

# 关于国融证券合高1号集合资产管理计划

## 第3次收益分配及份额调整方案的公告

尊敬的国融证券合高1号集合资产管理计划投资者及托管人：

根据《国融证券合高1号集合资产管理计划资产管理合同》（合同编号：国融证券合同【21】第1075号，以下简称《资产管理合同》）的有关规定，我司作为“国融证券合高1号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）的管理人，决定以截至2024年11月18日可供分配的利润为基准进行收益分配，经管理人制定并由托管人兴业证券股份有限公司复核，现将本集合计划第3次收益分配的方案公告如下：

### 一、收益的构成

本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。

### 二、收益分配对象

在2024年11月18日（不包括本收益分配基准日）前购入的计划份额，并在2024年11月18日当天登记在册份额的所有投资者。

### 三、收益分配原则

1. 每份集合计划份额享有同等收益分配权。
2. 本集合计划采用现金分红的方式分配收益。
3. 在符合有关收益分配条件和收益分配原则的前提下，管理人有权进行收益分配。集合计划收益分配基准日的集合计划份额净值减去集合计划份额收益分配金额后不能低于集合计划份额面值。
4. 本集合计划收益分配基准日指享有收益分配权益的计划份额的登记日期，只有在收益分配基准日（不包括本收益分配基准日）前购入的计划份额，并在收益分配基准日当天登记在册的份额才有资格参加收益分配，具体以管理人公告为准。
5. 红利分配时所发生的银行转账等费用由投资者承担。
6. 当日申购的集合计划份额自下一个工作日起享有集合计划的分配权益；当日退出的集合计划份额自下一工作日起，不享有集合计划的分配权益。



7. 法律、法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 四、可供分配收益

本次收益分配的可供分配收益为截至2024年11月18日集合计划未分配利润。

收益分配金额=投资者份额数\*(2024年11月18日收益分配之前的单位净值)-管理人业绩报酬-投资者本金。

具体计算规则如下：

1. 产品年化收益率(R) =  $(P1 - P0) / P \times 365 / N \times 100\%$

其中：

P1为本次收益分配基准日的集合计划单位累计净值；

P0为上一收益分配基准日(若无上一收益分配基准日，则为集合计划成立日)集合计划的单位累计净值；

P为上一收益分配基准日(若无上一收益分配基准日，则为集合计划成立日)集合计划的单位净值；

N为上一收益分配基准日至本次收益分配基准日之间的天数，(若无上一收益分配基准日，则为集合计划成立日)；

2. 单个投资者单笔投资计划份额业绩报酬计算公式如下：

$$PF_{i,j} = F_{i,j} \times (NAV'_1 - HWM_{t_j}) \times Y$$

Y：业绩报酬提取比例为 20%；

$PF_{i,j}$ ：本计提日第 i 个投资者第 j 笔投资的业绩报酬；

$F_{i,j}$ ：收益分配日(若有)提取时，表示第 i 个投资者持有的第 j 笔投资的计划份额；退出日提取时，表示第 i 个投资者退出份额中第 j 笔投资的计划份额；计划终止日提取时，表示第 i 个投资者终止清算时持有的第 j 笔投资的计划份额；

$NAV'_1$ ：本次业绩报酬计提基准日计划份额累计净值；

$HWM_{t_j}$ ：第 i 个投资者第 j 笔投资的高水位，为该笔份额上一次提取业绩报酬时的计划份额累计净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则  $HWM_{t_j}$  为投资者在取得该笔份额时对应的认购/参与/除息日的计划份额累计净值；

如果  $PF_{i,j}$  计算结果为负或者为零，则该计提日第 i 个投资者第 j 笔投资提

取的业绩报酬为零，管理人就该笔投资不提取业绩报酬。

某计提日提取的业绩报酬总额为该计提日所有单个投资者各笔投资业绩报酬之和（包括从退出资金、分红资金（若有）或清算资金中扣除的业绩报酬，下同）。某计提日单个计划投资者计提的业绩报酬总额为该投资者持有的各笔投资业绩报酬之和。管理人业绩报酬以现金方式支付。

注：单个投资者单笔投资业绩报酬保留到小数点后2位，小数点后第3位四舍五入。

## 五、收益分配时间及分配方式

（一）本次分配权益期间：2023年4月18日（不含该日）至2024年11月18日（含该日）。

（二）本次收益分配发放时间：在2024年11月18日后五个工作日内发放。

（三）本次收益分配方式：现金分红。

## 六、收益分配金额

分配金额为自本集合计划自2023年4月18日（不含该日）至2024年11月18日（含该日）的全部收益，具体发放金额以管理人公告为准。

## 七、份额调整

由于本集合计划开放频次较高，投资者均按照开放日的单位净值确认份额，使得收益分配完成后的产品净值不为1.0000元，各投资者均以公允的价格获得收益。

根据《资产管理合同》的相关约定，管理人将在2024年11月18日日终对各投资者按单位净值1.0000元重新确认份额，在本次收益分配后，将根据各投资者原持有份额及参与价格折算成新的份额数（即按照投资者参与产品时的本金确认份额）。

特此公告。

  
国融证券股份有限公司  
2024年11月18日