

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

第二个运作期投资起始日及开放日的说明

由南方资本管理有限公司担任资产管理人的“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”）已于 2022 年 11 月 16 日成立，本计划资产管理合同生效。

根据合同约定，本计划第二个运作期相关日期披露如下：

（1）投资起始运作日指每个运作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，本计划第二个运作期的投资起始日、期初观察日均为 2023 年 6 月 19 日，第二个运作期到期日为 2023 年 12 月 15 日。

（2）第二个运作周期开放日为 2023 年 12 月 15 日，同时开放参与、退出；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 日）至前两个工作日（T-2 日）。

（3）中证 1000 指数在第二个运作周期对应的投资起始日特定时间段（14:00-14:30）的算术平均价为 6699.4483。

（4）本计划投资策略主要是通过投资股指期货，利用期货贴水以及无风险套利的交割机制获取标的指数增强收益。因本计划第二个运作期前至本计划实际投资期间，中证 1000 指数期货基差发生变化，本计划第二个运作周期年化增强收益率将相应调整为 4.5%。

资产管理人特别声明：本计划增强收益率而非预期收益率，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。

