

关于中信建投基金-稳富 9 号资产管理计划 资产管理合同条款变更的通知

尊敬的资产委托人：

我公司管理、国泰君安证券股份有限公司托管的中信建投基金-稳富 9 号资产管理计划（下称“本计划”）于 2016 年 9 月 22 日成立。根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（下称“《管理办法》”）及配套规则、《中信建投基金-稳富 9 号资产管理计划资产管理合同》及其补充协议（以下合称“《资管合同》”）的规定，经管理人、托管人协商一致，对本计划《资管合同》如下事项进行调整：

一、根据最新监管规定调整本计划管理人业绩报酬的相关表述

将《资管合同》第五十五条第（三）款业绩报酬的表述调整为：

业绩报酬的计提原则：本计划的业绩报酬在投资者部分或全部退出、本计划分红（按规定不计提业绩报酬的除外）、本计划终止清算时针对退出份额、分红基准份额和终止清算份额计提。业绩报酬提取时点为退出确认日、分红确认日和计划终止清算日，业绩报酬计提基准为 Y_N ($N=1/2/3\cdots N$)，业绩报酬提取比例为 60%。

业绩报酬计提基准 Y_N 可能由于市场情况变动以及根据市场情况变动对资产组合配置进行相应调整而发生变化，具体业绩报酬计提基准 Y_N 以管理人公布的《中信建投基金-稳富 9 号资产管理计划关于下一运作周期业绩报酬计提基准的通知》（具体名称以届时的公告为准）中的约定为准。

本计划在退出确认日提取的业绩报酬，从投资者的退出资金中扣除；在计划终止清算日提取的业绩报酬，从投资者的清算资金中扣除；本计划分红且按规定可以计提业绩报酬的，单笔业绩报酬计提金额不超过分红金额，从分红资金中扣除。

如退出份额为一笔认购/参与份额的一部分，则将该部分退出份额直接进行核算；若持有人在退出前多次认购/参与，则退出时对份额采取“先进先出”的原则进行计算。当计划终止清算时，涉及多次清算的，每次清算确认日计提业绩报酬，应按本合同规定计提业绩报酬。如业绩报酬计提日所涉份额之来源为非交

中信建投
骑

易过户等,其份额明细继承原份额的注册日期、最近业绩报酬计提日等基本属性。

(1) 当计提业绩报酬时,年化收益率 R 小于等于 Y_N 的最小值,不提取业绩报酬;

(2) 当计提业绩报酬时,年化收益率 R 大于 Y_N 的最小值,则业绩报酬为 R 按照不同区间对应业绩报酬计提基准的部分计提 60% 业绩报酬的和。

业绩报酬的计算公式:

$$(1) PF = \sum_{j=1}^n PF_j$$

$$(2) R = \frac{NAV_e - HWM_j}{HWM_j \times T_j} \times 365$$

(3) $PF_j = \min[\max\{\sum_{N=1}^N (R - Y_N) \times 60\% \times \frac{HWM_j \times T_N}{365} \times F_j, 0\}, Y]$ (分红计提业绩报酬适用)

$PF_j = \max\{\sum_{N=1}^N (R - Y_N) \times 60\% \times \frac{HWM_j \times T_N}{365} \times F_j, 0\}$ (退出、终止清算计提业绩报酬适用)

其中:

PF : 投资者于退出确认日/分红确认日/计划终止清算日应计提的全部业绩报酬;

PF_j : 业绩报酬计提日投资者第 j 笔投资的明细份额所对应的应计提业绩报酬,其中分红时以该笔投资实际分红金额 Y 为限;

F_j : 退出确认日提取业绩报酬时,表示投资者退出份额中第 j 笔投资对应的本计划份额;计划分红确认日提取业绩报酬时,表示投资者分红时持有的第 j 笔投资对应的本计划份额;计划终止清算日提取业绩报酬时,表示投资者终止清算时持有的第 j 笔投资对应的本计划份额;

NAV_e : 投资者退出申请日/分红除权除息日之前一工作日/计划终止清算日的计划份额累计单位净值;

HWM_j : 若该笔份额已经计提过业绩报酬,为投资者第 j 笔上一次成功计提业绩报酬基准日的计划份额累计净值;若该笔份额还未计提过业绩报酬,为投资

者第 j 笔投资参与时计划份额累计净值(如第 j 笔投资为本公告发布日之前取得的份额, 则 HWM_j 为 2023 年 3 月 22 日的计划份额累计单位净值);

HWM_j' : 若该笔份额已经计提过业绩报酬, 为投资者第 j 笔投资的上一次成功计提业绩报酬基准日的计划份额净值; 若该笔份额还未计提过业绩报酬, 则为投资者第 j 笔投资参与时计划份额净值(如第 j 笔投资为本公告发布日之前取得的份额, 则 HWM_j' 为 2023 年 3 月 22 日的计划份额单位净值);

T_j : 投资者第 j 笔投资上一次业绩报酬计提基准日与参与申请日的孰近日(如第 j 笔投资为本公告发布日之前取得的份额, 则为 2023 年 3 月 22 日)至本次业绩报酬计提基准日(退出申请日/分红确认日/计划终止清算日)之间的实际天数(算尾不算头);

Y_N ($N = 1/2/3...N$): 为不同区间的业绩报酬计提基准, 具体以《中信建投基金-稳富 9 号资产管理计划关于下一运作周期业绩报酬计提基准的通知》(具体名称以届时的公告为准)为准;

T_N ($N = 1/2/3...N$): 投资者第 j 笔投资对应份额在上一次业绩报酬计提基准日与参与日的孰近日(如第 j 笔投资为本公告发布日之前取得的份额, 则为 2023 年 3 月 22 日)至本次业绩报酬计提基准日(退出申请日/分红确认日/计划终止清算日)之间适用不同区间业绩报酬计提基准的实际天数(算尾不算头),

$\Sigma T_N = T_j$;

R: 投资者第 j 笔投资在上一次业绩报酬计提基准日与参与日的孰近日(如第 j 笔投资为本公告发布日之前取得的份额, 则为 2023 年 3 月 22 日)至本次业绩报酬计提基准日(退出申请日/分红确认日/计划终止清算日)之间的年化收益率;

M 为分红除权除息日前一工作日实质违约投资标的的应收利息余额、未核销的市值余额之和。

如果 PF_j 计算结果为零, 则不对该计提日投资者第 j 笔投资提取业绩报酬。

除权除息日: 根据计划分红情况, 对本次分红业务进行账务处理的日期, 一般情形下, 分红后除权除息日当天的计划份额单位净值下降。除权除息日具体以管理人发布分红公告或管理人按照本合同约定的信息披露方式告知资产委托人

基金管理有限
缝专用

的日期为准。

退出确认日：对投资者退出份额金额确认的日期。

分红处理日：计划分红，对本次分红业务进行明细确认的日期。分红处理日具体以管理人发布分红公告或管理人按照本合同约定的信息披露方式告知资产委托人的日期为准。

计划终止清算日：是指计划终止后，对计划财产逐次清算处理之日。

当本计划分红除权除息日前一工作日的 M 占当日计划资产净值的比例超过 3%的，该次分红管理人有权不计提业绩报酬；当分红计提业绩报酬且除权除息日与退出开放日为同一日的，管理人有权对投资者于该日的退出份额不计提业绩报酬。

本计划连续两次计提业绩报酬基准日的间隔期应在 6 个月以上(包括本数)，但因管理人在投资者退出计划份额时或在计划终止清算时计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制，也不纳入间隔期考虑范围。

提示：上述年化投资收益率、业绩报酬计提基准仅为管理人计提业绩报酬的计算依据，不作为管理人对本计划未来收益的预测和保证。

委托人在退出前如多次参与，则退出时对计划份额采取“先进先出”的原则进行计算，故存在委托人虽整体亏损，但是因部分份额有盈利，管理人仍然计提了业绩报酬的情况。另，因上述分红处理日计提业绩报酬的机制，如分红后退出确认或终止清算时份额累计净值低于或远低于分红处理日份额累计净值，亦存在委托人虽整体亏损，管理人仍然计提了业绩报酬的情况。

若本计划在分红时提取业绩报酬的，根据上述业绩报酬计算公式，业绩报酬从向投资者分配的分红资金中扣除且不超过分红资金，可能会存在投资者实际收到的现金分红款少于计划管理人披露的分配方案中载明的分红金额的情形。

同时根据上述业绩报酬的计提方式，本计划分红时，业绩报酬的计提依据为累计净值增值部分，而非分红金额部分，故存在计提的业绩报酬占分红金额的比例不等于业绩报酬计提比例，甚至存在分红金额全为业绩报酬，导致虽分红但投资者实际未获得任何分红款的情况。

业绩报酬由资产管理人负责计算及复核，业绩报酬的支付由管理人向托管人发送划付指令，托管人根据划付指令从计划财产中支付给管理人。

二、根据最新监管规定调整本计划被动超标的相关约定

将《资管合同》第三十六条第（六）款、第四十九条中关于被动超标的表述调整为：“因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致资产管理计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，证券期货经营机构应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十个交易日内调整至符合相关要求。”

三、若后续法律法规、部门规章及自律规则有最新规定的，本计划将按照最新规定执行。

四、本公告自发布之日起生效并实施。请委托人及时登陆管理人网站【www.cfund108.com】并查阅相关公告内容。本计划委托人登录账号为委托人开户时使用的有效证件号码（自然人为身份证件号码，机构客户为统一社会信用代码，产品客户为基金账号或者具有唯一性的证件号码），登陆密码及其他登陆信息详询资产管理人客服热线：4009-108-108。

特此通知。



中信建投基金管理有限公司

2023年6月7日