**嘉合鑫源量化对冲一号资产管理计划要素表**

|  |  |  |
| --- | --- | --- |
| **产品名称** | | 嘉合鑫源量化对冲一号资产管理计划 |
| **产品类型** | | 基金管理公司特定客户资产管理计划 |
| **管理人** | | 嘉合基金管理有限公司 |
| **托管人** | | 招商银行股份有限公司XX分行 |
| **推广机构** | | 优先级份额：公司直销、招商银行股份有限公司代销  进取级份额：公司直销 |
| **投资目标** | | 在控制市场风险暴露的前提下，运用股指期货等各种金融工具力争为投资人创造较高的收益。 |
| **投资策略** | | 本资产管理计划的投资策略包括股指期现对冲策略、股指期货投资策略、股票投资策略、固定收益证券投资策略等。 |
| **投资范围** | | 股票（包括在创业板上市的股票及上市公司非公开发行股票）、股指期货、权证、证券投资基金、集合资产管理计划、固定收益品种（包括债券逆回购、货币市场基金、银行存款等）、现金。 |
| **资产配置比例** | | （1） 股指期货、权证及其他金融衍生品：0%～90%；  （2） 股票、证券投资基金、固定收益品种：0%～90%；  （3） 现金、银行存款：0%～100%。 |
| **产品分级**  **及收益分配** | | 本资产管理计划优先级份额和进取级份额之比不超过4:1。本计划中进取级份额以其所持的份额资产为限承担亏损。  优先级约定收益为6.5%。  优先级份额与进取级份额收益分配占比如下：  假设本计划自运作起始日满1年时，扣除业绩报酬（如有）后的收益率为X，那么  0%<X≤6.5%，优先级份额收益为6.5%，进取级份额承担补偿责任；  6.5%<X，优先级份额收益为6.5%，进取级份额享受超过6.5%的收益；  如  X=0%时，优先级份额收益率为6.5%，进取级份额收益率为-26%  X=5%时，优先级份额收益率为6.5%，进取级份额收益率为-1%  X=6.5%时，优先级份额收益率为6.5%，进取级份额收益率为6.5%  X=10%时，优先级份额收益率为6.5%，进取级份额收益率为24%。 |
| **产品风险**  **控制措施** | | 预警线：单位净值=0.87元。  如计划单位净值于T日收盘后跌破预警线0.87元，本计划立即开始变现所持有的非现金资产，使所持有的非现金资产比例不高于本计划资产总值的50%，直至计划单位净值恢复至不低于0.87元为止。  止损平仓线：单位净值=0.85元。  如计划单位净值于T日收盘后跌破止损线，即低于（含）0.85元时，本计划持有的全部风险资产按市价变现，直至计划单位净值恢复至不低于0.85元为止。 |
| **最低参与金额** | | 100万元起 |
| **产品规模** | | 2.5亿 |
| **产品期限** | | 本计划存续期为1年。 |
| **封闭期与开放期** | | 全程封闭，不接受期间参与退出及违约退出 |
| **产**  **品**  **费**  **率** | **销售服务费** | 优先级份额0.4% /年，直销客户不收取销售服务费（待定） |
| **管理费** | 1.00% /年，按日计提，按季支付。（待定） |
| **托管费** | 0.15% /年，按日计提，按季支付。（待定） |
| **业绩提成** | 对超出8%的部分收取20％的业绩报酬（待定） |
| **产品特点** | | 1. **有效对冲风险，获取绝对收益：**产品应用量化策略进行对冲投资，通过金融衍生品管理风险敞口，获取稳定的绝对收益。 2. **程序化投资管理，恪守投资纪律性：**投资计划、风险预算方案、资产配置方案及组合调整规则，完全通过计算机程序模型驱动，确保投资计划严格执行，有效排除人为判断偏差的影响。 3. **策略科学合理，得到长期验证：**产品应用的投资策略均采用科学金融工程理论构造，并得到长时间的实盘考验，策略过往业绩稳健，获得客户广泛认可。 4. **结构分级，实现风险收益配置：**计划优先级份额安全边际高，本金及预期收益有保障，适合低风险偏好投资者配置；计划进取级份额分享杠杆投资收益，获得一定风险水平下较高投资回报。 |

注：具体条款以合同为准。