

关于祺瑛增财沪深 300 指数增强 1 号私募证券投资基金 基金合同变更（202302）通知函

尊敬的投资者：

上海祺瑛投资管理有限公司（以下简称“我司”）发行成立的祺瑛增财沪深 300 指数增强 1 号私募证券投资基金（以下简称“该基金”）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，我司根据《祺瑛增财沪深 300 指数增强 1 号私募证券投资基金基金合同》的约定对该基金的业绩报酬进行变更，将 A 类份额业绩报酬计提比例由 40% 降到 10%。具体修改描述如下：

序号 1

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：

本基金只对 A 类份额计提业绩报酬，对 B 类份额不计提业绩报酬。

业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。

当基金份额赎回、基金终止或分红时，若该份额当期收益为正且超过沪深 300 指数（000300）对应期间收益的两倍，则管理人将提取赎回份额或分红份额当期超过沪深 300 指数（000300）对应期间收益的两倍的 U% 作为业绩报酬（但提取业绩报酬之后该份额当期收益不得为负数）。如本次基金分红时间距上次分红时间（如有）不足 3 个月（每月按 30 个自然日计算），则本次基金分红不对基金份额计提业绩报酬。

份额类别	业绩报酬计提比例 U
A 类份额	40
B 类份额	0

业绩报酬的计提方法如下：

当基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据基金份额持有人

每一基金份额的当期收益率（R）相对沪深 300 指数（000300）对应期间收益率提取业绩报酬，经计算确认的业绩报酬从基金份额持有人赎回、基金分红款或基金资金清算款中以现金支付。

其中，基金分红时基金参与份额（红利转投份额）的参与日重定为上一个业绩报酬提取日。当分红款少于提取业绩报酬时，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

A=赎回日对应的开放日、分红除权日或基金终止日各类别基金份额累计净值；

$B = \frac{B1-B0}{B0} \times 100\%$ ，B1 为业绩报酬计提日沪深 300 指数（000300）收市价格，B0 为上一个业绩报酬提取日的沪深 300 指数（000300）收市价格，若“上一个业绩报酬提取日”不存在，对于业绩报酬计提基准起始日（不含）之前认/申购份额则为业绩报酬计提基准起始日的沪深 300 指数（000300）收市价格；对于业绩报酬计提基准起始日（含）之后申购的份额则 B0 为该份额申购对应开放日的沪深 300 指数（000300）收市价格。

其中，业绩报酬计提基准起始日由基金管理人指定，基金管理人在确定后应及时通知基金份额持有人、基金托管人和基金服务机构，由于基金管理人未告知到位导致的运营错误由基金管理人承担，托管人和基金服务机构不承担责任。

C=上一个业绩报酬提取基准日各类别基金份额累计净值；若“上一个业绩报酬提取基准日”不存在，则 C 为该份额申购开放日各类别基金份额累计净值（业绩报酬计提基准起始日之后的申购份额）或业绩报酬计提基准起始日各类别基金份额累计净值（业绩报酬计提基准起始日及之前的认/申购份额）；

D=上一个业绩报酬提取日各类别基金份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 D 为该份额申购开放日各类别基金份额净值（业绩报酬计提基准起始日之后的申购份额）或业绩报酬计提基准起始日各类别基金份额净值（业绩报酬计提基准起始日及之前的认/申购份额）；

E=业绩报酬；

F=赎回份额或分红除权日持有份额；

E_{ij} ：上一次基金分红除权日至本次基金分红除权日的存续自然天数（算头不算尾）；

收益率 $R = \frac{A-C}{D} \times 100\%$

业绩报酬计提标准（针对分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{ij} \geq 3$ 个月，每月按 30 个

自然日计算，但对首次通过分红时提取业绩报酬则无需满足本条件）：

当 $R > \text{Max}(2*B, 0)$ 时，对超过 $2*B$ 的收益部分提取 $U\%$ 的业绩报酬（但提取业绩报酬之后该份额当期收益不得为负数），即：

$$E = F \times D \times \text{Min}[(R - 2 \times B) \times U\%, R] ;$$

当 $R \leq \text{Max}(2*B, 0)$ 时，则不提取业绩报酬。

如果管理人已经提取业绩报酬，即使基金份额持有人赎回时净值有所下跌，则该部分已提取的业绩报酬将不退还基金份额持有人。

业绩报酬在基金份额持有人分红、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、分红款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者限定损失金额和比例的承诺。

5、基金管理人的业绩报酬

现条款：

本基金只对 A 类份额计提业绩报酬，对 B 类份额不计提业绩报酬。

业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。

当基金份额赎回、基金终止或分红时，若该份额当期收益为正且超过沪深 300 指数（000300）对应期间收益的两倍，则管理人将提取赎回份额或分红份额当期超过沪深 300 指数（000300）对应期间收益的两倍的 $U\%$ 作为业绩报酬（但提取业绩报酬之后该份额当期收益不得为负数）。如本次基金分红时间距上次分红时间（如有）不足 3 个月（每月按 30 个自然日计算），则本次基金分红不对基金份额计提业绩报酬。

份额类别	业绩报酬计提比例 U
A 类份额	10
B 类份额	0

业绩报酬的计提方法如下：

当基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据基金份额持有人每一基金份额的当期收益率（R）相对沪深 300 指数（000300）对应期间收益率提取业绩报酬，经计算确认的业绩报酬从基金份额持有人赎回、基金分红款或基金资金清算款中以现金支付。

其中，基金分红时基金参与份额（红利转投份额）的参与日重定为上一个业绩报酬提取日。当分红款少于提取业绩报酬时，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。

A=赎回日对应的开放日、分红除权日或基金终止日各类别基金份额累计净值；

$B = \frac{B1-B0}{B0} \times 100\%$ ，B1 为业绩报酬计提日沪深 300 指数（000300）收市价格，B0 为上一个业绩报酬提取日的沪深 300 指数（000300）收市价格，若“上一个业绩报酬提取日”不存在，对于业绩报酬计提基准起始日（不含）之前认/申购份额则为业绩报酬计提基准起始日的沪深 300 指数（000300）收市价格；对于业绩报酬计提基准起始日（含）之后申购的份额则 B0 为该份额申购对应开放日的沪深 300 指数（000300）收市价格。

其中，业绩报酬计提基准起始日由基金管理人指定，基金管理人在确定后应及时通知基金份额持有人、基金托管人和基金服务机构，由于基金管理人未告知到位导致的运营错误由基金管理人承担，托管人和基金服务机构不承担责任。

C=上一个业绩报酬提取基准日各类别基金份额累计净值；若“上一个业绩报酬提取基准日”不存在，则 C 为该份额申购开放日各类别基金份额累计净值（业绩报酬计提基准起始日之后的申购份额）或业绩报酬计提基准起始日各类别基金份额累计净值（业绩报酬计提基准起始日及之前的认/申购份额）；

D=上一个业绩报酬提取日各类别基金份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 D 为该份额申购开放日各类别基金份额净值（业绩报酬计提基准起始日之后的申购份额）或业绩报酬计提基准起始日各类别基金份额净值（业绩报酬计提基准起始日及之前的认/申购份额）；

E=业绩报酬；

F=赎回份额或分红除权日持有份额；

$E_{i,j}$ ：上一次基金分红除权日至本次基金分红除权日的存续自然天数（算头不算尾）；

收益率 $R = \frac{A-C}{D} \times 100\%$



业绩报酬计提标准（针对分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{ij} \geq 3$ 个月，每月按30个自然日计算，但对首次通过分红时提取业绩报酬则无需满足本条件）：

当 $R > \text{Max}(2*B, 0)$ 时，对超过 $2*B$ 的收益部分提取 $U\%$ 的业绩报酬（但提取业绩报酬之后该份额当期收益不得为负数），即：

$$E = F \times D \times \text{Min}[(R - 2 \times B) \times U\%, R] ;$$

当 $R \leq \text{Max}(2*B, 0)$ 时，则不提取业绩报酬。

如果管理人已经提取业绩报酬，即使基金份额持有人赎回时净值有所下跌，则该部分已提取的业绩报酬将不退还基金份额持有人。

业绩报酬在基金份额持有人分红、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、分红款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者限定损失金额和比例的承诺。

本合同变更的生效日期为：2023年7月11日。

我司承诺合同变更生效后将按根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求及时履行报告义务以及向投资者披露。特此通知。

我司承诺本次合同变更生效后，在合同变更生效日之后进行申购的投资者所签署合同为根据变更内容调整后的最新有效的基金合同。因新投资人签署合同版本与实际不符而导致的损失，由管理人承担相应的责任，托管人不承担任何责任。

上海祺瑛投资管理有限公司

2023年7月11日