

关于中航证券鑫航双季聚利1号集合资产管理计划业绩报酬表述修订的公告

尊敬的投资者：

中航证券鑫航双季聚利1号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）是由中航证券有限公司（以下简称“我司”）作为管理人，招商银行股份有限公司天津分行作为托管人设立的一只集合资产管理计划，我司在取得托管行同意后，于2023年6月27日发布《关于中航证券鑫航双季聚利1号集合资产管理计划资产管理合同变更的公告》，并按照合同约定履行后续合同变更相关程序定于2023年7月5日生效。（经2023年6月27日发布《关于中航证券鑫航双季聚利1号集合资产管理计划资产管理合同变更的公告》修改的资产管理合同称为“原资产管理合同”）。为完善原资产管理合同表述，特对原资产管理合同“第二十节 集合计划的费用与税收（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间 2、管理费（2）业绩报酬”进行补充修订，修订内容详见附件。

委托人不同意本次合同补充修订的，可于2024年3月21日退出本集合计划；委托人未在前述时间退出本集合计划的，视为委托人同意本次合同补充修订。本次合同补充修订将于2024年3月26日生效，生效后管理人将根据相关要求将本次修订事项向相关监管机构予以备案。

附件：中航证券鑫航双季聚利1号集合资产管理计划资产管理合同业绩报酬相关表述对比表



附件：中航证券鑫航双季聚利 1 号集合资产管理计划资产管理合同业绩报酬相关表述对比表

修改处	原资产管理合同条款	变更后条款
<p>第二十章 集合计划的费用与税收</p> <p>(二) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>2、管理费</p> <p>(2) 业绩报酬</p>	<p>本集合计划投资者年化收益率低于管理人公布的业绩报酬计提基准时，管理人收取业绩报酬，投资者年化收益率高于管理人公布的业绩报酬计提基准以上的部分，管理人业绩报酬计提比例为 60%。投资者年化收益率计算区间为上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则推广期参与的为计划成立日，存续期参与的为份额参与申请日，下同）到本次业绩报酬计提日，详见业绩报酬计提方法。</p> <p>业绩报酬计提基准仅作为管理人计提业绩报酬的依据，不作为对业绩的承诺。管理人在发生业绩报酬计提基准调整时，公告新的业绩报酬计提基准，在下次业绩报酬计提基准调整之前，都以该业绩报酬计提基准计提业绩报酬。</p> <p>①管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>A、同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算持有期年化收益率、计提业绩报</p>	<p>在本集合计划分红确认日（如有）、投资者退出确认日和清算终止日，将根据投资者的期间年化收益率（R），对期间年化收益率超过业绩报酬计提基准以上的部分按照 60%的比例收取管理人业绩报酬（以下简称“业绩报酬”）。</p> <p>业绩报酬计提基准仅用于计算管理人的业绩报酬，不构成管理人、托管人保证投资者参与资金不受损失或取得最低收益的承诺。管理人在发生业绩报酬计提基准调整时，将通过管理人网站进行公告，具体以管理人公告为准。</p> <p>1) 管理人计提业绩报酬的原则：</p> <p>A、同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬；</p> <p>B、在本集合计划分红确认日（如有）、投资者退出确认日和清算终止日对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；</p> <p>C、在分红确认日（如有）计提业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；</p> <p>D、在投资者退出或清算终止时计提业绩报酬的，业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除；如退出份额为一笔参与份额的一部分，则将该退出份额单独核算业绩报酬，而该笔参与的剩余份额不受影响。</p> <p>E、本集合计划在终止后进入清算期间，投资者持有期间业绩表现依据清算终止日的单位累计净值与上一次业绩报酬计提基准日的单位累计净值之间的变化，而期间长度则依据上一次业绩报酬计提日至本集合计划终止日之间的间隔天数。</p> <p>F、投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序，进行顺序退出的方式确定退出份额，计提退出份额对应的业绩报酬。</p>

<p>酬；</p> <p>B、在分红登记日、投资者退出申请日、计划终止日对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；</p> <p>C、在分红登记日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除；</p> <p>D、在投资者退出或计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；</p> <p>E、投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。</p> <p>②业绩报酬的计提方法：</p> <p>每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如该笔参与份额不存在上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日，则推广期参与的为计划成立日，存续期参与的为份额参与申请日，下同）到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的基准。</p> <p>年化收益率的计算公式如下：</p> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 365 \times 100\%$ <p>业绩报酬计提日为分红登记日、投资者退出申请</p>	<p>2) 业绩报酬的计提方法：</p> <p>业绩报酬计提基准日为本集合计划分红登记日（如有）、投资者退出申请日和清算终止日；业绩报酬计提日为本集合计划分红确认日（如有）、投资者退出确认日和清算终止日。</p> <p>① 期间年化收益率的计算公式如下：</p> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0^*} \div D \times 365 \times 100\%$ <p>P_1为投资者本次业绩报酬计提基准日的单位累计净值；</p> <p>P_0为投资者上一个业绩报酬计提基准日的单位累计净值；</p> <p>P_0^*为投资者上一个业绩报酬计提基准日的单位净值；</p> <p>D表示投资者上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的间隔天数；</p> <p>R为期间年化收益率。</p> <p>注1：“上一个业绩报酬计提基准日”表示每笔参与份额上一个发生过业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日，如投资者该笔份额未发生过业绩报酬计提，募集期参与的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提基准日和上一个业绩报酬计提日；存续期内参与的，以参与申请日为上一个业绩报酬计提基准日，以参与确认日为上一个业绩报酬计提日。</p> <p>注2：本集合计划在终止后进入清算期间，投资者持有期间业绩表现依据清算终止日的单位累计净值与上一次业绩报酬计提基准日的单位累计净值之间的变化，而期间长度则依据上一次业绩报酬计提日至本集合计划终止日之间的间隔天数。</p> <p>②管理人业绩报酬计提如下：</p> <p>在本集合计划分红确认日（如有）、投资者退出确认日和清算终止日计提业绩报酬时，若投资者持有集合计划份额期间，发生业绩报酬计提基准调整，需将投资者期间年化收益率与不同的业绩报酬计提基准进行比较，并加总计算管理人业绩报酬。</p> <table border="1" data-bbox="699 1892 1324 1989"> <tr> <td>年化收益率(R)</td> <td>计提比例</td> <td>业绩报酬(Y)的计提公式</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </table>	年化收益率(R)	计提比例	业绩报酬(Y)的计提公式			
年化收益率(R)	计提比例	业绩报酬(Y)的计提公式					

<p>日或计划终止日； P_1为业绩报酬计提日的集合计划的单位累计净值； P_0为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值； P_0^*为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值； D表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数； R为年化收益率。</p> <p>管理人业绩报酬计提如下：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>计提比例</th> <th>业绩报酬(Y)的计提公式</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>$R \geq$ 业绩报酬计提基准</td> <td>60%</td> <td>$Y = N \times P_0^* \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times D \div 365$</td> </tr> </tbody> </table>	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬(Y)的计提公式	$R \geq$ 业绩报酬计提基准	60%	$Y = N \times P_0^* \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times D \div 365$	<p>$R \geq$ 业绩报酬计提基准</p>	<p>60%</p>	$Y = \sum_{i=1}^n [N \times P_i^* \times (R - X_i) \times 60\% \times (T_i \div 365)]$
	年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬(Y)的计提公式						
$R \geq$ 业绩报酬计提基准	60%	$Y = N \times P_0^* \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times D \div 365$							
<p>注：若投资者持有集合计划份额期间，发生业绩报酬计提基准调整，需将投资者年化收益率与不同的业绩报酬计提基准进行比较，并加总计算管理人业绩报酬。</p> <p>Y = 业绩报酬； N = 业绩报酬计提日投资者每笔符合业绩报酬计提条件的份额； P_0^* = 上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值。</p> <p>③业绩报酬支付：由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个</p>	<p>Y = 该笔参与份额对应的业绩报酬； N = 业绩报酬计提日投资者该笔符合业绩报酬计提条件的份额； P_i^* = 投资者上一个业绩报酬计提基准日的单位净值 (P_1^*) 以及每个业绩报酬计提基准调整日前一工作日的单位净值 ($P_2^* \dots \dots P_n^*$)。 X_i = 该笔份额采用的每个业绩报酬计提基准 T_i = 该笔份额采用每个业绩报酬计提基准的天数。</p> <p>③如投资者有多笔参与份额，分别计算每笔份额的业绩报酬，并加总后计算管理人业绩报酬。</p> <p>3) 业绩报酬支付：由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个工作日内将业绩报酬划拨给管理人。从分红资金中提取业绩报酬的频率不超过每6个月一次。因投资者退出资产管理计划，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。当集合计划份额退出或集合计划终止时，托管人根据管理人的指令将退出净值总额（含业绩报酬和退出费用）或分红金额（含业绩报酬）划拨给份额登记机构专用账户，由份额登记机构将业绩报酬和退出费用支付给管理人，并将扣除业绩报酬和退出费用的退出款项转入销售机构在份额登记机构的资金账户。托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。</p> <p>业绩报酬收费账户信息如下： 户名：中航证券有限公司 开户行：招商银行股份有限公司南昌站前西路支行 账号：791900068410866</p>								

工作日内将业绩报酬划拨给管理人。从分红资金中提取业绩报酬的频率不超过每6个月一次。因投资者退出资产管理计划，管理人按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。当集合计划份额退出或集合计划终止时，托管人根据管理人的指令将退出净值总额（含业绩报酬和退出费用）或分红金额（含业绩报酬）划拨给份额登记机构专用账户，由份额登记机构将业绩报酬和退出费用支付给管理人，并将扣除业绩报酬和退出费用的退出款项转入推广机构在份额登记机构的资金账户。托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

