

中信建投智享盈波 2 号集合资产管理计划销售公告

一、重要提示

1、管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本公告对集合计划未来的收益预测仅供投资者参考，不构成管理人、托管人和销售机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

2、本公告仅对本集合计划募集的有关事项和规定予以说明。投资者如欲了解本集合计划的详细情况，请阅读本公司网站（www.csc108.com）备置的《中信建投智享盈波 2 号集合资产管理计划说明书》和《中信建投智享盈波 2 号集合资产管理计划资产管理合同》。

二、本集合计划概况

1、名称：中信建投智享盈波 2 号集合资产管理计划

2、类型：混合类集合资产管理计划。本计划为私募产品，面向合格投资者通过非公开方式发行。

3、产品代码：B5Z498

4、存续期限：10 年

5、风险等级：中高

6、每份额面值：人民币 1 元

7、最低认购金额：本计划最低认购金额为人民币 40 万元(不包含认购费)。

当日的认购申请可以在销售机构规定的时间内撤销。

8、认购费：本集合计划不设置认购费

9、参与费：本集合计划不设置参与费

10、退出费：本集合计划免收退出费

11、管理人的业绩报酬：在集合计划份额持有人赎回和本集合计划终止时，业绩报酬分别按集合计划份额持有人赎回份额和集合计划终止时持有份额计算。业绩报酬计提基准于每个量化波动投资运作期前由管理人公告确定。



12、开放期和封闭期安排：

本集合计划存续期内除开放期外为封闭期，封闭期内不办理集合计划的参与和退出业务。

本集合计划自成立之日起至第 1 个量化波动投资运作期的投资起始日封闭不开放。本集合计划自第 1 个量化波动投资运作期的投资起始日起分为多个量化波动投资运作期，每个量化波动投资运作期的投资安排以当期管理人公告为准；每个量化波动投资运作期原则上不少于 3 个月，每个量化波动投资运作期内的开放规则以公告为准；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；具体以管理人公告为准）后的第 2 个工作日起进入开放期。本集合计划每个量化波动投资运作期后的开放期不少于 1 个工作日。

在第 i ($i=1, 2, 3, \dots$) 个量化波动投资运作期到期日，若本集合计划未有分红且 r 值小于 0，则本集合计划在该量化波动投资运作期到期日的第 2 个工作日开放，从该量化波动投资运作期到期日的第 3 个工作日开始，本集合计划进入指数增强投资运作期，将采用指数增强策略进行投资，指数增强投资运作期本集合计划每月 10 号开放（遇非工作日顺延至下一工作日），具体以届时管理人公告为准。

开放期内投资者可以根据合同约定和管理人公告办理及销售机构政策参与和退出业务。

上个量化波动投资运作期结束后，未在该量化波动投资运作期的开放期申请退出而继续存续的投资者，将自动转入下一量化波动投资运作期或指数增强投资运作期（如有）。

本集合计划可根据销售机构政策采用预约参与和预约退出安排，具体安排由管理人于开放期前公告。如采用预约安排，则投资者须于预约期内提交预约参与或退出申请，管理人有权拒绝投资者未预约的参与或退出申请。预约参与和预约退出的办理方式具体以销售机构的规则为准。

当发生法律法规修订、监管要求调整、对合同进行变更等情形时，管理人可以根据需要设置临时开放期，并于临时开放期前公告，具体安排以管理人公告为

准。

三、 募集期限

本集合计划的设立募集期从 2023 年 3 月 20 日（含）开始，管理人有权根据募集情况提前结束或延长募集期，但募集期自集合计划份额发售之日起最长不超过 60 天。此类变更适用于管理人委托的销售机构。管理人提前结束或延长募集期的，应当通过管理人网站及时公告，集合计划自公告所载募集结束日期起不再接受认购申请。

四、 募集对象

认同本集合计划的投资理念，追求合理收益、对资产流动性要求不高、有相应风险承受能力的合格投资者。

五、 销售机构

本集合计划的销售机构为中信建投证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司。

六、 募集方式

本计划为私募资产管理产品，通过非公开方式向合格投资者募集。销售机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大预期收益和商业贿赂等不正当手段销售集合计划。

管理人及销售机构应当采取有效措施，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过报刊、电台、电视台、互联网等公众传播媒体或者讲座、报告会、分析会、传单、布告、自媒体等方式向不特定对象宣传推介。

证券股
隆专用

七、 本集合计划的成立

1、 集合计划成立的条件

集合计划的初始募集规模不低于1000万元人民币,投资者人数不少于2人,且不超过200人,符合本合同和集合计划说明书的相关规定,募集过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定。集合计划在募集金额缴足之日起十个工作日内,公告集合计划成立。

2、 集合计划设立失败

集合计划募集结束,在集合计划规模低于人民币1000万元或投资者人数少于2人条件下,或募集期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力,集合计划设立失败,管理人承担集合计划的募集费用,并将已募集资金加计按照中国人民银行公布的银行同期活期存款基准利率计算的利息在募集期结束后30日内退还投资者。

八、 本集合计划的当事人

1、 管理人

名称: 中信建投证券股份有限公司

住所: 北京市朝阳区安立路66号4号楼

通信地址: 北京市东城区朝内大街188号

邮政编码: 100010

联系电话: 010-85159383

联系人: 何晓冬

公司网站: <http://www.csc108.com>

2、 托管人

名称: 中信银行股份有限公司天津分行

住所: 天津市和平区张自忠路162号增5号

通信地址: 天津市和平区大沽北路2号环球金融中心7层

邮政编码: 300000

联系电话: 022-23028012

联系人: 王峥

3、销售机构

中信建投证券股份有限公司、上海天天基金销售有限公司。

4、登记机构

中信建投证券股份有限公司

资产管理人特别声明：业绩报酬计提基准用于约定管理人报酬计提标准，不等同于预期收益率，并非管理人对产品业绩的承诺，管理人不对委托人的本金和收益做出任何承诺和保证。管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

中信建投证券股份有限公司

2023年3月17日

