

关于签署万吨资产天行健私募证券投资基金 基金合同补充协议（一）的说明

尊敬的投资者：

万吨资产天行健私募证券投资基金成立于2019年07月09日，我司作为管理人勤勉尽责，谨慎管理、运用基金资产，截至目前基金业绩良好，回撤稳定。

根据原合同“十九（二）基金合同的变更”条款的约定，以及管理人基于该产品实际运作的需要，经与托管人协商一致，决定对原基金合同进行如下修订：

章节	原合同内容	变更后的内容
四、私募基金的基本情况”下“（十一）其他需要订明的内容	<p>（十一）其他需要订明的内容</p> <p>本基金分为A、B两类份额，A类份额为特定级份额（仅供本基金管理人或本基金管理人工，管理人发行的其他产品，以及管理人确定的特定投资者认申购），B类份额为普通级份额。管理人仅对B类份额持有人收取管理费和业绩报酬，对A类份额持有人不收取管理费和业绩报酬。两类份额分别设有不同的代码，分开募集，合并运作。若在产品存续期间，某一类份额的份额总数为0，则该类别再次申购时，申购初始单位净值同申购当日的另一类份额的单位净值。</p> <p>1、基金份额配比</p> <p>本基金存续期内，A类和B类基金份额没有固定的比例关系。</p> <p>2、基金管理费提取</p> <p>本基金根据份额类别的不同，分类计提管理费和收取业绩报酬，具体参照“十五、私募基金的费用与税收”的相关约定。</p> <p>3、基金份额的份额净值计算</p> <p>A类份额和B类份额由于费用的不</p>	<p>（十一）其他需要订明的内容</p> <p>本基金分为A、B两类份额，A类份额为特定级份额（仅供本基金管理人或本基金管理人工，管理人发行的其他产品），B类份额为普通级份额。管理人仅对B类份额持有人收取管理费和业绩报酬，对A类份额持有人不收取管理费和业绩报酬。两类份额分别设有不同的代码，分开募集，合并运作。若在产品存续期间，某一类份额的份额总数为0，则该类别再次申购时，申购初始单位净值同申购当日的另一类份额的单位净值。</p> <p>1、基金份额配比</p> <p>本基金存续期内，A类和B类基金份额没有固定的比例关系。</p> <p>2、基金管理费提取</p> <p>本基金根据份额类别的不同，分类计提管理费和收取业绩报酬，具体参照“十五、私募基金的费用与税收”的相关约定。</p> <p>3、基金份额的份额净值计算</p> <p>A类份额和B类份额由于费用的不</p>



	<p>同，本基金A类基金份额和B类基金份额将分别计算基金份额净值和基金份额累计净值。基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。基金份额累计净值计算公式为计算日该类别基金份额净值加上该类别基金份额累计分红金额。</p> <p>具体计算公式如下： A级当日净值 $V_{ad} = V_a + M_a - N_a + (V + Q_2 + Y_2 + T_1 + T_2 - M_a + N_a - M_b + N_b - V_z) * V_a / (V_a + V_b) - T_1$ B级当日净值 $V_{bd} = V - V_{ad}$</p> <p>其中： V_a 为A级昨日资产净值 V_b 为B级昨日资产净值 M_a 为A级的当日申购款 N_a 为A级的当日赎回款 M_b 为B级的当日申购款 N_b 为B级的当日赎回款 V 为当日基金总资产净值 V_z 为昨日基金总资产净值 Q₂ 为B级当日管理费 Y₂ 为B级当日业绩报酬 T₁ 为A级当日分红金额 T₂ 为B级当日分红金额 A级、B级当日净值均保留小数点后两位。</p>	<p>份额累计净值。基金份额净值计算公式为计算日该类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。基金份额累计净值计算公式为计算日该类别基金份额净值加上该类别基金份额累计分红金额。</p> <p>具体计算公式如下： A类份额当日净值 $V_{ad} = \text{round} (V_a + M_a - N_a + (V + Q_1 + Q_2 + Y_1 + Y_2 + T_1 + T_2 - M_a + N_a - M_b + N_b - V_z) * (V_a + M_a - N_a) / (V_a + V_b + M_a - N_a + M_b - N_b)) - Q_1 - Y_1 - T_1, 2)$ B类份额当日净值 $V_{bd} = V - V_{ad}$</p> <p>其中： V_a: A类份额昨日资产净值 V_b: B类份额昨日资产净值 M_a: A类份额当日申购款 N_a: A类份额当日赎回款 M_b: B类份额当日申购款 N_b: B类份额当日赎回款 V: 当日总资产净值 V_z: 昨日总资产净值 Q₁: A类份额当日管理费 Q₂: B类份额当日管理费 Y₁: A类当日业绩报酬 Y₂: B类当日业绩报酬 T₁: A类当日分红金额 T₂: B类当日分红金额 A级、B类当日净值均保留小数点后两位。</p>
<p>十一、私募基金的“投资”下“（一）本基金投资策略如下：</p>	<p>2、投资范围</p> <p>(1) 股票(A股、港股通)；</p> <p>(2) 债券(国债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、可分离债券、非公开定向债务融资工具(PPN)、债券回购)；</p> <p>(3) 基金(货币市场基金、ETF基金)；</p> <p>(4) 期货期权(商品期货、国债期货、股指期货、场内期权)；</p> <p>(5) 其他(银行存款、商业银行理财产品、信托产品、融资融券、转</p>	<p>2、投资范围</p> <p>(1) 股票(A股、港股通、科创板、新三板精选层股票、新股申购(网上、网下))；</p> <p>(2) 债券(国债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、可分离债券、非公开定向债务融资工具(PPN)、债券回购)；</p> <p>(3) 基金(封闭式基金、开放式基金、股票型基金、债券型基金、混合基金、货币市场基金、LOF基金、ETF基金)；</p>



	<p>融通、权证、资产支持证券、收益凭证、黄金 T+D、白银 T+D、资产管理计划（包括但不限于基金及其子公司资管计划、券商及其子公司资管计划、保险及其子公司资管计划、期货公司资管计划等）。</p> <p>如本基金投资资产管理产品，管理人应确保所投资的资产管理产品未投资或在本基金持有期内不投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品。</p>	<p>(4) 期货期权(商品期货、国债期货、股指期货、场内期权)；</p> <p>(5) 其他(银行存款、商业银行理财产品、信托产品、融资融券、转融通、权证、资产支持证券、收益凭证、黄金 T+D、白银 T+D、私募基金产品、资产管理计划（包括但不限于基金及其子公司资管计划、券商及其子公司资管计划、保险及其子公司资管计划、期货公司资管计划等）)。</p> <p>如本基金投资资产管理产品，管理人应确保所投资的资产管理产品未投资或在本基金持有期内不投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品。</p>
--	--	--

请投资者配合尽快完成签署，以便管理人能更好地把握投资机会，继续为投资者创造满意的业绩。如投资者不同意此次变更，请于本基金下一次开放日（2020年8月3日）赎回持有的基金份额，感谢您的支持和配合！

特此说明！

上海万吨资产管理有限公司



2020年07月15日



扫描全能王 创建