

# 安信证券沪港深精选集合资产管理计划

## 关于商品及金融衍生品投资的公告

根据《安信证券沪港深精选集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称“合同”)的说明,安信证券沪港深精选集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)可将部分资金投资于商品及金融衍生品(持仓合约价值的比例不高于资产管理计划总资产80%,或衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产20%),现将相关情况做进一步公告:

### 1、挂钩资产、控制措施

本集合计划主要拟投资上证 50ETF 期权(目前唯一的场内期权品种,本产品还可能投资交易所推出新的期权交易品种),在极端市场环境下,运用期权策略进行下行保护,期权组合持有周期据市场情况而定。

### 2、衍生品估值方法

1) 上市交易期权合约按估值日的结算价估值,估值日没有交易的,按最近交易日的结算价估值。

2) 期货合约按照期货交易所估值日的结算价估值,若估值日当日无结算价的,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。法律法规另有规定的,从其规定。

### 3、风险揭示

投资场内期权交易的风险:

1) 期权属于高风险高收益的金融衍生品,由于高杠杆特征,当

出现不利行情时，所投资期权合约品种微小的变动就可能会使本集合计划遭受较大损失。

2) 如本集合计划作为期权合约的买方，当出现不利行情时，如本集合计划选择不执行期权则本集合计划可能损失权利金/期权费及相应的时间成本，如本集合计划选择执行期权则可能因为不利行情因素导致本集合计划投资遭受损失；如本集合计划作为期权合约的卖方，当出现不利行情时，期权合约买方往往选择不执行期权，本集合计划可能由于所持期权价格受不利行情影响而产生较大的损失。

3) 当前，我国的场内期权交易品种及相关法律法规、交易规则尚未完全建立，不排除该等法律法规、交易规则的实施可能导致本集合计划无法参与期权交易。

上述公告不影响本集合计划的实际风险，也不影响投资者的实际权利。

如有任何疑问，请咨询销售机构营业网点工作人员，或致电本公司客服热线：95517。

特此公告。



安信证券股份有限公司  
二〇一九年四月十七日