

# 关于南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划 2023 年度第一次开放公告

尊敬的委托人：

根据《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》（下称“《本合同》”）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认购告知书》约定，本计划首个运作期将于 2023 年 6 月 16 日到期。本计划首个开放日 2023 年 6 月 16 日，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）。现将有关事项通知如下：

## 一、销售机构

本计划销售机构为蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司。

## 二、参与和退出的时间

根据《本合同》约定，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。

本次本计划将于 2023 年 6 月 9 日至 2023 年 6 月 14 日接受投资者的参与或退出申请。

## 三、参与和退出的费用

本计划参与和退出不收取费用，管理人不收取首个运作周期的管理人业绩报酬。

## 四、参与和退出的价格

本计划参与和退出采用“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。

## 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、参与和退出的方式及程序

1、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。

2、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。

3、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。

4、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。

5、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。

6、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。

## 七、其他事项

1、管理人不收取首个运作期管理人业绩报酬。

2、如未在退出申请日提交退出申请的委托人，将视为同意继续参与本计划第二个运作期，并知悉且同意适用第二个运作期的《参与告知书》中的全部内容。本计划第二个运作期的《参与告知书》详见附件一。

3、由于本次开放投资者的参与、退出金额具有不确定性，如本次开放参与、退出申请确认后，本计划净值低于1000万元时，且管理人认为资产管理计划规模过小而不再适应投资策略，资产管理人有权提前终止本计划。届时，管理人将另行发布本计划提前终止公告，并尽快完成产品清算。

特此公告。



# 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 第二个运作周期参与告知书

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第二个运作周期参与信息告知如下：

## 一、基本信息

- 1、计划代码：3W0103
- 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：2022 年 11 月 16 日
- 4、第二个运作周期投资起始日：指第二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、第二个运作周期起始日：以管理人公告为准。
- 6、第二个运作周期到期日：2023 年 12 月 15 日。
- 7、第二个运作周期期初观察日：第二个运作周期起始日。
- 8、观察期：第二个运作周期期初观察日（含）至第二个运作周期到期日所有交易日。
- 9、本计划第二个运作周期开放日、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）

本资产管理计划的第二个运作周期业绩报酬计提基准按照以下规则确定：

本计划第二个运作周期为第二个运作周期起始日至 2023 年 12 月 15 日。

本期业绩报酬计提基准（年化） $R_i$  为：

$\max \{ \text{第二个运作期对应的中证 1000 指数收益率} \div \text{第二个运作期对应的投资起始日 (含) 至第二个运作期对应的到期日 (不含) 的自然日天数} \times 365 + \text{第二个运作期对应的年化增强收益率} E_i - \text{年化税率 (如有), 0} \}$ , 其中: 第二个运作周期对应的中证 1000 指数收益率 = 中证 1000 指数在第二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 指数在第二个运作周期对应的投资起始日 14:00-14:30 的算术平均价 - 1。本运作周期年化增强收益率  $E_i$  约为【3.8%】, 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。

南方资本管理有限公司

2023年6月8日