

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 资产管理合同变更的公告

尊敬的委托人并托管人：

由南方资本管理有限公司（下称“我司”）作为管理人，华泰证券股份有限公司（下称“华泰证券”）作为托管人的南方资本恒逸中证 1000 指数增强 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）于 2022 年 11 月 16 日成立。

现根据 2023 年 3 月 1 日起实施的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告〔2023〕2 号）和《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第 203 号）规定以及《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”）的相关约定，经与资产托管人协商一致后，我司对资产管理合同进行变更和补充。具体修改如下：

资产管理合同变更前的条款	资产管理合同变更后的条款
一、前言	
<p>（一）订立本合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本资产管理合同的依据是《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》（以下简称“《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）》和其他有关法律法规、部门规章及中国证券投资基金业协会</p>	<p>（一）订立本合同的目的、依据和原则</p> <p>2、订立本资产管理合同的依据是《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投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、<u>《中华人民共和国期货和衍生品法》</u>（以下简称“<u>《期货和衍生品法》</u>”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（<u>证监会令第 203 号</u>，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》（<u>证监会公告〔2023〕2 号</u>，以下简称“《运作规定》”）、《集合资</p>



<p>(以下简称“基金业协会”)自律规则等。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处,应当以届时有效的法律法规的规定为准,各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。</p>	<p>产管理计划资产管理合同内容与格式指引(试行)》和其他有关法律法规、部门规章及中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)自律规则等。若因法律法规的制定或修改导致本合同的内容存在与届时有效的法律法规的规定不一致之处,应当以届时有效的法律法规的规定为准,各方当事人应及时就本合同做出相应的变更和调整。</p>
<p>五、资产管理计划的基本情况</p>	
<p>(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</p> <p>.....</p> <p>2、主要投资方向及比例</p> <p>投资方向:</p> <p>.....</p> <p>(3) 商品及金融衍生品资产: 股指期货。</p> <p>投资比例:</p> <p>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。</p>	<p>(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</p> <p>.....</p> <p>2、主要投资方向及比例</p> <p>投资方向:</p> <p>.....</p> <p>(3) 期货和衍生品资产: 股指期货</p> <p>投资比例:</p> <p>本计划为混合类资产管理计划, 投资比例应符合《管理办法》第二十一条第(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。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>	
<p>(二) 投资范围及投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>.....</p> <p>(3) 商品及金融衍生品资产: 股指期货。</p>	<p>(二) 投资范围及投资比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>.....</p> <p>(3) 期货和衍生品资产: 股指期货</p>
<p>2、投资比例</p>	<p>2、投资比例</p>

<p>(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%、投资商品及金额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%;</p>	<p>(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%、投资期货和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%;</p>
<p>十四、利益冲突及关联交易</p>	
<p>(一)资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形一</p> <p>全体委托人知悉并认可，管理人作为专业资管机构已经或将会设立不同的资产管理计划，管理人将按照法律法规的规定，公平对待不同资产管理计划的投资机会。同时，对于管理人、托管人、代销机构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，但需要符合金融监管部门的规定、遵循投资者利益优先的原则、防范利益冲突。</p>	<p>(一) 资产管理计划存在的或可能存在利益冲突的情形</p> <p>管理人作为专业资管机构已经或将会设立不同的资产管理计划，管理人将按照法律法规的规定，公平对待不同资产管理计划的投资机会。同时，<u>本计划与管理人、托管人、代销机构及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方及其管理的资管产品之间可能互为交易对手或从事其他类型的关联交易</u>，本计划从事关联交易需要符合金融监管部门的规定，遵循投资者利益优先的原则，防范利益冲突，但在业务运营中仍可能存在与本计划的利益产生实际或潜在的冲突。</p>
<p>(二)资产管理计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率。</p> <p>1、处理方式</p> <p>管理人在符合金融监管部门相关规定之要求的基础上，遵循投资者利益优先的原则，按照市场上通行的方式和条件参与，</p>	<p>(二) 资产管理计划存在利益冲突的处理方式</p> <p><u>本计划项下关联方包括但不限于管理人、托管人、代销机构及前述机构的控股股东、实际控制人以及资产管理人认定的其他关联方（管理人的控股股东、实际控制人包括南方基金管理股份有限公司，其他关联方</u></p>

<p>公平对待委托财产，防范及公平解决利益冲突。</p> <p>2、披露方式及披露频率</p> <p>资产管理计划在投资运作中发生利益冲突情形时，管理人将在投资或交易完成后的五个工作日内通过管理人官网进行披露，并同时在年度报告及季度报告中予以披露。</p> <p>3、披露内容</p> <p>临时报告及季度报告将对是否发生利益冲突事项及已发生利益冲突事项情形、处置方式以及对委托人利益影响等内容进行详尽披露。</p>	<p>名单管理人将通过官网或公告方式向委托人披露，资产托管人的关联方名单详见资产托管人定期报告)。</p> <p>关联交易分为重大关联交易和一般关联交易。</p> <p>重大关联交易是指资产管理人运用计划财产投资于资产管理人、资产托管人、代销机构（如有）及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，以及中国证监会、基金业协会、管理人公司制度规定或管理人及托管人一致认定的其他重大关联交易情形。</p> <p>重大关联交易以外的关联交易为一般关联交易。本计划可以投资于资产管理人、资产托管人、代销机构及前述机构的股东、实际控制人等关联方管理或发行的证券投资基金以及资产证券化产品等法律法规允许投资的品种。</p> <p>对于管理人以本计划资产从事重大关联交易的，除本合同另有约定外，资产管理人应提前不少于2个自然日以公告、邮件或其他方式通知投资者，投资者未在前述通知的指定时间内通过指定形式明确表示不同意该笔重大关联交易的，即视为同意。投资者不同意的，管理人将保障投资者选择退出本计划的权利或者以管理人和投资者协商一致的方式处理，并事后进行单独披露和报告。</p> <p>管理人以本计划资产从事前述重大关</p>
--	---

	<p>联交易外的其他关联交易的，除构成重大关联交易外，资产管理人无需就具体关联交易再行分别、逐笔取得投资者的统一或授权，投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事该等关联交易。但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，有充分证据证明未损害委托人利益，并通过定期报告等方式履行事后告知义务。</p> <p>如法律法规、自律规则对关联交易的定义及披露规则有所变更的，本计划关联交易相关规则按照法律法规、自律组织的要求执行，管理人和托管人一致确认后可按变更后的规则对本合同进行调整，并通知投资者。</p>
<p>(三) 本计划从事关联交易(如有)的安排</p> <p>除前述第(一)款规定外，管理人不得将其管理的本计划资产，直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为本机构、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提供或者变相提供融资。</p> <p>管理人自营账户、资产管理计划账户、管理人作为投资顾问管理的产品账户之间，以及管理人所管理的不同资产管理计划账户之间，不得发生交易，有充分证据证明进行有效隔离并且价格公允的除外。</p> <p>管理人的母公司(南方基金管理股份有限公司)的自营账户、所管理的资产管理计</p>	<p>(三) 关联交易的管控机制</p> <p>本计划所涉关联交易将根据相关法律法规及管理人内控制度要求，经管理人投资部门、风控合规相关部门的审核人员以及部门负责人根据公平交易原则审批，重点关注是否存在利益输送、结构化发行、内幕交易、操纵证券交易价格、违规为管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资等违法违规情形，审批程序完成后方可进行交易。</p> <p>管理人承诺：建立健全关联交易管理制度，对关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序进行规范，不会以本计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场等违反法律法规要求的</p>

<p>划账户以及作为投资顾问管理的产品账户与管理人所管理的资产管理计划账户之间不得发生交易，有充分证据证明进行有效隔离并且价格公允的除外。</p> <p>委托人签署本合同即表明其已经知晓且认可本计划可能进行上述关联交易。除构成重大关联交易外，无需取得资产委托人的个别授权，但应事后通过资产管理计划季度报告和年度报告等方式向委托人进行详尽披露。</p> <p>管理人承诺：建立健全关联交易管理制度，对关联交易认定标准、交易定价方法、交易审批程序进行规范，不会以本计划的资产与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场等违反法律法规要求的行为。</p>	<p>行为。</p>
	<p>增加如下内容：</p> <p><u>（四）特别风险提示</u></p> <p><u>虽然资产管理人积极遵循资产委托人利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍可能因资产管理人运用本计划财产从事重大或一般关联交易被监管部门认为存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响资产委托人的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，资产管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而</u></p>

	<p><u>可能影响参与资金的投资收益。</u></p> <p>1. 重大关联交易的特别风险揭示</p> <p><u>本计划从事本合同约定的重大关联交易时，资产管理人将通过公告、邮件或其他可以书面确认的方式提前取得投资者的同意，因此在资产管理人以公告、邮件或其他可以书面确认的方式通知投资者后，投资者应及时查看本计划的相关公告，并且积极主动表示明确意见，切实行使投资者的相关权利。其次，从事重大关联交易一般涉及金额较大，对本计划财产损益可能产生较大影响，管理人承诺将严格按照相关法律法规及管理人内控制度的要求审批，不对投资者的利益造成损害。</u></p> <p>2. 一般关联交易的特别风险揭示</p> <p><u>管理人以本计划资产从事前述重大关联交易外的其他关联交易为一般关联交易，投资者签署本合同则视为同意本计划在以投资者利益为优先，遵照法律法规的要求进行交易，无需事前再征求投资者意见，但事后应及时充分披露，该等行为不一定能为本计划带来投资回报，由此产生的损益由投资者自行承担。</u></p>
<p>十九、越权交易</p>	
<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、托管人对资产管理人具体投资监督事项以本章约定为准</p> <p>.....</p> <p>(1) 投资范围：</p>	<p>(三) 托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>1、托管人对资产管理人具体投资监督事项以本章约定为准</p> <p>.....</p> <p>(1) 投资范围：</p>

<p>.....</p> <p>3) 商品及金融衍生品资产：股指期货。</p> <p>(2) 本计划的投资比例</p> <p>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%;</p>	<p>.....</p> <p>3) <u>期货和</u>衍生品资产：股指期货。</p> <p>(2) 本计划的投资比例</p> <p>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 <u>期货和</u>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%;</p>
<p>二十四、风险揭示</p>	
<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>.....</p> <p>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。</p> <p>(1) 关联交易风险。</p> <p>.....</p>	<p>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。</p> <p>(1) 关联交易风险。</p> <p>.....</p> <p><u>1) 重大关联交易的特别风险揭示</u></p> <p><u>本计划从事本合同约定的重大关联交易时，资产管理人将通过公告、邮件或其他可以书面确认的方式提前取得投资者的同意，因此在资产管理人以公告、邮件或其他可以书面确认的方式通知投资者后，投资者应及时查看本计划的相关公告，并且积极主动表示明确意见，切实行使投资者的相关权利。其次，从事重大关联交易一般涉及金额较大，对本计划财产损益可能产生较大影响，管理人承诺将严格按照相关法律法规及管理人内控制度的要求审批，不对投资者的利益造成损害。</u></p>

	<p>2) <u>一般关联交易的特别风险揭示</u></p> <p><u>管理人以本计划资产从事前述重大关联交易外的其他关联交易为一般关联交易，投资者签署本合同则视为同意本计划在以投资者利益为优先，遵照法律法规的要求进行交易，无需事前再征求投资者意见，但事后应及时充分披露，该等行为不一定能为本计划带来投资回报，由此产生的损益由投资者自行承担。</u></p>
--	--

除上述列明变更和补充的合同条款外，资产管理合同无其他重大条款的变更。

按照资产管理合同约定，前述条款的变更和补充属于管理人有权自主决定变更合同内容情形中的“因相应的法律法规发生变动而应当对资产管理合同进行变更”。本次变更后的资产管理合同自本公告发出之日起生效。

在本次资产管理合同变更生效后，我司将根据法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的要求及时履行报告义务。

特此公告。



