

招商财富-佳利 1 号 FOF 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-佳利 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称《资产管理合同》）及第一个运作期《招商财富-佳利 1 号 FOF 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》）约定，“招商财富-佳利 1 号 FOF 集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）第 1 个运作期将于 2024 年 1 月 29 日到期。

《资产管理合同》约定：“本计划自投资起始日起分为多个运作期，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；本计划的开放频率不超过每三个月开放一次。

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 1 月 29 日为开放退出日，退出预约申请日为 2024 年 1 月 24 日至 2024 年 1 月 25 日；设置 2024 年 1 月 30 日为开放参与日，参与预约申请日为 2024 年 1 月 22 日至 2024 年 1 月 29 日。

资产委托人需在上述退出/参与预约申请期内预约申请办理本计划份额的退出/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期内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 2 个运作期的《认购/参与告知书》中的全部内容。本计划第 2 个运作期的《认购/参与告知书》请详见附件。

特此公告。

招商财富资产管理有限公司

2024年1月19日



附件：《认购/参与告知书》

认购/参与告知书
(编号: CMWA-佳利 1 号 FOF-002)

尊敬的委托人:

在您此次认购/参与“招商财富-佳利 1 号 FOF 集合资产管理计划”(以下简称“本计划”)前,请对本计划第 2 个运作期的以下内容进行确认:

一、基本信息

1. 本计划第 2 个运作期到期日:【2026 年 02 月 02 日】,如该运作期内发生下述的敲出事件,则该运作期于敲出事件发生当日提前到期。
2. 本计划第 2 个运作期的开放日(T 日和 T+1 日):即退出日和参与日,应为交易日;本计划第 2 个运作期的开放退出日暂拟定【2026 年 02 月 02 日】,开放参与日暂拟定【2026 年 02 月 03 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. 参与预约申请日:T-5 日至 T 日,均为交易日。
5. 参与、退出规则:

(1) 本计划自投资起始日起分为多个运作期,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),均为交易日。

(2) 本计划退出或参与预约申请期内投资者的退出/参与预约申请不可撤销,否则由此造成的损失由投资者及委托财产承担。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/参与(本计划开放日不接受退出/参与预约申请),资产管理人于本计划的开放日进行受理。投资者于非退出/参与预约申请期内提出退出/参与申请的,资产管理人均有权拒绝。

二、业绩报酬计提基准

1. 本计划第 2 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】

观察期:期初观察日(含)至第【2】个运作期到期日(含)的全部交易日

挂钩标的:【中证 1000 指数(代码:000852.SH),参考网页:<http://www.csindex.com.cn/>】

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：挂钩标的在第 2 个运作期到期日或提前到期日的收盘价

敲出价格：期初参考价*【100%】（按照四舍五入精确至小数点后 2 位）

敲入价格：期初参考价*【80%】（按照四舍五入精确至小数点后 2 位）

敲出事件：观察期内存在任一敲出观察日挂钩标的收盘价大于或等于敲出价格

敲入事件：观察期内存在某一交易日挂钩标的收盘价小于敲入价格

敲出观察日 i：

敲出观察日 (i)	日期
i=1	2024 年 05 月 07 日
i=2	2024 年 06 月 03 日
i=3	2024 年 07 月 01 日
i=4	2024 年 08 月 01 日
i=5	2024 年 09 月 02 日
i=6	2024 年 10 月 09 日
i=7	2024 年 11 月 01 日
i=8	2024 年 12 月 02 日
i=9	2025 年 01 月 07 日
i=10	2025 年 02 月 06 日
i=11	2025 年 03 月 03 日
i=12	2025 年 04 月 10 日
i=13	2025 年 05 月 07 日
i=14	2025 年 06 月 05 日
i=15	2025 年 07 月 01 日
i=16	2025 年 08 月 01 日
i=17	2025 年 09 月 01 日
i=18	2025 年 10 月 13 日
i=19	2025 年 11 月 03 日
i=20	2025 年 12 月 01 日
i=21	2026 年 01 月 07 日
i=22	2026 年 02 月 02 日

2. 本计划第 2 个运作期的业绩报酬计提基准约定如下：

1) 若观察期内存在任一敲出观察日 i (i=1, 2, ..., 22)，挂钩标的收盘价大于或等于敲出价格，本计划第 2 个运作期于该敲出观察日 i 提前到期，本计划第 2 个运作期的业绩报酬计提基准（年化）为【6%】。

2) 若观察期内所有的敲出观察日挂钩标的的收盘价均小于敲出价格，且观察期内所有交易日挂钩标的收盘价均大于或等于敲入价格，则本计划第 2 个运作期的业绩报酬计提基准（年化）为【6%】。

3) 若观察期内所有的敲出观察日挂钩标的收盘价均小于敲出价格, 且观察期内存在某一交易日挂钩标的收盘价小于敲入价格 (发生敲入事件), 则本计划第 2 个运作期的业绩报酬计提基准 (年化) 为【 $1.5\% + 20\% \times \min(\text{挂钩标的年化涨跌幅}, 0)$ 】。

挂钩标的年化涨跌幅 = (期末参考价 ÷ 期初参考价 - 1) ÷ 期初观察日 (含) 至到期日或提前到期日 (不含) 的自然日天数 × 365

以上以实际存续天数计算, 年化基数 365 天, 未扣除应缴纳相关税费 (如有), 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而不是保证收益率。资产委托人确认并充分了解, 资产管理合同所提及的业绩报酬计提基准仅是本计划管理人提取业绩报酬的标准, 不构成资产管理人、资产托管人对委托财产收益状况的任何承诺或担保, 在某些情况下, 资产委托人可能面临无法获得投资收益甚至委托财产本金受损的风险。

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-佳利 1 号 FOF 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, 投资者对新的运作期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最新公告的《认购/参与告知书》中的全部内容。

3. 管理人有权于本计划第 2 个运作期到期日提前终止本计划。

招商财富资产管理有限公司

2024 年 1 月 19 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-佳利 1 号 FOF-002），
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

