

关于盘京盛信 12 期 A 私募证券投资基金 基金合同变更 (202301) 的通知函

招商证券股份有限公司:

上海盘京投资管理中心 (有限合伙) (以下简称“我司”) 在贵司托管的盘京盛信 12 期 A 私募证券投资基金 (以下简称“该基金”) 自成立以来, 一直坚持规范运作, 稳健运营。为更好地为该基金投资者提供投资服务, 我司根据《盘京盛信 12 期 A 私募证券投资基金基金合同》的约定对该基金相关条款进行变更。

《盘京盛信 12 期 A 私募证券投资基金基金合同》条款具体修改如下:

序号 1

关于本基金业绩报酬计提方式的特别说明

原条款:

关于本基金业绩报酬计提方式的特别说明

尊敬的投资者:

业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”: 业绩报酬提取时点分为固定时点提取、分红时提取、赎回时提取和合同终止时提取。固定时点提取是在基金成立后每 3 年的对应月对应日 (例如: 基金成立日为 2015 年 7 月 30 日, 则满 3 年的对日为 2018 年 7 月 30 日, 以此类推), 如对应日为非工作日, 则顺延至下一个工作日。分红时提取、赎回时提取、合同终止时提取是指本基金进行分红时、基金份额持有人赎回基金份额和合同终止时提取业绩报酬。如本次固定时点或基金分红时提取业绩报酬的时间距该基金上次固定时点或基金分红时计提业绩报酬的时间 (如有) 不足 3 个月 (每月按 30 个自然日计算), 则本次固定时点或基金分红时不对该基金份额计提业绩报酬。

其中, 针对基金分红时, 管理人根据基金份额持有人每一基金份额的年化收益率提取业绩报酬, 经计算确认的业绩报酬从基金分红款中以现金支付。当分红款少于提取业绩报酬时, 则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时, 当分红款少于业绩报酬, 管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

在业绩报酬固定提取时点提取业绩报酬的, 业绩报酬以扣减基金份额持有人份额的方式提取; 赎回和合同终止时提取业绩报酬的, 业绩报酬从赎回资金中扣除。

管理人提取基金份额当期 (指上一次已提取了业绩报酬的业绩报酬提取日至本业绩报酬计提日, 如该份额未提取过业绩报酬, 则为基金成立日 (认购份额) 或该份额申购对应开放日 (申购份额) 至本业绩报酬计提日) 收益的 20% 作为业绩报酬。

单个基金份额持有人单笔投资基金份额提取业绩报酬的计算公式如下 (针对固定时点或分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{i,j} \geq 3$ 个月, 每月按 30 个自然日计算, 但如“上次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”不存在则无需满足本条件):

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (NAV' - HWM_{i,j}) \times 20\%$$

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV}$$

$E_{i,j}$: “上次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”至“本次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”的存续自然天数 (算头不算尾);

$PF_{i,j}$: 本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬;

$F_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的基金份额;

NAV' : 本计提日基金份额累计净值;

$HWM_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的高水位, 为该笔份额上一次已成功提取了业绩报酬时的基金份额累计净值; 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则 $HWM_{i,j}$ 为该笔份额认购/申购时基金份额累计净值;

$\Delta S_{i,j}$: 固定时点提取业绩报酬时, 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额;

$NAV_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的上一次已成功提取了业绩报酬时的基金份额净值, 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则 $NAV_{i,j}$ 为该笔份额认购/申购时基金份额净值;

NAV : 本计提日基金份额净值;

如果 $PF_{i,j}$ 计算结果为负或者为零, 则该计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬为零, 基金管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日基金管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个基金份额持有人各笔投资业绩报酬之和, 但针对固定时点提取业绩报酬的方式, 对于被冻结 (人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机构依法要求冻结) 的基金份额则不计提业绩报酬。

注: 单个基金份额持有人单笔投资业绩报酬保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入。

业绩报酬由基金管理人负责计算, 基金托管人不承担复核义务。基金管理人向基金托管

人发送业绩报酬划付指令,基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。

示例:

投资者甲认购参与本基金 100 万份,认购面值为 1.00 元。其持有至该笔份额对应的第一个固定时点计提日,期间没有分红时计提过业绩报酬在该日亦未赎回,现假设该计提日基金份额累计净值 1.2000,基金份额净值 1.2000。

则在该日管理人计提业绩报酬金额:

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (NAV' - HWM_{i,j}) \times 20\% = 1000000 \times (1.2000 - 1.0000) \times 20\% = 40000 \text{ 元}$$

对应调减投资者甲的份额数:

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV} = \frac{40000}{1.2000} = 33333.33$$

综上,投资者甲在本次固定时点计提日日终,其持有份额数将变为:

$$1000000 - 33333.33 = 966666.67$$

其资产总额为: $966666.67 \times 1.2000 = 1160000.00$ 元

[为充分提示业绩报酬计提方式,提请投资者将本段抄录在后。]

本人/本机构作为投资者已详阅并充分理解本基金合同描述的业绩报酬计提方式及本特别说明,并自愿承担由上述业绩报酬计提方式引致全部后果。

投资者抄录:

本人/本机构作为投资者已_____本基金合同描述的业绩报酬计提方式及本特别说明,并_____由上述业绩报酬计提方式引致全部后果。

基金投资者(自然人)

(签字)

或：基金投资者（机构）

（加盖公章并由法定代表人/负责人或授权代表签字）

日期： 年 月 日

现条款：

关于本基金业绩报酬计提方式的特别说明

尊敬的投资者：

业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：业绩报酬提取时点分为固定时点提取、分红时提取、赎回时提取和合同终止时提取。固定时点提取是在基金成立后每 3 年的对应月对应日（例如：基金成立日为 2015 年 7 月 30 日，则满 3 年的对日为 2018 年 7 月 30 日，以此类推），如对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。分红时提取、赎回时提取、合同终止时提取是指本基金进行分红时、基金份额持有人赎回基金份额和合同终止时提取业绩报酬。如本次固定时点或基金分红时提取业绩报酬的时间距该基金上次固定时点或基金分红时计提业绩报酬的时间（如有）不足 3 个月（每月按 30 个自然日计算），则本次固定时点或基金分红时不对该基金份额计提业绩报酬。

其中，针对基金分红时，管理人根据基金份额持有人每一基金份额的年化收益率提取业绩报酬，经计算确认的业绩报酬从基金分红款中以现金支付。当分红款少于提取业绩报酬时，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

在业绩报酬固定提取时点提取业绩报酬的，业绩报酬以扣减基金份额持有人份额的方式提取；赎回和合同终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除。

当基金份额当期（指上一次已提取了业绩报酬的业绩报酬提取日至本业绩报酬计提日，如该份额未提取过业绩报酬，则为基金成立日（认购份额）或该份额申购对应开放日（申购份额）至本业绩报酬计提日）年化收益小于等于 5% 时，管理人不计提业绩报酬；

当基金份额当期（指上一次已提取了业绩报酬的业绩报酬提取日至本业绩报酬计提日，如该份额未提取过业绩报酬，则为基金成立日（认购份额）或该份额申购对应开放日（申购

份额)至本业绩报酬计提日) 年化收益大于 5%时, 管理人提取超过年化收益 5%盈利部分的 20%作为业绩报酬。

单个基金份额持有人单笔投资基金份额提取业绩报酬的计算公式如下 (针对固定时点或分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{i,j} \geq 3$ 个月, 每月按 30 个自然日计算, 但如“上次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”不存在则无需满足本条件):

$$1) \text{ 当 } \frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} \leq 5\% \text{ 时, } PF_{i,j} = 0$$

$$2) \text{ 当 } \frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} > 5\% \text{ 时,}$$

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times NAV_{i,j} \times \frac{m - n_{i,j}}{365} \times \left(\frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} - 5\% \right) \times 20\%$$

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV}$$

$E_{i,j}$: “上次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”至“本次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”的存续自然天数 (算头不算尾);

$PF_{i,j}$: 本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬;

$F_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的基金份额;

NAV' : 本计提日基金份额累计净值;

$HWM_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的高水位, 为该笔份额上一次已成功提取了业绩报酬时的基金份额累计净值; 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则 $HWM_{i,j}$ 为该笔份额认购/申购时基金份额累计净值;

$\Delta S_{i,j}$: 固定时点提取业绩报酬时, 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额;

$NAV_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的上一次已成功提取了业绩报酬时的基金份额净值, 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则 $NAV_{i,j}$ 为该笔份额认购/申购时基金份额净值;

NAV : 本计提日基金份额净值;

m 为该基金份额持有人本次业绩报酬计提日;

$n_{i,j}$ 为第 i 个基金份额持有人第 j 笔基金份额上一次已成功提取业绩报酬的业绩报酬计提日, 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则为该笔份额认购/申购之日 (认购日为基金成立日、申购日为申购所对应开放日);

$m - n_{i,j}$ 指 m 与 $n_{i,j}$ 之间的自然日天数。

如果 $PF_{i,j}$ 计算结果为负或者为零, 则该计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的

业绩报酬为零, 基金管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日基金管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个基金份额持有人各笔投资业绩报酬之和, 但针对固定时点提取业绩报酬的方式, 对于被冻结 (人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机构依法要求冻结) 的基金份额则不计提业绩报酬。

注: 单个基金份额持有人单笔投资业绩报酬保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入。

业绩报酬由基金管理人负责计算, 基金托管人不承担复核义务。基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令, 基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。

示例:

投资者甲认购参与本基金 100 万份, 认购面值为 1.00 元。其持有至该笔份额对应的第一个固定时点计提日 (期限刚好 36 个月), 期间没有分红时计提过业绩报酬在该日亦未赎回, 现假设该计提日基金份额累计净值 1.2000, 基金份额净值 1.2000。

则在该日管理人计提业绩报酬金额:

$$PF_{ij} = F_{ij} \times NAV_{ij} \times \left(\frac{NAV' - HWM_{ij}}{NAV_{ij}} - 5\% \times \frac{m - n_{ij}}{365} \right) \times 20\% = 1000000 \times (1.2000 - 1.0000 - 5\% \times 3 \times 1.0) \times 20\% = 10000 \text{ 元}$$

对应调减投资者甲的份额数:

$$\Delta S_{ij} = \frac{PF_{ij}}{NAV} = \frac{10000}{1.2000} = 8333.33$$

综上, 投资者甲在本次固定时点计提日日终, 其持有份额数将变为:

$$1000000 - 8333.33 = 991666.67$$

其资产总额为: $991666.67 \times 1.2000 = 1190000.00$ 元

[为充分提示业绩报酬计提方式, 提请投资者将本段抄录在后。]

本人 / 本机构作为投资者已详阅并充分理解本基金合同描述的业绩报酬计提方式及本特别说明, 并自愿承担由上述业绩报酬计提方式引致的全部后果。

投资者抄录:

本人 / 本机构作为投资者已_____本基金合同描述的业绩报酬计提方式及本特别说明, 并_____由上述业绩报酬计提方式引致的全部后果。

基金投资者 (自然人)

(签字)

或: 基金投资者 (机构)

(加盖公章并由法定代表人/负责人或授权代表签字)

日期: 年 月 日

序号 2

十七、基金的费用与税收

原条款:

5、基金管理人的业绩报酬

业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”: 业绩报酬提取时点分为固定时点提取、分红时提取、赎回时提取和合同终止时提取。固定时点提取是在基金成立后每 3 年的对应月对应日 (例如: 基金成立日为 2015 年 7 月 30 日, 则满 3 年的对日为 2018 年 7 月 30 日, 以此类推), 如对应日为非工作日, 则顺延至下一个工作日。分红时提取、赎回时提取、合同终止时提取是指本基金进行分红时、基金份额持有人赎回基金份额和合同终止时提取业绩报酬。如本次固定时点或基金分红时提取业绩报酬的时间距该基金上次固定时点或基金分红时计提业绩报酬的时间 (如有) 不足 3 个月 (每月按 30 个自然日计算), 则本次固定时点或基金分红时不对该基金份额计提业绩报酬。

其中, 针对基金分红时, 管理人根据基金份额持有人每一基金份额的年化收益率提取业绩报酬, 经计算确认的业绩报酬从基金分红款中以现金支付。当分红款少于提取业绩报酬时,

则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时,当分红款少于业绩报酬,管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

在业绩报酬固定提取时点提取业绩报酬的,业绩报酬以扣减基金份额持有人份额的方式提取;赎回和合同终止时提取业绩报酬的,业绩报酬从赎回资金中扣除。

管理人提取基金份额当期(指上一次已提取了业绩报酬的业绩报酬提取日至本业绩报酬计提日,如该份额未提取过业绩报酬,则为基金成立日(认购份额)或该份额申购对应开放日(申购份额)至本业绩报酬计提日)收益的 20% 作为业绩报酬。

单个基金份额持有人单笔投资基金份额提取业绩报酬的计算公式如下(针对固定时点或分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{i,j} \geq 3$ 个月,每月按 30 个自然日计算,但如“上次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”不存在则无需满足本条件):

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (NAV' - HWM_{i,j}) \times 20\%$$

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV}$$

$E_{i,j}$: “上次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”至“本次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日”的存续自然天数(算头不算尾);

$PF_{i,j}$: 本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬;

$F_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的基金份额;

NAV' : 本计提日基金份额累计净值;

$HWM_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的高水位,为该笔份额上一次已成功提取了业绩报酬时的基金份额累计净值;若该笔份额还未提取过业绩报酬,则 $HWM_{i,j}$ 为该笔份额认购/申购时基金份额累计净值;

$\Delta S_{i,j}$: 固定时点提取业绩报酬时,第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额;

$NAV_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的上一次已成功提取了业绩报酬时的基金份额净值,若该笔份额还未提取过业绩报酬,则 $NAV_{i,j}$ 为该笔份额认购/申购时基金份额净值;

NAV : 本计提日基金份额净值;

如果 $PF_{i,j}$ 计算结果为负或者为零,则该计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬为零,基金管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日基金管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个基金份额持有人各笔投资业绩报酬之和,但针对固定时点提取业绩报酬的方式,对于被冻结(人民法院、人民检察

院、公安机关及其他国家有权机构依法要求冻结) 的基金份额则不计提业绩报酬。

注: 单个基金份额持有人单笔投资业绩报酬保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入。

业绩报酬由基金管理人负责计算, 基金托管人不承担复核义务。基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令, 基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。

示例:

投资者甲认购参与本基金 100 万份, 认购面值为 1.00 元。其持有至该笔份额对应的第一个固定时点计提日, 期间没有分红时计提过业绩报酬在该日亦未赎回, 现假设该计提日基金份额累计净值 1.2000, 基金份额净值 1.2000。

则在该日管理人计提业绩报酬金额:

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (NAV' - HWM_{i,j}) \times 20\% = 1000000 \times (1.2000 - 1.0000) \times 20\% = 40000 \text{ 元}$$

对应调减投资者甲的份额数:

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV} = \frac{40000}{1.2000} = 33333.33$$

综上, 投资者甲在本次固定时点计提日日终, 其持有份额数将变为:

$$1000000 - 33333.33 = 966666.67$$

其资产总额为: $966666.67 \times 1.2000 = 1160000.00 \text{ 元}$

现条款:

5、基金管理人的业绩报酬

业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”: 业绩报酬提取时点分为固定时点提取、分红时提取、赎回时提取和合同终止时提取。固定时点提取是在基金成立后每 3 年的对应月对应日 (例如: 基金成立日为 2015 年 7 月 30 日, 则满 3 年的对日为 2018 年 7 月 30 日, 以此类推), 如对应日为非工作日, 则顺延至下一个工作日。分红时提取、赎回时提取、合同终止时提取是指本基金进行分红时、基金份额持有人赎回基金份额和合同终止时提取业绩报酬。如本次固定时点或基金分红时提取业绩报酬的时间距该基金上次固定时点或基金分红时计提业绩报酬的时间 (如有) 不足 3 个月 (每月按 30 个自然日计算), 则本次固定时点或基金分红时不对该基金份额计提业绩报酬。

其中, 针对基金分红时, 管理人根据基金份额持有人每一基金份额的年化收益率提取业绩报酬, 经计算确认的业绩报酬从基金分红款中以现金支付。当分红款少于提取业绩报酬时, 则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时, 当分红款少于业绩报酬, 管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

在业绩报酬固定提取时点提取业绩报酬的, 业绩报酬以扣减基金份额持有人份额的方式提取; 赎回和合同终止时提取业绩报酬的, 业绩报酬从赎回资金中扣除。

当基金份额当期 (指上一次已提取了业绩报酬的业绩报酬提取日至本业绩报酬计提日, 如该份额未提取过业绩报酬, 则为基金成立日 (认购份额) 或该份额申购对应开放日 (申购份额) 至本业绩报酬计提日) 年化收益小于等于 5% 时, 管理人不计提业绩报酬;

当基金份额当期 (指上一次已提取了业绩报酬的业绩报酬提取日至本业绩报酬计提日, 如该份额未提取过业绩报酬, 则为基金成立日 (认购份额) 或该份额申购对应开放日 (申购份额) 至本业绩报酬计提日) 年化收益大于 5% 时, 管理人提取超过年化收益 5% 盈利部分的 20% 作为业绩报酬。

单个基金份额持有人单笔投资基金份额提取业绩报酬的计算公式如下 (针对固定时点或分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{i,j} \geq 3$ 个月, 每月按 30 个自然日计算, 但如 “上次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日” 不存在则无需满足本条件):

$$1) \text{ 当 } \frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} \leq 5\% \text{ 时, } PF_{i,j} = 0$$

$$2) \text{ 当 } \frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} > 5\% \text{ 时,}$$

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times NAV_{i,j} \times \frac{m - n_{i,j}}{365} \times \left(\frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} - 5\% \right) \times 20\%$$

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV}$$

$E_{i,j}$: “上次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日” 至 “本次基金固定时点计提业绩报酬日或者分红除权日” 的存续自然天数 (算头不算尾);

$PF_{i,j}$: 本计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬;

$F_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的基金份额;

NAV' : 本计提日基金份额累计净值;

$HWM_{i,j}$: 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的高水位, 为该笔份额上一次已成功提取了业绩报酬时的基金份额累计净值; 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则 $HWM_{i,j}$ 为该笔份额认购/申购时基金份额累计净值;

ΔS_{ij} : 固定时点提取业绩报酬时, 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额;

NAV_{ij} : 第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资的上一次已成功提取了业绩报酬时的基金份额净值, 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则 NAV_{ij} 为该笔份额认购/申购时基金份额净值;

NAV: 本计提日基金份额净值;

m 为该基金份额持有人本次业绩报酬计提日;

n_{ij} 为第 i 个基金份额持有人第 j 笔基金份额上一次已成功提取业绩报酬的业绩报酬计提日, 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则为该笔份额认购/申购之日 (认购日为基金成立日、申购日为申购所对应开放日);

$m - n_{ij}$ 指 m 与 n_{ij} 之间的自然日天数。

如果 PF_{ij} 计算结果为负或者为零, 则该计提日第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬为零, 基金管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日基金管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个基金份额持有人各笔投资业绩报酬之和, 但针对固定时点提取业绩报酬的方式, 对于被冻结 (人民法院、人民检察院、公安机关及其他国家有权机构依法要求冻结) 的基金份额则不计提业绩报酬。

注: 单个基金份额持有人单笔投资业绩报酬保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入。

业绩报酬由基金管理人负责计算, 基金托管人不承担复核义务。基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令, 基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的, 顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。

示例:

投资者甲认购参与本基金 100 万份, 认购面值为 1.00 元。其持有至该笔份额对应的第一个固定时点计提日 (期限刚好 36 个月), 期间没有分红时计提过业绩报酬在该日亦未赎回, 现假设该计提日基金份额累计净值 1.2000, 基金份额净值 1.2000。

则在该日管理人计提业绩报酬金额:

$$PF_{ij} = F_{ij} \times NAV_{ij} \times \left(\frac{NAV' - HWM_{ij}}{NAV_{ij}} - 5\% \times \frac{m - n_{ij}}{365} \right) \times 20\% = 1000000 \times (1.2000 - 1.0000 - 5\% \times 3 \times 1.0) \times 20\% = 10000 \text{ 元}$$

对应调减投资者甲的份额数:

$$\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV} = \frac{10000}{1.2000} = 8333.33$$

综上, 投资者甲在本次固定时点计提日终, 其持有份额数将变为:

$$1000000 - 8333.33 = 991666.67$$

其资产总额为: $991666.67 \times 1.2000 = 1190000.00$ 元

针对变更生效时的存续份额:

本次合同变更生效后首次提取业绩报酬的起始基准为该笔份额上一个成功提取业绩报酬的份额累计净值/份额净值 (若“上一个成功提取业绩报酬的提取日”不存在, 则为该份额申购开放日所对应的份额累计净值/份额净值 (申购份额) 或基金份额初始面值 (认购份额)), 而非本次合同变更生效日当日所对应的份额累计净值/份额净值; 自上述计算起始基准之日起适用本次合同变更生效后的业绩报酬计提比例及业绩报酬计提基准 (如有)。

如本次合同变更生效后该笔份额首次计提业绩报酬的时间距离该笔份额上一次成功提取业绩报酬的时间少于 3 个月 (每月按 30 个自然日计算), 则在该次业绩报酬计提日不对该笔份额提取业绩报酬 (基金份额持有人赎回基金份额或在基金清算时提取业绩报酬的, 不受上述间隔期的限制)。

本次合同变更的生效日期为: 2023 年 02 月 06 日。

我司承诺合同变更生效后将根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求及时履行报告义务以及向投资者披露。特此通知。

我司承诺本次合同变更生效后, 在合同变更生效日之后进行申购的投资者所签署合同为根据变更内容调整后的最新有效的基金合同。因新投资人签署合同版本与实际不符而导致的损失, 托管人不承担任何责任。

上海盘京投资管理中心 (有限合伙)

2023 年 02 月 06 日