

关于天道 1 期私募证券投资基金降低业绩报酬计提频率的通知

函

尊敬的天道 1 期私募证券投资基金委托人、中信证券股份有限公司（基金托管人）、中信中证投资服务有限责任公司（基金行政服务机构）：

根据天道 1 期私募证券投资基金（产品代码 SCN787，以下简称“本基金”）基金合同中第二十三章第（一）条第 3 款第（2）项如下约定：

“3、在与本第二十三章第（一）条第 2 款项下约定不冲突的前提下，有下列情形之一的，基金管理人有权单方变更合同的相关内容，若基金管理人进行任何单方面变更，应及时将变更内容以经基金管理人有权签字人签字并加盖公章的方式书面告知基金托管人。基金托管人收到该等书面告知后，基金管理人作出的变更对基金托管人发生效力：

.....

（2）调低从本基金资产列支由管理人、销售机构（若有）、投资顾问（若有）收取的费用的标准；”

本基金管理人通知如下：

一、本基金基金合同第十九部分第（三）条第 3 款第（1）项“业绩报酬的计算方式”部分约定如下：

“（1）业绩报酬的计算方式

本基金业绩报酬计提基准日分为固定计提基准日、除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日，固定计提基准日为封闭期满后本基金的开放日（不包括临时开放日）。业绩报酬提取时点为固定计提确认日、分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。

本基金在固定计提确认日提取业绩报酬，业绩报酬以扣减投资者份额的方式提取；在分红确认日提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的分红资金中扣除（若有）；在赎回确认日提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的赎回资金中扣除；在基金终止确认日提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除。

本基金业绩报酬的提取比例（Y）为 15%。

单个投资者单笔投资基金份额业绩报酬及应调减份额计算公式如下：



$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (NAV'_1 - HWM_{i,j}) \times Y$$

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

Y ：为业绩报酬提取比例；

$PF_{i,j}$ ：本计提日第 i 个投资者第 j 笔投资的业绩报酬；

$F_{i,j}$ ：固定计提确认日、分红确认日（若有）提取时，表示第 i 个投资者持有的第 j 笔投资的基金份额；赎回确认日提取时，表示第 i 个投资者赎回份额中第 j 笔投资的基金份额；基金终止确认日提取时，表示第 i 个投资者终止清算时持有的第 j 笔投资的基金份额；

NAV'_1 ：本次业绩报酬计提基准日基金份额累计净值；

$HWM_{i,j}$ ：第 i 个投资者第 j 笔投资的高水位，为该笔份额上一次提取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 $HWM_{i,j}$ 为投资者在取得该笔份额时对应的认购/申购/除息日的基金份额累计净值；

$\Delta S_{i,j}$ ：固定计提确认日提取业绩报酬时，第 i 个投资者第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额；保留到小数点后两位，小数点第三位起四舍五入；

NAV ：本计提基准日基金份额净值。

如果 $PF_{i,j}$ 计算结果为负或者为零，则该计提日第 i 个投资者第 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。

某计提日提取的业绩报酬总额为该计提日所有单个投资者各笔投资业绩报酬之和（包括以扣减基金份额方式收取的，从赎回资金、分红资金（若有）或清算资金中扣除的业绩报酬，下同）。某计提日单个基金份额持有人计提的业绩报酬总额为该投资者持有的各笔投资业绩报酬之和。

注：单个投资者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。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，基金托管人不对计算结果进行复核。”

变更后，本基金的业绩报酬约定如下：

“（1）业绩报酬的计算方式

本基金业绩报酬计提基准日分为固定计提基准日、除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日，固定计提基准日为封闭期满后每年 6 月 30 日（如对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日）。业绩报酬提取时点为固定计提确认日、分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。

本基金在固定计提确认日提取业绩报酬，业绩报酬以扣减投资者份额的方式提取；在分红确认日提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的分红资金中扣除（若有）；在赎回确认日提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的赎回资金中扣除；在基金终止确认日提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除。

本基金业绩报酬的提取比例（Y）为 15%。

单个投资者单笔投资基金份额业绩报酬及应调减份额计算公式如下：

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (NAV'_1 - HWM_{i,j}) \times Y$$

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

Y：为业绩报酬提取比例；

$PF_{i,j}$ ：本计提日第 i 个投资者第 j 笔投资的业绩报酬；

$F_{i,j}$ ：固定计提确认日、分红确认日（若有）提取时，表示第 i 个投资者持有的第 j 笔投资的基金份额；赎回确认日提取时，表示第 i 个投资者赎回份额中第 j 笔投资的基金份额；基金终止确认日提取时，表示第 i 个投资者终止清算时持有的第 j 笔投资的基金份额；

NAV'_1 ：本次业绩报酬计提基准日基金份额累计净值；

$HWM_{i,j}$ ：第 i 个投资者第 j 笔投资的高水位，为该笔份额上一次提取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 $HWM_{i,j}$ 为投资者在取得该笔份额时对应的认购/申购/除息日的基金份额累计净值；

$\Delta S_{i,j}$ ：固定计提确认日提取业绩报酬时，第 i 个投资者第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额；保留到小数点后两位，小数点第三位起四舍五入；

NAV：本计提基准日基金份额净值。

如果 $PF_{i,j}$ 计算结果为负或者为零，则该计提日第 i 个投资者第 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。

某计提日提取的业绩报酬总额为该计提日所有单个投资者各笔投资业绩报酬之和（包括以扣减基金份额方式收取的，从赎回资金、分红资金（若有）或清算资金中扣除的业绩报酬，下同）。某计提日单个基金份额持有人计提的业绩报酬总额为该投资者持有的各笔投资业绩报酬之和。

注：单个投资者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。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，基金托管人不对计算结果进行复核。”

二、上述变更后，管理人收取业绩报酬的频率变低，在净值处于波动状态下管理人相对于变更前收取到业绩报酬的可能性也降低，总体可能减少了基金管理人收取的业绩报酬数额，对基金委托人利益无实质不利影响。

三、该变更自 2023 年 7 月 1 日执行。我司不再保留恢复以原频率计提业绩报酬的权利。不同意的基金委托人有权在最近一个开放日 2023 年 6 月 30 日赎回全部份额，未在变更生效日前全部赎回份额的基金委托人视为同意前述变更。

四、我司承诺，产品的上述变更不违反基金合同的约定，不损害基金委托人的利益。我司将按照基金合同的约定将本通知函通知至全体基金委托人，并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。

上述内容，敬请知悉。



2023 年 6 月 8 日

