（上接D10版）

第一部分 前言	一、订立本资产管理合同的目的、依据和原则 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》”）和其他有关法律法规。 三、中信证券量化优选股票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。 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。 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。 关于集合计划产品资料概要编制、披露与更新的要求，由中国证监会规定之日起开始执行。	一、订立本基金合同的目的、依据和原则 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。 三、华夏量化选股股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由中信证券量化选股股票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。中信证券量化优选股票型集合资产管理计划由中信证券姜利宏1号集合资产管理计划（以下简称“原集合计划”）变更而来，原集合计划由中信证券投资有限公司（以下简称“中信证券”）设立并管理，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《关于中信证券投资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。 中国证监会对原集合计划变更为中信证券量化优选股票型集合资产管理计划的批准，中信证券量化优选股票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。 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。 六、本基金资产投资于港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“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（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。 本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通标的股票或选择不将基金资产投资于港股通标的股票，基金资产并非必然投资港股通标的股票。
第二部分 释义	4、资产管理合同或《资产管理合同》：指《中信证券量化优选股票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 6、招募说明书：指《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划招募说明书》及其更新 8、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会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<中华人民共和国港口法>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 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 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 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 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 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 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 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 20、投资人、投资者、委托人：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 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 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 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变动情况的账户 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 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<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》变更后的《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》生效日 30、存续期：指资产管理合同生效至终止之间的期间 34、开放日：指为投资者办理集合计划份额申购、赎回或其他业务的工作日 49、指定媒介：指中国证监会指定的用以进行信息披露的媒介 50、A类计划份额：指本集合计划存续期间，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别计划资产中计提销售服务费的份额。对于投资者依据原《中信证券姜利宏1号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姜利宏1号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 51、C类计划份额：指本集合计划存续期间，在投资者申购时不收取申购费用，但在赎回时收取赎回费，并从本类别计划资产中计提销售服务费的份额 56、大集合计划：指《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》规范的大集合产品	4、基金合同：指《基金合同》或本基金合同；指《华夏量化选股股票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 6、招募说明书或《招募说明书》：指《华夏量化选股股票型证券投资基金招募说明书》及其更新 8、《基金法》：指《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 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 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 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 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 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 18、合格境外机构投资者：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 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 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，办理销售业务的机构 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 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 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、定期定额投资等交易情况的账户 27、基金合同生效日：指《华夏量化选股股票型证券投资基金基金合同》生效日，《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》日同一日起失效 29、存续期：指《中信证券姜利宏1号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 33、开放日：指为投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日（若本基金参与港股通交易且该日为非港股通交易日，则本基金有权不开放申购、赎回，具体以届时公告为准） 48、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 49、A类基金份额：指本基金存续期间，在投资者申购时收取申购费用，在赎回时收取赎回费，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。原中信证券量化优选股票型集合资产管理计划A类计划份额，自本基金《基金合同》生效之日起将全部自动转换为本基金A类基金份额 50、C类基金份额：指本基金存续期间，在投资者申购时不收取申购费用，但在赎回时收取赎回费，并从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额。原中信证券量化优选股票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 54、港股通：指投资者委托内地证券公司，经由内地证券交易所设立的证券交易服务公司，向香港联合交易所进行申报，买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票。
第三部分 基金的基本情况	二、集合计划的类别 股票型集合资产管理计划 四、集合计划的投资目标 本集合计划通过量化模型、合理配置资产权重、精选个股、在充分控制投资风险的前提下，力求开创选持续稳定的相对收益。 六、基金存续期限 不定期 七、基金份额类别设置 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 本集合计划根据销售费用收取方式的不同，将份额分为不同的类别。 对于投资者依据原《中信证券姜利宏1号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姜利宏1号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。 投资者在申购份额时可自行选择A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》的有关规定在指定媒介上公告，不需要召开集合计划份额持有人大会。	二、基金的类别 股票型证券投资基金 四、基金的投资目标 本基金通过量化模型、合理配置资产权重、精选个股、在充分控制投资风险的前提下，力求开创选持续稳定的相对收益。 六、基金存续期限 不定期 七、基金份额类别设置 本基金根据申购费、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。 投资者在申购份额时可自行选择A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、减少或调整基金份额类别设置，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	第四部分 集合计划的历史沿革 中信证券姜利宏1号集合资产管理计划于2013年5月14日开始募集，2013年5月31日成立，并于2013年6月5日取得中国证券业协会《关于中信证券股份有限公司发起设立中信证券姜利宏1号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]583号）。 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》，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“中信证券量化优选股票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。	第四部分 基金的历史沿革 华夏量化选股股票型证券投资基金由中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更而来。中信证券量化优选股票型集合资产管理计划由中信证券姜利宏1号集合资产管理计划变更而来。 中信证券姜利宏1号集合资产管理计划于2013年5月14日开始募集，2013年5月31日成立，并于2013年6月5日取得中国证券业协会《关于中信证券股份有限公司发起设立中信证券姜利宏1号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]583号）。 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》，中信证券股份有限公司发起设立中信证券姜利宏1号集合资产管理计划变更注册事项，已经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准，同意中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更为华夏量化选股股票型证券投资基金。中信证券量化优选股票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]933号文准予变更注册。 20**年**月**日，中信证券量化优选股票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《关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的议案》，同意中信证券量化优选股票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，中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更为华夏量化选股股票型证券投资基金，即本基金；并调整投资范围、投资策略、投资限制、相关费率、估值方法等内容。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，《华夏量化选股股票型证券投资基金基金合同》生效，《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效。	第四部分 基金的历史沿革 华夏量化选股股票型证券投资基金由中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更而来，中信证券量化优选股票型集合资产管理计划由中信证券姜利宏1号集合资产管理计划变更而来。 中信证券姜利宏1号集合资产管理计划于2013年5月14日开始募集，2013年5月31日成立，并于2013年6月5日取得中国证券业协会《关于中信证券股份有限公司发起设立中信证券姜利宏1号集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]583号）。 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》，中信证券股份有限公司发起设立中信证券姜利宏1号集合资产管理计划变更注册事项，已经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）核准，同意中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更为华夏量化选股股票型证券投资基金。中信证券量化优选股票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]933号文准予变更注册。 20**年**月**日，中信证券量化优选股票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《关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更管理人并变更注册为华夏量化选股股票型证券投资基金有关事项的议案》，同意中信证券量化优选股票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，中信证券量化优选股票型集合资产管理计划变更为华夏量化选股股票型证券投资基金，即本基金；并调整投资范围、投资策略、投资限制、相关费率、估值方法等内容。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，《华夏量化选股股票型证券投资基金基金合同》生效，《中信证券量化优选股票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	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，但基金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。 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，即按照投资者认购、申购的先后次序进行顺序赎回； 四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 如遇证券、期货交易所成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往集合计划份额持有人银行账户。 3、申购和赎回申请的确认 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，投资者应时查询并妥善行使合法权利。因投资者自于行使权利，致使其相关权益受损的，集合计划管理人、集合托管人、基金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。本基金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，并按照各合同的约定公告。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：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金A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该类基金计划份额净值，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基金计划财产承担。 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金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基金计划财产承担。 4、申购费用由申购人支付，不列入基金财产。 5、赎回费用由赎回基金计划份额的基金份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回基金计划份额时收取。赎回费用日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，并全额计入基金计划财产。 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。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：当集合计划管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的资产变现可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，集合计划管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日集合计划总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。若集合计划发生巨额赎回，对于单个集合计划份额持有人当日超过上一开放日集合计划总份额10%以上部分的赎回申请，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请最占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资者在接受赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请享有同等优先权并以下一开放日的集合计划份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。 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。 十五、集合计划的冻结和解冻	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（若本基金参与港股通交易且该日为非港股通交易日，则本基金有权不开放申购、赎回，具体以届时公告为准），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。 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各类基金份额净值为基准进行计算； 4、本基金份额分为多个类别，适用不同的申购费或销售服务费，投资者在申购时可自行选择基金份额类别； 5、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； 6、投资者办理申购、赎回等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守基金合同和招募说明书规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准； 四、申购与赎回的程序 2、申购和赎回的款项支付 如遇证券、期货交易所成交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行交换系统故障、港股通非交易日或者发生港股通暂停交易或其他非基金管理人及基金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往集合计划份额持有人银行账户。 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。因投资者自于行使权利，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。 六、申购和赎回的价格、费用及其用途 1、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。本基金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：本基金申购份额的计算详见《招募说明书》。本基金A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。 3、赎回金额的计算及处理方式：本基金赎回金额的计算详见《招募说明书》。本基金计划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。 4、申购费用由申购人支付，不列入基金财产。 5、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在集合计划份额持有人赎回基金份额时收取。赎回费用日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。 7、基金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。 九、巨额赎回的情形及处理方式 2、巨额赎回的处理方式 （2）部分延期赎回：当基金计划管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为因支付投资者的赎回申请而进行的资产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。若基金发生巨额赎回，对于单个基金份额持有人当日超过上一开放日基金份额10%以上部分的赎回申请，将自动进行延期办理。对于其余当日非自动延期办理的赎回申请，应当按单个账户非自动延期办理的赎回申请最占非自动延期办理的赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额。对于未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请享有同等优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。 3、巨额赎回的公告 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，同时在指定媒介上刊登公告。 十五、基金份额的冻结和解冻 十八、基金管理人应当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。
第七部分 基金合同当事人及权利义务	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，决议日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决议； 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资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，并保证不对基金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，决议日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资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。
第十二部分 基金的投资	一、投资目标 本基金通过量化模型，合理配置资产权重，精选个股，在充分控制投资风险的前提下，力求开创选持续稳定的相对收益。 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80%-95%，港股通标的股票投资占股票资产的比例为0-50%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为5%-20%。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，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 本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经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、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）。 如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 集合计划的投资组合比例为：本集合计划股票投资占集合计划资产的80%-95%；除股票外的其他资产占集合计划资产的比例范围为5%-20%。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。 如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，集合计划管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。 集合计划的投资组合比例为：本集合计划股票投资占集合计划资产的80%-95%；除股票外的其他资产占集合计划资产的比例范围为5%-20%。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。 （一）权益类资产投资策略 1、股票投资策略 基于基本面研究逻辑，构建模块化投资流程和量化模型进行股票投资。基金以模块化投资流程强化投资纪律，以量化模型确保投资风格和决策的一致性，同时通过组合风险和回撤控制，力争实现长期稳健收益。 组合构建方法与流程： （1）通过多维度的基本面及市场交易数据构建初选股票池，并通过对因子前一段时间表现动态调整每个因子在选股模型中的权重，通过主动剔除具有极端风险的个股，构建全市场优质股票池并进行定期更新。 （2）通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选具有投资价值的个股构建投资组合。通过风险控制模型对组合进行相对于指数的跟踪误差的控制，主要限制组合相对指数的风险暴露和行业暴露，计算个股权重，达到在合理跟踪误差范围内增强指数收益的效果。 （3）根据市场变化趋势及个股基本面变化，定期或不定期地对策略与模型进行动态再平衡，通过风险控制模型进行组合流动率控制和预期回撤控制。 2、存托凭证投资策略 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。 3、港股通标的股票投资策略 在港股通标的股票投资策略方面，本基金将充分挖掘资本市场互联互通、资金双向流动机制下A股市场和港股市场的投资机会，重点关注香港市场上市、具有行业代表性的优质中资公司以及A股市场稀缺的香港本地公司、外资公司。通过精选香港市场行业结构、估值、成长性等方面具有吸引力的投资标的，结合投研团队的综合判断，构建投资组合。 基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股通选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。 （二）债券投资策略 本基金的债券投资主要分为： 1、流动性管理 首先根据基金的基金合同约定、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。 3、可转换债券、可交换债券投资策略 本基金计划主要投资于债性强、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换债券、可交换债券。 （三）金融衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，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。 未来，根据市场情况，在不改变