

目录

目录	II
一、前言	1
二、释义	2
三、声明与承诺	5
四、当事人及权利义务	7
五、资产管理计划的基本情况	13
六、资产管理计划的募集	15
七、资产管理计划的成立与备案	17
八、资产管理计划的参与、退出与份额转让	18
九、份额持有人大会及日常机构	25
十、资产管理计划份额的登记	25
十一、资产管理计划的投资	26
十二、投资顾问	29
十三、分级安排	29
十四、利益冲突及关联交易	30
十五、投资经理的指定与变更	31
十六、资产管理计划的财产	31
十七、投资指令的发送、确认与执行	34
十八、交易及清算交收安排	38
十九、越权交易的界定	43
二十、资产管理计划财产的估值和会计核算	47
二十一、资产管理计划的费用与税收	50
二十二、资产管理计划的收益分配	55
二十三、报告义务	56
二十四、风险揭示	58
二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算	65
二十六、违约责任	70
二十七、法律适用和争议的处理	71
二十八、资产管理合同的效力	72
二十九、其他事项	73

附件一：南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划认购/参与告知书.....	76
附件三：管理人及托管人业务人员联系核实信息表	80
附件四：投资指令授权通知（样本）	81
附件五：南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划投资指令.....	82

一、前言

(一) 订立本资产管理合同的目的、依据和原则

1、订立本资产管理合同的目的是明确资产管理合同当事人的权利义务，规范南方资本恒逸中证1000指数增强1号集合资产管理计划(以下简称“资产管理计划”或“本计划”)的运作，保护各方当事人的合法权益，确保资产管理计划财产的安全。

2、订立本资产管理合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称“《指导意见》”)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称“《管理办法》”)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称“《运作规定》”)、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》和其他有关法律法规、部门规章及中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)自律规则等。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处，应当以届时有效的法律法规的规定为准，各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。

3、订立本资产管理合同的原则是平等自愿、诚实信用、充分保护资产管理合同当事人的合法权益。

(二) 资产管理合同是规定资产管理合同当事人之间权利义务关系的基本法律文件，其他与资产管理计划相关的涉及资产管理合同当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，如与本资产管理合同不一致或有冲突，均以本资产管理合同为准。资产管理合同的当事人包括委托人、管理人和托管人。委托人自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。自其不再持有本资产管理计划份额之日起，委托人不再成为资产管理计划的投资人和资产管理合同的当事人。

(三) 管理人应当对资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。基金业协会接受资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表基金业

协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。投资者应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

二、释义

本合同中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义（若释义与合同正文内容不一致，以合同正文内容为准）：

1. **委托人/份额持有人/投资者**：指签署本资产管理合同，委托管理人投资管理其委托财产的合格投资者。
2. **管理人**：指受委托人委托，负责为委托人的利益，运用计划财产进行投资运作的专业机构。本合同中即指南方资本管理有限公司，管理人公司网址为 <http://www.southerncapital.com.cn>。
3. **托管人**：本合同中即指华泰证券股份有限公司。
4. **资产管理合同/资管合同/合同**：指委托人、管理人及托管人三方签署的《南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及其附件，以及该三方对本合同及其附件做出的任何有效变更或补充。
5. **计划说明书**：指《南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划计划说明书》，内容包括资产管理计划概况、资产管理合同的主要内容、管理人与托管人概况、投资风险揭示、初始销售期间、中国证监会规定的其他事项等。
6. **合同当事人**：指受本合同约束，根据本合同享受权利并承担义务的委托人、管理人和托管人。
7. **委托财产**：指委托人拥有合法所有权或处分权、委托管理人管理并由托管人托管的、作为本合同标的的财产及其投资运作产生的收益。
8. **资产管理计划/资管计划/集合计划/计划**：指南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划。
9. **合同生效日/计划成立日**：指资产管理合同成立且本计划符合本合同约定的计划成立条件，管理人在其公司网站发布计划成立公告之日。自该日起，本计划成立，本计划资产管理合同生效。
10. **《指导意见》**：指《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》。

11. **《管理办法》**:指《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。
12. **《运作规定》**:指《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。
13. **《资管细则》**:指《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》的合称。
14. **中国证监会**:指中国证券监督管理委员会及其派出机构。
15. **基金业协会**:指中国证券投资基金业协会。
16. **销售机构**:指管理人和符合中国证监会或中国证券投资基金业协会规定的条件,取得基金销售资格并接受管理人委托,办理本计划认购、参与、退出等业务的机构。
17. **注册登记机构**:指办理注册登记业务的机构,本资产管理计划的注册登记机构指南方资本管理有限公司。
18. **委托人专户账户**:指注册登记机构为委托人开立的、记录其持有的、管理人所管理的计划份额余额及其变动情况的账户。
19. **委托人交易账户**:指销售机构为委托人开立的、记录委托人通过该销售机构买卖本计划的计划份额变动及结余情况的账户。
20. **存续期**:指本合同生效至终止之间的期限。
21. **初始销售期间**:指资产管理合同及计划说明书中载明,自计划份额发售之日起最长不超过60日。
22. **开放日**:指本计划存续期间,管理人办理计划参与、退出业务的交易日。
23. **认购**:指认购委托人在本计划初始销售期内申请认购本计划的行为。
24. **参与**:指资产管理合同生效后,委托人根据资产管理合同的规定在开放期内申请购买资产管理计划份额的行为。
25. **退出**:指资产管理合同生效后,委托人按资产管理合同规定的条件在开放期内要求将资产管理计划份额兑换为现金的行为。
26. **违约退出**:指委托人在非合同约定的开放日主动退出资产管理计划的行为。本计划不接受违约退出。
27. **第*i*个运作周期($i=1, 2, \dots$)**:除首个和最后一个运作周期外,本计划自上个开放日的首日(不含)至下一个开放期的首日(含)为一个运作周期。首个运作周期为本计划成立日(含)至本计划首个开放期的首日(含),

最后一个运作周期为本计划最后一个开放期的首日（不含）至计划终止日（含）。每个运作周期的最后一日为业绩报酬计提基准日。

28. **投资起始日**：指每个运作周期内管理人根据本合同的约定完成股指期货合约投资的日期，具体以管理人公告为准。
29. **投资终止日**：指每个运作周期内管理人根据本合同的约定投资的股指期货交割日期。
30. **计划份额/份额**：指集合计划在数量上的计量单位。某一委托人持有的集合计划份额等于该委托人参与集合计划的资金净额除以其认购、参与申请被受理当日集合计划份额净值；集合计划总份额等于全体委托人持有的集合计划份额之和。
31. **计划财产总值**：指计划财产所拥有的各类证券及票据、银行存款本息以及其他资产的价值总和。
32. **计划资产净值**：指计划财产总值扣除负债后的净资产值。
33. **计划份额净值**：指估值日资产管理计划资产净值除以估值日资产管理计划份额总数。
34. **计划财产估值**：指计算评估计划财产和负债的价值，以确定计划资产净值的过程。
35. **计划财产专用账户**：包括计划财产专用银行账户、专用场外交易账户等计划财产进行投资、托管所需开立的相关账户。
36. **计划财产专用银行账户**：指托管人根据有关规定为资产管理计划财产开立的，专门用于资金收付、清算交收的专用银行账户，即托管账户。
37. **募集账户**：指管理人开立的募集结算专用账户，用于统一归集本基金的募集结算资金。
38. **交易日**：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日。
39. **工作日**：同交易日。
40. **日**：指公历日。
41. **年度对日**：指某一日期之后各年度的对应日期，如 2021 年 1 月 1 日的年度对日为之后各年度的 1 月 1 日，即 2022 年 1 月 1 日、2023 年 1 月 1 日等。
42. **月**：指公历月。

43. 元：指人民币元。
44. 法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件、地方性法规、地方政府规章及规范性文件。
45. 不可抗力：指本合同当事人不能预见、不能避免、不能克服，且在本合同生效之日后发生的，使本合同当事人无法全部履行或无法部分履行本合同的任何事件和因素，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、恐怖袭击、传染病传播、法律法规变化、突发停电、通讯失败或其他突发事件，非因管理人、托管人自身原因导致的技术系统异常事故、政策法规的修改或监管要求调整等情形，因中国人民银行或其他商业银行结算系统、证券交易所或证券登记结算机构非正常暂停或停止交易或发送数据存在延误、错漏。

三、声明与承诺

（一）管理人的声明与承诺

1、管理人在签订本合同前充分地向投资者说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

2、管理人已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者的财务状况进行了充分评估。

3、管理人按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。

（二）托管人承诺

1、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

2、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和资产管理合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

3、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会，维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外。

（三）委托人声明与承诺

1. 符合《运作规定》合格投资者的要求，向资产管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知资产管理人或销售机构。资产委托人承诺将根据法律法规、监管机构要求履行或配合资产管理人、资产托管人履行信息披露义务、反洗钱义务、反恐怖融资义务等，承诺向资产管理人和资产托管人提供法律法规及监管要求的全部信息并配合提供尽调资料。

2. 投资者承诺以真实身份和自有资金认购资产管理计划，保证财产的来源及用途符合国家有关规定，委托财产为其拥有合法所有权或处分权的资产，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。保证有完全及合法的权利或授权委托资产管理人和资产托管人分别进行资产管理计划的投资管理和托管业务，保证投资本计划符合法律法规及监管要求，保证没有任何其他限制性条件妨碍资产管理人和资产托管人对该委托财产行使相关权利且该权利不会为任何第三方所质疑。

3. 已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，愿意承担相应的投资风险。委托人应当根据自身的经济状况和风险偏好考虑是否适于参加本资产管理计划。知晓资产管理人、资产托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。资产委托人知悉并同意，本计划运作过程中应缴纳的增值税及其附加税费，以资产管理人名义缴纳，但该等税费由委托财产及委托人承担。

4. 资产委托人承诺没有违反任何适用的经济制裁和出口管制法律和法规（以下简称“制裁和管制法”）；没有被任何有权实施经济制裁或出口管制的政府机构或国际组织（以下简称“制裁和管制机构”）以任何方式进行制裁或管制，或因制裁或管制的原因被制裁和管制机构调查、处罚或起诉。资产委托人同意在其受到（或可能受到）任何有权实施经济制裁或出口管制的政府机构或国际组织（以下简称“制裁和管制机构”）制裁或管制的情况下，或因制裁或管制的原因被制裁和管制机构调查、处罚或起诉的情况下，应立即通知本计划

管理人、托管人，并与本计划管理人、托管人积极沟通协商解决或替代方案。

四、当事人及权利义务

(一) 委托人

1、委托人概况

签署本合同且合同正式生效的投资人即为本合同的委托人。委托人的情况见合同签署页或“客户信息表”，资产管理计划设定为均等份额，除本合同另有约定外，每份同类计划份额具有同等的合法权益。

2、委托人的权利

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (3) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (4) 根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权；
- (5) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；
- (6) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；
- (7) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

3、委托人的义务

- (1) 认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法。遵守本合同，保证以真实身份参与资产管理计划；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (3) 承诺投资资产管理计划的最终资金来源不存在为贷款、发行债券等筹集的非自有资金的情形；
- (4) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；

(5) 认真阅读并签署风险揭示书；

(6) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

(7) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；

(8) 向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；

(9) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；

(10) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动，遵守所有适用的经济制裁和出口管制法律和法规；

(11) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；

(12) 配合资产管理人在反洗钱方面对投资者的尽职调查、资金来源和用途合法性审查、可疑交易调查和报告；

(13) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务。

(二) 管理人

1、管理人概况

名称：南方资本管理有限公司

住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

通信地址：深圳市福田区莲花街道益田路5999号基金大厦39层

法定代表人：朱运东

联系人：梁茜

联系电话：0755-21912224

网址：<http://www.southerncapital.com.cn/>

2、管理人的权利

- (1) 按照资产管理合同约定，独立管理和运用资产管理计划财产；
- (2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬；
- (3) 按照有关规定和资产管理合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；
- (4) 根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告证监会派出机构及基金业协会；
- (5) 自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；
- (6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；
- (7) 管理人有权根据市场情况对本资产管理计划的总规模、单个委托人与金额及持有的本计划总金额限制进行调整；
- (8) 法律法规、中国证监会、基金业协会规定的及资产管理合同约定的其他权利。

3、管理人的义务

- (1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (2) 按照基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；
- (3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；
- (4) 识别本资产管理计划的投资者和所投资标的（含所投下层资产管理产品），对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；
- (5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；
- (6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

(7) 建立健全的内部管理制度，保证本资产管理计划财产与管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；

(8) 除依据法律法规、资产管理合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；

(9) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；

(10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；

(11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(12) 按照资产管理合同约定接受投资者和托管人的监督；

(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；

(15) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；

(16) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(17) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；

(18) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(19) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；

(20) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，并向基金业协会备案，抄报证监会相关派出机构；

(21) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(22) 建立并保存投资者名单；

(23) 组织并参加资产管理计划清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、

估价、变现和分配；

(24) 按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册、妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于20年；

(25) 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相关派出机构、基金业协会并通知托管人和投资者；

(26) 本资产管理计划的反洗钱的义务由管理人承担，管理人保证遵守《中华人民共和国反洗钱法》及监管机构的要求遵守反洗钱、反恐融资及反逃税的相关法律规定，不从事涉及洗钱、恐怖融资及偷逃税等违法活动，遵守所有适用的经济制裁和出口管制法律和法规。若托管人根据内部业务管理或监管部门的要求，需进行投资人身份识别、身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等各项反洗钱工作的（如需），则管理人应当配合并提供满足托管人要求的相关证明材料。管理人应确保其向托管人提供的该投资者身份信息是真实、有效和完整的，如果前述该等投资者资料信息发生变化的，管理人有义务及时书面通知托管人并提供满足托管人要求的相关证明材料；

(27) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的的其他义务。

（三）托管人

1、托管人概况

名称：华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路228号

联系地址：南京市江东中路228号

负责人或授权代表：张伟

联系人：尹鹏

联系电话：025-83389988/025-83389966

2、托管人的权利

- (1) 按照资产管理合同约定，依法保管资产管理计划财产；
- (2) 按照资产管理合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；
- (3) 托管人有权要求管理人根据《中华人民共和国反洗钱法》的规定，

或根据托管人内部业务管理或监管部门的要求，配合托管人进行投资人身份识别、身份资料和交易记录保存、大额交易和可疑交易报告等各项反洗钱工作的（如需），管理人应当配合并提供满足托管人要求的相关证明材料。管理人应确保其向托管人提供的该投资者身份信息是真实、有效和完整的，如果前述该等投资者资料信息发生变化的，管理人有义务及时书面通知托管人并提供满足托管人要求的相关证明材料。若管理人拒绝配合提供该等投资者身份识别资料或配合托管人进行投资者身份识别工作的，或管理人提供的资料不真实或不完整的，或管理人未能及时提供变更后的投资者信息资料的，则托管人均有权暂停执行管理人的投资指令、及/或终止托管人在本合同项下的服务，而无需承担任何责任；

（4）法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。

3、托管人的义务

（1）安全保管资产管理计划财产，但不对处于托管人实际控制之外的财产承担保管责任；

（2）除依据法律法规规定和资产管理合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；

（3）对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；

（4）公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；

（5）按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；

（6）复核资产管理计划资产净值和份额净值；

（7）办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；

（8）根据相关法律法规和资产管理合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；

（9）编制托管年度报告，并向基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；

（10）按照法律法规要求和资产管理合同约定，根据管理人的投资指令，

及时办理清算、交割事宜；

(11) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；

(12) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划资产管理会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于20年；

(13) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和基金业协会。

(14) 投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；

(15) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的，由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；

(16) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

五、资产管理计划的基本情况

(一) 资产管理计划的名称

南方资本恒逸中证1000指数增强1号集合资产管理计划

(二) 资产管理计划的类型

本计划属于混合类集合资产管理计划。

(三) FOF、MOM产品的特别标识

不涉及。

(四) 资产管理计划的运作方式

开放式。

(五) 资产管理计划的投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级

1、投资目标

本计划在对标的指数进行有效跟踪的基础上，力争获取高于标的指数的投资回报。

2、主要投资方向及投资比例

投资方向：

(1) 固定收益类资产：银行存款（包括活期存款、定期存款、同业存款与协议存款等）、同业存单、货币市场基金（含货币ETF）、货币市场或现金管理类银行理财、证券公司及其资产管理子公司资产管理计划、保险公司资产管理计划和信托计划。

(2) 权益类资产：沪深交易所发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票，含新股申购）、股票型和混合型公开募集证券投资基金。

(3) 商品及金融衍生品资产：股指期货。

投资比例：

本计划为混合类资产管理计划，投资比例应符合《管理办法》第二十条第（四）款的规定，计算各类资产投资比例的方式以第十一章的约定为准。

3、产品风险等级

本资产管理计划风险等级为R4级。

（六）资产管理计划的存续期限

除发生本合同约定的提前终止情形，本资产管理计划的存续期限自合同生效之日起至原则上投资运行满5年后终止。本计划自管理人在其公司网站发布计划成立公告之日，本计划成立，本计划资产管理合同生效。此外，本计划可根据合同相关约定提前终止或展期。

（七）资产管理计划份额初始面值

人民币1.000元。

（八）资产管理计划的初始募集规模

本资产管理计划成立时委托财产的初始资产净值不得低于1,000万元人民币。单个委托人的初始资产管理计划资产不得低于40万元人民币（不含认购费用）。但中国证监会或基金业协会另有规定的除外。

（九）资产管理计划的分级安排

不涉及

（十）资产管理计划的份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

不涉及。

六、资产管理计划的募集

(一) 资产管理计划份额的初始销售期间

初始销售期间自计划份额发售之日起原则上不超过60日，管理人可与销售机构协商后提前终止初始销售，并在管理人网站及时公告，即视为履行完毕提前终止初始销售的程序。管理人发布公告提前结束初始销售的，本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。

(二) 销售方式

本资产管理计划通过管理人及其代理销售机构进行销售。具体发售方式、销售机构名单、联系方式以本资产管理计划的《计划说明书》为准。

本计划提供通过纸质合同或电子合同进行认购。通过纸质合同认购的，客户必须与管理人、托管人签署纸质的资产管理合同，并按销售机构规定的方式足额缴纳认购款项。

(三) 销售对象

本计划仅面向合格投资者进行销售，本计划的委托人人数不得少于2人，不得超过200人。合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于本计划的金额不低于人民币40万元（不含认购费用），且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。

1、具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低于40万元。

2、最近1年末净资产不低于1,000万元的法人单位。

3、依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构。

4、接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品。

5、基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会

公募基金,合格境外机构投资者(QFII)、人民币合格境外机构投资者(RQFII)。

6、中国证监会视为合格投资者的其他情形。

前述“金融资产”是指银行存款、股票、债券、基金份额、资产管理计划、银行理财产品、信托计划、保险产品、期货及其他衍生产品等。

投资者不得使用贷款、借款、发行债券等筹集的非自有资金投资于本计划。特别地,如果将来法律法规、金融管理部门另有规定的,从其规定。

同时,鉴于本计划投资范围包含资产管理产品,为符合监管要求,本计划不接受资产管理产品的认购申请。

(四) 资产管理计划份额的认购和持有限额

本资产管理计划采取全额缴款认购的方式。单个委托人在初始销售期间的认购金额不得低于40万元人民币(不含认购费用),并可多次认购。追加委托投资的最低金额应为人民币1万元(不含认购费用),委托人可多次追加委托投资金额。

(五) 资产管理计划份额的认购费用

无。

(六) 资产管理计划认购份额的计算方式

委托人的认购份额=委托人认购金额/1.00元/份;

认购份额的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产计入计划财产。

(七) 初始销售期间的认购程序

1、管理人委托销售机构进行销售的,由销售机构完成对投资者的销售适当性尽职调查工作,并将相关资料提供给管理人。

2、认购程序。委托人办理认购业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下,以销售机构的具体规定为准。

3、认购申请的确认。认购申请受理完成后,投资者不得撤销。如认购计划份额的人数总和超过200人,则按照时间优先、金额优先的原则进行确认,确保本合同生效时本资产管理计划的人数不超过200人(含)。按照以上顺序,对于排序在前的委托人的有效认购申请全额予以确认,其余委托人的认购资金予以返还。认购申请采取时间优先、金额优先原则进行确认。

销售网点受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以注册登记机构的确认并且资产管理合同生效为准。委托人应在本合同生效后到各销售网点查询最终确认情况和有效认购份额，并同意以注册登记机构或销售机构的认购确认书作为最终认购金额和份额的依据。

(八) 管理人、销售机构应当在具备基金销售业务资格的商业银行或者从事客户交易结算资金存管的指定商业银行，或者中国证券登记结算有限责任公司开立资产管理计划销售结算专用账户。

管理人应当将资产管理计划初始销售期间客户的资金存入本资产管理计划管理人开立的募集账户，在资产管理计划初始销售行为结束前，任何机构或个人不得动用该账户中用于认购本资产管理计划的客户资金。

账户信息如下：

银行名称：中国工商银行深圳免税大厦支行

银行户名：南方资本管理有限公司募集户

银行账号：4000053629100149448

(九) 资产管理计划初始销售资金利息的处理方式

本资产管理计划不收取认购费用。

投资者的认购参与款项（不含认购费用）加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有，其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

投资者的认购份额=（委托人认购金额+委托人认购期利息）/1.00元/份。

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分舍去，舍去部分所代表的资产计入计划财产。

七、资产管理计划的成立与备案

(一) 资产管理计划的成立

本计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告。本计划取得验资报告，并且符合以下条件的，由管理人公告本计划成立：

- 1、募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；
- 2、募集金额不低于1,000万元人民币；
- 3、投资者人数不少于2人且未超过200人；
- 4、符合中国证监会规定以及资产管理合同约定的其他条件。

自管理人在其公司网站发布计划成立公告之日，本计划成立，本计划资产管理合同生效。资产管理计划成立前，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。

（二）资产管理计划的备案

管理人应当在本计划成立之日起5个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

资产管理计划在成立后完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

资产管理计划完成备案，获得基金业协会备案证明后，资产管理计划方可以按照本合同约定进行投资运作。

如资产管理计划最终未能通过基金业协会备案，本计划将无法按照合同约定进行投资运作，本计划及其资产管理合同应当自动终止，委托人认购参与款项及其现金管理收益（如有）将退还至委托人认购账户。

（三）资产管理计划募集失败的处理方式

资产管理计划销售期限届满，资产管理计划未达到成立条件的，管理人应当承担的责任：

- 1、以固有财产承担因销售行为而产生的债务和费用。
- 2、在资产管理计划销售期限届满后30日内返还客户已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

八、资产管理计划的参与、退出与份额转让

（一）参与和退出场所

本计划的参与和退出将通过资产管理人委托的销售代理机构进行。

（二）参与和退出的方式、开放日和时间

本计划设有封闭期，封闭期为成立之日起至本计划首个开放日（不含），封闭期内不办理参与退出业务，本计划不接受违约退出。

本计划首个开放日为2023年6月16日。第二个及之后开放日为第一个开放日起每6个月对月的第三个周五（遇非交易日则顺延至下一个交易日）。为了匹配投资标的变现期限，管理人有权根据本计划运营管理情况，适当调整开放安排，开放期安排以管理人公告为准。

本计划开放安排采取预约设置。投资者必须通过提前预约的方式参与或退出本计划，预约期为每个开放日（T日）前五个工作日（T-5）至前两个工作日（T-2日），投资者应当在预约期内的交易时间（9:30-15:00）向销售机构提交书面的参与或退出申请。开放日仅办理投资者在预约期提出的预约申请，不接受投资者在开放日当日提出的参与或退出申请；投资者未在预约期内提出预约申请的，销售机构有权拒绝受理委托人的参与或退出申请。

本计划参与和退出的开放日和时间以管理人届时在公司官网（www.southerncapital.com.cn）与销售机构披露渠道发布的公告为准。除上述情况外，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，资产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并告知资产委托人。资产管理人提前3个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

（三）临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排

因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化需要变更资产管理合同，导致委托人需要退出本计划的，管理人有权在法规调整的情况下，根据本合同第二十五章的约定设置临时开放期，临时开放期仅供不同意变更的委托人退出，具体以管理人公告为准。

（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认

1、参与和退出价格和方式

(1) “未知价”原则，即本计划的参与和退出价格以开放日当日（T日）收市后计算的资产管理计划份额净值为基准进行计算。

(2) 资产管理计划金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

(3) 委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

(4) 当日的参与和退出申请可以在当日开放时间结束前撤销，在当日的开放时间结束后不得撤销。

(5) 参与和退出申请的确认。销售网点受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了参与或退出申请。参与申请采取时间优先、金额优先原则进行确认，确保本计划委托人人数不超过 200 人。退出申请按先进先出的方式处理。申请是否有效应以注册登记机构的确认为准。注册登记机构应在 T+1 工作日对资产委托人参与、退出申请的有效性进行确认。投资者应在一个开放周期结束后至各销售网点查询最终确认情况。

(6) 参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，已交付的委托款项将退回资产委托人指定资金账户。资产委托人退出申请成交后，资产管理人应按规定向资产委托人支付退出款项，退出款项自确认之日起 5 个工作日内划往代销机构清算账户或资产委托人银行账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。

(7) 管理人在不损害资产委托人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 3 个工作日告知资产委托人。资产管理人提前 3 个工作日在网站公告前述调整事项即视为履行了告知义务。

2、参与和退出的程序

委托人参与、退出的具体方式和程序，以及办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同和计划说明书的前提下，以各销售机构的具体规定为准。

(五) 参与和退出的金额限制

1、投资者在资产管理计划存续期开放日购买资产管理计划份额的，投资者应符合合格投资者标准，参与金额应不低于 40 万元（不含参与费用），已持有资产管理计划份额的投资者在资产管理计划存续期开放日追加购买资产管理计划份额的除外。

2、当委托人持有的计划资产净值高于 40 万元时，委托人可以选择全部或部

分退出资产管理计划；选择部分退出资产管理计划的，委托人在退出后持有的计划资产净值不得低于 40 万元。当管理人发现委托人申请部分退出资产管理计划将致使其在部分退出申请确认后持有的计划资产净值低于 40 万元（含）时，管理人有权适当减少该资产委托人的退出金额，以保证部分退出申请确认后资产委托人持有的计划资产净值不低于 40 万元。当委托人持有的计划资产净值低于 40 万元（含）时，需要退出计划的，委托人必须选择一次性全部退出资产管理计划，委托人未一次性全部退出的，管理人有权强制全部退出。

管理人可根据市场情况，合理调整参与金额和退出份额的数量限制，管理人进行前述调整前必须提前 3 个工作日告知委托人

（六）参与和退出的费用

本计划参与和退出不收取费用。

（七）参与份额的计算方式、退出金额的计算方式

1、参与、退出价格为开放日当日（T 日）收市后计算的资产管理计划份额净值；

2、计划参与份额的计算

参与份额=参与金额/开放日当日（T 日）收市后计算的资产管理计划份额净值

参与份额计算结果按照四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此误差产生的损失由资产管理计划财产承担，产生的收益归资产管理计划财产所有。

3、计划退出金额的计算

退出金额=退出份额×开放日当日（T 日）收市后计算的资产管理计划份额净值—管理人业绩报酬（如有）

退出金额的计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后 2 位，由此误差产生的损失由资产管理计划财产承担，产生的收益归资产管理计划财产所有。

（八）参与资金的利息处理方式（如有）

无。

（九）拒绝或暂停参与的情形

出现以下情形之一，资产管理人有权拒绝或暂停参与：

1、本计划参与人数达到上限 200 人；

- 2、不可抗力的原因导致本计划无法正常运作；
- 3、证券交易所在交易时间非正常停市；
- 4、发生本合同规定的暂停计划资产估值情况；
- 5、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

如果资产委托人的参与被拒绝，被拒绝的参与款项本金将退还给资产委托人。

（十）暂停退出或延缓支付退出款项的情形

出现以下情形之一，资产管理人可以暂停退出或延缓支付退出款项：

- 1、不可抗力的原因导致本计划无法正常运作；
- 2、证券交易所在交易时间非正常停市；
- 3、发生本合同规定的暂停计划资产估值情况；
- 4、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

（十一）大额退出的通知

单一委托人在一个开放日退出金额超过 500 万元的，应当在退出日前 3 个工作日书面通知资产管理人。资产管理人未收到相关通知的，有权拒绝资产委托人的退出。

（十二）巨额退出的认定及处理方式

1、巨额退出的认定

在一次开放周期内，资产管理计划的净退出申请份额超过退出开放日前一个工作日资产管理计划总份额的 20%，为巨额退出。

2、巨额退出的处理方式

出现巨额退出时，资产管理人可以根据本计划当时的资产状况决定接受全额退出或部分退出。

（1）接受全额退出：当资产管理人认为有能力兑付资产委托人的全部退出申请时，按正常退出程序执行。

（2）部分退出：当资产管理人认为全额兑付资产委托人的退出申请有困难，或认为兑付资产委托人的退出申请进行的资产变现可能使资产管理计划财产净值发生较大波动时，资产管理人在接受退出比例不低于退出开放日前一个工作日资产管理计划总份额 20%的前提下，办理部分退出，并按单个资产委托人申请退出份额占净退出申请份额的比例，确定该资产委托人的退出份额；未受理部分予

以撤销。部分退出导致资产委托人持有的计划资产净值低于 100 万元（含）的，资产管理人可按全额退出处理。

(3) 当发生巨额退出并只接受部分退出时，资产管理人应当通过管理人网站、邮寄、传真、本合同或计划说明书规定的其他方式，在参与开放日后的 3 个交易日内及时告知资产委托人，说明有关处理方法。

(十三) 非交易过户

1、管理人及注册登记机构只受理继承、捐赠、司法强制执行和经注册登记机构认可的其他情况下的非交易过户。其中：“继承”是指委托人死亡，其持有的计划份额由其合法的继承人继承；“捐赠”是指委托人将其合法持有的计划份额捐赠给福利性质的基金会或社会团体；“司法强制执行”是指司法机构依据生效司法文书将委托人持有的计划份额强制划转给其他自然人、法人、社会团体或其他组织的情形。

2、办理非交易过产业务必须提供注册登记机构规定的相关资料。符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理；申请人按注册登记机构规定的标准缴纳过户费用。

(十四) 份额转让

1、本资产管理计划存续期间内，管理人可以视情况开放本计划的份额转让。经管理人同意，持有本计划份额的委托人可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向符合条件的合格投资者转让其持有的计划份额。

2、委托人申请份额转让的，应当经过管理人的合规性审查；受让方必须具备合格投资者身份，并且在份额转让后持有本计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。受让方首次参与本计划的，应先与管理人、托管人签订本资产管理合同。份额转让所产生的相关税、费由转让双方按照相关规定或约定自行承担。

3、份额转让完成后，受让方即成为本计划的委托人，享有和承担本合同所约定的所有权利和义务。转让方如不再持有本计划份额，则不再享有和承担本合同所约定的所有权利和义务。

4、上述份额转让事项应当符合国家有关法律法规的规定及要求，遵守交易场所相关规定及要求，并按照管理人的要求提供相关资料并办理份额登记手续。具体操作规则详见管理人网站届时提前公布的公告信息。

5、委托人持有计划份额的变动情况以及持有份额数量以注册登记机构的记

录为准。本资产管理计划终止日，委托人名录及持有份额明细，以注册登记机构登记的记录为准。管理人应当按照法律法规的相关规定定期将本计划委托人变动情况及其持有计划份额的变动情况报送基金业协会。

(十五) 管理人自有资金参与集合计划

1、管理人可以以自有资金参与本集合计划。管理人自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 20%，管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不超过本集合计划总份额的 50%。

2、管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得低于 6 个月，管理人有多笔自有资金参与的，按照“先进先出”原则计算管理人自有资金参与份额的持有期限。参与、退出时应当提前 5 个工作日告知委托人和托管人。

3、因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超过法律、法规规定比例而导致管理人自有资金退出的，可以不受本条第 2 款约定限制，管理人应当按照相关法律法规规定，退出被动超限的部分份额，依法及时调整。

4、为应对巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出本计划可不受上述第 1、2 款的限制，但需事后及时告知委托人和托管人，并向管理人所在地中国证监会派出机构及基金业协会报告。为应对集合计划巨额赎回，解决流动性风险，管理人有权设置特定开放期，自行安排自有资金参与或退出集合计划。

5、自有资金的收益分配：管理人持有的份额（如有）与其他份额享有同等权益、承担同等风险。

6、自有资金责任承担方式和金额：管理人持有的份额（如有），除承担份额相对应责任外，不再承担额外责任。

7、风险揭示：管理人自有资金参与份额（如有）退出，可能遭遇流动性风险，从而影响集合计划损益。管理人将认真履行职责，关注集合计划规模变动情况，尽可能控制流动性风险。

(十六) 管理人应定期将资产管理计划投资者变更情况报送基金业协会。

九、份额持有人大会及日常机构

考虑到本计划运作特点，本计划所有当事人一致同意，本计划不设份额持有人大会及日常机构。对于延长资产管理合同期限、修改资产管理合同的重要内容或提前终止资产管理合同、更换管理人或托管人、调整管理人和托管人的报酬标准或其他可能对份额持有人权利义务产生重大影响的事宜，将按照资产管理合同相关章节相应条款处理。

十、资产管理计划份额的登记

(一) 本资产管理计划份额的注册登记业务指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

(二) 本资产管理计划的注册登记业务由管理人南方资本管理有限公司办理。

(三) 注册登记机构的职责

- 1、建立和保管委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客户资料表提供给管理人。
- 2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 3、严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。
- 4、严格按照法律法规和本资产管理合同规定计算计划利益，并提供交易信息和计算过程明细给管理人。
- 5、保管资产管理计划客户资料表及相关的参与和退出等业务记录 20 年以上。
- 6、对委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对委托人、管理人、托管人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但司法强制检查及按照法律法规的规定进行披露的情形除外。
- 7、按照本资产管理合同，为委托人办理非交易过户等业务，提供资产管理计划利益分配等其他必要的服务。
- 8、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则。

9、法律法规规定及本合同约定的其他职责。

(四) 全体资产管理计划份额持有人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将集合资产管理计划投资者名称、身份信息以及集合资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。

十一、资产管理计划的投资

(一) 投资目标

本计划在对标的中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，力争获取高于标的指数的投资收益。

(二) 投资范围及投资比例

1、投资范围：

(1) 固定收益类资产：银行存款（包括活期存款、定期存款、同业存款与协议存款等）、同业存单、货币市场基金（含货币 ETF）、货币市场或现金管理类银行理财、证券公司及其资产管理子公司资产管理计划、保险公司资产管理计划和信托计划。

(2) 权益类资产：沪深交易所发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票，含新股申购）、股票型和混合型公开募集证券投资基金。

(3) 商品及金融衍生品资产：股指期货。

2、投资比例：

(1) 本计划根据穿透原则合并计算的投资于权益类资产的总值不超过计划总资产的 80%、投资于固定收益类资产的总值不超过计划总资产的 80%、投资商品及金融衍生品类资产的总值不超过计划总资产的 80%或衍生品保证金账户权益不超过计划总资产的 20%；

(2) 本计划按《运作规定》规定进行组合投资，本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%；本管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。银行活期存款等中国证监会认可的投资品种的除外。

(三) 投资比例超限的处理方式及流程

因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，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十五个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

（四）风险收益特征

本资产管理计划为【混合】类集合资产管理计划，本计划的风险等级为【R4】，适合专业投资者和风险承受能力评级不低于【C4】级的普通投资者。本计划的收益表现主要取决于本计划挂钩标的及投资标的在本计划存续期间的表现，资产管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益或委托财产本金不受损失，以及限定投资损失金额或比例。

（五）投资策略

1、投资策略

本计划将采取指数增强策略进行投资，具体来说在每个运作期独立运作，即于每个运作期的到期日完成期货合约交割以及其他所有资产的变现，并于下一个运作期的投资起始日投资于新的期货合约等资产。具体如下：

（1）资产配置策略

根据宏观经济指标，各类资产的流动性状况、证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析，在整体资产之间进行动态配置，确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

（2）衍生品的投资策略

本计划将在每个运作期期初，选择在当个运作期期末交割的标的指数股指期货进行投资，利用股指期货合约与标的指数的价格收敛性，通过观察标的指数股指期货合约与标的指数的基差，对市场走势、衍生品合约的风险收益及投资时机进行充分评估后，选择期货贴水幅度较大时的有利建仓时机和配置比例。

（3）基金及其他资管产品的投资策略

本计划将优先选择符合以下条件的基金或其他资管产品：

1) 被投标的管理人及基金经理/投资经理最近两年没有重大违法违规行为，管理人内部管理规范、业绩优良，基金经理/投资经理管理经验丰富、过往业绩良好且较为稳定；

2) 被投标的集中度、分散度、流动性与本计划相匹配。

3) 被投资资产管理产品全部投资标准化资产，不能再投资其它资产管理计划。

(4) 权益类资产投资策略

当股指期货合约不能实现指数增强策略目标时，本计划将备选权益类资产进行投资配置，以实现指数增强策略目标。权益类资产重点将优选跟踪标的指数的股票型ETF基金及指数增强型公募基金以实现对指数的追踪基础上，获取可能的增强收益。

2、决策依据

本计划将在遵循法律法规、部门规章及证券投资基金业协会自律规则等规定、公司内部投资管理制度以及本合同相关约定基础上，结合本计划的投资目标、投资策略进行投资决策。

3、决策程序

本计划管理人设置有投资决策委员会对产品投资原则、投资目标等进行审议，并任命投资经理。投资经理在授权范围内构建和调整投资组合，风控、合规人员参与整个投资决策流程，防范和监控可能出现的风险。

4、投资管理的方法和标准

本管理人将在审慎的尽职调查的基础上，综合考虑交易对手资质、各类投资标的的期限、收益率、基础资产、信用风险等情况，寻找合适的标的进行投资。

资产委托人确认并明确本章节所述投资标的，资产委托人对本计划投资于本章节所述投资标的具有明确认知并无异议表示，管理人将根据本合同授权签署相关投资合同。

(六) 投资限制

(1) 本计划持有一家上市公司的股票，其市值不得超过该计划财产净值的

10%且不得超过该证券的10%；

(2) 本计划的总资产不得超过本计划净资产的200%；

(3) 本计划投资于同一标的资产不得超过本计划资产净值的25%；资产管理人管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等经中国证监会认可的投资品种除外。

(七) 投资禁止行为

本资产管理计划财产禁止从事下列行为：

(1) 承销证券；

(2) 违反规定向他人贷款或提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(5) 法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

(八) 建仓期

本计划建仓期为自计划成立之日起至计划成立届满6个月之日止。管理人应当在建仓期内使本计划投资组合比例符合法律法规相关规定以及本合同相关约定。

(九) 资产组合的流动性与参与、退出安排的匹配

管理人将按照法律法规及本合同约定确保本计划所投资的资产组合流动性与本计划参与、退出安排相匹配。

本计划开放退出期内，资产组合中7个工作日可变现资产的价值，不低于本计划净值的10%。

十二、投资顾问

本计划未聘请投资顾问。

十三、分级安排

本计划不进行分级安排。

十四、利益冲突及关联交易

(一) 本计划可能存在的利益冲突情形

全体委托人知悉并认可，管理人作为专业资管机构已经或将会设立不同的资产管理计划，管理人将按照法律法规的规定，公平对待不同资产管理计划的投资机会。同时，对于管理人、托管人、代销机构及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方所发行的证券、管理的公募基金、代理销售的资产管理产品或承销期内承销的证券，管理人可运用本计划财产向其投资或与其交易，但需要符合金融监管部门的规定、遵循投资者利益优先的原则、防范利益冲突。

(二) 本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容及披露频率

1、处理方式

管理人在符合金融监管部门相关规定之要求的基础上，遵循投资者利益优先的原则，按照市场上通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防范及公平解决利益冲突。

2、披露方式及披露频率

资产管理计划在投资运作中发生利益冲突情形时，管理人将在投资或交易完成后的五个工作日内通过管理人官网进行披露，并同时于年度报告及季度报告中予以披露。

3、披露内容

临时报告及季度报告将对是否发生利益冲突事项及已发生利益冲突事项情形、处置方式以及对委托人利益影响等内容进行详尽披露。

(三) 本计划从事关联交易（如有）的安排

除前述第（一）款规定外，管理人不得将其管理的本计划资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为本机构、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。

管理人自营账户、资产管理计划账户、管理人作为投资顾问管理的账户之间，以及管理人所管理的不同资产管理计划账户之间，不得发生交易，有充分证据证明进行有效隔离并且价格公允的除外。管理人的母公司（南方基金管理股份有限公司）的自营账户、所管理的资产管理计划账户以及作为投资顾问管理的账户与管理人所管理的资产管理计划账户之间不得发生交易，有

充分证据证明进行有效隔离并且价格公允的除外。

委托人签署本合同即表明其已经知晓且认可本计划可能进行上述关联交易。除构成重大关联交易外，无需取得资产委托人的个别授权，但应事后通过资产管理计划季度报告和年度报告等方式向委托人进行详尽披露。

管理人承诺：建立健全关联交易管理制度，对关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序进行规范，不会以本计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场等违反法律法规要求的行为。

十五、投资经理的指定与变更

(一) 投资经理的指定

1、投资经理的指定

资产管理计划投资经理由管理人负责指定。

2、本计划投资经理

本资产管理计划的投资经理简历如下：

季伟先生，硕士，计量经济学专业，拥有基金从业资格，曾先后任职于招商证券研究所金融工程研究员、中国国际金融有限公司证券投资部量化投资经理。2013年3月加入南方基金，任量化高级研究员；2014年12月任投资经理。现任南方资本投资管理部总监，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，无公募基金基金经理兼任情况。

(二) 投资经理的变更

管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知委托人。管理人自变更之日起5个交易日内在管理人公司网站www.southerncapital.com.cn公告调整事项即视为履行了告知义务。

十六、资产管理计划的财产

(一) 资产管理计划财产的保管与处分

1、资产管理计划财产的债务由资产管理计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。托管人对实际交付并控制下的计划财产承担保管职责，对于结算机构等非托管人保管的财产不承担责任。

2、资产管理计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理

人管理的和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将资产管理计划财产归入其固有财产。

3、管理人、托管人因资产管理计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益归入资产管理计划财产。

4、管理人、托管人可以按本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对资产管理计划财产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，资产管理计划财产不属于其清算财产。

5、资产管理计划财产产生的债权不得与不属于资产管理计划财产本身的债务相互抵销。非因资产管理计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对资产管理计划财产强制执行。上述债权人对资产管理计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知资产管理计划财产的独立性。

（二）银行账户的开设和管理

1、托管人应负责本计划有关的银行账户的开设和管理，管理人应配合托管人办理开立账户事宜并提供相关资料。

2、托管人以计划的名义或托管人的名义在具有相关资格的银行代理开设托管专户，保管计划的银行存款。该账户的开设和管理由托管人负责，托管专户户名以实际开立为准。本计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该账户进行。管理人在确定托管账户名称时应考虑满足三方存管、银行间市场开户要求等需要。

3、托管专户的开立和使用，限于满足开展托管业务的需要。托管人和管理人不得假借本计划的名义开立其他任何银行账户；亦不得使用本计划的任何银行账户进行本计划业务以外的活动。

4、托管专户的管理应符合《人民币银行结算账户管理办法》、《现金管理暂行条例》、《支付结算办法》和中国人民银行利率管理的有关规定以及其他有关规定。

（三）计划的证券账户和证券资金账户的开设和管理

1、管理人或托管人应当以计划的名义在中国证券登记结算有限责任公司

开设证券账户，用于本计划证券投资的清算和存管，证券账户名称应当符合证券、期货登记结算机构的有关规定。管理人与托管人应互相配合办理开立账户事宜并提供相关资料。

2、本计划证券账户的开立和使用，限于满足开展本计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本计划的任何证券账户；亦不得使用本计划的任何证券账户进行本计划业务以外的活动。

3、本计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由托管人负责，管理和使用由管理人负责。

4、托管人协助管理人以计划名义在证券经纪商营业网点开立证券资金账户，并按照证券经纪商营业网点开户的流程和要求，签订相关的协议，并办理三方存管，银证转账的密码交由托管人保管，托管人应根据管理人的指令，进行银证转账和银期转账的操作。

5、交易所证券交易资金采用第三方存管模式，即用于证券交易结算资金全额存放在管理人为本计划开设证券资金账户中，场内的证券交易资金清算由管理人选择的证券经纪商证券营业部负责。

（四）基金账户的开设和管理

1、管理人应当以计划的名义在拟投资基金的注册登记人处开设基金账户，并在该基金的销售机构开设基金交易账户。基金账户名称应至少包含资产管理计划名称，具体以托管人实际开立为准。

2、本计划基金账户和基金交易账户的开立和使用限于满足开展本计划业务的需要。托管人和管理人不得出借和未经另一方同意擅自转让本计划的任何基金账户或基金交易账户；亦不得使用本计划的任何基金账户或基金交易账户进行本计划业务以外的活动。

3、本计划基金账户和基金交易账户的管理和使用由管理人负责。

（五）债券托管专户的开设和管理

资产管理合同生效后，管理人和托管人相互配合，根据中国人民银行及中央国债登记结算有限责任公司、银行间清算所股份有限公司的有关规定，在债券登记结算机构开立债券托管账户，并代表委托财产进行银行间市场债券的结算。管理人负责委托资产在银行间市场的债券交易，托管人负责银行间债券交

割与资金划拨。

（六）定期存款账户的开立和管理

定期存款（包括协议存款）账户的预留印鉴至少包含一枚托管人指定人名章，由托管人保管和使用。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为投资指令附件。该协议中必须有如下明确条款：‘存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户’。如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的投资指令。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本。

（七）投资银行理财的银行账户的开立和管理

因本计划运作需要投资银行理财产品的，须通过本计划托管账户所在开户行开通理财交易账户购买。

（八）其他账户的开设和管理

因业务发展而需要开立的其他账户，应由托管人或管理人根据有关法律法规的规定开立。新账户按有关规则管理并使用。

（九）募集资金的移交验证

本计划初始销售期限届满，管理人应将属于资产管理计划财产的全部资金划入托管人开立的计划财产专用银行账户。本计划的募集金额缴足之日起10个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告。本计划取得验资报告，并且符合成立条件的，由管理人公告本计划成立。管理人应当在本计划成立之日起5个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

十七、投资指令的发送、确认与执行

（一）交易清算授权

管理人应向托管人提供预留印鉴和授权人签字样本，事先书面通知（以下称“授权通知”）托管人有权发送指令的人员名单，注明相应的交易权限，授

权书的格式可参考托管人服务平台公告的模板样式，具体格式以管理人实际发送的版本为准（但应包含被授权人名单、预留印鉴以及被授权人签字样本等基本要素）。管理人应将前述授权通知的扫描件发送至托管人，同时以录音电话形式向托管人确认。双方电话确认后，该授权通知于通知载明时间生效，如双方电话确认的时间晚于通知载明时间的，该授权通知于双方电话确认时生效。管理人和托管人对授权文件负有保密义务，除法律法规另有规定外，其内容不得向被授权人及相关操作人员以外的任何人泄露。

（二）投资指令的内容

投资指令是管理人在管理、运用资产管理计划财产时，向托管人发出的资金划拨及其他款项支付的指令。管理人发给托管人的指令应写明款项事由、支付时间、到账时间、金额、收款账户信息等，加盖预留印鉴并由被授权人签章。

（三）投资指令的发送、确认和执行的程序和程序

投资指令由“授权通知”确定的有权发送人代表管理人用传真的方式或其他托管人和管理人确认的方式向托管人发送。资产托管人接收划款指令的邮箱以及传真号参见托管人电子服务平台的公告信息，如有变更参见资产托管人电子服务平台的最新通知。管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话方式进行确认。指令以与托管人录音电话确认该指令已成功接收之时视为送达托管人。因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时清算所造成的损失，由资产管理人承担。托管人依照授权通知规定的方法对指令进行表面审慎验证确认指令有效后，方可执行投资指令。

对于被授权人在其授权范围内发出的指令，管理人不得否认其效力。管理人应按照有关法律法规和本合同的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送投资指令，被授权人应按照其授权权限发送投资指令。

管理人方应在15:30之前向托管人发送投资指令，15:30之后发送投资指令的，托管人不能保证划款成功。如管理人要求当天某一时点到账，应至少提前2工作小时向托管人发送投资指令并与托管人电话确认。管理人指令传输不及时，未能留出足够的执行时间，致使指令未能及时执行的，致使资金未能及时到账所造成的损失由资产管理人承担。

托管人收到管理人发送的指令后，应立即依据“授权通知”规定的方法审

慎验证有关内容（包括指令是否符合《交易监控合规表》的规定、被授权人的印鉴和签名形式是否表面相符，以及指令是否符合被授权人的授权范围），复核无误后应在规定期限内执行，不得有合理延误。为审核投资指令的有效性，托管人有权要求管理人以传真或其他托管人和管理人确认的方式提供相关交易凭证、项目交易文件或其他有效会计资料（上述资料应加盖管理人公章）。管理人应在合理时间内补充相关资料，并给托管人执行投资指令预留必要的执行时间，管理人应保证其提交的上述文件资料的真实、合法、完整和有效。

对缺乏被授权人印鉴和签名或印鉴和签名不符或超越被授权人授权范围的投资指令、投资指令中重要信息模糊不清或不全等管理人发送错误投资指令的情形，托管人有权拒绝执行，并立即通知管理人进行核查。

托管人仅根据被授权人预留印鉴和签名进行表面相符性的形式审查，对其真实性不承担责任。

管理人向托管人下达指令时，应确保资产管理计划财产专用银行账户有足够的资金余额，对管理人在没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人可不予执行，并立即通知管理人。

本资产管理计划财产在交易所场内交易的资金清算交割，由管理人委托的证券经营机构直接根据相关登记结算公司的结算规则办理。

本资产管理计划财产专用银行账户发生的银行结算费用、银行账户维护费等银行费用，由托管人直接从计划财产专用银行账户中扣划，无须管理人出具投资指令。

托管人发现管理人发送的指令违反《基金法》、《资管细则》、本合同或其他有关法律法规的规定时，有权不予执行，并及时以书面形式通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对托管人发出回函确认，由此造成的损失由管理人承担。

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人在履行监督职能时，以通常合理的注意义务，发现管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知管理人改正。

如根据法律法规、交易所有关交易清算规则，托管人只能在事后发现管理

人投资行为违反法律法规或本合同约定的，托管人在及时通知管理人并向管理人住所地证监局或基金业协会报告后，即视为履行了对管理人的投资监督职责，对于管理人违反法律法规或本合同约定给委托人/委托资产造成的损失，由管理人承担责任。

（四）资产托管人暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

资产托管人发现资产管理人发送的场外指令违反本合同的约定时，不予执行，并应及时通知资产管理人纠正，资产管理人收到通知后应及时核对，并予以纠正，如未及时调整由此造成的损失由资产管理人承担。

（五）资产管理人发送错误指令的情形和处理程序

资产管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息，指令中重要信息模糊不清或不全等。

资产托管人发现资产管理人的指令错误时，有权拒绝执行，并及时通知资产管理人改正。如需撤销指令，资产管理人应按照托管人认可的方式进行撤销，并加盖预留印鉴。

资产托管人在按照本协议约定履行指令审核责任后，因执行资产管理人的合法指令和依据交易程序已经生效的指令而对资产管理计划财产造成的损失不承担赔偿责任。

（六）管理人更换被授权人的程序

管理人撤换被授权人或改变被授权人的权限，必须提前至少一个交易日，使用传真或邮件向托管人发出被授权人变更通知并预留新的被授权人的印鉴和签字或签章样本，同时电话通知托管人确认。被授权人变更通知于通知载明的时间生效日生效，如双方电话确认的时间晚于通知载明时间的，该变更授权通知于双方电话确认时生效。管理人更换被授权人通知生效后，对于已被撤换的原被授权人发送的指令或被改变授权人员超权限发送的指令，管理人不承担责任。

（七）交易指令

管理人应将投资者参与、退出计划的数据通过双方商定的方式提供托管人，管理人应对传送的此类数据的真实性、准确性和完整性负责。

（八）投资指令的保管

投资指令若以传真或邮件形式发出，则正本由管理人保管，托管人保管指令传真件或扫描件。当两者不一致时，以托管人收到的投资指令传真件或扫描件为准。

（九）其他相关责任

托管人正确执行管理人符合本合同约定的投资指令，资产管理计划财产发生损失的，委托人、管理人不得向托管人主张赔偿责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人原因未能及时或正确执行符合本合同约定的投资指令而导致资产管理计划财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管账户及其他账户余额不足或托管人遇到不可抗力的情况除外。

如果管理人的投资指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时（如管理人遇到不可抗力的情况除外）提供投资指令人员的预留印鉴和签字样本等非托管人原因造成的情形，由此给计划财产造成损失的，相关责任由管理人承担。

十八、交易及清算交收安排

本产品参与交易所场内证券投资，采取券商结算模式，资产管理人、资产托管人应遵守本合同下述约定：

（一）选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

资产管理人负责选择代理本资产管理计划财产证券买卖的证券经营机构，并与其签订证券经纪合同。资产管理人、资产托管人和证券经纪机构就本计划参与证券交易的具体事项另行签订协议，明确三方在本计划参与场内证券买卖的中的各类证券交易、证券交收及相关资金交收过程中的职责和义务。资产管理人应及时将本计划财产的佣金费率等基本信息以及变更情况及时以书面形式通知资产托管人，以便资产托管人估值核算使用。

投资者经资产托管人充分提示已知悉并认可，本产品采取证券公司结算模式办理场内证券交易的清算交割，场内清算交收全部由资产管理人委托的证券经纪机构负责。本计划的证券交易结算资金不在托管账户中保管，委托证券资产存放在本计划证券账户并由资产管理人负责使用，由本计划选择的证券经营机构对投资者证券交易结算资金和证券资产的保管。因资产管理人对证券交易结算资金或专用证券账户中的资产保管不善，或因管理人挪用证券交易结算资

金导致委托资产受损的，由过错方承担责任。

在证券公司结算模式下资产托管人对于资产管理人的证券交易投资行为、证券交易结算资金收付情况只能通过资产管理人事后发送给资产托管人的数据进行核对，因此资产托管人对资产管理人的投资监督在性质上属于事后监督，如果由于资产管理人发送给资产托管人的数据与真实交易不符，资产托管人的事后监督将无法发现资产管理人的违规投资行为。因资产管理人发送数据不真实致使资产托管人事后监督职责落空的，由过错方承担责任。

（二）投资证券后的清算交收安排

1、资产管理人和资产托管人在清算和交收中的责任

（1）本资产管理计划财产通过证券经纪机构进行的交易由证券经纪机构作为结算参与人代理本计划进行结算；本计划其它证券交易由托管人或相关机构负责结算。

（2）证券交易所证券资金结算

资产托管人、资产管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则 and 规定，该等规则 and 规定自动成为本条款约定的内容。

资产管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则 and 规定。

证券经纪机构代理资产管理计划财产与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承担由证券经纪机构原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于资产管理人原因造成的正常结算业务无法完成，责任由资产管理人承担。

（3）对于任何原因发生的证券资金交收违约事件，相关各方应当及时协商解决。

（4）其它场外交易资金结算

场外资金对外投资划款由资产托管人凭资产管理人符合本合同约定的有效资金划拨指令和相关投资合同（如有）进行资金划拨；场外投资本金及收益的划回，由资产管理人负责协调相关资金划拨回产品托管户事宜。

2、无法按时支付证券清算款的责任认定及处理程序

资产管理人应确保资产托管人在执行资产管理人发送的指令时，有足够的

头寸进行交收。对于场外证券交易，资产管理计划财产的资金头寸不足时，资产托管人有权拒绝资产管理人发送的划款指令。资产托管人应告知资产管理人划款处理时间，资产管理人在发送划款指令时应充分考虑资产托管人的划款处理时间。

在资金头寸充足的情况下，资产托管人对资产管理人在正常业务受理渠道和指令规定的时间内发送的符合法律法规、本合同的指令不得拖延或拒绝执行。如由于资产托管人的原因导致资产管理计划财产无法按时支付证券清算款，由此造成的损失由资产托管人承担，但资产托管人如遇到不可抗力的情况除外。

（三）资金及交易记录的核对

资产管理人和资产托管人每月对资产管理计划财产的交易记录进行核对。

（四）参与和退出业务处理的基本规定

1、参与和退出的确认、清算由资产管理人或其委托的注册登记机构负责。

2、资产管理人应将每个开放日的参与和退出的数据传送给资产托管人。资产管理人应对传递的参与和退出数据的真实性负责。资产托管人应及时查收参与及转入资金的到账情况并根据资产管理人指令及时划付退出及转出款项。

3、资产管理人应保证本资产管理计划的注册登记机构每个工作日15:00前向资产托管人发送前一开放日上述有关数据，并保证相关数据的准确、完整。

4、注册登记机构应通过与资产托管人建立的加密系统发送有关数据(包括电子数据和盖章生效的纸制清算汇总表)，如因各种原因，该系统无法正常发送，双方可协商解决处理方式。资产管理人向资产托管人发送的数据，双方各自按有关规定保存。

5、如资产管理人委托其他机构办理本资产管理计划的注册登记业务，应保证上述相关事宜按时进行。否则，由资产管理人承担相应的责任。

6、关于清算专用账户的设立和管理

为满足参与、退出及分红资金汇划的需要，由资产管理人开立资金清算的专用账户，该账户由注册登记机构管理。

7、退出和分红资金划拨规定

拨付退出款或进行本计划分红时，如资金账户有足够的资金，资产托管人应按时拨付；因资金账户没有足够的资金，导致资产托管人不能按时拨付，如

系资产管理人的原因造成，责任由资产管理人承担，资产托管人不承担垫款义务。

8、资金指令

除参与款项到达资产管理计划资金账户需双方按约定方式对账外，回购到期付款和与投资有关的付款、退出和分红资金划拨时，资产管理人需向资产托管人下达指令。

资金指令的格式、内容、发送、接收和确认方式等与投资指令相同。

（五）参与、退出净额结算

资产管理计划托管资金账户与“资产管理计划清算账户”间的资金结算遵循“全额清算、净额交收”的原则，每日按照托管资金账户应收资金与应付资金的差额来确定托管资金账户净应收额或净应付额，以此确定资金交收额。当存在托管资金账户净应收额时，资产管理人应在交收日15:00之前从资产管理计划清算账户划到资产管理计划托管资金账户；当存在托管资金账户净应付额时，资产管理人应在T交收日前一日将划款指令发送给资产托管人，资产托管人按资产管理人的划款指令将托管资金账户净应付额在交收日划往资产管理计划清算账户。

（七）投资银行存款的特别约定

1、资产管理人和资产托管人的职责

资产管理人应当加强对本产品投资银行存款风险的评估与研究，建立健全银行存款投资的业务流程、岗位职责、风险控制措施和监察稽核制度，严格测算与控制投资银行存款的风险敞口，针对不同类型存款银行建立相关投资限制制度，切实防范有关风险。由于资产管理人提前支取或部分提前支取存款投资导致的息差（即本产品已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），资产管理人负责解决。

资产托管人负责依据资产管理人提供的银行存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件办理资金的支付以及存款证实书的接收、保管与交付，切实履行托管职责。资产托管人负责依据托管合同的约定对存款开户证实书进行保管，资产管理人应与存管机构约定由移交机构对凭证的真实性、合法性、有效性和完整性负责；实际存管在交易对手、中介机构等其他机构的证券和存

放在资产托管人以外银行账户内的资金，对该等证券或资金的任何损失，由过错方承担责任。

2、相关协议的签署

资产管理人在投资银行存款之前，需与存款银行签订具体存款协议。具体存款协议应包括但不限于以下内容：

(1) 存款账户必须以本资产管理计划名义开立。

(2) 协议须约定存款类型、期限、利率、计息方式、金额、账号、起止时间，存款银行经办行名称、地址及进款账户。

(3) 协议须约定将资产托管人为本计划开立的托管银行账户指定为唯一回款账户，任何情况下，存款银行都不得将存款本息划往任何其他账户。

(4) 存款银行有义务保证本产品存款投资在存续期内的安全。

(5) 协议须约定存款银行不得接受资产管理人或资产托管人任何一方单方面提出的对该笔存款投资进行更名、转让、挂失、质押、担保、撤销变更印鉴及回款账户信息等任何可能导致财产转移的申请。

(6) 协议须明确，存款银行对存款证实书的真实性负责，并承担移交过程中由于存款证实书丢失、损毁、被人为调换等所引发的一切后果。正常情况下，同城存款银行应在存款证实书开立后2个工作日内将原件移交托管人保管；异地存款银行应在存款证实书开立后5个工作日内将原件移交资产托管人保管。

3、办理资产管理计划投资银行存款的开户、全部提前支取、部分提前支取或到期支取，可采取以下方式：

(1) 由资产管理人和资产托管人的授权代表持授权委托书共同全程办理，资产管理人上述事项被授权人员与资产管理人负责洽谈存款事宜并签订存款协议的人员不能为同一人。

(2) 由存款银行/资产管理人提供上门送、取单服务。在上门送、取单时，存款银行/资产管理人经办人员应携带单位介绍信/授权书以及个人身份证件，以便资产托管人进行核查。资产管理人上述事项被授权人员与资产管理人负责洽谈存款事宜并签订存款协议的人员不能为同一人。

(3) 资产管理人与资产托管人双方协商一致的其他办理方式。

4、本产品投资银行存款或办理存款支取时，资产管理人需提前发送银行

存款投资合同/协议、投资指令、支取通知等有关文件到资产托管人处，以便资产托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

5、如发生逾期支取，资产托管人不承担相应利息损失及逾期支取手续费。

6、本产品投资银行存款时，应本着便于存款证实书安全保管和日常监督检查的原则，尽可能选择托管账户开户行所在地的银行机构办理。

7、对于已移交资产托管人保管的存款开户证实书等实物凭证，资产托管人应确保安全保管；对未按约定将存款开户证实书等实物凭证移交资产托管人保管的，资产托管人应向资产管理人进行必要的催缴和风险提示；提示后仍不将相关实物凭证送达资产托管人保管的，出于托管履职和尽责，资产托管人可视情况采取必要的风险控制措施：（1）建立风险预警机制，对于实物凭证未送达集中度较高的存款银行，主动发函资产管理人尽量避免在此类银行进行存款投资；（2）在定期报告中，对未按约定送达资产托管人保管的实物凭证信息进行规定范围信息披露；（3）未送达实物凭证超过送单截止日后30个工作日的，部分或全部暂停配合资产管理人办理后续新增存款投资业务，直至实物凭证送达我行保管后解除。实物凭证未送达但存款本息已安全划回托管账户的，以及因发生特殊情况由资产管理人提供相关书面说明并重新承诺送单截止时间的，可剔除不计。

（八）托管产品通过第三方销售机构参与开放式基金投资的特别约定

本产品可以通过第三方基金销售机构渠道投资开放式基金。为维护产品持有人利益、保障资产安全，资产托管人应负责制订选择第三方基金销售机构的标准和程序，并据此选择第三方销售机构。资产管理人确保所选择的销售机构在中国证监会注册取得基金销售业务资格并已成为中国证券投资基金业协会会员，符合开展前述各类产品销售业务的各项资质和要求。

十九、越权交易的界定

（一）越权交易的界定

越权交易是指管理人违反本合同附件二《交易监控合规表》的规定以及违反或超出本合同项下委托人的授权而进行的投资交易行为，包括：（1）违反本合同附件二《交易监控合规表》规定进行的投资交易行为；（2）法律法规禁止

的超买、超卖行为。

因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等管理人之外的因素致使本计划投资不符合本合同约定的投资比例规定的，属于被动超标，不属于越权交易。但发生上述情形时，管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起交易日及时调整完毕，如因证券暂停交易或其他非管理人可以控制的原因导致管理人不能履行调整义务的，则不受上述约定之限制，但管理人应当自证券恢复交易之日起及时使本计划的投资组合比例符合上述约定。法律法规另有规定的从其规定。

管理人应在本合同规定的权限内运用计划财产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

托管人根据附件二《交易监控合规表》约定，对本计划的投资范围及投资比例进行监督。托管人根据附件二《交易监控合规表》对计划财产投资的监督和检查自本资产管理计划建账估值之日起开始。

（二）越权交易的处理程序

1、违反有关法律法规和本合同附件二《交易监控合规表》规定进行的投资交易行为

托管人发现管理人的投资运作违反法律、行政法规和其他有关规定及本合同附件二《交易监控合规表》约定的，有权拒绝执行，并立即通知管理人，并有权报告中国证监会或基金业协会。

托管人发现管理人可能存在违反法律、行政法规和其他有关规定，或者违反本合同约定，但难以明确界定时，应立即通知管理人，管理人应以书面形式向托管人进行解释、举证，并提出处理方案。在期限内，资产托管人有权随时对通知事项进行复查，督促资产管理人改正；未能在限期内改正的，资产托管人应报告中国证监会。

托管人发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反本合同附件二《交易监控合规表》约定的，有权通知管理人并有权报告中国证监会或基金业协会。

管理人应向委托人和托管人主动报告越权交易。在限期内，委托人和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对委托人和托管人

通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会或基金业协会。

2、法律法规禁止的超买、超卖行为

托管人如果发现资产管理计划财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，有权提醒管理人，由管理人负责解决，由此给资产管理计划财产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，必须于T+1日11:00前完成融资，保证完成清算交收。

3、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归本资产管理计划财产所有。

(三) 托管人对管理人的投资运作的监督

1、托管人对资产管理人具体投资监督事项以本章约定为准。资产托管人根据本合同中有关约定，对本计划的投资范围、投资比例、投资限制进行监督。具体投资监督事项如下：

(1) 投资范围：

1) 固定收益类资产：银行存款（包括活期存款、定期存款、同业存款与协议存款等）、同业存单、货币市场基金（含货币ETF）、货币市场或现金管理类银行理财、证券公司及其资产管理子公司资产管理计划、保险公司资产管理计划和信托计划。

2) 权益类资产：沪深交易所发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票，含新股申购）、股票型和混合型公开募集证券投资基金。

3) 商品及金融衍生品资产：股指期货。

(2) 本计划的投资比例

1) 本计划根据穿透原则合并计算的投资于权益类资产的总值不超过计划总资产的80%、投资于固定收益类资产的总值不超过计划总资产的80%、投资商品及金融衍生品类资产的总值不超过计划总资产的80%或衍生品保证金账户权益不超过计划总资产的20%；

2) 本计划按《运作规定》规定进行组合投资, 本计划投资于同一资产的资金, 不得超过本计划资产净值的 25%; 银行活期存款等中国证监会认可的投资品种的除外。

(3) 投资限制

1) 本计划持有一家上市公司的股票, 其市值不得超过该计划财产净值的 10%且不得超过该证券的 10%;

2) 本计划的总资产不得超过本计划净资产的 200%;

3) 本计划投资于同一标的的资产不得超过本计划资产净值的 25%; 银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等经中国证监会认可的投资品种除外。

(4) 投资禁止行为

本资产管理计划财产禁止从事下列行为:

- 1) 承销证券;
- 2) 违反规定向他人贷款或提供担保;
- 3) 从事承担无限责任的投资;
- 4) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
- 5) 法律法规、中国证监会以及本合同规定禁止从事的其他行为。

2、托管人根据合同的约定对下述委托财产投资限制进行监督。

(1) 不得违反本资产管理合同中有关投资范围的规定; 法律法规或监管部门的其它规定。为免异议, 各方同意如出现间接投资情况的, 托管人对于下层资产管理产品或相关投向、投资比例等不承担监督责任, 应当有管理人确保所投下层资管产品符合本合同约定的投资范围及投资比例, 以及法律法规或监管部门的规定。

(2) 经当事人协商一致, 可就投资范围和投资限制做出调整, 同时由管理人书面通知托管人, 并给托管人留出必要实施时间

3、托管人对委托财产的投资限制的监督和检查自本合同生效之日起开始。

自本合同生效后, 委托人若需更改或增加新的投资品种, 应在进行新品种投资前与管理人和托管人商议, 重新调整监督事项和修订本合同, 并为新品种的托管流程设计和系统开发上线留出足够准备时间。

(四) 委托人确认, 托管人投资监督的准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。托管人对这些机构的信息的准确性和完整性不作任何担保、暗示或表示。

(五) 管理人负责关联交易的报告和披露, 管理人应主动定期更新名单, 由于管理人未按照相关规定提供关联方名单而造成的违规交易, 由管理人承担责任。

(六) 由于产品设计缺陷或越权交易造成的任何损失, 委托人不得向托管人主张赔偿责任。

二十、资产管理计划财产的估值和会计核算

(一) 估值目的

计划财产估值的目的是客观、准确地反映计划财产的价值。

计划财产按照法律法规和本合同规定的估值方法和程序进行。计划资产净值是指计划财产总值减去负债后的净资产值。计划资产净值的计算保留到小数点后2位, 小数点后第3位四舍五入。

(二) 估值核对日及估值时间

本资产管理计划估值日为每个工作日, 估值日当日为估值核对确认日。管理人与托管人在估值核对确认日以双方认可的方式(如电话对账、电子对账或邮件等)对资产管理计划财产进行估值核对确认。

如国家法律法规有其他规定的, 遵其规定执行。

(三) 估值依据

估值应符合本合同、《证券投资基金会计核算业务指引》及其他法律、法规的规定, 如法律法规未做明确规定的, 参照证券投资基金的行业通行做法处理。估值数据依据合法的数据来源独立取得。

(四) 估值方法

本计划按照《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则(试行)》等金融管理部门制定的估值相关业务规则办理计划资产估值。

1、证券交易所上市有价证券的估值方法

证券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, 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, 确定公允价值。

2、证券投资基金估值方法:

1) 上市流通的证券投资基金按估值日其所在证券交易所的收盘价估值; 估值日无交易的, 以最近一个交易日的收盘价估值;

2) 开放式基金(包括托管在场外的上市开放式基金(LOF))以估值日前一工作日基金份额净值估值, 估值日前一工作日开放式基金份额净值未公布的, 以前最近一个工作日基金份额净值计算。货币基金以成本估值, 每日按前一交易日的万份收益计提红利, 前一交易日没有每万份收益的, 且最近交易日后经济环境未发生重大变化, 按最近公告的基金每万份收益估值。

3、股指期货估值

投资的期货合约, 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。

4、银行存款按照约定利率在持有期内逐日计提应收利息, 在利息到账日以实收利息入账。

5、本计划的银行理财产品、证券公司及其资产管理子公司资产管理计划、保险公司资产管理计划等资产管理产品的估值, 以估值日该计划的份额净值估值, 若上述资产管理产品的管理人或授权机构公布或发送虚拟净值的, 优先使用虚拟净值进行估值。若无估值日份额净值/虚拟净值的, 按最新公布或发送的份额净值/虚拟净值估值。

6、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的, 管理人可根据具体情况与托管人商定后, 按最能反映公允价值的价格估值。

7、相关法律、行政法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值。

根据有关法律法规, 资产管理计划资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本资产管理计划的会计责任方由管理人担任, 因此, 就与本资产管理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，按照管理人对资产管理计划资产净值的计算结果对外予以公布。

(五) 估值对象

委托财产的估值对象为资产管理计划所拥有的所有资产及负债。

(六) 估值程序与资产管理计划份额净值的确认

管理人于每个估值日当日计算本估值日的计划资产净值并以电话对账或其他管理人和托管人认可的方式（如电子对账、录音电话或邮件等）发送给托管人。托管人对净值计算结果复核后，以管理人和托管人认可的方式（如电子对账、录音电话或邮件等）告知管理人。

计划份额净值的计算精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入，相关法律法规另有规定的，从其规定。

(七) 估值错误的处理

如管理人或托管人发现资产管理计划估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，协商解决。

根据有关法律法规，资产管理计划资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本计划的会计责任方由管理人担任。因此，就与本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，仍无法达成一致意见，以管理人的意见为准。

当计划财产估值出现错误时，管理人和托管人应该立即协商采取更正措施，并按本合同约定的报告方式向委托人及时披露（披露方式参见第二十条报告义务中临时报告）。

管理人计算的资产管理计划净值已由托管人复核确认，但因资产估值错误给委托人造成损失的，由管理人与托管人按照管理费率和托管费率的比例各自承担相应的责任。

由于一方当事人提供的信息错误，另一方当事人在采取了必要合理的措施后仍不能发现该错误，进而导致委托财产净值计算错误造成委托人的损失，以及由此造成以后交易日委托财产净值计算顺延错误而引起的委托人的损失，由提供错误信息的当事人一方负责赔偿。

由于不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施

进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的委托财产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(八) 暂停估值的情形

1、资产管理计划投资所涉及的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估资产管理计划财产价值时；

3、占资产管理计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，管理人为保障委托人的利益决定暂停估值的；

4、中国证监会或基金业协会认定的其他情形。

(九) 特殊情形的处理

1、管理人按估值方法的第1-6项进行估值时，所造成的误差不作为资产管理计划财产估值错误处理；

2、由于不可抗力原因，或由于证券交易场所及登记结算公司发送的数据错误，管理人和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，由此造成的资产管理计划财产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

(十) 资产管理计划的会计政策

会计制度执行国家有关会计制度执行：

1、管理人为本计划的会计责任方。

2、本计划的会计年度为公历年度的1月1日至12月31日。

3、本计划核算以人民币为记账本位币，以人民币元为记账单位。

4、本计划单独建账、独立核算；管理人及托管人各自保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表。管理人应定期与托管人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

二十一、资产管理计划的费用与税收

(一) 计划费用的种类

- 1、管理人的管理费；
- 2、托管人的托管费；
- 3、管理人的业绩报酬；
- 4、计划的交易费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商及期货佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等)；
- 5、计划财产的银行汇划费用及开立账户需要支付的费用；
- 6、资产管理合同生效以后与计划相关的会计师费(包括审计费用)及律师费、诉讼仲裁费(若有)；
- 7、本资产管理计划运营过程中发生的增值税应税行为所产生的增值税及附加税费；
- 8、资产管理计划份额持有人大会费用；
- 9、按照国家有关规定和本合同约定,可以在计划财产中列支的其他费用。

(二) 费用计提方法、计提标准和支付方式

1、管理人的管理费

资产管理计划财产的年管理费率为1.5%/年。计算方法如下:

第*i*个运作周期中每日应计提的管理费=第*i*个运作周期当日计费基准×年管理费率÷365

第*i*个运作周期当日计费基准为第*i*-1个运作周期到期日的单位净值*第*i*个运作周期内当日资产管理计划存续份额,特别地,但当*i*=1时,第*i*-1个运作周期到期日的单位净值为1.000元,具体费用基数发生变更的时点,需由管理人邮件通知托管人。

本计划的固定管理费自资产管理计划备案通过之日开始,每日计提。经资产管理人与资产托管人核对一致后,按照每个运作周期为一结算周期,由资产管理人在每个投资运作周期结束后5个工作日内向资产托管人发送划款指令,资产托管人依据管理人的相关指令从资产管理计划资产中支付上一运作周期内固定管理费。每运作周期内支付费用按该运作周期的实际自然日天数计算。

根据《基金管理公司特定客户资产管理子公司风险控制指标管理暂行规定》等相关规定,管理人管理费收入的项目均应计提10%风险准备金。

管理人指定的接收管理费的银行账户信息:

账户名称（接收管理费）：南方资本管理有限公司

账号：211223639175700002

开户行：珠海华润银行深圳宝体支行

管理人指定的风险准备金收款账户：

账户名称（接收风险准备金）：南方资本管理有限公司

账号：19200188000544679

开户行：江苏银行深圳分行营业部

2、托管人的托管费

资产管理计划财产的年托管费率为0.01%/年。计算方法如下：

第*i*个运作周期中每日应计提的托管费=第*i*个运作周期当日计费基准×年托管费率÷365

第*i*个运作周期当日计费基准为第*i*-1个运作周期到期日的单位净值*第*i*个运作周期内当日资产管理计划存续份额，特别地，但当*i*=1时，第*i*-1个运作周期到期日的单位净值为1.000元，具体费用基数发生变更的时点，需由管理人邮件通知托管人。

本计划的固定托管费自资产管理计划备案通过之日起开始，每日计提。经资产管理人与资产托管人核对一致后，按照每个运作周期为一结算周期，由资产管理人在每个投资运作周期结束后5个工作日内向资产托管人发送划款指令，资产托管人依据管理人的相关指令从资产管理计划资产中支付上一运作周期内固定托管费。每运作周期内支付费用按该运作周期的实际自然日天数计算。

户名：华泰证券股份有限公司

账号：491068633089

开户行：中国银行江苏省分行营业部

3、管理人的业绩报酬

除首个和最后一个运作周期外，本计划自上个运作周期到期日（不含）至下个运作周期到期日（含）为一个运作周期。首个运作周期为本计划成立日（含）至本计划首个运作周期到期日（含）。最后一个运作周期为本计划上个运作周期到期日（不含）至计划终止日（含）。每个运作周期的最后一日为业绩报酬计提基准日。管理人业绩报酬按每个运作周期单独核算并计提。

在本计划每个运作周期到期日和计划终止日时，管理人按计划份额在该运作周期期间超过业绩报酬计提基准以上部分计提业绩报酬。任意两次业绩报酬计提间隔不短于六个月。

本计划第 i 个运作周期对应的业绩报酬计提基准（年化） $R_i = \max \{ \text{第 } i \text{ 个运作期对应的中证 1000 指数收益率} \div \text{第 } i \text{ 个运作周期对应的投资起始日（含）至第 } i \text{ 个运作周期对应的到期日（不含）的自然日天数} \times 365 + \text{第 } i \text{ 个运作周期对应的年化增强收益率 } E_i - \text{年化税率（如有）， } 0 \}$ ，其中：第 i 个运作周期对应的中证 1000 指数收益率 = 中证 1000 指数在第 i 个运作周期对应的到期日 13:00-15:00 的算术平均价 \div 中证 1000 指数在第 i 个运作周期对应的投资起始日特定时间段（各产品会根据投资安排设定该时间段）的算术平均价 - 1；

第 i 个运作周期对应的投资起始日特定时间段的算术平均价、年化增强收益率 E_i 、运作周期到期日和投资起始日以管理人公告为准。

第 i 个运作周期对应的业绩报酬以本计划第 $i-1$ 个运作周期到期日（对于第 1 个运作期即本计划成立日）至第 i 个运作周期到期日的投资增值部分高于第 i 个运作周期对应的业绩报酬计提基准的部分为基础进行计算，具体计算方法如下：

如 $NAV_i \leq NAV_{i-1}$ 管理人不收取当个运作周期对应的业绩报酬；

如 $NAV_i > NAV_{i-1}$ ，第 i 个运作期对应的超额收益 = $\max \{ S_i \times NAV_{i-1} \times [(NAV_i - NAV_{i-1}) / NAV_{i-1} - R_i \times T / 365], 0 \}$

其中：

S_i 为第 i 个业绩报酬计提基准日的计划份额；

NAV_i 为第 i 个运作周期到期日扣除业绩报酬前的资产管理计划累计份额净值；

NAV_{i-1} 为第 $i-1$ 个运作周期到期日（对于首个运作期，第 $i-1$ 个业绩报酬计提基准日为计划成立日）的资产管理计划累计份额净值；

R_i 为第 i 个运作期对应的计划业绩报酬计提基准（年化）；

T 为第 i 个运作期的实际自然日运作天数。

管理人收取超额收益的【20】%作为业绩报酬，其余部分的超额收益归投资者所有。业绩报酬由管理人负责计算，并向托管人提供业绩报酬计算底稿，协助托管人复核，管理人与托管人核对一致后，管理人在每个开放日起5个工作日和本计划终止日起五个工作日内向托管人发送划款指令，由托管人从计划

财产中支付给管理人。管理人计提业绩报酬将对本计划资产净值产生一定的波动影响。

本计划的相关业绩报酬计提基准仅是管理人收取业绩报酬的计提标准而非预期收益率，不构成管理人或托管人对委托财产本金不受损及收益预期、收益状况的任何承诺或保证。

根据《基金管理公司特定客户资产管理子公司风险控制指标管理暂行规定》等相关规定，管理人收取的业绩报酬项目均应计提10%风险准备金。

管理人指定的提取业绩报酬的银行账户信息：

账户名称（提取业绩报酬）：南方资本管理有限公司

账号：211223639175700002

开户行：珠海华润银行深圳宝体支行

管理人指定的风险准备金收款账户：

账户名称（接收风险准备金）：南方资本管理有限公司

账号：19200188000544679

开户行：江苏银行深圳分行营业部

4、上述第（一）款其他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或摊入当期费用，由托管人从计划财产中支付。

5、不列入资产管理业务费用的项目

1) 管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或计划财产的损失。

2) 管理人和托管人处理与计划运作无关的事项发生的费用。

3) 其他根据相关法律法规及中国证监会或基金业协会的有关规定不得列入计划费用的项目。

（三）资产管理业务的税收

鉴于管理人为本计划的利益，投资、运用委托财产过程中，可能因法律法规、税收政策的要求而成为纳税义务人，就归属于计划的投资收益、投资回报和/或本金承担纳税义务。因此，本计划运营过程中由于上述原因发生的增值税及相关附加税费等税负，仍由本计划委托财产承担。管理人有权在本计划每次收益分配前或计划清算时从委托财产中先行提取一定金额作为税费备用资

金，具体金额由管理人根据届时情况确定，提取总额不得超过本计划应缴税费金额。管理人可能通过本计划托管账户直接缴付税费，或划付至管理人账户并由管理人依据税务部门要求完成税款申报缴纳。如果管理人以固有财产垫付资产管理计划运营过程中产生的增值税或其他税费（如有）的，则管理人有权从委托财产中优先受偿。委托人从委托财产中获得的各项收益产生的税费，由委托人根据国家法律法规的规定自行承担。根据法律法规或主管税务机关规定，管理人应当就委托人获得收益所产生的税费履行代扣代缴义务的，则管理人有权根据届时有效的规定对委托人代扣代缴相关税费。管理人、托管人就其取得的资产管理计划管理费、托管费，依据法律法规规定履行各自的纳税义务。

（四）费用调整

对于管理费率、托管费率调高的，须经管理人和托管人与全体委托人协商一致，并报基金业协会备案。对于管理费率、托管费率调低的，则管理人、托管人无须与委托人协商，可以直接调低费率，并报基金业协会备案。管理人网站上发布公告即视为履行了告知义务。

二十二、资产管理计划的收益分配

（一）可供分配金额的构成

资产管理计划可供分配金额指截至收益分配基准日资产管理计划可供分配的货币资金扣除产品应承担的税费后的净额。

本资产管理计划可供分配金额来源包括但不限于本计划项下运作周期内投资所获得的收益、资金（包括但不限于预付金）返还及其他收益。

（二）分配原则

1、在符合有关资产管理计划分红条件的前提下，资产管理人每季度至多分配一次，是否进行收益分配及相关规则由管理人决定。本计划运作期内将可供分配利润在满足前述条件情况下向委托人进行分配，不代表资产管理计划一定盈利或资产管理计划本金不受损失。如挂钩标的在运作期内表现不佳，委托人仍存在本金损失的可能。

2、本资产管理计划采取现金分配的方式。

3、本资产管理计划的每份资产管理计划份额享有同等分配权。

4、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费由委托人自行承担。当拟分配给委托人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或手续费用时，资产管理人可决定不进行现金分红。

（三）分配方案的确定与执行

资产管理计划收益分配方案中应载明分配基准日以及该日资产管理计划分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式、支付方式等内容。具体以届时管理人的公告为准。资产管理计划分配方案由资产管理人拟订，由资产管理人通知资产委托人。

在分配方案确定后，资产管理人依据具体方案的规定就支付的资金向资产托管人发送投资指令，资产托管人按照资产管理人的指令及时进行划付。

二十三、报告义务

（一）运作期报告

1、管理人向委托人提供的报告种类、内容和提供时间

（1）年度报告

管理人应当在每年度结束之日起4个月内，编制完成委托财产年度报告并经托管人复核其中财务数据后，向委托人披露报告期内资产管理计划运作情况，包括但不限于下列信息：（1）管理人履职报告；（2）托管人履职报告（如适用）；（3）资产管理计划投资表现；（4）资产管理计划投资组合报告；（5）资产管理计划运用杠杆情况（如有）；（6）资产管理计划财务会计报告；（7）资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；（8）本计划投资收益分配情况；（9）投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；（10）中国证监会规定的其他事项。管理人应于每年结束之日起3个月内完成年度报告，并将有关报告提供托管人复核，托管人在收到后1个月内复核其中财务数据后，并将复核结果书面通知管理人。计划成立不足3个月或者存续期间不足3个月的，管理人无需编制当期年度报告。

计划年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对计划会计核算及净值计算等出具意见。

(2) 季度报告

管理人应当在每季度结束之日起 1 个月内，编制完成委托财产季度报告，向委托人披露报告期内资产管理计划运作情况，包括但不限于下列信息：(1) 管理人履职报告；(2) 托管人履职报告（如适用）；(3) 资产管理计划投资表现；(4) 资产管理计划投资组合报告；(5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；(6) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等的计提基准、计提方式和支付方式；(7) 本计划投资收益分配情况；(8) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；(9) 中国证监会规定的其他事项。计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人无需编制当期季度报告。

(3) 份额净值报告

管理人至少每周（或通过销售机构）向委托人披露一次经托管人复核的计划份额净值。

(4) 临时报告

发生本合同约定的、可能影响委托人利益的重大事项时，管理人应在事项发生之日起五日内及时履行报告义务，涉及托管人的，托管人应及时向管理人告知相关事项。

2、管理人向委托人提供报告及委托人信息查询的方式

管理人向委托人提供的报告，将严格按照《资管细则》及其他有关规定通过以下至少一种方式进行。委托人信息查询将通过以下至少一种中国证监会或基金业协会允许的、本合同约定的方式进行。

(1) 网站

定期报告、份额净值报告、临时报告等有关本资产管理计划的信息将在管理人网站（www.southerncapital.com.cn）上披露，委托人可随时查阅，查阅路径为：首页-南方资本账户登录，登录账号为资产委托人登记的证件号码，初始密码为“nfzb_证件号码后 6 位”。

(2) 邮寄服务

委托人在合同签署页上填写的通信地址为送达地址。通信地址如有变更，委托人应当及时通知管理人。

(3) 传真或电子邮件或手机短信等

如委托人办理资产管理计划认购、参与或退出等业务时留有传真号、电子邮箱、手机及电话号码等联系方式的，管理人也可通过传真、电子邮件、手机短信、电话、电报等方式将报告信息通知委托人。委托人上述联系方式若发生变更应当及时通知管理人。

3、托管人向委托人提供计划资产托管情况查询的方式

托管人按照规定定期向委托人提供资产托管报告，置于托管人办公地点备查，委托人可在营业时间前来查询。

(二) 向监管机构提供的报告

管理人、托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务。

二十四、风险揭示

本管理人提示投资者充分了解资产管理计划投资的风险和收益特征，建议投资者在选择本计划之前，通过正规的途径，对本计划进行充分、详细的了解。投资者应对自己的资金状况、投资期限、收益预期、风险承受能力和风险偏好做出客观合理的评估后，再做出是否投资的决定。

本管理人提醒投资者“买者自负”投资原则，在投资者做出投资决策后，计划的运营状况与计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

本管理人将按照本资产管理合同的约定，依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划资产，在风险控制的基础上为投资者争取最大的投资收益，但不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。请投资者正确认识和对待本计划未来可能的收益和风险。

本计划在投资管理过程中可能面临的各项风险包括但不限于：

(一) 特殊风险揭示

1、资产管理合同与基金业协会合同指引不一致所涉风险

本资产管理合同依据基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》（以下简称“《指引》”）及相关法律法规制定。《指引》规定，在不违反相关法律法规、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》、本《指引》以及其他有

关规定的前提下，资产管理合同当事人可以根据实际情况约定本《指引》规定内容之外的事项，本《指引》部分具体要求对当事人确不适用的，当事人可对相应内容做出合理调整和变动。本合同中对《指引》规定内容之外的部分事项进行约定，也可能存在个别内容与《指引》不一致，或不适用《指引》中个别规定的情形，可能对投资者合法权益造成影响。

2、关于本计划成立、合同生效以及备案等相关事项的特别风险提示

根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》相关规定，本计划符合资产管理合同约定的计划成立条件的，在募集金额缴足并取得验资报告后，由管理人公告本计划成立。自管理人在其公司网站发布计划成立公告之日，本计划成立，本计划资产管理合同生效。本计划成立之日起五个工作日内，管理人将向基金业协会提交备案申请。在获得基金业协会备案证明之前，本计划不得开展以现金管理为目的之外的任何其他投资活动，因此本计划在备案期间无法建仓及追踪标的指数，可能出现备案期间标的指数上涨，而本计划无投资收益的情形；如本计划最终未能通过基金业协会备案，本计划将无法按照合同约定进行投资运作，本计划及其资产管理合同应当自动终止，委托人认购参与款项及其现金管理收益（如有）将退还至委托人认购账户。本计划能否通过基金业协会备案存在不确定性的风险，该风险受限于基金业协会备案政策等与本计划备案相关的若干客观情况的变化及其之间契合性，无论如何不可归责于管理人，如本计划最终未能完成基金业协会备案的，管理人除按照合同约定进行本计划终止、清算外，无需承担任何其他义务或责任。

3、资产管理计划委托募集所涉风险

本管理人将委托销售机构代理销售本资产管理计划，尽管管理人已通过合理方式对销售机构的行为进行一定的监督和约束，但销售机构的销售行为合法合规仍依赖于其自身对法律法规的遵守，如果销售机构在销售行为中存在违法违规或管理不善、操作失误等情形，可能造成投资者遭受损失的风险。

4、资产管理计划未设置份额持有人大会所涉风险

本计划的所有当事人包括全体委托人、管理人、托管人一致同意不设置份额持有人大会及日常机构，因此资产管理计划的投资者无法通过份额持有人大会方式行使相关权利义务，但本计划根据资产管理合同约定进行变更且合同的变更涉

及当事人权利义务发生变化或对份额持有人利益有实质影响时，管理人将征询份额持有人的意见，不同意变更的委托人有权在最近一次开放日退出本计划。

5、资产管理计划份额转让所涉风险

本资产管理计划办理份额为投资者办理资产管理计划份额转让业务时，可能存在包括但不限于如下风险：

1) 资管计划份额转让交易价格由资产管理计划交易双方协商确定，协商交易价格可能与份额实际价值存在偏差，导致交易一方遭受损失；

2) 资产管理计划份额转让需通过证券交易所或中国证监会认可的其他方式进行，并由资产管理计划份额登记机构完成份额变更登记，转让交易双方完成转让协议签署及资金交收后，在完成转让及份额登记手续之前，存在操作风险；

3) 根据法律法规及税收政策，资产管理计划份额转让涉及增值税及附加税应税行为，将影响资产管理计划份额转让方实际收益。

6、投资特定标的所涉风险

(1) 挂钩标的相关风险

本计划委托人的最终收益与挂钩标的相关。挂钩标的波动将影响委托人所获得的收益。挂钩标的并不能完全代表整个证券市场。挂钩标的成份股的平均回报率与整个证券市场的平均回报率可能存在偏离。挂钩标的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致挂钩标的价格波动，直接影响挂钩标的的表现。

(2) 投资金融衍生品的风险包括但不限于：

①投资于股指期货等金融衍生品。无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，若股票指数行情向不利方向剧烈变动，可能承受超出保证金甚至委托财产本金的损失；

②期货交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。计划可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓，进而可能给计划造成重大损失：计划所委托的交易所会员除接受本计划委托外，还可能同时接受其他主体的委托，计划所委托的交易所会员发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施，而这种不足不一定是计划的保证金不足造成的，

还可能是上述交易所会员进行其他主体的委托操作所造成的,但即便如此计划也可能因此受到重大损失:为及时缴纳保证金,本计划可能紧急变现部分计划财产,在上述情况下,该部分计划财产的变现可能并非以最优价格进行,从而造成计划的损失。计划及计划所委托的交易所会员可能被实行强制结算,一旦计划或计划所委托的交易所会员被强制结算、可能给计划财产造成损失;

③在市场剧烈变化的情况下,管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失,计划必须承担由此导致的全部损失。同时计划将面临期货合约无法当天平仓而价格变动的风险;

④基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况,则可能对计划投资产生不利影响。

(3) 投资于股票的风险包括但不限于:

①国家货币政策、财政政策、产业政策等的变化对证券市场产生一定的影响,导致市场价格水平波动的风险;

②宏观经济运行周期性波动,对股票市场的收益水平产生影响的风险;

③上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化,从而导致股票价格变动的风险。

(4) 投资于公募证券投资基金及其他资产管理产品的风险:

本计划资金投资的公募证券投资基金、资产管理产品,最终将投向债券、股票等资产等可能因资产自身特性、市场变化或交易对手等原因,导致投资者的利益受到不利影响,极端情形下甚至可能导致投资者损失全部投资本金,主要风险如下:

①债券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响,导致投资标的收益水平变化,产生风险。

②上市公司的经营好坏受多种因素影响,如管理能力、财务状况、市场前景、行业竞争、人员素质等,这些都会导致企业的盈利发生变化。如果本计划所投资的上市公司经营不善,其股票价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,使投资标的投资收益下降。

(4) 估值的公允价值变化及所披露的净值可能无法反映投资情况风险

本计划通过组合投资方式进行投资,受限于底端相应投资标的的估值时间、

采用的估值方法、披露时间等可能存在的不一致，本计划披露的份额净值可能无法反映真实投资管理情况。

管理人披露的计划份额净值并不代表委托人所能够即时获得的现金等财产金额，也不代表将来在财产分配时所能获得的分配金额，份额净值的估值及披露受限于资产管理合同约定的假设、方法及时效，不构成管理人或托管人对委托人财产本金、收益的任何保证或承诺。

(5) 本计划资产投资于存款等高流动性资产时，如果交易对手方延期兑付存款等高流动性资产的本金或收益，则本计划的终止清算也将顺延，对投资者的流动性需求有所影响。此外，如果交易对手方发生违约，无法全额回收存款等高流动性资产的本金及收益，则委托人将面临较大损失。同时，本计划投资的存款等高流动性资产存在着收益为零甚至损失本金的风险及可能。

(6) 资产管理计划成立后不能按预计计划投资的风险

本计划委托资金将投资于存款等高流动性资产和金融衍生品，投资运作前面临着交易对手提高报价或拒不确认签约前期询价过程中确认的交易条件，从而造成本计划的投资目的无法实现的，管理人有权提前终止本计划并按清算程序将委托财产分配给委托人。

管理人认为当前市场环境不适合再进行投资的，可提前终止本资产管理计划。

7、收益分配相关风险提示

若本计划根据本合同约定在某一运作期内向委托人进行收益分配，该等收益分配并不代表资产管理计划一定盈利或委托财产本金不受损失。当挂钩标的表现不佳时，资产委托人仍存在本金损失的可能。

8、资产管理计划外包事项所涉风险

不涉及。

(二) 一般风险提示

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于 R4 风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力 C4 及以上的

普通投资者。

2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。

3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

5、信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

6、募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

管理人的责任承担方式：

（一）以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

（二）在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

7、投资标的风险

本计划资金投资的存款等高流动性资产、资产管理产品等固定收益类资产以及金融衍生品可能因资产自身特性、市场变化或交易对手等原因，导致投资者的利益受到不利影响，极端情形下甚至可能导致投资者损失全部投资本金。

8、税收风险

管理人为本计划的利益投资、运用委托财产过程中，根据国家法律法规及国

家有关部门规章、规范性文件等规定，就归属于本计划的投资收益/投资利益资管计划需要缴纳增值税及/或其他税费，即使管理人被税务机关认定为纳税义务人，该等增值税及/或其他税费仍属于本计划税费，应在委托财产中列支，可能导致委托人可分配的收益减少，委托人对此应予同意及充分配合。此外，产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

9、其他风险包括但不限于关联交易风险、技术风险和操作风险、发生不可抗力事件的风险等。

(1) 关联交易风险。

对于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方所发行的证券、管理的公募基金、代理销售的资产管理产品或承销期内承销的证券，管理人可运用本计划财产向其投资或与其交易，存在关联交易风险。

(2) 操作或技术风险。相关当事人在业务各环节操作过程中，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，例如，越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。在计划的各种交易行为或者后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、份额登记机构、证券/期货经纪机构、销售机构、证券交易所、登记结算机构等。

(3) 不可抗力风险。战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券、期货市场的运行，可能导致计划资产的损失。金融市场危机、行业竞争、代理机构违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致投资者利益受损。

(4) 其他。金融市场危机、行业竞争、代理商违约等超出管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致投资者利益受损。在本计划的运作过程中，因托管人、证券/期货经纪机构等合作方违反国家法律规定或者相关合同约定而可能对计划财产带来风险。国家法律法规的变化，货币政策、财政政策、产业政策的调整，以及政府对金融市场和监管政策的调整，都可能影响本计划的经营业绩，从而影响本计划财产安全及收益。

二十五、资产管理合同的变更、终止与财产清算

(一) 资产管理合同的变更的条件及程序

1. 因法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定、要求发生变化需要变更资产管理合同，资产管理人应当与资产托管人协商一致后修改资产管理合同，并由资产管理人按照合同约定及时向投资者披露变更的具体内容。

如委托人对变更内容不接受的，委托人应在管理人发布变更公告之日起 3 个工作日内书面回复不同意变更的意见，管理人在收到委托人不同意变更的书面意见之日起的 5 个工作日内通过开放临时退出、允许委托人进行份额转让等方式合理保障委托人退出的权利。

2、资产管理计划改变投向和比例的，应当事先取得委托人同意。

3、因其他原因需要变更资产管理合同的，应经全体委托人、资产管理人和资产托管人协商一致后，可对资产管理合同内容进行变更，但管理人有权自主决定的情形以及本合同另有约定的情形除外。合同变更后，变更内容自动成为本合同的组成部分，委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

对于管理人有权自主决定变更合同内容的情形，管理人在管理人公司网站 www.southerncapital.com.cn 以公告形式通知委托人和托管人，管理人即视为履行了告知义务。如委托人不认可变更内容，可在下一个开放退出日退出。

上述管理人有权自主决定变更合同内容的情形包括：

(1) 投资经理的变更；

(2) 资产管理计划认购、参与与退出、非交易过户的原则、时间、业务规则等变更，但调高费用等对投资者权益产生不利影响的事项除外；

(3) 因相应的法律法规发生变动而应当对资产管理合同进行变更；

(4) 对资产管理合同的变更不涉及合同当事人权利义务关系发生重大变化；

(5) 对资产管理合同的变更对委托人、托管人利益无实质性不利影响；

(6) 本资产管理合同所约定的其他情形。

(二) 合同变更的备案

对资产管理合同任何形式的变更、补充，管理人应当按照基金业协会要求及时报基金业协会备案，并抄送中国证监会相关派出机构。

(三) 发生以下事项时，管理人应及时通过公告的形式向委托人披露：

1、资产管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他资产管理人承接；

2、资产托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、宣告破产，资产管理计划由其他资产托管人承接。

管理人应合理保障合同变更后投资者选择退出资产管理计划的权利。因发生以上事项资产管理合同需要变更的，管理人应以公告形式向资产委托人和托管人披露，保障委托人选择退出资产管理计划的权利，并对相关后续事项作出公平、合理安排。

(四) 合同的展期

本合同展期应当符合下列条件：

1、本计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；

2、本合同展期没有损害委托人利益的情形；

3、中国证监会规定的其他条件；本合同展期的，还应当符合本计划的成立条件。

资产管理计划符合上述条件，且资产管理合同需要展期的，管理人应当在资产管理合同期限届满 1 个月前，至少提前 5 个工作日以公告形式向委托人披露，如委托人未不愿展期的，管理人应当在本计划原定到期日为投资者安排退出时间。如委托人在原定到期日未提出退出申请的，则视为同意展期。

(五) 合同终止的情形

资产管理合同终止的情形包括下列事项：

1、资产管理合同期限届满而未延期的。

2、管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在 6 个月内没有新的管理人承接的。

3、托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在 6 个月内没有新的托管人承接的。

4、经全体委托人、管理人和托管人协商一致决定终止的。

5、持续五个工作日委托人少于 2 人的。

6、本计划未在基金业协会完成备案或基金业协会不予备案的情形。

7、合同成立以后客观情况发生了当事人在订立合同时无法预见的、非不可抗力造成的不属于商业风险的重大变化，继续履行合同对于一方当事人明显不公平或者不能实现合同目的，且管理人和托管人协商后决定终止本计划的。

8、资产管理计划的投资目的已实现或已确定无法实现的。

9、资产管理计划净值低于1000万元时，如管理人认为资产管理计划规模过小而不再适应投资策略的事宜，资产管理人有权提前终止本计划。

10、资产管理计划每个运作周期结束时，资产管理人有权提前终止本计划，但应提前通知资产委托人及托管人。

11、法律法规、证监会规定及本合同规定的其他情形。

管理人应当自本计划终止之日起5个工作日内报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构，前述第（6）项约定的情形除外。

（六）资产管理计划财产的清算

本合同终止时，应当按法律法规和本合同的有关规定对计划资产进行清算

1、资产管理计划财产清算小组

（1）资产管理计划终止，进入清算阶段后，由资产管理计划财产清算小组统一接管计划财产。

（2）资产管理计划财产清算小组组成：资产管理计划财产清算小组成员由管理人、托管人指定的人员组成。资产管理计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

（3）资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。资产管理计划财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

2、清算小组成员职责

管理人职责包括：

1) 资产变现；

2) 除交易所、银行等自动扣收的费用外，对清算期间资金支付出具划款指令；

3) 清算期间的会计核算；

4) 编制清算报告并签章；

- 5) 配合托管人账户注销工作;
- 6) 代表计划财产清算小组聘请会计师事务所、律师事务所(如涉及);
- 7) 向委托人发布清算报告;
- 8) 作为清算组对外文书签署主体进行文书签署;
- 9) 履行与管理人义务相关的其他职责等。

托管人职责包括:

- 1) 清算期间的现金类财产保管;
- 2) 清算期间的会计核算;
- 3) 对管理人划款指令进行审核后,依据划款指令进行资金划付;
- 4) 计划财产资金等账户的注销;
- 5) 复核管理人出具清算报告中的财务数据并签章;
- 6) 履行与托管人义务相关的其他职责等。

3、清算程序

(1) 资产管理计划财产清算小组负责资产管理计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。

(2) 清算小组在本计划终止后编制计划财产清算报告,由管理人或销售机构按照委托人提供的联系方式或由管理人通过其公司网站告知委托人。委托人在此同意,上述报告不再另行审计,除非法律法规或监管部门要求必须进行审计的。

(3) 清算小组根据计划财产清算报告完成清算财产的分配,本计划清算办理完毕。

(4) 除合同当事人三方另有约定外,计划财产期末移交采取现金方式,在计划终止日前,管理人必须将投资组合内所有证券变现。合同终止后,资产管理计划仍持有可流通非现金资产的,在5个交易日内(含合同终止日当日)由管理人进行强制变现处理;资产管理计划持有的流通受限证券,如未到期回购、未上市新股等,自限制条件解除日起(含解除当日)3个交易日内完成变现。未变现资产于清算期间损益由全体委托人享有或承担。

4、清算费用

清算费用是指资产管理计划财产清算小组在进行计划清算过程中发生的

所有合理费用，清算费用由资产管理计划财产清算小组优先从资产管理计划财产中支付。清算费用包括但不限于：

- (1) 聘请会计师、律师，以及其他工作人员所发生的报酬；
- (2) 资产管理计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- (3) 信息披露所发生的费用；
- (4) 诉讼仲裁所发生的费用；
- (5) 其他与清算事项有关的费用。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由管理人向托管人出具指令，由托管人复核后办理支付。

5、计划剩余财产的分配

(1) 自资产管理计划清算结束后 5 个工作日内，资产管理计划财产按下列顺序清偿：

- ① 支付清算费用；
- ② 交纳所欠税款（包括但不限于本计划应承担的增值税及其附加）；
- ③ 清偿资产管理计划债务；
- ④ 支付固定管理费、托管费、业绩报酬（如有）；
- ⑤ 剩余部分按委托人持有的资产管理计划份额比例进行分配。

资产管理计划财产按前款①—④项规定清偿后，按资产管理计划委托人持有的计划份额比例进行分配，另有约定的除外。

(2) 如本资产管理计划终止之日有未能流通变现的证券，清算小组应在该证券可流通变现时及时变现，在计提相关费用后按计划份额比例进行再次分配并履行相应的告知义务，直至所有未能流通变现的证券全部清算完毕。资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

6、计划资产清算报告的告知安排

管理人编制清算报告交托管人复核后，由管理人向基金业协会备案，销售机构应向委托人履行告知义务。

7、计划资产清算账册及文件由计划管理人保存 20 年以上。

(八) 资产管理计划资产相关账户的注销

管理人在开放式基金变现完毕、相关权益结清后 15 个工作日内完成场外开放式基金账户注销，并向托管人出具销户确认通知书。

计划资产清算完毕后，托管人注销资产管理计划的银行托管账户，管理人应给予必要的配合。

二十六、违约责任

(一) 资产管理合同当事人违反本合同，应当承担违约责任。给其他合同当事人造成损害的，应对受损方所遭受的直接损失依法承担赔偿责任。在发生一方或多方违约的情况下，本合同能继续履行的，应当继续履行。

(二) 本合同当事一方造成违约后，其他当事方应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

(三) 本计划除开放日外封闭运作，不允许委托人于非开放日违约退出。

(四) 资产管理人、资产托管人在履行各自职责的过程中，违反法律法规规定或者本合同约定，给资产管理计划财产或者投资者造成的直接损失，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任。资产托管人承担的最大赔偿责任以其在本合同项下收取的费用为限。但是发生下列情况的，当事人免责：

1、管理人和/或托管人按照中国证监会或基金业协会的规定或当时有效的法律法规的作为或不作为而造成的损失等；

2、在勤勉尽责的情况下，管理人由于按照本合同规定的投资原则进行的投资所造成的损失、或参考投资顾问（如有）的合法合规的投资建议进行投资所造成的损失等；

3、在勤勉尽责的情况下，托管人由于按照管理人符合本合同约定的有效指令执行而造成的损失等；

4、本合同任何一方应保证本合同规定必须由其提供的信息、数据真实完整，并承担相应的法律责任。但如果该当事人方提供的信息和数据不真实或不完整是由于本合同任何另一方提供的信息不完整和不真实所造成的，由此导致的后果由初始过错方承担，该当事人不承担违约责任。

5、对于无法预见、无法抗拒、无法避免且在本合同签署之日后发生的不可

可抗力事件，导致协议当事人方无法全部履行或部分履行本合同的，任何一方当事人不承担违约责任，但是，协议各方当事人应当在合理行为能力范围内勤勉尽责，以降低此类事件对委托财产和其他当事人方的影响。

6、托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、登记公司等）发送的数据错误给本计划财产造成的损失等。

7、托管人对存放或存管在托管人以外机构的计划资产，或交由商业银行、证券公司等其他机构负责清算交收的委托资产（包括但不限于保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益，因该等机构欺诈、疏忽、过失、破产等原因给委托资产带来的损失等。

（五）管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用计划财产。但管理人不保证计划财产一定盈利，也不保证最低收益。因证券市场波动、上市公司合并、资产管理计划规模变动、投资顾问（如有）等管理人之外的因素致使资产管理计划投资不符合投资比例、策略的，管理人应将及时调整，并不因此承担任何责任。

（六）本合同所指损失均为直接损失。

二十七、法律适用和争议的处理

有关本合同的签署和履行而产生的任何争议及对本协议项下条款的解释，均适用中华人民共和国法律法规（为本合同之目的，在此不包括香港、澳门特别行政区及台湾地区法律法规），并按其解释。

各方当事人同意，因本合同而产生的或与本合同有关的一切争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。经友好协商未能解决的，提交深圳国际仲裁院，按其现时有效的仲裁规则，在深圳仲裁；若资产托管人是仲裁中的唯一被申请人，则提交南京仲裁委员会进行仲裁，仲裁地点为南京。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。本合同各方一致同意，各方就仲裁的提起、仲裁过程、仲裁结果，以及与仲裁有关的一切事项或信息均予以保密，除法律法规、本合同或监管机构另有要求外，不向本合同当事方以外的其他方披露。

争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地

履行资产管理合同规定的义务，维护委托人的合法权益。

二十八、资产管理合同的效力

(一) 本合同是约定合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人或其他组织，本资产管理合同经投资者、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及各方法定代表人(负责人)或授权代理人签字或盖章之日起成立；如投资者为自然人，本资产管理合同经投资者本人签字或授权的代理人签字、资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人(负责人)或授权代理人签字或盖章之日起成立。投资者特此声明，其独立、自主、谨慎做出投资决策并签署本合同，同时认可其他当事人以套印方式(如需)加盖公章或合同专用章具有法律效力。

若本合同采用电子签约方式的，本合同经资产管理人和资产托管人加盖公章或合同专用章以及双方法定代表人(负责人)或法定代表人(负责人)授权的代理人签字或盖章后，资产委托人通过身份验证登陆指定的销售平台，阅读相关电子合同及相关法律文件，通过勾选同意或点击确认键等约定的电子签名方式完成签署的，视为有效签署，自有效签署之日起合同成立。

(二) 本资产管理合同自投资者按合同约定将资金划入指定账户且得到资产管理人确认，本计划取得验资报告后，本计划成立。资产管理人公告本计划成立之日起，资产管理合同生效。如投资者系本计划运作期间参与到本计划的，则资产管理合同自各方当事人依据上述要求签署之日起生效。

(三) 本合同当事人各执一份。每份均具有同等的法律效力。

(四) 本合同自生效之日起对投资者、资产管理人、资产托管人具有同等的法律约束力。

(五) 本合同的有效期限为5年。

(六) 本资产管理计划成立之日起5个工作日内，资产管理人将本合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

(七) 投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在资产管理计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，不再成为资产管理计

划的投资人和资产管理合同的当事人。

(八) 本合同终止/被认定无效/不成立的, 本合同项下清算条款、保密条款、违约责任条款、争议解决条款仍然有效。

(九) 如在本合同项下交易进行的过程中, 合同任意一方被任何有权实施经济制裁的政府机构或国际组织进行制裁或管制, 且该等制裁将使得本合同项下的交易违反(或可能违反)任何适用的法律法规, 或者本合同的目的无法实现, 则另一方有权即时终止交易、解除合同, 且不应因此承担任何进一步的义务或责任。

二十九、其他事项

本合同各方当事人应对签署和履行本合同过程中所接触和获取的其他方当事人的数据、信息和其它涉密信息承担保密义务, 非经其他方当事人同意, 不得以任何方式向第三人泄露或用于非本合同之目的(法律法规或司法监管部门要求或审计需要的除外)。本保密义务不因合同终止而终止。

如将来中国证监会对资产管理合同的内容与格式有其他要求的, 委托人、管理人和托管人应立即展开协商, 根据中国证监会的相关要求修改本合同的内容和格式。

本合同如有未尽事宜, 由合同当事人各方按有关法律法规和规定协商解决。

对本合同的合同签署页、任何有效修改、补充均是本合同的有效组成部分, 与本合同具有同等的法律效力。

本合同一式叁份, 合同当事人各执壹份, 每份具有同等的法律效力。

(以下无正文)

(本页无正文, 为《南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划资产管理合同》委托人认购签署页)

委托人请填写(务必确保填写的资料正确有效, 如因填写错误导致的任何损失, 管理人和托管人不不承担任何责任):

(一) 委托人

1、自然人

姓名:

证件名称: 身份证、军官证、护照

证件号码:

通讯地址:

联系电话:

2、法人或其他组织

名称:

营业执照号码:

组织机构代码证号码:

法定代表人或负责人:

联系地址:

邮编:

联系电话:

联系人:

(二) 委托人认购金额

人民币 元整 (¥)

委托人最终认购金额、认购份额应以注册登记机构的确认为准。

(三) 委托人账户

委托人认购、参与计划的划出账户与退出计划的划入账户, 必须为以委托人名义开立的同一个账户。特殊情况导致认购、参与和退出计划的账户名称不一致时, 委托人应出具符合相关法律法规规定的书面说明并提供相关证明。账户信息如下:

账户名称:

账号:

开户银行名称:

(本页无正文，为《南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划
资产管理合同》签署页)

委托人：

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

管理人：南方资本管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代表（签字或盖章）



托管人：华泰证券股份有限公司（盖章）

负责人或授权代表（签字或盖章）：



签署日期： 年 月 日

附件一：南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划

认购/参与告知书

尊敬的各位委托人：

现将南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划认购/参与信息告知如下：

一、基本信息

1、计划代码：***

2、跟踪指数：中证指数有限公司编制的中证 1000 指数，交易代码为“000852.SH”

3、计划成立日：指资产管理合同成立且本计划符合本合同约定的计划成立条件，管理人在其公司网站发布计划成立公告之日。自该日起，本计划成立，本计划资产管理合同生效。

4、投资起始日：指每个运作周期内管理人根据本合同的约定完成股指期货合约投资的日期，具体以管理人公告为准

5、首个/第 i 个运作周期起始日：以管理人公告为准

6、首个/第 i 个运作周期到期日：【】年【】月【】日

7、首个/第 i 个运作周期期初观察日：首个/第 i 个运作周期起始日。

8、观察期：首个/第 i 个期观察价日（含）至首个/第 i 个运作周期到期日所有交易日。

9、本计划首个/第 i 个运作周期开放日、预约参与日及预约退出日，届时以管理人公告为准。

二、风险收益特征

本资产管理计划为【混合】类集合资产管理计划，本计划的风险等级为【R4】，适合专业投资者和风险承受能力评级不低于【C4】级的普通投资者。本资产管理计划不保证本金不受损失或收益一定实现，投资者可能会因本风险揭示书所列风险蒙受损失，甚至存在亏损全部委托财产本金的可能性。

三、业绩报酬计提基准（年化）

本资产管理计划的首个/第 i 个运作周期业绩报酬计提基准按照以下规则确定：

本计划第 i 个运作周期为**至**日。本期业绩报酬计提基准(年化)Ri 为：
 $\max \{ \text{第 } i \text{ 个运作期对应的中证 1000 指数收益率} \div \text{第 } i \text{ 个运作期对应的投资起始日 (含) 至第 } i \text{ 个运作期对应的到期日 (不含) 的自然日天数} \times 365 + \text{第 } i \text{ 个运作期对应的年化增强收益率 } E_i - \text{年化税率 (如有), 0} \}$ ，其中：第 i 个运作周期对应的中证 1000 指数收益率=中证 1000 指数在第 i 个运作周期对应的到期日 13:00-15:00 的算术平均价 \div 中证 1000 指数在第 i 个运作周期对应的投资起始日 xx:xx-xx:xx 的算术平均价-1。本运作周期年化增强收益率 E_i 约为【%】，具体以管理人公告为准。

资产管理人特别声明：本计划的相关业绩报酬计提基准仅是管理人收取业绩报酬的计提标准而非预期收益率，不构成管理人或托管人对委托财产本金不受损及收益预期、收益状况的任何承诺或保证。管理人计提业绩报酬将对本计划资产净值产生一定的波动影响。

四、本计划特定投资方法及特定投资对象可能引起的主要特别风险

资产管理人特别揭示挂钩标的的风险如下：

本管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用资产管理计划财产，但不保证委托财产本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本管理人提醒投资者“买者自负”投资原则，在投资者做出投资决策后，计划的运营状况与计划净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。本计划在投资运作过程中可能面临的各项风险包括但不限于本金损失风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、投资标的风险、关联交易风险、操作或技术风险、税收风险、不可抗力风险、政策风险、备案风险等（具体详见《南方资本恒逸中证1000指数增强1号集合资产管理计划资产管理合同》第二十四章及《风险揭示书》），现本管理人就投资运作过程中可能面临的主要特别风险进行揭示，包括但不限于：

1. 挂钩标的的风险

挂钩标的的波动将影响委托人所获得的收益。一方面，挂钩标的并不能完全代表整个证券市场。挂钩标的的成份股的平均回报率与整个证券市场的平均回报率可能存在偏离。挂钩标的的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致挂钩标的的价格波

动，直接影响挂钩标的的表现。

(1) 挂钩标的相关风险

本计划委托人的最终收益与挂钩标的相关。挂钩标的波动将影响委托人所获得的收益。挂钩标的并不能完全代表整个证券市场。挂钩标的成份股的平均回报率与整个证券市场的平均回报率可能存在偏离。挂钩标的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致挂钩标的的价格波动，直接影响挂钩标的的表现。

(2) 投资金融衍生品的风险包括但不限于：

①投资于股指期货等金融衍生品。无论管理人是否出于投机目的对金融衍生品进行投资，由于金融衍生品的高杠杆性等特征，若股票指数行情向不利方向剧烈变动，可能承受超出保证金甚至委托财产本金的损失；

②期货交易所实行保证金制度、当日无负债结算制度、涨跌停板制度、持仓限额和大户持仓报告制度、风险准备金制度以及国务院期货监督管理机构规定的其他风险管理制度。计划可能因保证金不足而被采取限制开仓、强制平仓，进而可能给计划造成重大损失：计划所委托的交易所会员除接受本计划委托外，还可能同时接受其他主体的委托，计划所委托的交易所会员发生保证金不足时将被采取限制开仓、强制平仓等措施，而这种不足不一定是计划的保证金不足造成的，还可能是上达交易所会员进行其他主体的委托操作所造成的，但即便如此计划也可能因此受到重大损失：为及时缴纳保证金，本计划可能紧急变现部分计划财产，在上述情况下，该部分计划财产的变现可能并非以最优价格进行，从而造成计划的损失。计划及计划所委托的交易所会员可能被实行强制结算，一旦计划或计划所委托的交易所会员被强制结算、可能给计划财产造成损失；

③在市场剧烈变化的情况下，管理人可能难以或无法将持有的未平仓合约平仓。这类情况将导致保证金有可能无法弥补全部损失，计划必须承担由此导致的全部损失。同时计划将面临期货合约无法当天平仓而价格变动的风险；

④基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对计划投资产生不利影响。

(以下无正文)

附件二：交易监控合规表

投资监督事项表	
投资监督事项	<p>1、投资范围：</p> <p>1) 固定收益类资产：银行存款（包括活期存款、定期存款、同业存款与协议存款等）、同业存单、货币市场基金（含货币 ETF）、货币市场或现金管理类银行理财、证券公司及其资产管理子公司资产管理计划、保险公司资产管理计划和信托计划。</p> <p>2) 权益类资产：沪深交易所发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准上市的股票，含新股申购）、股票型和混合型公开募集证券投资基金。</p> <p>3) 商品及金融衍生品资产：股指期货。</p> <p>2、投资比例：</p> <p>(1) 本计划根据穿透原则合并计算的投资于权益类资产的总值不超过计划总资产的 80%、投资于固定收益类资产的总值不超过计划总资产的 80%、投资商品及金融衍生品类资产的总值不超过计划总资产的 80%或衍生品保证金账户权益不超过计划总资产的 20%；</p> <p>(2) 本计划按《运作规定》规定进行组合投资，本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%。银行活期存款等中国证监会认可的投资品种的除外。</p> <p>3、投资限制</p> <p>投资限制行为：</p> <p>(1) 本计划持有一家上市公司的股票，其市值不得超过该计划财产净值的 10%且不得超过该证券的 10%；</p> <p>(2) 本计划的总资产不得超过本计划净资产的 200%；</p> <p>(3) 本计划投资于同一标的的资产不得超过本计划资产净值的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等经中国证监会认可的投资品种除外。</p>

附件三：管理人及托管人业务人员联系核实信息表

一、管理人

管理人	南方资本 管理有限 公司	业务人员及其工作职责	办公电话	电子邮件
		梁茜，协议签署、业务协调	0755-21912224	liangxi@southernfund.com
		甘锦锋，指令与划款估值核算	0755-21912223	ganjinfeng@southernfund.com
		朱林奎，指令与划款估值核算	0755-21912213	zhulinkui@southernfund.com
		丘天奇，指令与划款估值核算	0755-21912282	qiutianqi@southernfund.com

二、托管人

岗 位	姓 名	联系电话	电子邮件
估值核算	张梦辰	025-83387221	zhangmengchen@htsc.com
划款指令接收、经办	李雪梅	025-833897967	tgzj@htsc.com
投资监督	华阳	025-83388290	huayang@htsc.com
产品管理	尹鹏	025-83387210	yinpeng@htsc.com

附件四：投资指令授权通知（样本）

华泰证券股份有限公司：

自“南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划”成立之日起至该资产计划终止清算完毕之日止，我公司向贵司发送管理运用资产财产的投资指令的被授权人及其权限为：

1、被授权人及权限：

_____：投资指令经办

_____：投资指令复核

_____：投资指令审核

2、指令被授权人签字样式：

（签字）

（签字）

（签字）

3、预留印鉴：

南方资本管理有限公司（公章）

法定代表人（授权代理人）：

年 月 日

附件五：南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划

投资指令

投资指令（样本）

编号：	2022 年第*号	
指令日期：	2022/**/*	
***：	<p>敬请贵部根据以下提供的收款人名称、开户行、账号、到账日期和划款金额划款。</p>	
到账日期：		
付款人：		
开户行：		
账号：		
收款人：		
开户行：		
账号：		
划款金额(小写)：	¥	
划款金额(大写)：		
划款用途：	<p>支付智汇费用</p>	
备注：		
管理人签章：	托管人签章：	
审批人：	审批人：	
复核人：	复核人：	
经办人：	经办人：	

制表：

复核：

审核：