

西南证券日新泽达 2 号集合资产管理计划说明书

(2024 年 10 月版)

特别提示:

本说明书依据《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《运作管理规定》)、《西南证券日新泽达 2 号集合资产管理计划资产管理合同(2024 年 10 月版)》(以下简称《资产管理合同》)及其他有关规定制作,管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

投资者承诺以真实身份参与本集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,并已阅知本说明书和《资产管理合同》全文,了解相关权利、义务和风险,自行承担投资风险和损失。

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。

投资者签订《资产管理合同》且合同生效后,投资者即为《资产管理合同》的投资者,其认购或参与集合计划份额的行为本身即表明其对《资产管理合同》及本说明书的承认和接受。投资者将按照《管理办法》《运作管理规定》《资产管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

名称	西南证券日新泽达 2 号集合资产管理计划
类型	混合类集合资产管理计划
管理人	西南证券股份有限公司 联系人:王寒 住所:重庆市江北区金沙门路 32 号 通讯地址:重庆市江北区金沙门路 32 号 邮政编码:400025 联系电话:023-67603514 邮箱:whan@swsc.com.cn
托管人	中国工商银行股份有限公司重庆市分行 联系人:张典 住所:重庆市南岸区泰昌路 61 号 通讯地址:重庆市南岸区泰昌路 61 号 联系电话:023-63788126 邮箱:zhangdian_yz@cq.icbc.com.cn
投资顾问	无

<p><b>投资范围</b></p>	<p>沪深交易所上市的股票；公募基金；股指期货；债券逆回购、银行存款、同业存单。</p>
<p><b>投资比例</b></p>	<p>以下对各类资产的配置比例均按照穿透原则计算底层资产，资产配置比例如下：</p> <p>（1）固定收益类资产：投资于货币市场基金、债券型基金、债券逆回购、银行存款、同业存单，占资管计划资产总值的比例为 0%-80%（不含）；</p> <p>（2）权益类资产：投资于沪深交易所上市的股票、股票型基金，占资管计划资产总值的比例为 0%-80%（不含）；</p> <p>（3）期货和衍生品类资产：投资于股指期货，持仓合约价值合计低于本计划当日资产总值的 80%（不含），或期货和衍生品账户权益低于资产管理计划总资产的 20%（不含）。</p> <p>（4）本计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算，且应当符合监管规定和资产管理合同的约定。</p>
<p><b>投资策略</b></p>	<p>1、投资决策依据</p> <p>集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。具体决策依据包括：</p> <p>（1）《管理办法》《运作规定》《指导意见》《资产管理合同》《说明书》等有关法律性文件。</p> <p>（2）宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场变化。</p> <p>（3）利率走势与通货膨胀预期，地区及行业基本面变化情况。</p> <p>（4）投资对象收益和风险的配比关系。本集合计划在衡量投资对象投资收益与风险之间的配比关系时，在尽量避免本金损失的前提下，力争为投资者获取较高的收益。</p> <p>2、投资决策程序</p> <p>（1）管理人资产管理决策委员会确定集合计划的设立等重大决策。</p> <p>（2）投资经理负责集合计划的投资</p> <p>投资经理参考研究员的研究，并依据宏观经济、政策走向等的分析，选择具体的投资标的构建投资组合，并根据基本面、市场等的变化，对组</p>

合进行调整和优化。

(3)交易员根据投资经理的投资指令在集合计划专有席位实施投资交易，并根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查。

### 3、投资管理的方法与标准

#### (1) 资产配置策略

集合计划通过定性分析与定量分析，综合分析国内外政治经济环境、政策形势、金融市场走势、行业景气等因素，研判市场时机，结合货币市场、债券市场和股票市场估值等状况，进行资产配置及组合的构建，合理确定集合计划在股票、现金等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态地调整，以降低投资组合的风险、提高收益。

#### (2) 股票投资策略

以价值投资为主线，采用稳定增长和积极增长相结合的配置策略，结合基本面研究与股票价格走势，优选行业内处于领先地位、具有竞争优势、成长性突出以及价值低估的公司进行投资。

#### (3) 固定收益投资策略

重视流动性管理，兼顾收益，主要投资于银行活期存款、国债逆回购、中高等级信用债及利率债对应的公募债券基金，优先选择管理规模排名靠前，具备完善的信评体系的管理人。

#### (4) 股指期货投资策略

集合计划投资股指期货仅限于在市场出现短期下跌风险时，通过股指期货进行风险对冲。

#### (5) 期货保证金的流动性应急处理机制

日常保证金头寸管理与资金调度、划转由专人负责，由投资经理和交易员建立双重复核机制，对保证金进行实时监控。出现异常情况时，投资经理及时进行应急处理。如集合计划保证金低于期货交易所规定的交易保证金水平时，投资经理应立即将部分或全部持仓平仓，直至保证金余额能够维持其剩余头寸。但如果行情变化极快，期货公司就会强平一定数量持仓，使集合计划的保证金达到合理水平。期货公司会就不足部分向管理人

	<p>追索，投资经理及交易员根据头寸的实时监控，及时向期货公司补充保证金。</p>
<p><b>投资限制</b></p>	<p>为维护投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、集合计划持有同一资产的比例（市值）不得超过当日集合计划资产净值的 25%；管理人管理的全部集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。中国证监会认可的投资品种除外；</li> <li>2、集合计划总资产占净资产的比例不超过 140%；</li> <li>3、不得投资于“ST、*ST 类股票”以及最近一期年报中审计意见为“保留意见”、“带强调事项段的无保留意见”、“无法表示意见”和“否定意见”股票；</li> <li>4、集合计划开放退出期内，主动投资于流动性受限资产的市值不超过计划资产净值的 20%，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值不低于集合计划资产净值的 10%；</li> <li>5、集合计划持有股指期货仅用于现货对冲，持有的股指期货空头合约价值，不得超过当日权益类资产净值的 100%；</li> <li>6、申购新股时，申购金额不得超过集合计划资产总额，申购数量不得超过上市公司本次发行总量。</li> </ol> <p>如法律、行政法规或监管部门修改或取消上述限制，经与托管人协商一致且履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>
<p><b>禁止行为</b></p>	<p>资产管理人不得运用本集合计划资产从事如下禁止行为：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；</li> <li>2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</li> <li>3、向投资者做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺；</li> <li>4、挪用集合计划资产；</li> <li>5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；</li> </ol>

	<p>6、接受单一投资者参与资金低于中国证监会规定的最低限额；</p> <p>7、使用集合计划资产进行不必要的交易；</p> <p>8、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；</p> <p>9、直接投资商业银行信贷资产；</p> <p>10、直接或间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域；</p> <p>11、违规为地方政府及其部门提供融资，或要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；开展明股实债投资；</p> <p>12、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。</p>
<p><b>投资风险揭示</b></p>	<p>详见投资者签署的《风险揭示书》</p>
<p><b>收益分配和风险承担安排</b></p>	<p>(一) 收益分配</p> <p>1、收益的构成</p> <p>本集合计划收益指集合计划投资所得红利、买卖证券价差、公允价值变动、银行存款利息及其他合法收入。</p> <p>2、集合计划净收益</p> <p>集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。</p> <p>3、可供分配利润：指截至收益分配基准日集合计划未分配收益。</p> <p>4、分配原则</p> <p>(1) 每一集合计划份额享有同等收益分配权；</p> <p>(2) 收益分配基准日的份额净值减去每单位集合计划份额收益分配金额后不能低于面值；</p> <p>(3) 管理人可根据产品运作情况在产品开放日进行分红，具体分配时间见管理人公告，收益分配频率不超过每6个月一次；</p> <p>(4) 收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担；</p> <p>(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p> <p>5、收益分配方案的确定与通知</p> <p>收益分配方案由管理人拟定，按照与托管行约定的方式经托管人复核后确定。管理人应在分红后5个工作日内公告当次收益分配方案。</p> <p>6、收益分配的执行方式</p> <p>本集合计划可以采用红利再投资和现金分红两种收益分配方式，若投</p>

	<p>投资者不选择，本集合计划默认的收益分配方式是红利再投资。</p> <p>若投资者选择现金分红，管理人自分红权益登记日起 5 个工作日内将分配的收益从托管户划出。</p> <p>现金分红形成的集合计划份额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入集合计划资产的损益。</p> <p>(二) 风险承担</p> <p>管理人、托管人不对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，投资者投资于本计划将自行承担投资风险。</p>
<p><b>管理费</b></p>	<p>一、管理费</p> <p>本集合计划的管理费按前一自然日集合计划的资产净值计提，管理费的年费率为【1】%。计算方法如下：</p> $H=E*【1】\%/365$ <p>H 为每日应计提的集合计划管理费</p> <p>E 为前一自然日集合计划资产净值</p> <p>集合计划管理费自计划成立日起于每个自然日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由管理人于本集合计划成立后的每自然季度的次季度首日起 5 个工作日内向托管人出具划款指令，托管人依据管理人划款指令从集合计划资产中扣划管理费一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>资产管理人指定收取管理费的银行账户为：</p> <p>户名：【西南证券股份有限公司】</p> <p>开户行：【中国建设银行股份有限公司重庆市分行营业部】</p> <p>账号：【50001333600050003872】</p> <p>二、业绩报酬</p> <p>1、管理人收取业绩报酬的原则</p> <p>(1) 同一投资者不同时间多次参与本集合计划份额的，对投资者每次参与的份额分别计算应当计提的业绩报酬。</p> <p>(2) 业绩报酬提取频率不超过 6 个月一次，但因投资者退出本集合计划或本集合计划终止情形的除外。</p> <p>在分红权益登记日、投资者退出日或集合计划清算终止时，管理人对</p>

符合业绩报酬提取条件的份额提取业绩报酬。

(3)在分红权益登记日提取业绩报酬的,业绩报酬从分红金额中扣除;在投资者退出或集合计划清算终止时提取业绩报酬的,业绩报酬从退出资金中扣除。

## 2、业绩报酬的计提方法

在分红权益登记日、投资者退出日或集合计划清算终止日,如集合计划年化收益率 R 超过【10】%/年的,管理人提取超额收益的 20%作为业绩报酬。

年化收益率 R 的计算公式为:

$$R=(A-B)/C/D\times 365\times 100\%$$

管理人计提的业绩报酬 H 的计算公式为:

$$H=\text{MAX}【R-【10】\%, 0】\times C\times D/365\times M\times 20\%$$

其中:

A 为业绩报酬提取日的累计单位净值;

B 为上一业绩报酬提取日(若无上一业绩报酬提取日的,则为集合计划成立日或投资者该笔份额申购日)的累计单位净值;

C 为上一业绩报酬提取日(若无上一业绩报酬提取日的,则为集合计划成立日或投资者该笔份额申购日)的单位净值;

D 为投资者所持有的每笔份额上一业绩报酬提取日(不含)(若无上一业绩报酬提取日的,则为集合计划成立日(含)或投资者该笔份额申购日(不含))到本次业绩报酬提取日(含)的实际天数;

M 为计提业绩报酬的份额数。

管理人对于业绩报酬计算结果四舍五入保留至小数点后两位,因四舍五入产生的差额由集合计划承担。

## 3、业绩报酬的支付

在业绩报酬计提后,托管人根据管理人的指令完成业绩报酬的划拨支付。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。业绩报酬一经计提,不得转回。

业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。业绩报酬收取账户为本合

	<p>同约定的资产管理人管理费收取账户。</p> <p>4、业绩报酬计提基准不是管理人向全体投资者保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺，集合计划份额也可能出现本金或收益的损失。</p>
<p>托管费</p>	<p>本集合计划托管人托管费按前一自然日集合计划资产净值的【0.02】%年费率（含税）计提，计算方法如下：</p> $H = E * 【0.02】\% / 365$ <p>H 为每日应计提的托管费；</p> <p>E 为前一自然日集合计划资产净值。</p> <p>集合计划托管费自计划成立日起于每个自然日计提，逐日累计至每季度末，按季支付。由管理人于本集合计划成立后的每自然季度的次季度首日起 5 个工作日内向托管人出具划款指令，托管人依据管理人划款指令从集合计划资产中扣划托管费一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>托管人指定收取托管费的银行账户为：</p> <p>户名：【资产托管业务手续费收入】</p> <p>开户行：【工行重庆市分行业务处理中心】</p> <p>账号：【3100020511200068142】</p> <p>大额支付号：【/】</p>
<p>其他费用</p>	<p>1、集合计划财产开立账户需要支付的费用、资金结算汇划费（含赎回划款手续费）、账户管理与维护费、网银开户相关费用等；</p> <p>2、集合计划财产的证券、期货（如有）等账户的开户费用以及证券、期货（如有）等投资交易费用（包括但不限于本集合计划所有金融工具的交易费、工商登记及变更费用（如有）、经手费、印花税、过户费、手续费、经纪商佣金等类似性质的费用）；</p> <p>3、注册登记费、电子合同费（如有）；</p> <p>4、本集合计划存续期间发生的信息披露费用、受托财产投资运作相关的或者为维护投资者利益支出的的会计师费、审计费、律师费、仲裁费、诉讼费、保全费等合理费用；</p> <p>5、按照法律法规及本合同的约定可以在受托财产中列支的其他费用。</p> <p>上述费用由托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际</p>

	<p>支出金额支付，列入当期计划费用。本集合计划投资运作期间发生的交易手续费、印花税等有关税费，作为交易成本在交易过程中直接列支。</p> <p>法律法规另有规定时从其规定，由托管人根据管理人划款指令按费用实际支出金额支付，列入当期集合计划费用。</p>
不列入集合计划费用的项目	<p>集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与销售有关的费用（如销售服务费、投资者维护费等），不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入集合计划费用。</p>
税收	<p>根据财政部、国家税务总局发布的《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》（财税[2016]140号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2号）、《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56号）以及《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》（财税[2017]90号）等文件的相关规定：自2018年1月1日起，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。前述税费由本计划受托财产承担，管理人将按相关法规和税务机关的规定计算和缴纳。投资者知悉因本计划所适用的税收征管法律法规及执行要求可能会因国家相关税收政策变化或管理人主管税务机关指导意见调整而发生改变。</p>
参与费、退出费	<p>本集合计划不收取参与费及退出费</p>
投资者权利和义务	<p>1、投资者的权利，包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>（1）分享资产管理计划财产收益；</li> <li>（2）取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；</li> <li>（3）按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；</li> <li>（4）按照本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；</li> <li>（5）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</li> <li>（6）法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。</li> </ol> <p>2、投资者的义务，包括但不限于：</p>

- (1) 认真阅读并遵守资产管理合同，保证投资资金的来源及用途合法；
- (2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；
- (3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；
- (4) 认真阅读并签署风险揭示书；
- (5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费（含业绩报酬（如有））、托管费、审计费、税费等合理费用；
- (6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；
- (7) 按照规定向管理人或资产管理计划销售机构提供信息资料及身份证明文件，配合管理人或者其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作，并确保提供的信息是真实、有效和完整的。如上述资料、信息发生变更时，及时向管理人提供变更后的证明资料。对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的投资者，接受管理人或托管人将按照反洗钱监管规定采取的必要管控措施或单方面终止合同；
- (8) 不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；
- (9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；
- (10) 不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；
- (11) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向、投资信息等，依法依规提供信息的除外；
- (12) 按本合同约定承担集合计划可能的投资损失；
- (13) 投资者转让集合计划份额应事先取得管理人的同意，不得违规转让其所拥有的集合计划份额（法律法规另有规定的除外）；
- (14) 保证其所做出的全部声明、保证与承诺在投资本集合计划存续期间持续有效，如相关情况出现变化需及时告知管理人，管理人有权根据

	<p>法律法规、监管规定、自律规则做出相关处理，投资者将予以配合并承担相关后果和损失；</p> <p>(15) 法律、行政法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。</p>
<p>募集期间</p>	<p>具体募集期间以管理人的募集公告为准，管理人有权根据本集合计划销售的实际情况提前结束或延长募集期，但募集期自本集合计划份额发售之日起最长不超过 60 个自然日。募集期限调整将通过管理人网站公告方式及时通知销售机构、托管人和投资者，集合计划募集结束后不再接受认购申请。</p>
<p>信息披露的内容、方式、频率</p>	<p>(一) 定期报告</p> <p>定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、年度审计报告。</p> <p>1、集合计划单位净值报告</p> <p>披露时间：管理人每个工作日通过管理人网站（www.swsc.com.cn）披露经过托管人复核的 T-2 个工作日的集合计划单位净值、集合计划累计单位净值。</p> <p>披露方式：本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》《运作规定》本合同及其他有关规定进行。本集合计划的计划单位净值、计划累计单位净值等信息将在管理人指定网站上披露，投资者可随时查阅。若管理人指定网站变更，管理人将提前进行相关信息的详细披露。</p> <p>管理人披露的计划份额净值并不代表投资者所能够即时获得的现金等财产金额，也不代表将来在财产分配时所能获得的分配金额，份额净值的估值及披露受限于资产管理合同约定的假设、方法及时效，不构成管理人或托管人对投资者受托财产本金、收益的任何保证或承诺。管理人披露资产管理计划净值应当经托管人复核。</p> <p>相关法律法规对信息披露有新规定的，本集合计划的信息披露也将按照新规定执行。</p> <p>2、集合计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人在每季度向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划季度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明，包括但不限于下列信息：</p> <p>(1) 管理人履职报告；</p>

- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- (7) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (8) 资产管理计划参与股指期货交易的有关情况，包括交易目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的交易目的；
- (9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

上述报告应于每季度截止日后 1 个月内通过管理人网站公告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制当期的季度报告。本计划当期已经完成终止清算的，无需出具当期的季度报告。

### 3、集合计划的资产管理年度报告

管理人在每年度分别向投资者提供一次准确、完整的资产管理计划年度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明，包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 资产管理计划参与股指期货交易的有关情况，包括交易目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的交易目的；
- (10) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (11) 中国证监会规定的其他事项。

	<p>上述报告应于每个会计年度截止日后 4 个月内通过管理人网站通告。集合计划成立不足 3 个月或者存续期间不足 3 个月的，管理人可以不编制当期的年度报告。本计划当期已经完成终止清算的，无需出具当期的年度报告。</p> <p>4、年度审计报告</p> <p>管理人应当符合《证券法》规定的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向投资者提供。</p> <p>(二) 临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以网站公告方式在事项发生之日起五日内向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、发生巨额退出或连续巨额退出并延期支付；</li> <li>2、集合计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的；</li> <li>3、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</li> <li>4、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</li> <li>5、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</li> <li>6、资产计价出现错误（当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误）；</li> <li>7、其他发生对集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件。</li> <li>8、其他管理人认为的重大事项。</li> </ol> <p>(三) 其他事项</p> <p>管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。</p> <p>(四) 向监管机构提供的报告</p> <p>管理人、托管人应当根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求履行报告义务。</p>
<p>利益冲突及关联交易</p>	<p>(一) 存在或可能存在利益冲突的情形</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、管理人运用集合计划财产从事一般关联交易或重大关联交易；</li> <li>2、管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；</li> </ol>

3、管理人在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作；

4、其他可能产生利益冲突的情况。

#### （二）资管计划关联方

资管计划关联方为本计划的管理人、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。

资管计划关联方名单详见附件 2，后续以管理人的定期公告为准。托管人关联方名单以托管人对外发布的半年报、年报信息为准。因托管人未及时对外发布导致管理人信息披露不准确、不及时，管理人不承担责任。

#### （三）关联交易情形

1、本计划投资于资管计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；

2、本计划接受资管计划关联方发行或承销期内承销的证券作为质押券与交易对手开展逆回购交易；

3、本计划与资管计划关联方作为交易对手发生交易；

4、本计划投资管理人及其关联方管理的其他资产管理产品。

其中第 1 项为重大关联交易，第 2、3、4 项为一般关联交易。

#### （四）利益冲突及关联交易内部控制机制

1、管理人建立健全内部控制机制，采取有效隔离措施，防范管理人与投资者之间、不同投资者之间的利益冲突。管理人将其证券经纪业务、证券承销业务、证券自营业务和证券资产管理业务分开办理，不得混合操作。

管理人资产管理业务建立健全内部控制制度，采取有效措施，将资产管理业务与其他业务分开管理，不同投资经理管理的资产管理计划的持仓和交易等重大非公开投资信息相隔离，控制敏感信息的不当流动和使用，防范内幕交易、利用未公开信息交易、利益冲突和利益输送。

当公司利益和投资者利益发生冲突时，应以投资者利益为重；当不同投资者利益发生冲突时，应公平的对待不同的投资者；严禁直接或者间接安排在不同投资组合之间进行利益输送。

2、管理人运用受托管理资产从事关联交易的，在遵循投资者利益优先原则和符合合同约定的投资目标及策略的前提下，管理人根据实际投资需要，按照资管计划关联方名单谨慎开展关联交易。

管理人建立关联交易管理制度，对关联交易操作、信息披露等环节进行有效管控。在投资方面，投资经理应对投资标的进行审慎评估，按照所投标的是否具备公允价值进行分类，分别提交资产管理决策机构或授权机构审批。

管理人运用受托管理资产从事关联交易的，应确认已按照本合同约定事先征得投资者的同意，事后须按照合同约定进行相关披露。

(五) 存在利益冲突的处理方式、披露方式、内容及频率

投资者在此对上述列举的存在的或可能存在的利益冲突情形表示知悉，资产管理计划投资者不得因本计划投资收益劣于管理人及其关联方管理的其他类似投资产品，而向管理人或托管人提出任何损失或损害补偿的要求。

1、管理人运用本计划资产进行前述关联交易，需要遵循投资者利益优先的原则、防范利益冲突。

资产管理计划投资者签署本合同即表明其已经充分理解并同意本计划从事前述的一般关联交易，管理人无需就具体的一般关联交易分别取得投资者的个别授权，但该种投资行为应按照市场通行的方式和条件参与。管理人运用受托资产从事一般关联交易的，应遵循投资者利益优先的原则，事后管理人应在定期报告中全面、客观的向投资者和托管人进行披露，并按要求及时向中国证监会相关派出机构报告。

管理人运用受托资产从事重大关联交易的，管理人应通过事先公告等方式逐笔取得投资者同意。投资者如未在公告载明的回复截止日按指定的形式回复意见或回复意见不明确的，视为同意本计划从事上述重大关联交易。

投资者不同意管理人进行重大关联交易的，管理人保障其退出集合计划的权利。管理人应当于征求意见期满后安排最近一个开放期，供不同意的投资者退出本计划。对于明确答复不同意但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人将统一在开放期次一工作日做强制退出处理（退出价格为退出当日的计划单位净值）。

重大关联交易发生之日起五日内，管理人通过临时报告形式向托管人和投资者进行告知，并及时向中国证监会相关派出机构报告。

2、投资者充分知悉并理解，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理受托财产、公平对待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能仍会存在一些利益冲突情形。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

	3、若管理人涉及相关利益冲突情形的，管理人应严格遵守法律、行政法规和中国证监会的规定以及本合同的约定，并及时履行相应的信息披露义务。
特别说明	本说明书作为《资产管理合同》的重要组成部分，与《资产管理合同》具有同等法律效力。

# 西南证券日新泽达2号集合管理计划

## 风险揭示书

(2024年10月版)

尊敬的投资者：

投资有风险。当您/贵机构参与资产管理计划时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您/贵机构在做出投资决策之前，请仔细阅读本风险揭示书和《西南证券日新泽达2号集合资产管理计划资产管理合同（2024年10月版）》（以下简称《资产管理合同》）等文件，充分认识本计划的风险收益特征和产品特性，认真考虑资产管理计划存在的各项风险因素，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断并谨慎做出投资决策。

本计划属于R4（中高风险）风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力C4（积极型）及以上等级的合格投资者。根据有关法律法规，资产管理人[西南证券股份有限公司]及投资者分别作出如下承诺、风险揭示及声明：

### 一、资产管理人声明与承诺

（一）管理人向投资者声明，中国证券投资基金业协会（以下简称协会）办理资产管理计划备案不作为对资产管理计划财产安全和投资者收益的保证，也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。

（二）管理人保证在投资者签署资产管理合同前已（或者已委托销售机构）向投资者揭示了相关风险；已经了解投资者的风险偏好、风险认知能力和风险承受能力。

（三）管理人承诺按照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用资产管理计划财产，不保证资产管理计划财产一定盈利，也不保证最低收益。

### 二、风险揭示

管理人在管理、运用或处分财产过程中，资产管理计划可能面临包括但不限于以下风险：

#### （一）特殊风险揭示

##### 1、资产管理合同与合同指引不一致风险

《资产管理合同》是基于协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同指

西南  
骑

引》而制定的，《资产管理合同》虽已在能够满足本计划投资需要的前提下涵盖了合同指引明确要求的条款，但合同指引主要为概括性、原则性约定，《资产管理合同》具体条款约定不可避免的比合同指引更为复杂具体，也不可避免与合同指引不完全相同。管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整，导致资产管理合同与合同指引不完全一致的风险。

## 2、集合计划委托募集风险

管理人可以委托具有公开募集证券投资基金销售资格的机构募集本计划，虽然管理人通过签署相关协议与销售机构进行权利义务的划分，但仍可能存在因销售机构自身违法违规行为、违反《资产管理合同》约定的操作、技术系统故障或操作差错等非管理人的原因而导致本计划投资者合法权益受损的风险。

## 3、募集失败所涉风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

管理人的责任承担方式：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内退还投资者已交纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

## 4、未在协会完成备案手续所涉风险

本计划成立后管理人应当根据有关规定及资产管理合同的约定向协会办理本计划备案手续，本计划在协会备案完成前无法进行投资操作，仅可进行现金管理。若因任何原因导致本计划无法完成备案的，管理人应当及时通过管理人网站公告方式告知投资者，并按照资产管理合同约定履行终止清算程序。本计划募集失败或提前终止情况下，投资者的投资目标无法实现。

备案中协会可能要求管理人对资产管理合同进行变更，管理人将按照资产管理合同约定的变更程序变更资产管理合同，资产管理合同变更履行相关程序需要一定时间，将影响本计划及时完成备案，进而影响本计划及时开展投资，如资产管理合同最终无法完成变更从而最终无法完成备案的，本计划提前终止。

## 5、份额转让所涉风险

在监管法规及技术措施允许的情况下，集合计划存续期间，投资者可以通过证券交易所及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的集合计划份额。集合计划份额转让可能不具有一个活跃的转让市场，且交易平台可能根据需要暂停或终止转让服务。投资者可能面临份额无法转让或转让失败的风险。

## 6、利益冲突及关联交易的风险

投资者知悉，管理人可以根据资产管理合同约定的程序和方式运用资产管理计划资产从事一般关联交易、重大关联交易（以下统称关联交易），管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行。

投资者知悉，尽管管理人承诺谨慎勤勉地管理资产管理计划财产、公平对

待各投资组合，本计划在投资和运作过程中可能还会存在一些其他的利益冲突情形，包括但不限于：管理人管理的其他资管产品（包括本计划投资经理管理的其他资管产品）基于各自投资策略需要可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后；管理人在遵循法律法规和相关原则的前提下运用自有资金进行证券投资，该等投资也可能与本计划存在相同、相似或相反的投资交易行为，或者在买卖同一只证券的时间上存在先后，不排除可能影响或限制本计划的投资运作等。该等利益冲突可能会不利于本计划，也可能使本计划在投资运作时暂时受限，进而可能会影响收益甚至发生损失等。投资者认可此等情形的存在并自愿承担相关投资风险。

此外，管理人运用资产管理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，进而可能影响资产管理计划财产的投资收益。管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据资产管理合同的约定参与关联交易，尽管管理人确认将确保该等交易安排合法合规、不存在利益输送等违法违规行为，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险。

除了上述风险以外，一般关联交易、重大关联交易还分别存在以下风险：

#### （1）一般关联交易风险

管理人根据实际投资需求，可能运用资产管理计划财产接受资管计划关联方发行或承销期内承销的证券作为质押券与交易对手开展逆回购交易；或者与资管计划关联方作为交易对手发生交易；或者投资管理人及其关联方成立的其他资产管理产品。对于资产管理计划涉及的一般关联交易事项，管理人可以根据资产管理合同的约定与投资者的授权以资产管理计划财产从事一般关联交易，管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得投资者授权，因此投资者承担管理人未经投资者另行同意直接开展一般关联交易的风险。

#### （2）重大关联交易风险

管理人根据实际投资需求，可能运用资产管理计划财产投资于资管计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。对于资产管理计划涉及的重大关联交易事项，为保护投资者权益，管理人应当根据资产管理合同的约定提前取得投资者同意，但投资者仍然面临关联交易可能造成的风险。

投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。

管理人承诺关联交易应按照市场通行的方式和条件进行，投资者认可此等关联交易情形的存在并自愿承担相关投资风险。

#### 7、业绩报酬计提基准调整的风险（如有）

本计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，不构成管理人保证计划财产本金不受损失或取得最低收益的承诺。本计划业绩报酬计提基准发生变更时由管理人通过公告形式告知投资者及托管人。业绩报酬计提基准的变化，可能对投资者的利益产生不利影响。

#### （二）一般风险揭示

### 1、本金损失风险

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，但不保证资产管理计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

### 2、市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险等。

#### （1）政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

#### （2）经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

#### （3）利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

#### （4）购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

#### （5）再投资风险

投资者将从本资产管理计划中获得的收益进行再次投资的情况，因以上所述风险的发生，而导致投资者再投资资产出现亏损的风险。

#### （6）衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

### 3、管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。

### 4、流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的风险。

### 5、信用风险

因债务人、交易对手或持仓金融头寸的发行人未能按时履约或者信用资质恶化，给资产管理计划带来损失的风险。

## 6、税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

## 7、技术风险

在集合计划资产管理业务的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等等。

## 8、操作风险

管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或操作规程不完善而引起的风险。

## 9、参与申请失败的风险

因本集合计划对参与人数进行控制，如果募集期或开放期内某日可能出现参与人数超过 200 人的情况，则管理人根据投资者申请单按时间优先原则进行排序，再对排序后的申请单进行逐笔金额确认，直到累计参与投资者数达到 200 人。超过目标规模上限的其他投资者参与申请将不被确认。如果确认某单笔参与申请将导致参与人数超限，则该单笔参与申请将全额不被确认。另外，由于投资者自身原因导致资金未到账或资金不到参与下限也将造成参与申请不被确认。投资者参与申请存在失败的风险。

10、管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责的风险。

管理人因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能导致受托资产的损失，从而带来风险。

### （三）本集合计划的特有风险揭示

#### 1、电子签名合同风险

本集合计划可以采取电子签名的方式签署电子合同，可以通过网上交易系统进行认购，因此存在互联网安全、操作失误等风险。

#### 2、封闭期、锁定期无法退出的风险

集合计划每周二、周五开放，允许投资者退出。除开放期外，均为封闭期。投资者存在封闭期内无法退出的风险。

集合计划设有份额锁定期，每笔份额参与后，需满足 180 个自然日份额锁定期，方可在产品开放期退出。180 个自然日份额锁定期内，该笔份额不可办理退出。投资者存在锁定期内无法退出的风险。

如果资产管理合同变更或监管规则修订，为保障投资者退出集合计划的权利，管理人可公告临时开放期或指定开放期，投资者可在临时开放期或指定开放期退出集合计划（但不得参与集合计划），投资者持有份额即使未达到份额锁定期限也可在指定开放期或临时开放期退出本计划。

#### 3、期货投资风险

本计划可参与股指期货交易，股指期货是具有高杠杆特征的衍生金融工具。

尽管管理人将以风险管理为目的，审慎投资，仍可能存在股指期货市场价格的不利变动对本计划资产净值产生重大不利影响。

(1) 管理人以本计划的名义在期货市场进行交易时，假如市场走势对本计划财产不利导致本计划财产的期货保证金账户保证金不足时，期货经纪商会按照期货经纪合同约定的时间和方式通知管理人追加保证金，以使本计划财产继续持有未平仓合约。如管理人未于规定时间内存入所需保证金，本计划财产持有的未平仓合约将可能在亏损的情况下被强行平仓，本计划财产承担由此导致的损失。

(2) 管理人应当了解、知悉并遵守期货交易所和期货经纪商的业务规则，如果管理人对本计划持有的合约持仓无法满足期货交易所和期货经纪商业务规则规定的要求，则本计划财产所持有的未平仓合约将可能根据有关规则被强行平仓，本计划财产承担由此导致的损失。

(3) 在某些市场情况下，管理人可能会难以或无法将持有的未平仓合约平仓。例如，这种情况可能在市场达到涨跌停板时出现。出现这类情况，期货保证金账户的所有保证金有可能无法弥补全部损失，本计划财产承担由此导致的损失。

(4) 由于国家法律、法规、政策的变化、期货交易所交易规则的修改、紧急措施的出台等原因，本计划财产持有的未平仓合约可能无法继续持有，本计划财产承担由此导致的损失。

(5) 由于非期货交易所或者期货经纪商所能控制的原因，例如：地震、水灾、火灾等不可抗力因素或者计算机系统、通讯系统故障甚至瘫痪、被网络黑客或计算机病毒攻击等，互联网数据传输可能因通信繁忙等原因出现延迟、中断、数据错误或不完整等情况，可能造成管理人的指令无法成交或者无法全部成交，本计划财产承担由此导致的损失。

(6) 在国内期货交易中，所有的交易结果须以当日交易所或结算机构的结算数据为依据。如果管理人利用盘中即时回报的交易结果作进一步的交易，本计划财产可能会承担额外的风险。

(7) 管理人可能对持有的股指期货合约持有至到期并进行交割，管理人作为股指期货的买方参与交割时，股指期货的卖方具有“交割选择权”，即股指期货的卖方有权选择将何种可交割国债交付买方的权利，管理人对股指期货多头合约进行交割时，可能获得对本计划财产不利的可交割标的并导致本计划财产在一定程度上遭受损失。

(8) 根据行业惯例，本计划的期货经纪商对本计划财产存放于期货保证金账户内的保证金不支付利息，如果管理人将过多闲置资金存放于期货保证金账户，本计划财产存放于期货保证金账户的资金将丧失正常的利息收入。

#### 4、止损线风控措施的风险

本集合计划止损线为累计单位净值【0.7000】元。本集合计划存续期间内任何一个工作日(T日)，如果日终集合计划累计单位净值不高于止损线的，自

T+1 日起管理人有权对集合计划持有的非现金类资产进行不可逆变现，并在 T+2 日内发布公告告知客户产品止损事宜。将可变现资产全部变现后本集合计划终止。

决定是否执行止损是管理人的权利而非义务，管理人有权决定在日终集合计划累计单位净值不高于止损线时止损，也有权决定在上述情况下继续运作本集合计划。

管理人根据上述情况进行止损操作，但止损操作的执行效果与所持有品种的流动性及止损时所处的市场环境等因素有关，即可能出现止损不能及时完成，本计划净值进一步下跌的可能，也可能出现因流动性等原因，止损价格不理想导致本集合计划财产损失（份额净值下跌）的可能性。

本集合计划止损线以累计单位净值为准，若集合计划在存续期间进行收益分配，收益分配后新认购集合计划的份额，将面临集合计划止损线因收益分配而下降的风险。

#### （四）不可抗力因素导致的风险

指遭受不可抗力事件一方不能预见，不能避免，不能克服的客观情况，包括但不限于政府干预，国家或者地方政策调整、社会安全事件、洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化或其他突发事件、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等。

#### （五）其他风险

1、金融市场危机、行业竞争、托管银行违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划投资者利益受损。

2、突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划投资者利益受损。

其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- （1）集合计划终止时，证券资产无法变现的情形；
- （2）相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；
- （3）交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；
- （4）无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

3、包括因业务竞争压力可能产生的风险；管理人、托管人被提起诉讼或业务活动违反法律或行政法规，可能承担行政责任或者赔偿责任，有可能导致受托财产损失的风险。

西南证券股份有限公司在此向您温馨提示：警惕洗钱陷阱，保护自身利益，请不要随意出借身份证件及个人账户供他人使用；请如实填写身份信息，配合金融机构工作人员开展客户尽职调查。

### 三、投资者声明与承诺

作为本计划的投资者，本人/机构已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，自愿自行承担投资该计划所面临的风险。本人/机构作出以下陈述和声明，并确认（自然人投资者在每段段尾“【\_\_\_\_\_】”内签名，机构投资者在本页、尾页盖章，加盖骑缝章）其内容的真实和正确：

1、本人/机构已仔细阅读资产管理业务相关法律文件和其他文件，充分理解相关权利、义务、本计划运作方式及风险收益特征，愿意承担由上述风险引致的一切全部后果。【\_\_\_\_\_】

2、本人/机构知晓，资产管理人、销售机构、资产托管人及相关机构不应当对资产管理计划财产的收益状况作出任何承诺或担保。【\_\_\_\_\_】

3、本人/机构符合《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》有关合格投资者的要求，并已按照管理人或销售机构的要求提供相关证明文件。【\_\_\_\_\_】

4、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【\_\_\_\_\_】

5、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第四章“当事人及权利义务”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【\_\_\_\_\_】

6、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第十一章“资产管理计划的投资”的所有内容，并愿意自行承担购买资产管理计划的法律责任。【\_\_\_\_\_】

7、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十章“资产管理计划的费用与税收”中的所有内容。【\_\_\_\_\_】

8、本人/机构已认真阅读并完全理解资产管理合同第二十六章“争议的处理”中的所有内容。【\_\_\_\_\_】

9、本人/机构已经配合资产管理人或其销售机构提供了法律法规规定的信息资料及身份证明文件，以配合上述机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查以及反洗钱等监管规定的工作。

本人/机构承诺上述信息资料及身份证明文件真实、准确、完整、有效。

【\_\_\_\_\_】

10、本人/机构知晓，中国证券投资基金业协会为资产管理计划办理备案不构成对资产管理人投资能力、持续合规情况的认可；不作为对资产管理计划财产安全的保证。【\_\_\_\_\_】

11、本人/机构承诺本次投资行为是为本人/机构购买（参与）资产管理计划。【\_\_\_\_\_】

12、本人/机构承诺不以非法拆分转让为目的购买资产管理计划，不会突破合格投资者标准，将资产管理计划份额或其收益权进行非法拆分转让。【\_\_\_\_\_】

13、本人/机构知悉本风险揭示书的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与资产管理计划所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。【\_\_\_\_\_】

【(本页无正文)为《西南证券日新泽达2号集合管理计划风险揭示书(2024年10月版)》签署页】

投资者(自然人签字或机构盖章):

日期:

资产管理人:西南证券股份有限公司(盖章)

日期:

销售机构经办人(签字):

日期:

