

关于盘京盛信 8 期 A 私募证券投资基金基金合同变更的征询公告

尊敬的份额持有人：

您好，我司作为基金管理人发行的“盘京盛信 8 期 A 私募证券投资基金”（以下简称“本基金”），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，我司拟根据《盘京盛信 8 期 A 私募证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定对该基金相关条款进行变更。

一、基金合同条款具体修改如下：

序号 1

删除条款：

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、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。赎回时提取、合同终止时提取是指本基金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。如本次固定时点提取业绩报酬的时间距该基金上次固定时点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），则本次固定时点不对该基金份额计提业绩报酬。

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”不存在则无需满足本条件）：

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

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

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

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

其中：

$E_{i,j}$ ：“上次基金固定时点计提业绩报酬日”至“本次基金固定时点计提业绩报酬日”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_{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。

特别提示: 本基金设置的业绩报酬计提基准并不构成对基金投资者投资本金不受损失或者取得最低或任何其他程度投资收益或者限定损失金额和比例的承诺。

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及之前亦未赎回, 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, $m - n_{ij}$ (指 m 与 n_{ij} 之间的自然日天数) 为 1095 天。

则在该日管理人计提业绩报酬金额:

$$\begin{aligned} PF_{ij} &= F_{ij} \times NAV_{ij} \times \frac{m - n_{ij}}{365} \times \left(\frac{NAV' - HWM_{ij}}{NAV_{ij}} \times \frac{365}{m - n_{ij}} - 5\% \right) \times 20\% \\ &= 1000000 \times \frac{1095}{365} \times \left(\frac{1.2000 - 1.0000}{1.0000} \times \frac{365}{1095} - 5\% \right) \times 20\% \\ &= 10000 \text{ 元} \end{aligned}$$

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
式及本特别说明, 并

本基金合同描述的业绩报酬计提方
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

关于本基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的特别说明

尊敬的投资者:

本基金可能会投资于全国中小企业股份转让系统挂牌的品种 (包括股票、可转换公司债券及其他证券品种), 由于全国中小企业股份转让系统本身存在较大的流动性风险, 日间交易不活跃, 因此会面临估值不公允且无法及时变现

的风险。

本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌的品种（包括股票、可转换公司债券及其他证券品种）按成本计算不得超过本基金资产总值的 20%，投资者的申购申请和赎回申请按照基金份额净值进行确认，因此可能会面临申购和赎回价格偏离实际价格的风险。

本基金可以以本基金的总资产为限参与全国中小企业股份转让系统挂牌的品种发行申购，如因参与获配导致投资比例超出本合同约定的，管理人应在可变现前提下的 10 个交易日内调整至符合合同约定。

1、全国中小企业股份转让系统挂牌的股票估值方法如下：

在全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票，以其估值日的收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，由管理人出具估值意见说明函，调整最近交易市价，确定证券估值价格；挂牌后未交易的股票按持有成本估值。

如果未来监管机构或行业协会等出台关于全国中小企业股份转让系统挂牌上市交易股票的统一的估值标准或方法，则参照新的标准或方法。

2、投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的特定风险如下：

（1）公司风险：全国中小企业股份转让系统挂企业具有规模较小，对单一技术依赖度较高，受技术更新换代影响较大；对核心技术人员依赖度较高；客户集中度高，议价能力不强等特点。企业抗市场风险和行业风险的能力较弱，业务收入可能波动较大。同时，每个在全国中小企业股份转让系统挂牌企业获得的相关政策扶持也有一定的差异，政策持续性具有不确定性，对企业中长期发展会有一定程度的影响。

（2）流动性风险：全国中小企业股份转让系统挂牌的股票本身存在较大的流动性风险，特别是基础层、创新层股票日间交易不活跃，变现时间较长。且与上市公司相比，全国中小企业股份转让系统挂牌企业股权相对集中，市场整体流动性低于沪深证券交易所。可能存在建仓时间较长，并在投资后，不能及时变现的风险。

(3) 信息风险：全国中小企业股份转让系统挂牌企业信息披露要求和标准低于上市公司，存在无法及时、准确获取全国中小企业股份转让系统挂牌企业最新经营信息和财务信息的风险。

(4) 收盘价未能真实反映公允价格以及价格波幅较大的风险：目前全国中小企业股份转让系统的股票，除精选层采取连续竞价配合开、收盘集合竞价方式以外，基础层、创新层依然采取做市交易方式或集合竞价交易方式之一进行交易，交易量相对于主板市场而言较小，且涨跌幅限制大于沪深证券交易所上市交易的股票，容易导致其价格显著偏离其内在价值，存在收盘价未能真实反映公允价格以及价格波幅较大而导致亏损的风险。

签署本合同投资者同意上述投资安排并知晓相关估值方法、投资风险及流动性风险。

[为充分提示风险，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关于投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的估值方法、风险及本特别说明，并自愿承担由上述内容引致的全部后果。

投资者抄录：

本人 / 本机构作为投资者已_____本基金合同关于投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的估值方法、风险及本特别说明，并_____由上述内容引致的全部后果。

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

七、基金的申购、赎回与转让 (一) 申购和赎回的开放日及时间

原条款:	现条款:
基金投资者可在本基金开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本基金，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。基金投资者须在开放日或开放日之前的工作日的 9：00-15：00 内根据募集机构的规定向募集机构及其销售网点提交书面申请文件（如募集机构另有规定的，遵循募集机构相关规定办理申请提交事宜）。未提交书面申请文件的，募集机构及其销售网点有权拒绝投资者的申购或赎回申请。若法律法规、中国证监会、中国基金业协会有新的规定或出现其他特殊情况，基金管理人将视情况对开放时间进行相应调整并进行通知。管理人应当统筹考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，设置匹配的开放期。 本基金不设置封闭期，本基金固定开放日为成立后每 3 年的对应月对应日（遇节假日顺延至下一工作日）。成立后每 3 年的对日接受申购和赎回申请（例如：基金成立日为 2015 年 7 月 30 日，则满 3 年的对日为	基金投资者可在本基金开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本基金，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。基金投资者须在开放日或开放日之前的工作日的 9：00-15：00 内根据募集机构的规定向募集机构及其销售网点提交书面申请文件（如募集机构另有规定的，遵循募集机构相关规定办理申请提交事宜）。未提交书面申请文件的，募集机构及其销售网点有权拒绝投资者的申购或赎回申请。若法律法规、中国证监会、中国基金业协会有新的规定或出现其他特殊情况，基金管理人将视情况对开放时间进行相应调整并进行通知。管理人应当统筹考虑投资标的流动性、投资策略、投资限制、销售渠道、潜在投资者类型与风险偏好、投资者结构等因素，设置匹配的开放期。 本基金固定开放日为每自然年 6 月、12 月的 20 号（遇节假日均顺延至下一工作日）。 出现以下情形时，管理人可增设临时开放日：法律、法规、自律规则及有关政策发

2018年7月30日，以此类推），上述开放日为非工作日，则顺延至下一个工作日。	生变化及其他情形需对本基金进行合同变更、能够公平保护所有投资者利益的基金投资运作需求、流动性管理等。临时开放日只可赎回不可申购，具体开放日期以管理人通知为准（管理人向托管人发出赎回指令即视为已向托管人通知增设临时开放日，因管理人未及时向基金投资者临时开放日导致的损失，托管人不承担责任）。
出现以下情形时，管理人可增设临时开放日：法律、法规、自律规则及有关政策发生变化及其他情形需对本基金进行合同变更、能够公平保护所有投资者利益的基金投资运作需求、流动性管理等。临时开放日只可赎回不可申购，具体开放日期以管理人通知为准（管理人向托管人发出赎回指令即视为已向托管人通知增设临时开放日，因管理人未及时向基金投资者临时开放日导致的损失，托管人不承担责任）。	

序号 3

七、基金的申购、赎回与转让 （八）申购份额与赎回金额的计算方式

2、赎回金额计算	2、赎回金额计算
原条款：	现条款：
赎回金额=赎回份数×赎回价格-业绩报酬	赎回金额=赎回份数×赎回价格-赎回费（如有）-赎回时提取的业绩报酬（如有）
赎回价格为赎回申请所对应开放日基金份额净值。	赎回价格为赎回申请所对应开放日基金份额净值。
赎回金额保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。	赎回金额保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

序号 4

八、当事人及权利义务 （三）基金托管人

1、基金托管人概况	1、基金托管人概况
原条款：	现条款：
名称：招商证券股份有限公司	名称：招商证券股份有限公司

住址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号	住址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
通讯地址：深圳市福田区福田街道福华 一路 111 号	通讯地址：深圳市福田区福田街道福华 一路 111 号
法定代表人：霍达	法定代表人：朱江涛
联系电话：0755-86157588	联系电话：0755-86157588
传真：0755-82960794	传真：0755-82960794
网址：www.newone.com.cn	网址：www.cmschina.com

序号 5

十一、基金的投资

原条款：	现条款：
（三）投资范围：本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股）、全国中小企业股份转让系统挂牌的品种（包括股票、可转换公司债券及其他证券品种）、债券（包括可转换债券）、债券逆回购、债券正回购、存款、公开募集证券投资基金（包括分级基金 B）、期货、场内期权、证券公司收益凭证、收益互换/跨境收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购。本基金可投资于证券公司（含证券公司子公司）资产管理计划、期货公司（含期货子公司）资产管理计划、基金公司（含基金子公司）资产管理计划、保险公司（含保险子公司）资产管理计划、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具	（三）投资范围：本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股）、债券（包括可转换债券）、债券逆回购、债券正回购、存款、公开募集证券投资基金（包括分级基金 B）、期货、场内期权、证券公司收益凭证、收益互换/跨境收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购。本基金可投资于证券公司（含证券公司子公司）资产管理计划、期货公司（含期货子公司）资产管理计划、基金公司（含基金子公司）资产管理计划、保险公司（含保险子公司）资产管理计划、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具

有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金，但不可投资于上述产品的劣后级份额。	契约式私募投资基金，但不可投资于上述产品的劣后级份额。
---	-----------------------------

序号 6

十一、基金的投资 （六）投资比例和投资限制

删除条款：
1、本基金总资产不得超过净资产的 200%；
删除条款：
9、本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌的品种（包括股票、可转换公司债券及其他证券品种）按成本计算不得超过本基金资产总值的 20%（本基金可以以本基金的总资产为限参与全国中小企业股份转让系统挂牌的品种发行申购，如因参与获配导致投资比例超出本合同约定的，管理人应在可变现前提下的 10 个交易日内调整至符合合同约定）

序号 7

十五、越权交易 （三）基金托管人对基金管理人越权交易的监督

原条款：	现条款：
(1) 本基金的投资范围： 本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股）、全国中小企业股份转让系统挂牌的品种（包括股票、可转换公司债券及其他证券品种）、债券（包括可转换债券）、债券逆回购、债券正回购、存款、公开募集证券投资基金（包括分级基金 B）、期货、场内期权、证券公司收益凭证、收益互换/跨境收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司	(1) 本基金的投资范围： 本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股）、债券（包括可转换债券）、债券逆回购、债券正回购、存款、公开募集证券投资基金（包括分级基金 B）、期货、场内期权、证券公司收益凭证、收益互换/跨境收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司

子公司作为交易对手)。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购。本基金可投资于证券公司(含证券公司子公司)资产管理计划、期货公司(含期货子公司)资产管理计划、基金公司(含基金子公司)资产管理计划、保险公司(含保险子公司)资产管理计划、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金,但不可投资于上述产品的劣后级份额。	金可投资于证券公司(含证券公司子公司)资产管理计划、期货公司(含期货子公司)资产管理计划、基金公司(含基金子公司)资产管理计划、保险公司(含保险子公司)资产管理计划、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金,但不可投资于上述产品的劣后级份额。
删除条款:	
(2) 本基金的投资比例和投资限制: 1) 本基金总资产不得超过净资产的 200%;	
删除条款:	
(2) 本基金的投资比例和投资限制: 9) 本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌的品种(包括股票、可转换公司债券及其他证券品种)按成本计算不得超过本基金资产总值的 20%(本基金可以以本基金的总资产为限参与全国中小企业股份转让系统挂牌的品种发行申购,如因参与获配导致投资比例超出本合同约定的,管理人应在可变现前提下的 10 个交易日内调整至符合合同约定)	

序号 8

十七、基金的费用与税收 (二) 费用计提方式、计提标准和支付方式

5、基金管理人的业绩报酬 原条款:	5、基金管理人的业绩报酬 现条款:
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	业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”:业绩报酬在基金份额持有人赎

点提取、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。赎回时提取、合同终止时提取是指本基金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。如本次固定时点提取业绩报酬的时间距该基金上次固定时点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），则本次固定时点不对该基金份额计提业绩报酬。 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	回时计提，赎回份额采取“先进先出”原则和本合同所约定的相关条款计算。当本基金清算时，所有投资者视同全部赎回，都按规定计提业绩报酬。业绩报酬的计提，以基金份额持有人申购对应份额持有期间收益为基准，按比例提取，具体提取比例如下： 当基金份额持有人本次赎回对应份额持有期间的年化收益率低于5%（含），不提取业绩报酬；当基金份额持有人本次赎回对应份额持有期间的年化收益率高于5%（不含），提取该对应份额年化收益率5%以上部分收益的20%作为业绩报酬。 计算方法如下： 当 $\frac{NAV_e' - NAV_{is}}{NAV_{is}} > 5\% \times \frac{m-n_i}{365}$ 时， $H_{xi} = \left(\frac{NAV_e' - NAV_{is}}{NAV_{is}} - 5\% \times \frac{m-n_i}{365} \right) \times N_{xi} \times NAV_{is} \times 20\%;$ 当 $\frac{NAV_e' - NAV_{is}}{NAV_{is}} \leq 5\% \times \frac{m-n_i}{365}$ 时， $H_{xi} = 0$; $H_x = \sum_{i=1}^n H_{xi}$ 其中： H_x 为第 x 位基金份额持有人本次赎回提取的全部业绩报酬； H_{xi} 为第 x 位基金份额持有人本次赎回对应的第 i 笔基金份额所提取的业绩报酬； NAV_e' 为该基金份额持有人本次赎回的赎回申请所对应开放日的基金份额累计净值； NAV_{is} 为该基金份额持有人本次赎回所
--	--

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”不存在则无需满足本条件）： $\text{当 } \frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} \leq 5\% \text{ 时, } PF_{i,j} = 0$ $\text{当 } \frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} > 5\% \text{ 时,}$ $PF_{i,j} = F_{i,j} \times NAV_{i,j} \times \frac{m - n_{i,j}}{365} \times \left(\frac{NAV' - HWM_{i,j}}{NAV_{i,j}} \times \frac{365}{m - n_{i,j}} - 5\% \right) \times 20\%$ $\Delta S_{i,j} = \frac{PF_{i,j}}{NAV}$ 其中： $E_{i,j}$：“上次基金固定时点计提业绩报酬日”至“本次基金固定时点计提业绩报酬日”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；	对应的第 i 笔基金份额申购申请所对应开放日的基金份额累计净值（如认购则为本基金份额面值）。 NAV_{is} 为该基金份额持有人本次赎回所对应的第 i 笔基金份额申购申请所对应开放日的基金份额净值（如认购则为本基金份额面值）。 m 为该基金份额持有人本次赎回的赎回申请所对应开放日，n_i 为该基金份额持有人本次赎回所对应的第 i 笔基金份额申购申请所对应开放日（如认购则为本基金成立日）。 $m - n_i$ 指 m 与 n_i 之间的自然日天数（算头不算尾），即基金份额持有人持有的第 i 笔基金份额的天数； N_{xi} 为第 x 位基金份额持有人本次赎回时对应的第 i 笔基金份额数。 业绩报酬在基金份额持有人赎回时或本基金清算时由基金管理人负责计算，基金托管人不承担复核义务。业绩报酬从基金份额持有人的赎回资金或清算资金中扣除后支付，由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。 特别提示：本基金设置的业绩报酬计提基准并不构成对基金投资者投资本金不受损失或者取得最低或任何其他程度投资收益或
---	--

$\Delta S_{i,j}$: 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	者限定损失金额和比例的承诺。
--	-----------------------

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。 特别提示：本基金设置的业绩报酬计提基准并不构成对基金投资者投资本金不受损失或者取得最低或任何其他程度投资收益或者限定损失金额和比例的承诺。 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及之前亦未赎回，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，$m - n_{ij}$（指 m 与 n_{ij} 之间的自然日天数）为 1095 天。 则在该日管理人计提业绩报酬金额： $ \begin{aligned} PF_{ij} &= F_{ij} \times NAV_{ij} \times \frac{m - n_{ij}}{365} \\ &\quad \times \left(\frac{NAV' - HWM_{ij}}{NAV_{ij}} \right) \\ &\quad \times \left(\frac{365}{m - n_{ij}} - 5\% \right) \times 20\% \\ &= 1000000 \times \frac{1095}{365} \times \left(\frac{1.2000 - 1.0000}{1.0000} \right) \times \end{aligned} $	

$\frac{365}{1095} - 5\% \times 20\%$	
$=10000 \text{ 元}$	
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 日终，其持有份额数将变为： $1000000 - 8333.33 = 991666.67$	
其 资 产 总 额 为 ： $991666.67 \times 1.2000 = 1190000.00 \text{ 元}$	

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高水位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；自本次合同变更生效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 6 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）。

基金管理人、基金托管人已就上述变更事项书面达成一致。基金管理人指定 2026 年【9】月【21】日为临时开放日，若本基金委托人不同意本次合同变更条款的，应于该开放日全部赎回其所有基金份额。上述合同变更条款将于 2026 年【9】月【22】日起正式生效。

若本基金委托人未在本通知函指定的开放日全部赎回本基金的（无论本基金委托人是否向管理人提交过回复，亦无论本基金委托人是否表明过不同意），均视为本基金委托人同意本次变更。

特此公告。

上海盘京投资管理中心（有限合伙）（盖章）



2026年9月3日

公告

