

广发资管鑫添利 2 号集合资产管理计划 2016 年第一次开放期安排

及第二个封闭周期业绩报酬计提标准公告

一、 2016 年第一次开放期安排

广发资管鑫添利 2 号集合资产管理计划（以下简称：本集合计划）第一个封闭周期将于 2016 年 11 月 22 日结束，2016 年第一次开放期为 2016 年 11 月 23 日至 2016 年 11 月 29 日；开放期可办理参与和退出业务，但开放期的最后一个工作日（2016 年 11 月 29 日）仅办理参与业务，不可退出。开放期结束后将进入本集合计划第二个封闭周期。

二、 第二个封闭周期

本集合计划的第二个封闭周期为 2016 年 11 月 30 日至 2017 年 2 月 28 日。

三、 第二个封闭周期的挂钩标的

本集合计划第二个封闭周期的挂钩标的①为：上海期货交易所交割月份为 2017 年 6 月的黄金期货实盘合约（交易代码是 AU1706）；挂钩标的②为：沪深 300 指数。

四、 第二个封闭周期的业绩报酬计提标准

- 1、如果出现如下任何一种情况则业绩报酬计提标准（年化）为：2.5%。（1）封闭期内最后交易日 2 个挂钩标的收盘价涨幅或者跌幅均小于封闭期内首个交易日收盘价的 2%；（2）封闭周期内任意交易日 2 个挂钩标的均出现过收盘价涨幅或者跌幅触及或超过封闭期内首个交易日收盘价的 6%；（3）封闭周期内任意交易日其中一个挂钩标的出现过收盘价涨幅或者跌幅触及或超过封闭期内首个交易日收盘价的 6%，另一个挂钩标的在封闭期内最后交易日收盘价涨幅或者跌幅小于封闭期内首个交易日收盘价的 2%；
- 2、如果封闭期内最后交易日 2 个挂钩标的收盘价涨幅或者跌幅均大于封闭期内首个交易日收盘价的 2%，且封闭周期内任意交易日 2 个挂钩标的均没有出现过收盘价涨幅或者跌幅触及或超过封闭期内首个交易日收盘价的 6%，则业绩报酬计提标准（年化）为：2.5%+（封闭期内挂钩标的①涨跌幅绝对值-2%）×50%+（封闭期内挂钩标的②涨跌幅绝对值-2%）×50%；
- 3、如果封闭期内最后交易日 2 个挂钩标的收盘价涨幅或者跌幅均大于封闭期内首个交易日

收盘价的 2%，且封闭周期内任意一个交易日只有其中一个挂钩标的出现收盘价涨幅或者跌幅触及或超过封闭期内首个交易日收盘价的 6%，则业绩报酬计提标准(年化)为： $2.5\% + (\text{封闭周期内任意一个交易日未出现收盘价涨幅或者跌幅触及或超过封闭期内首个交易日收盘价的 } 6\% \text{ 的挂钩标的涨跌幅绝对值} - 2\%) \times 50\%$

- 4、如果封闭期内最后交易日一个挂钩标的收盘价涨幅或者跌幅小于封闭期内首个交易日收盘价的 2%，且封闭周期内任意一个交易日另外一个挂钩标的收盘价涨幅或者跌幅均小于 6%，则业绩报酬计提标准（年化）为： $2.5\% + (\text{封闭周期内任意一个交易日另外一个挂钩标的收盘价涨幅或者跌幅均小于 } 6\% \text{ 挂钩标的涨跌幅绝对值} - 2\%) \times 50\%$

五、 重要提示

- 1、业绩报酬计提标准不是预期收益和保证收益率，不构成管理人、托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保。在某些情况下，委托人仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。
- 2、收盘价指上海期货交易所或者中证指数公司公布的挂钩标的收盘价。

广发证券资产管理（广东）有限公司

2016 年 11 月 17 日