

关于中信建投智享盈波 2 号集合资产管理计划 第 1 个量化波动投资运作期相关产品要素的公告

依据《中信建投智享盈波 2 号集合资产管理计划资产管理合同》约定，中信建投智享盈波 2 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）需要由管理人公告的相关产品要素包括：每个量化波动投资运作期的分红条件、每个量化波动投资运作期投资起始日、每个量化波动投资运作期到期日、每个量化波动投资运作期内的开放规则、每个量化波动投资运作期的收益分配基准日、业绩报酬计提基准等。

依据《中信建投智享盈波 2 号集合资产管理计划资产管理合同》约定，现向投资者公告本集合计划第 1 个量化波动投资运作期的相关产品要素：

1、分红条件：

在第 1 个量化波动投资运作期的任一收益分配基准日，本集合计划满足以下任一分红条件，则该量化波动投资运作期提前到期，本集合计划于该收益分配基准日后进行分红。

(1) 第 1 个量化波动投资运作期期间年化收益率 $r \geq$ 分红条件阈值 1。

第 1 个量化波动投资运作期分红条件阈值 1 为【15.0%】。

(2) 第 1 个量化波动投资运作期的任一收益分配基准日，本集合计划参考标的的收盘价相较该投资运作期投资起始日参考标的收盘价的涨幅达到或超过参考标的的涨幅阈值 2。

第 1 个量化波动投资运作期参考标的的证券名称代码：中证 1000 指数 (000852.SH)。

第 1 个量化波动投资运作期参考标的的涨幅阈值 2 为 0%。

2、量化波动投资运作期投资起始日：第 1 个量化波动投资运作期的投资起始日为本集合计划投资账户开立完成后的三个交易日内，具体日期以管理人后续公告为准。

3、量化波动投资运作期到期日：第 1 个量化波动投资运作期到期日为第 1 个量化波动投资运作期投资起始日 2 年后的对应日，如遇非工作日或无对应日，

则顺延至下一工作日；在任一收益分配基准日，如本集合计划满足分红条件，则本次量化波动投资运作期提前到期；具体日期以管理人后续公告为准。

4、**开放规则：**自第 1 个量化波动投资运作期的投资起始日起至第 1 个量化波动投资运作期到期日后的第 2 个工作日（不含当日）封闭不开放，第 1 个量化波动投资运作期到期日后的第 2 个工作日起进入开放期，开放期不少于 1 个工作日，开放期内投资者可以根据合同约定和管理人公告及销售机构政策办理参与和退出业务，具体开放时间以管理人后续公告为准。

5、**收益分配基准日：**第 1 个量化波动投资运作期的收益分配基准日为该量化波动投资运作期的投资起始日在第 j 个月的对日（ $j=3, 4, \dots, 24$ ），如该日为非工作日，则顺延至下一工作日，若无对应日期，则以该月的最后一个自然日为准（遇节假日、休息日自动顺延至下一工作日），具体日期以管理人后续公告为准。

6、**业绩报酬计提基准：**第 1 个量化波动投资运作期业绩报酬计提基准为 15.0%，自集合计划成立日开始生效。

资产管理人特别声明：本集合计划的分红条件和业绩报酬计提基准不是保证收益率。投资者确认并充分了解，本集合计划的分红条件仅供管理人判断产品是否进行分红时使用、本集合计划的业绩报酬计提基准仅供管理人计算提取业绩报酬使用，本集合计划的分红条件和业绩报酬计提基准均不构成管理人、托管人对投资者本金及收益状况的任何预测、承诺或担保。投资有风险，投资者面临无法取得相应收益甚至损失本金的风险。

特此公告。



中信建投证券股份有限公司

2023年3月16日