

方正证券量化鑫利 12 号集合资产管理计划

第 2 个投资运作期运作要素公告

根据《方正证券量化鑫利 12 号集合资产管理计划资产管理合同》中的约定，现向投资者披露本集合计划的第 2 个运作期起始运作具体要素情况：

1、挂钩标的：中证 1000 指数

2、第 2 个投资运作期投资起始运作日：2026 年 2 月 6 日

3、中证 1000 指数（代码：000852.SH）在投资运作起始日的收盘价：8051.57

4、第 2 个投资运作期：24 个月，可提前终止

5、第 2 个投资运作期提前终止条件：在每个投资运作期内的指定日，本计划挂钩标的收盘价达到或超过本计划该投资运作期投资运作起始日挂钩标的收盘价的 103%。

指定日为该投资运作期投资运作起始日起满 3 个月的对日（若为非交易日，则顺延至下一个交易日）以及此后每月对日（若为非交易日，则顺延至下一个交易日），指定日的次一交易日为赎回开放日（若为指定日因非节假日顺延，则赎回开放日相应顺延至下一个交易日）。

第 3 个投资运作期内的具体指定日、对应赎回日具体如下：

编号	指定日	对应赎回日
指定日 1	2026/05/06	2026/05/07
指定日 2	2026/06/08	2026/06/09
指定日 3	2026/07/06	2026/07/07
指定日 4	2026/08/06	2026/08/07
指定日 5	2026/09/07	2026/09/08
指定日 6	2026/10/08	2026/10/09
指定日 7	2026/11/06	2026/11/09
指定日 8	2026/12/07	2026/12/08
指定日 9	2027/01/06	2027/01/07
指定日 10	2027/02/12	2027/02/15
指定日 11	2027/03/08	2027/03/09
指定日 12	2027/04/06	2027/04/07
指定日 13	2027/05/06	2027/05/07
指定日 14	2027/06/07	2027/06/08
指定日 15	2027/07/06	2027/07/07
指定日 16	2027/08/06	2027/08/09
指定日 17	2027/09/06	2027/09/07
指定日 18	2027/10/08	2027/10/11
指定日 19	2027/11/08	2027/11/09
指定日 20	2027/12/06	2027/12/07



指定日 21	2028/01/06	2028/01/07
指定日 22	2028/02/07	2028/02/08

特别提示：

1、表格中列示的指定日及对应赎回日仅适用于第 2 个投资运作期内。若第 2 个投资运作期触发提前终止条件，则前述指定观察安排及对应赎回日不再适用。

2、因 2027 年及 2028 年国家假日安排尚未公布，故本公告所列指定日及对应赎回日仅供参考，如后续国家假期安排导致沪深交易所调整交易日安排的，管理人有权直接根据资管合同的相关约定对前述指定日及赎回日进行调整且不再重新公告。

特此公告。

方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司

