分资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资于港股。 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。 (四)债券投资策略 本基金的债券类资产投资主要分为： 1.流动性管理 首先根据基金合同约定、整体资产配置和客户赎回规模的预期，确定高流动性债券资产的基本规模，选择信用好、期限短的高等级债券为主要投资对象。
第十四部分 基金资产估值	四、估值方法 1、基金的估值 (1)非上市基金的估值 1)境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的份额净值估值。 2)境内货币市场基金，如所投资基金披露万份(百份)收益，按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益；如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值。 (2)上市基金的估值 1)ETF基金，按所投资ETF基金估值日的收盘价估值。 2)境内上市开放式基金(LOF)，按所投资基金估值日的份额净值估值。 3)境内上市定期开放式基金、封闭式基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。 4)投资的境内上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益。 (3)特殊情况处理 如果未来相关法律法规或监管规定对基金中基金投资证券投资基金的估值方法进行调整，本基金将采用调整后的方法对基金中基金投资的证券投资基金进行估值，不需召开基金份额持有人大会。 2、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(包括股票等)，以其估值日在证券交易所挂牌的市价(收盘价)估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化或证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的市价(收盘价)估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生影响证券价格的重大事件的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格； (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)交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价； 3、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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 4、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。 5、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)后未行使回售权的投资人持续持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。 五、估值程序 (1)本集合计划估值日的各类集合计划份额净值是以估值日集合计划资产净值除以估值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。T日的各类集合计划份额净值和各类集合计划份额累计净值在T+2日内计算，并按照资产管理合同的约定公告。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。 六、估值错误的处理 2.估值错误处理原则 (1)估值错误已发生，但尚未给当事人造成损失时，估值错误责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正估值错误发生的费用由估值错误责任方承担；由于估值错误责任方未及时更正已产生的估值错误，给当事人造成损失的，由估值错误责任方对直接损失承担赔偿责任；若估值错误责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。估值错误责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保估值错误已得到更正。 3.估值错误处理程序 估值错误被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下： (4)根据估值错误处理的方法，需要修改集合计划登记机构交易数据的，由集合计划登记机构进行更正，并就估值错误的更正向有关当事人进行确认。 4、集合计划份额净值估值错误处理的方法如下： (2)错误偏差达到该类集合计划份额净值的0.25%时，集合计划管理人应当通报集合计划托管人并报中国证监会备案；错误偏差达到该类集合计划份额净值的0.5%时，集合计划管理人应当在报中国证监会备案的同时并及时进行公告。 七、暂停估值的情形 3、占集合计划资产相当比例的被投资基金暂停估值、暂停公告基金份额净值或暂停公告每万份基金已实现收益的情形时，集合计划管理人可以暂停集合计划估值； 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。集合计划管理人应每个工作日对集合计划资产估值后，将集合计划资产净值和集合计划份额净值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。 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5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。	四、投资限制 (一)组合限制 本基金的投资组合将遵循以下比例限制： (1)本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的基金份额投资比例不低于基金资产的80%，其中股票、股票型基金、混合型基金和商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)投资占集合计划资产的比例合计为60%-95%(此处混合型基金还应至少满足以下标准之一：(1)基金合同约定的股票资产占基金资产的比例不低于60%；(2)最近四个季度报告披露的持有股票资产占基金资产比例均不低于60%。)； (3)本基金持有单只基金市值不得高于基金资产净值的20%，且不得持有其他基金中基金；除ETF联接基金外，本基金管理人管理的全部基金持有单只基金不得超过该被投资基金净资产的20%，被投资基金净资产规模以最近定期报告披露的规模为准； (7)本基金不得持有分级基金等具有复杂、衍生品性质的基金份额，包括分级基金和中国证监会认定的其他基金份额，中国证监会另行规定的除外； (9)本基金持有一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额，同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算)，其市值不超过基金资产净值的10%； (10)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券(不含本基金所投资的基金份额，同一家公司在内地和香港同时上市的A+H股合计计算)，不超过该证券的10%； (14)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%； (17)本基金管理人管理的全部开放式基金(包含开放式基金以及处于开放期的采取定期开放方式运作的基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%； (22)本基金投资于QDII基金及香港互认基金合计占基金资产的比例不超过20%； (23)本基金港股通标的股票投资占股票资产的比例不超过50%； (24)本基金投资存托凭证的比例限制依照境内上市交易的股票执行，与境内上市交易的股票合并计算； 除上述第(2)、(3)、(15)、(19)、(20)项情形之外，因证券市场波动、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；因前述因素致使基金投资比例不符合上述第(3)项时，基金管理人应当在20个交易日内进行调整；但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。 (二)禁止行为 为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动： 本基金投资基金管理人或基金管理人关联方或基金托管人关联方管理基金的情况，不属于前述重大关联交易，但是应当按照法律法规或监管规定的要求履行信息披露义务。 六、风险收益特征 本基金为混合型基金中基金，在通常情况下其风险收益水平高于债券型基金、货币市场基金、债券型基金中基金和货币型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。 基金资产可投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。 七、基金管理人代表基金行使相关权利的处理原则及方法 1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使相关权利，保护基金份额持有人的利益； 4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。
第十五部分 基金费用与税收	一、集合计划费用的种类 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 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年费率为0.5%。C类计划份额的销售服务费按前一日 C类计划份额对应的集合计划资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下： H＝E×0.5%÷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 类计划份额对应的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。 上述"一、集合计划费用的种类"中第4—11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。 三、不列入集合计划费用的项目 五、集合计划税收 本集合计划运作过程中涉及的各纳税主体，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。 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 11、因投资港股通标的股票而产生的各项费用； 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 基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的指令并进行复核后，于次月前5个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。 2、基金托管人的托管费 基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的指令并进行复核后，于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延。 3、销售服务费 销售服务费用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费年费率为0.5%。C类基金份额的销售服务费按前一日 C类基金份额的基金资产净值的0.5%年费率计提。计算方法如下： H＝E×0.5%÷当年天数 H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费 E 为 C 类基金份额的前一日基金资产净值 销售服务费每日计算，逐日累计至每个月月底，按月支付，由基金托管人根据基金管理人的指令并进行复核后，于次月前 5 个工作日内从基金资产中一次性支付。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。 上述"一、基金费用的种类"中第4—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，由基金托管人从基金财产中支付。 三、不列入基金费用的项目 基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的(ETF除外)，应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费(按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外)、销售服务费(如有)等销售费用。 四、《基金合同》生效前的相关费用按照《中信证券财富优选一年持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》相关标准执行。 六、基金税收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体，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。
第十六部分 基金的收益与分配	三、收益分配原则 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规定媒介和集合计划管理人网站公告。	三、基金收益分配原则 5.红利再投资所形成的基金份额，其最短持有期限同享受该红利的对应原基金份额的最短持有期限。 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。
第十七部分 基金的会计与审计	一、集合计划会计政策 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。	一、基金会计政策 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书面或电子方式确认。
第十八部分 基金的信息披露	二、信息披露义务人 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。 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符合中国证监会规定条件的全国性报刊(以下简称"规定报刊")和《信息披露办法》规定的互联网网站(以下简称"规定网站"，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。 五、公开披露的集合计划信息 公开披露的集合计划信息包括： (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 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。 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，并登载在规定网站上，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。 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。 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。 (二)集合计划份额净值和集合计划份额累计净值 资产管理合同生效后，在开始办理集合计划份额申购或者赎回前，集合计划管理人应当至少每周在规定网站披露一次集合计划份额净值和集合计划份额累计净值。 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每个开放日后的3个工作日内，通过规定网站、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