

# 关于东亚前海证券吉星 2 号集合资产管理计划的 公告

**尊敬的投资者：**

现对《东亚前海证券吉星 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称本合同）、《东亚前海证券吉星 2 号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议一》（以下简称补充协议一）的相关约定内容修改如下：

（一）补充协议一的附件 1 中的第五章第（八）1（3）项由原“

本集合计划开放日分为参与开放日与退出开放日。参与开放日为本计划成立之日次月起每月的 15 日、16 日、17 日（若为非工作日，则顺延至下一个工作日，三个连续工作日为一个参与开放期），可以办理参与本集合计划的业务；退出开放日为本计划成立之日次月起每【6 个月】的末月的 15、16、17 日（非工作日，则顺延至下一个工作日，三个连续工作日为一个退出开放期），可以办理退出本集合计划的业务。管理人应至少提前 1 个工作日在指定网站上披露开放日及具体安排。在非开放期间，原则上不办理退出业务，若出现法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定变更的情况或资产管理合同发生变更的情况，管理人将视情况设置临时退出开放日，具体开放时间及相关情况由管理人提前在指定网站上公告。即：如本集合计划 2019 年 3 月 7 日成立，第一个参与开放期为 2019 年 4 月 15 日、2019 年 4 月 16 日、2019 年 4 月 17 日，以此类推；第一个退出开放期为 2019 年 9 月 16 日、2019 年 9 月 17 日、2019 年 9 月 18 日，以此类推。临时退出开放日由管理人提前公告。”

**现修改为“**

本集合计划开放日为本计划成立之日次月起每月的 15 日、16 日、17 日（若为非工作日，则顺延至下一个工作日，三个连续工作日为一个开放期），可以办理参与、退出本集合计划的业务。管理人应至少提前 1 个工作日在指定网站上披露开放日及具体安排。在非开放期间，原则上不办理退出业务，若出现法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定变更的情况或资产管理合同发生变更的情况，管理人将视情况设置临时退出开放日，具体开放时间及相关情况由管理人提前在指定网站上公告。临时退出开放日由管理人提前公告。”

东亚前海  
证券

(二) 补充协议一的附件 1 中的第八章第 (一) 项由原 “

本计划开放期以外的存续期间均为封闭期。在封闭期间，原则上不办理退出业务，若出现法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定变更的情况或资产管理合同发生变更的情况，管理人将视情况设置临时退出开放期，具体开放时间及相关情况由管理人提前在指定网站上公告。本集合计划开放日分为参与开放日与退出开放日。参与开放日为本计划成立之日次月起每月的 15 日、16 日、17 日（若为非工作日，则顺延至下一个工作日，三个连续工作日为一个参与开放期），可以办理参与本集合计划的业务；退出开放日为本计划成立之日次月起每【6 个月】的末月的 15、16、17 日（非工作日，则顺延至下一个工作日，三个连续工作日为一个退出开放期），可以办理退出本集合计划的业务。管理人应至少提前 1 个工作日在指定网站上披露开放日及具体安排。在非开放期间，原则上不办理退出业务，若出现法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定变更的情况或资产管理合同发生变更的情况，管理人将视情况设置临时退出开放日，具体开放时间及相关情况由管理人提前在指定网站上公告。即：如本集合计划 2019 年 3 月 7 日成立，第一个参与开放期为 2019 年 4 月 15 日、2019 年 4 月 16 日、2019 年 4 月 17 日，以此类推；第一个退出开放期为 2019 年 9 月 16 日、2019 年 9 月 17 日、2019 年 9 月 18 日，以此类推。临时退出开放日由管理人提前公告。”

现修改为 “

本计划开放期以外的存续期间均为封闭期。在封闭期间，原则上不办理退出业务，若出现法律法规或中国证监会、证券投资基金业协会的相关规定变更的情况或资产管理合同发生变更的情况，管理人将视情况设置临时退出开放期，具体开放时间及相关情况由管理人提前在指定网站上公告。本集合计划开放日为本计划成立之日次月起每月的 15 日、16 日、17 日（若为非工作日，则顺延至下一个工作日，三个连续工作日为一个开放期），可以办理参与、退出本集合计划的业务。管理人应至少提前 1 个工作日在指定网站上披露开放日及具体安排。”

(三) 补充协议一的附件 1 中的第五章第 (八) 3 (5) 项由原 “

业绩报酬：采用单客户单份额计提方式，在退出开放期的首个退出开放日、份额退出、集合计划终止时对超额部分计提 20% 的业绩报酬。详见本合同“集合计划的费用与税收”章节。”

现修改为 “



业绩报酬：采用单客户单份额计提方式，在固定计提基准日、份额退出申请日、集合计划终止时对超额部分计提 20%的业绩报酬。详见本合同“集合计划的费用与税收”章节。”

(四) 补充协议一的附件1中的第二十二章第(一)3项由原“

提取业绩报酬的具体方法如下：

① 业绩报酬的提取时间

同一委托人不同时间多次参与的，对委托人每笔参与份额分别计算收益率并计提业绩报酬。业绩报酬计提基准日分为退出开放期的首个退出开放日、份额退出申请日和集合计划终止日，固定计提基准日为自本计划成立日起之后【退出开放期的首个工作日】（不含临时开放日，不含开放日退出的份额）。退出申请日提取（含开放日和临时开放日退出的份额）、集合计划终止日提取是指份额持有人退出份额时和集合计划终止时提取业绩报酬。业绩报酬提取时点为固定计提确认日、退出确认日和集合计划终止确认日。

在业绩报酬固定提取时点（即固定计提确认日）提取业绩报酬的，业绩报酬以扣减份额持有人份额的方式提取；退出和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出和清算资金中扣除。

② 业绩报酬的计算

单个份额持有人单笔份额明细业绩报酬计算公式如下：

$$PF_{ij} = \max(F_{ij} \times (NAV_i - HWM_{ij}) \times 20\%, 0)$$

$$\Delta S_{ij} = PF_{ij} \div NAV$$

$PF_{ij}$ ：本计提日第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细的业绩报酬；

$F_{ij}$ ：第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细；

$NAV_i$ ：本计提基准日份额累计净值；

$HWM_{ij}$ ：为第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细上一次提取业绩报酬时的份额累计净值；

若该笔份额还未提取过业绩报酬，则  $HWM_{ij}$  为该笔份额认购/参与/分红转份额时份额累计净值；

$\Delta S_{ij}$ ：固定提取时点提取业绩报酬时，第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细提取的业绩报酬对应的应调减份额；

NAV: 本计提基准日单位份额净值。

如果  $PF_{ij}$  计算结果为负或者为零, 则该计提日第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细提取的业绩报酬为零, 管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个份额持有人各笔份额明细业绩报酬之和。某计提日单个份额持有人计提的业绩报酬总额为该份额持有人持有的各笔份额明细业绩报酬之和。

业绩报酬金额的计算和扣减份额的计算均保留到小数点后 2 位, 小数点后第 3 位四舍五入, 由此带来的收益和损失归入计划资产。

### ③ 业绩报酬支付

固定提取时点提取的业绩报酬以扣减份额持有人份额的方式提取, 退出和集合计划终止时提取的业绩报酬从份额持有人的退出或终止清算资金中提取, 并由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令, 托管人于十个工作日内将业绩报酬划拨给份额登记机构。

因涉及份额注册登记, 投资者、管理人与托管人达成一致, 托管人仅按照管理人划付指令进行支付业绩报酬, 不对其金额承担任何复核职责, 金额错误带来的损失, 托管人免于任何责任。”

### 现修改为“

提取业绩报酬的具体方法如下:

#### ① 业绩报酬的提取时间

同一委托人不同时间多次参与的, 对委托人每笔参与份额分别计算收益率并计提业绩报酬。业绩报酬计提基准日分为固定计提基准日、份额退出申请日和集合计划终止日, 固定计提基准日为自本计划成立之日次月起每【6 个月】的末月的开放期的首个工作日(不含临时开放日, 不含开放日退出的份额)。退出申请日提取(含开放日和临时开放日退出的份额)、集合计划终止日提取是指份额持有人退出份额时和集合计划终止时提取业绩报酬。业绩报酬提取时点为固定计提确认日、退出确认日和集合计划终止确认日。

在业绩报酬固定提取时点(即固定计提确认日)提取业绩报酬的, 业绩报酬以扣减份额持有人份额的方式提取; 退出和集合计划终止时提取业绩报酬的, 业绩报酬从退出和清算资金中扣除。

#### ② 业绩报酬的计算

单个份额持有人单笔份额明细业绩报酬计算公式如下：

$$PF_{ij} = \max(F_{ij} \times (NAV_i - HWM_{ij}) \times 20\%, 0)$$

$$\Delta S_{ij} = PF_{ij} \div NAV$$

$PF_{ij}$ ：本计提日第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细的业绩报酬；

$F_{ij}$ ：第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细；

$NAV_i$ ：本计提基准日份额累计净值；

$HWM_{ij}$ ：为第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细上一次提取业绩报酬时的份额累计净值；

若该笔份额还未提取过业绩报酬，则  $HWM_{ij}$  为该笔份额认购/参与/分红转份额时份额累计净值；

$\Delta S_{ij}$ ：固定提取时点提取业绩报酬时，第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细提取的业绩报酬对应的应调减份额；

$NAV$ ：本计提基准日单位份额净值。

如果  $PF_{ij}$  计算结果为负或者为零，则该计提日第  $i$  个份额持有人第  $j$  笔份额明细提取的业绩报酬为零，管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日管理人计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个份额持有人各笔份额明细业绩报酬之和。某计提日单个份额持有人计提的业绩报酬总额为该份额持有人持有的各笔份额明细业绩报酬之和。

业绩报酬金额的计算和扣减份额的计算均保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此带来的收益和损失归入计划资产。

### ③ 业绩报酬支付

固定提取时点提取的业绩报酬以扣减份额持有人份额的方式提取，退出和集合计划终止时提取的业绩报酬从份额持有人的退出或终止清算资金中提取，并由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于十个工作日内将业绩报酬划拨给份额登记机构。

因涉及份额注册登记，投资者、管理人与托管人达成一致，托管人仅按照管理人划付指令进行支付业绩报酬，不对其金额承担任何复核职责。

管理人指定的接收固定计提基准日业绩报酬的银行账户信息：



账户名称：东亚前海证券有限责任公司

银行账号：755935096210401

开户银行：招商银行股份有限公司深圳时代广场支行

管理人指定的接收退出、终止业绩报酬的银行账户为本计划募集专户。”

（五）补充协议一的附件 1 中的第二十五章（六）删除“

8、参与开放日与退出开放日不一致的风险。由于本计划设定了参与开放日与退出开放日频率存在不一致性，管理人将根据合同约定对本计划进行开放，退出开放期之间间隔较长，因此委托人可能面临因上述原因而不能短期内退出的风险。”

本计划将严格按照以上要求执行。

以上对本合同、补充协议一的合同修改内容，已经管理人和托管人协商达成一致，在管理人网站公告满 3 个工作日后生效。投资者如对上述合同修改的内容有异议的，可在上述合同修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。

特此公告。

东亚前海证券有限责任公司  
2020年9月24日



公司

