
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

资产管理人：南方资本管理有限公司

资产托管人：华泰证券股份有限公司

二〇二二年 十月



目录

第一节	前言.....	3
第二节	释义.....	4
第三节	资产管理计划的概况	7
第四节	资产管理合同的主要内容.....	13
第五节	管理人与托管人的概况.....	37
第六节	投资风险揭示.....	38
第七节	资产管理计划的募集	45

第一节 前言

本计划说明书依据《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》”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《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）》和其他有关法律法規以及《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》（以下简称“资产管理合同”）编写。

本计划说明书阐述了南方资本恒逸中证1000指数增强1号集合资产管理计划的投资目标、投资策略、风险、费率等与委托人投资决策有关的全部必要事项，委托人在做出投资决策前应仔细阅读本计划说明书。

本管理人承诺本计划说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。

本资产管理计划根据本计划说明书所载明的内容进行销售。本管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本计划说明书中载明的信息，或对本计划说明书作任何解释或者说明。

本计划说明书根据本资产管理计划的资产管理合同编写。资产管理合同是约定资产管理计划当事人之间权利、义务的法律文件。委托人自签订资产管理合同且依据合同取得资产管理计划份额，即成为资产管理合同当事人，其持有资产管理计划份额的行为本身即表明其对资产管理合同的承认和接受，并按照《基金法》、资产管理合同及其他有关规定享有权利、承担义务。委托人欲了解本资产管理计划份额持有人的权利和义务，应详细查阅资产管理合同。

如本计划说明书文字表述存在不完善或不尽然之处，以本资产管理计划资产管理合同为准。

第二节 释义

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。

第三节 资产管理计划的概况

一、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。

二、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於【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%。

三、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。

第四节 资产管理合同的主要内容

一、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；

(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、单个委托人参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。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。

二、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。

三、资产管理计划的参与、退出和转让

（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的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，资产管理人可以拒绝或暂停参与：

- 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转；
- 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转；
- 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的情形;“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、办理非交易过户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。

四、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。

五、资产管理计划的费用和税收

（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 \times 年管理费率 \div 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 \times 年托管费率 $\div 365$

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 \times 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÷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。

六、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。

七、信息披露与报告

（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。

第五节 管理人与托管人的概况

一、管理人的概况

名称：南方资本管理有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路 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

网站：www.southerncapital.com.cn

二、托管人的概况

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

第六节 投资风险揭示

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情况下，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。

(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 inconsistence，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) 一般风险揭示

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。

第七节 资产管理计划的募集

（一）募集期

本资产管理计划自2022年10月20日至2022年11月7日进行初始销售。

资产管理人有权根据资产管理计划初始销售的实际情况，与销售机构协商一致，在符合法律法规要求的前提下延长或缩短初始销售期。

（二）销售机构

1、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

名称：蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969号3幢5层599室

法定代表人：王珺

（三）募集对象

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，慈善基金等社会公益基金，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）资产管理计划的认购金额限制

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。

