

南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划

风险揭示书

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构认购或申购南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在作出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和《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”），充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎作出投资决策。

根据有关法律法规，管理人南方资本管理有限公司及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

一、管理人声明与承诺

（一）管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。

（二）管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或已委托代理销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力。

（三）管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

二、风险揭示

（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**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。

三、投资者声明

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构作出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【_____】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

1、本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的全部后果。【_____】

2、本人/机构知晓，管理人、代理销售机构、托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【_____】

3、本人/机构已符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求并已按照管理人或代理销售机构的要求提供相关证明文件。【_____】

4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第四章“当事人及权利义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第十一章“资产管理计划的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【_____】

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十一章“资产管理计划的费用与税收”中的所有内容。【_____】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十七章“争议的处理”中的所有内容。【_____】

9、本人/机构已经配合管理人或代理销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述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以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。

【_____】

10、本人/机构知晓，中国证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【_____】

11、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。

【_____】

12、本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【_____】

13、本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。【_____】

投资者（自然人签字或机构盖章）：

管理人（盖章）：



销售机构经办人（签字）：

签署日期：2022年10月20日

