

# 关于中银期货-利位 1 号集合资产管理计划资产管理合同 变更条款的公告

尊敬的委托人：

根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及《中银期货-利位 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“资产管理合同”）第二十三节第（一）条第 2 款“4、资产管理合同约定资产管理人有权变更合同内容的情形可由资产管理人根据相关法律法规规定及资产管理合同的约定办理合同变更，并至少应于变更后 3 个工作日内通知资产委托人和资产托管人，上述情形包括：（2）调低参与退出费率、管理费率、业绩报酬计提比例。资产管理人在其网站公告即视为履行完毕前述通知义务。”的有关规定及监管要求，为了保护投资者利益，我司拟对资产管理合同约定的部分条款进行修订。具体修订如下：

章节	变更前	变更后
第十九节	<p>5、资产管理人和投资顾问的业绩报酬</p> <p>① 业绩报酬的提取时间</p> <p>计划资产管理人和投资顾问将根据高水位净值法对单个计划份额持有人单笔投资计划份额在<b>【退出计划份额时、计划终止时】</b>（以下简称为“计提日”）分别提取业绩报酬。本计划业绩报酬计提基准日（以下简称“计提基准日”）分为<b>【退出申请对应的开放日、计划终止日】</b>。</p>	<p>5、资产管理人和投资顾问的业绩报酬</p> <p>① 业绩报酬的提取时间</p> <p>计划资产管理人和投资顾问将根据高水位净值法对单个计划份额持有人单笔投资计划份额在<b>【退出计划份额时、计划终止时】</b>（以下简称为“计提日”）分别提取业绩报酬。本计划业绩报酬计提基准日（以下简称“计提基准日”）分为<b>【退出申请对应的开放日、计划终止日】</b>。</p>



<p>符合业绩报酬计提条件时，在集合计划退出日和集合计划终止日计提业绩报酬；在退出计划份额时提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的退出资金中扣除；在计划终止时提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除；在投资者退出和计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额和集合计划终止时持有份额计算；</p> <p>② 业绩报酬的计算</p> <p>第 i 个计划份额持有人持有的第 j 笔投资的期间年化收益率 <math>R_{i,j} = (NAV_1 - HWM_{i,j}) / HWM_0 \times 365 / T \times 100\%</math>，则业绩报酬计提的条件为：</p> <p>当 <math>R_{i,j} \leq 6.08\%</math> 时，不计提业绩报酬；</p> <p>当 <math>R_{i,j} &gt; 6.08\%</math> 时，对期间年化收益率超过 6.08% 的部分提取 50% 作为业绩报酬，即</p> $PF_{i,j} = F_{i,j} \times (R_{i,j} - 6.08\%) \times HWM_0 \times 50\% \times T / 365;$ <p><math>PF_{i,j}</math>：本计提基准日第 i 个计划份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬；</p> <p><math>F_{i,j}</math>：计划终止提取时，表示在本计提基准日第 i 个计划份额持有人持有的第 j 笔投资的计划</p>	<p>符合业绩报酬计提条件时，在集合计划退出日和集合计划终止日计提业绩报酬；在退出计划份额时提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的退出资金中扣除；在计划终止时提取业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除；在投资者退出和计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额和集合计划终止时持有份额计算；</p> <p>② 业绩报酬的计算</p> <p>第 i 个计划份额持有人持有的第 j 笔投资的期间年化收益率 <math>R_{i,j} = (NAV_1 - HWM_{i,j}) / HWM_0 \times 365 / T \times 100\%</math>，则业绩报酬计提的条件为：</p> <p>当 <math>R_{i,j} \leq 6.08\%</math> 时，不计提业绩报酬；</p> <p>当 <math>R_{i,j} &gt; 6.08\%</math> 时，对期间年化收益率超过 6.08% 的部分提取 20% 作为业绩报酬，即</p> $PF_{i,j} = F_{i,j} \times (R_{i,j} - 6.08\%) \times HWM_0 \times 20\% \times T / 365;$ <p><math>PF_{i,j}</math>：本计提基准日第 i 个计划份额持有人第 j 笔投资的业绩报酬；</p> <p><math>F_{i,j}</math>：计划终止提取时，表示在本计提基准日第 i 个计划份额持有人持有的第 j 笔投资的计划</p>
--	--

<p>份额余额；退出提取时，表示在本计提基准日第 <math>i</math> 个投资者退出份额中第 <math>j</math> 笔投资的计划份额；</p> <p><math>NAV_i</math>：本计提基准日计划份额累计净值；</p> <p><math>HWM_{i,j}</math>：第 <math>i</math> 个计划份额持有人第 <math>j</math> 笔投资的高水位，为该笔份额最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提基准日的计划份额累计净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则 <math>HWM_{i,j}</math> 为该笔份额认购确认日/参与申请日/除权除息日的计划份额累计净值；</p> <p><math>HWM_0</math>：为该笔份额最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提基准日的计划份额净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则 <math>HWM_0</math> 为该笔份额认购确认日/参与申请日/除权除息日的计划份额净值；</p> <p><math>T</math>：第 <math>i</math> 个计划份额持有人第 <math>j</math> 笔投资最近一个成功计提业绩报酬的计提日到本计提日的份额持有天数；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则以该笔份额认购/参与的份额确认日或红利再投日起算；</p> <p>如果 <math>PF_{i,j}</math> 计算结果为负或者</p>	<p>份额余额；退出提取时，表示在本计提基准日第 <math>i</math> 个投资者退出份额中第 <math>j</math> 笔投资的计划份额；</p> <p><math>NAV_i</math>：本计提基准日计划份额累计净值；</p> <p><math>HWM_{i,j}</math>：第 <math>i</math> 个计划份额持有人第 <math>j</math> 笔投资的高水位，为该笔份额最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提基准日的计划份额累计净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则 <math>HWM_{i,j}</math> 为该笔份额认购确认日/参与申请日/除权除息日的计划份额累计净值；</p> <p><math>HWM_0</math>：为该笔份额最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提基准日的计划份额净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则 <math>HWM_0</math> 为该笔份额认购确认日/参与申请日/除权除息日的计划份额净值；</p> <p><math>T</math>：第 <math>i</math> 个计划份额持有人第 <math>j</math> 笔投资最近一个成功计提业绩报酬的计提日到本计提日的份额持有天数；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则以该笔份额认购/参与的份额确认日或红利再投日起算；</p> <p>如果 <math>PF_{i,j}</math> 计算结果为负或者</p>
--	--

为零，则该计提日第  $i$  个计划份额持有人第  $j$  笔投资提取的业绩报酬为零，计划资产管理人和投资顾问就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日计划资产管理人和投资顾问计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个计划份额持有人各笔投资业绩报酬之和。某计提日单个计划份额持有人计提的业绩报酬总额为该计划份额持有人持有的各笔投资业绩报酬之和。

业绩报酬金额的计算保留到小数点后 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。

计划资产托管人不对业绩报酬的计算和计提承担任何责任，业绩报酬由【计划资产管理人或其委托的计划行政服务机构】负责计算及复核。

本计划的首个业绩报酬计提基准是 6.08%/年，并可根据市场情况由管理人、投资顾问和销售机构协商调整。如需调整业绩报酬计提基准，管理人应在开放日  $T$  日三个工作日前，公布调整后的业绩报酬计提基准，管理人在网

为零，则该计提日第  $i$  个计划份额持有人第  $j$  笔投资提取的业绩报酬为零，计划资产管理人和投资顾问就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日计划资产管理人和投资顾问计提的业绩报酬总额为该计提日所有单个计划份额持有人各笔投资业绩报酬之和。某计提日单个计划份额持有人计提的业绩报酬总额为该计划份额持有人持有的各笔投资业绩报酬之和。

业绩报酬金额的计算保留到小数点后 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。

计划资产托管人不对业绩报酬的计算和计提承担任何责任，业绩报酬由【计划资产管理人或其委托的计划行政服务机构】负责计算及复核。

本计划的首个业绩报酬计提基准是 6.08%/年，并可根据市场情况由管理人、投资顾问和销售机构协商调整。如需调整业绩报酬计提基准，管理人应在开放日  $T$  日三个工作日前，公布调整后的业绩报酬计提基准，管理人在

站或本合同约定其他方式公告前述事项即视为履行了告知义务。业绩报酬计提基准如有调整，管理人应不晚于开放日 T 日出具说明函告知行政服务机构调整后的业绩报酬计提基准，行政服务机构不对业绩报酬计提基准的调整承担任何责任。由于管理人未及时提供调整后的业绩报酬计提基准而导致的业绩报酬计提不准确，行政服务机构不承担任何责任。对于开放日后仍持有份额的委托人，计提业绩报酬均使用业绩报酬计提日当日的业绩报酬计提基准计算。

③ 业绩报酬支付

业绩报酬分为浮动管理服务费及浮动投资顾问费。

浮动投资顾问费=70%\*业绩报酬

浮动管理服务费=30%\*业绩报酬

计划资产管理人在单个计划份额持有人【退出或清算】款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，计划资产托管人根据计划资产管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到计划募集账户，

网站或本合同约定其他方式公告前述事项即视为履行了告知义务。业绩报酬计提基准如有调整，管理人应不晚于开放日 T 日出具说明函告知行政服务机构调整后的业绩报酬计提基准，行政服务机构不对业绩报酬计提基准的调整承担任何责任。由于管理人未及时提供调整后的业绩报酬计提基准而导致的业绩报酬计提不准确，行政服务机构不承担任何责任。对于开放日后仍持有份额的委托人，计提业绩报酬均使用业绩报酬计提日当日的业绩报酬计提基准计算。

③ 业绩报酬支付

业绩报酬分为浮动管理服务费及浮动投资顾问费。

浮动投资顾问费=70%\*业绩报酬

浮动管理服务费=30%\*业绩报酬

计划资产管理人在单个计划份额持有人【退出或清算】款项（以下简称“退出金额”）中分别予以相应扣除，即退出金额支付日，计划资产托管人根据计划资产管理人的指令将退出金额（含业绩报酬）划拨到计划募集账户，

<p>计划资产管理人或其委托的计划行政服务机构将归资产管理人和投资顾问所有的业绩报酬分别支付给计划资产管理人和投资顾问后，将剩余的退出金额支付给计划份额持有人。</p> <p>资产管理人指定收费的银行账户为：</p> <p>    账户名称：中银国际期货有限责任公司</p> <p>    账号：452059215520</p> <p>    开户银行：中国银行上海市期货大厦支行</p> <p>    上述第（一）款第 6-11 项费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由资产托管人从计划财产中支付。制费/股东卡开户费用若由托管人在开立托管账户或开立股东卡时先行垫付，自资产管理计划成立后由托管人自动从资产管理计划中扣划，资产管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。</p>	<p>计划资产管理人或其委托的计划行政服务机构将归资产管理人和投资顾问所有的业绩报酬分别支付给计划资产管理人和投资顾问后，将剩余的退出金额支付给计划份额持有人。</p> <p>资产管理人指定收费的银行账户为：</p> <p>    账户名称：中银国际期货有限责任公司</p> <p>    账号：452059215520</p> <p>    开户银行：中国银行上海市期货大厦支行</p> <p>    上述第（一）款第 6-11 项费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入或摊入当期费用，由资产托管人从计划财产中支付。制费/股东卡开户费用若由托管人在开立托管账户或开立股东卡时先行垫付，自资产管理计划成立后由托管人自动从资产管理计划中扣划，资产管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，资产管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。</p>
--	--

本公告作为资产管理合同的补充协议，与资产管理合同具有同等法律效力。自本公告发布之日起生效执行。本公告与三方签署的资产管理合同约定相冲突或不一致之条款，均以本公告为准。

特此公告。

中银国际期货有限责任公司  
2021年5月26日



二八、