

招商财富-多元挂钩-泽利1号FOF集合资产管理计划开放公告

尊敬的资产委托人：

根据《招商财富-多元挂钩-泽利1号FOF集合资产管理计划资产管理合同》（下称“《资产管理合同》”）及《招商财富-多元挂钩-泽利1号FOF集合资产管理计划认购/参与告知书》（编号：CMWA-多元挂钩-泽利1号FOF-003）约定，“招商财富-多元挂钩-泽利1号FOF集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）第三个运作期将于2024年12月20日到期。

《资产管理合同》约定：“本计划自投资起始日起分为多个运作期，每个运作期到期日（具体以《认购/参与告知书》或管理人公告为准）开放一次计划份额的参与及退出；本计划的开放频率不超过每三个月开放一次；

本计划开放日为T日，原则上T-3日至T-2日为本计划的参与/退出预约申请日，开放日及退出/参与预约申请日均为交易日，具体开放期及开放安排以《认购/参与告知书》或管理人公告为准。

本计划退出或参与预约申请期内投资者的退出/参与预约申请不可撤销，否则由此造成的损失由投资者及委托财产承担。在合同约定的开放期内，投资者可根据上述开放规则预约申请办理本资产管理计划份额的退出/参与（本计划开放日不接受退出/参与预约申请），资产管理人于本计划的开放日进行受理。投资者于非退出/参与预约申请期内提出退出/参与申请的，资产管理人均有权拒绝。

根据本合同的约定，全体委托人充分知悉并完全同意资产管理人有权根据对当前市场环境的合理评估以及本计划的实际运作情况调整上述开放期规则，并在管理人网站上公告，即视为履行了告知义务。”

根据上述约定，我司作为本计划的资产管理人，决定于【2024/12/20】向资产委托人开放退出，并设置【2024/12/17-2024/12/18】为退出预约申请日，决定于【2024/12/20】向资产委托人开放参与，并设置【2024/12/16-2024/12/19】为参与预约申请日。资产委托人需在参与/退出预约申请日提交参与/退出申请，且该申请不可撤销；如未在退出预约申请日提交退出申请而继续存续的资产委托人，将视为已知悉且同意适用第四个运作期的《认购/参与告知书》中的全部内容。本计划第四个运作期的《认购/参与告知书》详见附件。

特此公告。



附件：《认购/参与告知书》

认购/参与告知书
(编号: CMWA-多元挂钩-泽利 1 号 FOF-004)

尊敬的委托人:

在您此次认购/参与“招商财富-多元挂钩-泽利 1 号 FOF 集合资产管理计划”(以下简称“本计划”)前,请对本计划的以下内容进行确认:

一、基本信息

本计划第四个运作期到期日:【2025 年 9 月 19 日】。

二、业绩报酬计提基准

1. 本计划第四个运作期的业绩报酬计提基准的确定规则为:

期初观察日:【具体以管理人公告为准】

挂钩标的:【沪深 300 指数(代码:000300.SH),参考网页:<http://www.csindex.com.cn/>】

观察期:期初观察日(含)至运作期到期日(含)的全部交易日,期初观察日以管理人公告为准。

交易日:上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所预定开市的正常交易日。

期初参考价:挂钩标的在期初观察日 13:00-15:00 的算术平均价。

期末参考价:挂钩标的在运作期到期日 13:00-15:00 的算术平均价。

以上期初/期末参考价计算方法参考股指期货合约交割结算价的计算方法,即标的指数最后 2 小时的算术平均价。

以上参考价具体以管理人公告为准。

参与率:【30%】

锁利涨幅:【10%】

锁利价格:【期初参考价*(1+锁利涨幅)】,具体以管理人公告为准。

行权价格:在期初观察日所投挂钩标的指数期权的行权价(行权价参考当日挂钩标的的实际点位*【110%】),具体以管理人公告为准。

锁利事件:观察期内任一交易日挂钩标的收盘价大于或等于锁利价格。

2. 本计划第四个运作期的业绩报酬计提基准约定如下:

(1) 若观察期内发生锁利事件,且期末参考价大于或等于锁利价格,则本计划第四个运作期的业绩报酬计提基准(年化)为【{锁利涨幅 + max[(期末参考价-行权价格)/期初



参考价, 0] × 参与率} ÷ 期初观察日(含)至退出日或运作期到期日(不含)的自然日天数 × 365】
- 年化税费(如有)

(2) 若观察期内发生锁利事件, 但期末参考价小于锁利价格, 则本计划第四个运作期的业绩报酬计提基准(年化)为【锁利涨幅 ÷ 期初观察日(含)至退出日或运作期到期日(不含)的自然日天数 × 365】- 年化税费(如有)

(3) 若观察期内未发生锁利事件, 则本计划第四个运作期的业绩报酬计提基准(年化)为【挂钩标的涨跌幅 ÷ 期初观察日(含)至退出日或运作期到期日(不含)的自然日天数 × 365】+ 【0】% - 年化税费(如有)

其中,

$$\text{年化税费} = \text{MAX} \left(0, \frac{(\text{ET} - \text{E1}) * 0.03 * 1.12 * 365}{\text{E0} * 1.03 * \text{持有天数}} \right)$$

ET 为运作期到期日累计单位净值

E1 为期初观察日累计单位净值

E0 为期初观察日单位净值

挂钩标的涨跌幅 = 期末参考价 ÷ 期初参考价 - 1

以上以实际存续天数计算, 年化基数 365 天, 按照四舍五入法精确到小数点后 2 位。

资产管理人特别声明: 本计划的业绩报酬计提基准仅是资产管理人提取业绩报酬的标准, 并非本计划预期收益率, 不构成资产管理人对受托财产收益状况的任何承诺或保证, 本计划设置业绩报酬计提基准不代表投资者退出本计划时可按照业绩报酬计提基准数值获得投资收益。因本计划所投资资产的价格受市场波动、交易对手信用风险、流动性风险等各种因素影响, 本计划可能无法实现投资收益目标, 或者客户持有的份额本运作期内实际年化收益率可能低于业绩报酬计提基准。管理人不保证受托资产不受损失或产生收益, 投资者可能面临受托财产本金部分或全部受损的风险。

其中, 年化税费为调减项, 相关计算公式系为计算业绩报酬计提基准的简要计算参考公式, 并非资产管理计划实际产生的增值税计算标准。本计划存续期间实际产生的增值税以其持有的每个应税投资标的存续期间已实现的投资收益为基础计算, 受投资标的收益实现后再投资、已实现亏损不得转入下一个会计年度、贷款服务收入与金融商品转让价差无法相互抵扣等投资策略、税收相关的法律法规和税收政策影响, 上述参考公式的计算结果并非资产

