

招商财富-多元挂钩-莞盈新利 38 号集合资产管理计划

开放公告

尊敬的资产委托人：

根据《招商财富-多元挂钩-莞盈新利 38 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》，合同编号：CMWA-多元挂钩-莞盈新利 38 号-ZCGLHT）及《招商财富-多元挂钩-莞盈新利 38 号集合资产管理计划认购/参与告知书》（以下简称《认购/参与告知书》，编号：CMWA-多元挂钩-莞盈新利 38 号-003）约定，“招商财富-多元挂钩-莞盈新利 38 号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）第三个运作期将于 2024 年 10 月 23 日到期。

《资产管理合同》约定：“本计划自投资起始日起每三个月至多开放一次计划份额的退出，每个运作期到期日以及每个运作期到期日的次一交易日开放一次计划份额的退出及参与；

本计划开放日为 T 日（为退出日）和 T+1 日（为参与日），原则上 T-3 日至 T-2 日为本计划的退出预约申请日，T-5 日至 T 日为本计划的参与预约申请日，开放日及退出/参与预约申请日均为交易日，具体开放期及开放安排以《认购/参与告知书》或管理人公告为准。”

我司作为本计划的资产管理人，决定设置 2024 年 10 月 23 日为开放退出日，退出预约申请日为 2024 年 10 月 18 日至 2024 年 10 月 21 日；设置 2024 年 10 月 24 日为开放参与日，参与预约申请日为 2024 年 10 月 16 日至 2024 年 10 月 23 日。

资产委托人需在上述退出/参与预约申请日申请办理本计划的退出/参与（本计划开放日不接受退出/参与预约申请），且该退出/参与申请不可撤销。未在本次退出预约申请日提交退出申请而继续存续的资产委托人，将视为已知悉且同意适用第四个运作期的《认购/参与告知书》中的全部内容。本计划第四个运作期的《认购/参与告知书》请参见附件。

特此公告。

招商财富资产管理有限公司（盖章）

2024 年 10 月 10 日

附件：《认购/参与告知书》

认购/参与告知书

(编号: CMWA-多元挂钩-莞盈新利 38 号-004)

尊敬的委托人:

在您此次认购/参与“招商财富-多元挂钩-莞盈新利 38 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

1. 本计划第四个运作期到期日:【2025 年 10 月 17 日】
2. 本计划第四个运作期的开放日(T 日):即退出日应为交易日;由本计划第四个运作期的开放退出日暂拟定【2025 年 01 月 23 日、2025 年 04 月 24 日、2025 年 07 月 24 日】,如遇非交易日则顺延至下一交易日;具体开放日以管理人公告为准。
3. 退出预约申请日:T-3 日至 T-2 日,均为交易日。
4. 退出规则:
 - (1) 计划自第四个运作期投资起始日起每三个月至多开放一次计划份额的退出,本计划开放日 T 日(为退出日)为交易日;
 - (2) 本计划退出预约申请期内投资者的退出预约申请不可撤销,否则由此造成的损失由投资者及受托财产承担。在合同约定的开放期内,投资者可根据上述开放规则预约申请办理本资产管理计划份额的退出(本计划开放日不接受退出预约申请),资产管理人于本计划的开放日进行受理。投资者于非退出预约申请期内提出退出申请的,资产管理人均有权拒绝。
 - (3) 本计划仅接受投资者计划份额一次性全部退出申请,不接受计划份额部分退出申请。当资产委托人持有的计划份额资产净值高于或等于 100 万元人民币时,委托人仅可选择一次性全部退出资产管理计划份额;委托人选择部分退出资产管理计划份额的,资产管理人将对剩余持有的计划份额做强制退出处理。
5. 本计划第四个运作期内每三个月分配一次,每次分配时以本计划托管账户上现金为限,每份份额的分配金额原则上为:

【1.8】% \div 365 \times T \times 第四个运作期投资起始日单位净值

T 为期初观察日/上一个退出日(含)至本次分配基准日(不含)的自然日天数

本计划第四个运作期内分配基准日原则上为退出日,如有特殊情况,以管理人公告为准。



本计划季度分配并非收益分配，仅为期间现金分配，产品运作期到期时仍存在本金亏损或业绩报酬计提基准不能实现的风险。

二、业绩报酬计提基准

1. 本计划第四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：【中证 500 指数(代码:000905.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

期初参考价：挂钩标的在期初观察日的收盘价

期末参考价：挂钩标的在运作期到期日的收盘价

退出价格：挂钩标的在退出日的收盘价

2. 本计划第四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） = 挂钩标的涨跌幅 ÷ 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 + 【1.8%】 - 年化税费（如有）

其中，

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

ET 为退出日/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

挂钩标的涨跌幅 = 退出价格或期末参考价 ÷ 期初参考价 - 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投资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，或客户持有的份额本运作期内实际年化投资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-莞盈新利 38 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。

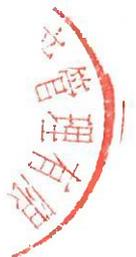
2. 资产管理人会根据市场情况，公布每个运作期相应的业绩报酬计提基准。新认购/参与份额的业绩报酬计提基准以其签署的《认购/参与告知书》为准，上个运作期到期日未在该开放期申请退出而继续存续的投资者，视为已知悉并同意适用当期资产管理人提前最新公布的《认购/参与告知书》中的全部内容。

3. 管理人有权于本计划第四个运作期到期日提前终止本计划。

4. 请投资者特别关注本计划投资运作可能面临的以下风险：

再投资风险：根据资管合同约定，本计划存续期间管理人可对计划所投资的资产因交易、分配或到期等原因收到的利息、投资收益、本金等现金流进行再投资，因再投资资产的品种、交易时间、交易本金、投资收益等交易要素随市场变化而变化，本计划可能面临预定投资策略下再投资回报不确定的再投资风险。该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投资收益率低于业绩报酬计提基准。投资者可能面临受托财产本金部分或全部受损的风险。

收益互换等场外衍生品合约价格波动或提前终止风险：本计划拟投资于收益互换等



场外衍生品合约，可能存在因挂钩标的市场表现、影响衍生品价格的要素波动、衍生品合约收益条款发生变更、调整或终止、以及场外衍生品交易对手方的信用变化等因素，或因相关法律、法规、监管规则的变化，或因不可抗力、政府行为，或因标的被取消交易，或因证监会及交易所等监管或自律组织的交易限制、窗口指导等其他非管理人可以控制的事件，导致出现管理人继续执行本计划所投资的衍生品交易的行为构成违法违规，或被提前要求终止交易、调整合约条款及要素，或将导致本计划出现无法按原有策略进行投资等情形，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投资收益率低于业绩报酬计提基准，投资者可能面临受托财产本金部分或全部受损的风险。


招商财富资产管理有限公司
2024年10月10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-莞盈新利 38号-004），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