

认购/参与告知书
(编号: CMWA-多元挂钩-新利增强 3 号-005)

尊敬的委托人:

在您此次认购/参与“招商财富-多元挂钩-新利增强 3 号集合资产管理计划”(以下简称“本计划”)前,请对本计划的以下内容进行确认:

一、基本信息

本计划第五个运作期到期日:【2024 年 12 月 20 日】。

二、业绩报酬计提基准

1. 本计划第五个运作期的业绩报酬计提基准的确定规则为:

期初观察日:【具体以管理人公告为准】

挂钩标的 1:【中证 500 指数(代码:000905.SH),参考网页:<http://www.csindex.com.cn/>】

挂钩标的 2:【沪深 300 指数(代码:000300.SH),参考网页:<http://www.csindex.com.cn/>】

观察期:期初观察日(含)至运作期到期日(含)的全部交易日

交易日:上海证券交易所、深圳证券交易所和北京证券交易所预定开市的正常交易日

参与率 1:【100%】

参与率 2:【50%】

期初参考价 1:挂钩标的 1 在期初观察日 13:00-15:00 的算术平均价

期末参考价 1:挂钩标的 1 在运作期到期日 13:00-15:00 的算术平均价

期初参考价 2:本计划所投挂钩标的 2 指数期权的行权价(行权价参考期初观察日挂钩标的 2 的实际点位)

期末参考价 2:挂钩标的 2 在运作期到期日 13:00-15:00 的算术平均价

以上期初/期末参考价计算方法参考股指期货合约交割结算价的计算方法,即标的指数最后 2 小时的算术平均价。

以上参考价具体以管理人公告为准。

2. 本计划第五个运作期的业绩报酬计提基准约定如下:

业绩报酬计提基准(年化) = 【挂钩标的 1 涨跌幅*参与率 1+ max(0, 挂钩标的 2 涨跌幅*参与率 2)】÷期初观察日(含)至退出日或运作期到期日(不含)的自然日天数×365-
年化税费(如有)



其中，

$$\text{年化税费} = \text{MAX} \left(0, \frac{(\text{ET}-\text{E1}) \times 0.03 \times 1.12 \times 365}{\text{E0} \times 1.03 \times \text{持有天数}} \right)$$

ET 为运作期到期日累计单位净值

E1 为期初观察日累计单位净值

E0 为期初观察日单位净值

挂钩标的 i 涨跌幅 = 期末参考价 i ÷ 期初参考价 i-1

以上以实际存续天数计算，年化基数 365 天，按照四舍五入法精确到小数点后 2 位。

资产管理人特别声明：本计划的业绩报酬计提基准仅是资产管理人提取业绩报酬的标准，并非本计划预期收益率，不构成资产管理人对受托财产收益状况的任何承诺或保证，本计划设置业绩报酬计提基准不代表投资者退出本计划时可按照业绩报酬计提基准数值获得投资收益。因本计划所投资资产的价格受市场波动、交易对手信用风险、流动性风险等各种因素影响，本计划可能无法实现投资收益目标，或者客户持有的份额本运作期内实际年化收益率可能低于业绩报酬计提基准。管理人不保证受托资产不受损失或产生收益，投资者可能面临受托财产本金部分或全部受损的风险。

其中，年化税费为调减项，相关计算公式系为计算业绩报酬计提基准的简要计算参考公式，并非资产管理计划实际产生的增值税计算标准。本计划存续期间实际产生的增值税以其持有的每个应税投资标的存续期间已实现的投资收益为基础计算，受投资标的收益实现后再投资、已实现亏损不得转入下一个会计年度、贷款服务收入与金融商品转让价差无法相互抵扣等投资策略、税收相关的法律法规和税收政策影响，上述参考公式的计算结果并非资产管理计划本身实际缴纳税费的情况，可能出现包括但不限于本计划亏损情况下仍需承担增值税及附加、实际缴纳增值税及附加金额与上述参考公式的计算结果差异较大等情形。因此，请委托人充分知悉，业绩报酬计提基准公式中相关调减项仅用于计算业绩报酬计提基准，不构成资产管理人对计划实际缴纳税费以及投资收益的承诺和保证。前述风险可能对本计划的收益产生影响，导致本计划可能无法实现投资收益目标，或者客户持有的份额本运作期内实际年化收益率低于业绩报酬计提基准。

三、其他

1. 本计划的实际基本信息及业绩报酬计提基准的确定规则与本《认购/参与告知书》不一致的，以资产管理人通过“招商财富-多元挂钩-新利增强3号集合资产管理计划认购/参与告知书补充公告”的形式另行公告为准。

2. 资产管理人会根据市场情况，公布每个运作期相应的业绩报酬计提基准。新认购/参与份额的业绩报酬计提基准以其签署的《认购/参与告知书》为准，投资者对新的《认购/参与告知书》内容不接受的，可以选择在最近一个开放日退出。上个运作期末日未在该开放期申请退出而继续存续的投资者，视为已知悉并同意适用当期资产管理人提前最新公布的《认购/参与告知书》中的全部内容。

招商财富资产管理有限公司

2024年6月7日

资产委托人声明：本人已仔细阅读《认购/参与告知书》（编号：CMWA-多元挂钩-新利增强3号-005），确认本计划的相关内容，并决定认购/参与本计划。

资产委托人签章：

年 月 日