

中信期货信安 1 号集合资产管理计划发行公告

尊敬的投资者：

现将中信期货信安 1 号集合资产管理计划发行事宜公告如下：

产品名称	中信期货信安 1 号集合资产管理计划
产品类型	本计划为固定收益类集合资产管理计划
管理人(发行机构)	中信期货有限公司
托管人	中信银行股份有限公司济南分行
销售机构	中信期货有限公司、上海天天基金销售有限公司。管理人可以根据情况变化增加或减少销售机构，并另行公告。
最低募集规模	本集合计划募集规模不低于 1000 万元，总参与人数不得超过 200 人。
投资范围	<p>本计划的投资范围包括沪深交易所发行、上市的股票（包含上市公司非公开发行股票、新股申购、股票定增）、港股通标的范围内的股票、沪深交易所发行及上市的存托凭证、证券交易所发行及上市的优先股、沪深交易所发行及交易的债券和资产支持证券、银行间市场发行及交易的债券和资产支持证券、可交换债、可转债、银行间市场发行及交易的资产支持票据、央行票据、短期融资券、中期票据、非金融企业债务融资工具、债券正回购、债券逆回购、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款、结构性存款和其他银行存款）、同业存单、公募基金、货币基金、银行及其理财子公司发行的理财产品、证券期货经营机构发行的资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。在履行合同变更程序后，可以变更本合同约定的投资范围。</p>
风险等级	中风险
业绩报酬计提基准	6%，具体见“管理人报酬计提标准、计提方式”。
管理人报酬计提标准、计提方式	<p>管理费按前一日计划资产净值的 0.5% 年费率计提。计算方法如下： $H = E \times 0.5\% \div 365$ H 为每日应计提的管理费 E 为前一日的资产管理计划资产净值（成立当日以初始委托计划份额总数计提）。本计划的管理费每日计提，逐日累计至每季度季末最后一个自然日，按季支付，由管理人与托管人双方核对无误后，管理人有权于次季度后的 5 个工作日内向托管人发送管理费划款指令，托管人收到划款指令后从资产管理计划财产中将应付未付的管理费一次性支付给管理人。</p> <p>本计划于固定时点、资产委托人退出时、计划终止清算时采用单人单笔高水位方式计提资产管理人的业绩报酬。</p> <p>于固定时点计提业绩报酬，业绩报酬计提日为 3 月和 9 月的第一个工作日，前一工作日（2 月和 8 月份的最后一个工作日）为基准日，业绩报酬以扣减投资者份额的方式提取。</p> <p>于退出时计提业绩报酬，退出确认日为业绩报酬计提日，退出日为基准日，业绩报酬从投资者的退出资金中扣除。</p> <p>于终止清算时计提业绩报酬，终止确认日为业绩报酬计提日，终止日为基准日，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除。</p> <p>①期间年化收益率计算 $R = [(P1 - P0) / P0x] \times (365 \div T)$ P1 = 本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值 P0 = 上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值 P0x = 上一个业绩报酬计提基准日的份额净值 T = 上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数</p> <p>②管理人以超额比例的方式提取业绩报酬 管理人根据期间年化收益率对收益率超过 6.0% 以上部分按 50% 的比例计提业绩报酬。具体计算方式如下：</p> <p>期间年化收益率 管理人业绩报酬计算公式 $R \leq 6.0\% \quad E = 0$ $6.0\% < R \quad E = N \times P0x \times (R - 6\%) \times 50\% \times (T \div 365)$ E = 某笔份额对应的管理人业绩报酬</p>



	<p>N=投资者所持的单笔份额数</p> <p>③将所有笔数的管理人业绩报酬加总，得到总的管理人业绩报酬（$\sum E$）。</p> <p>$\sum E=E_1+E_2+E_3+\dots+E_n$</p> <p>其中的 n 为所对应的份额笔数。</p> <p>管理人业绩报酬由管理人负责计算，托管人不进行复核。</p> <p>本计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，但因委托人退出本计划，按照上述约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p>
托管人报酬计提标准、计提方式	<p>本资产管理计划的托管费按前一日计划资产净值的【0.05】%年费率计提。托管费的计算方法如下：</p> <p>$H_2=E_2 \times 【0.05】\% \div 365$</p> <p>H2 为每日应计提的托管费</p> <p>E2 为前一日的资产管理计划资产净值（成立当日以初始委托计划份额总数计提）。本计划的托管费每日计提，逐日累计至每季度季末最后一个自然日，按季支付，由资产管理人与资产托管人双方核对无误后，管理人有权于次季度后的 5 个工作日之内向资产托管人发送托管费划款指令，资产托管人收到划款指令后从资产管理计划财产中将应付未付的托管费一次性支付给资产托管人。</p>
封闭期、开放日约定	<p>（一）在本资产管理计划存续期，本资产管理计划开放日（以下简称 T 日或开放日）为每月 15 日，开放日如遇非工作日则顺延至下一工作日。开放日接受计划份额的参与和退出。</p> <p>（二）本计划委托人认购及申购的资产管理计划份额未满 6 个月的，不得申请赎回。</p> <p>（三）委托人通过管理人直销参与或退出本计划的，申请参与和退出的资产委托人应在开放日（即：T 日）对应的 T-5 日至 T 日（含）15:00 前的工作日向资产管理人提交参与和退出申请。参与登记成功以委托人已签署合同并且参与资金到达募集账户为准。参与或退出申请可以在 T 日（含）15:00 前撤销。</p> <p>（四）未在前述期间提交参与或退出申请书的，管理人有权拒绝受理委托人的参与或退出申请。</p> <p>（五）存续期间，资产管理人有权调整开放日以及委托人必须提交申请的时间，并通知资产托管人，有权根据证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况对开放日及开放时间作相应调整。</p> <p>（六）资产委托人签署本合同即表示同意：管理人提前 5 个工作日在资产管理人网站公告或通过委托人认可的其他形式告知前述调整事项即视为履行了告知义务。</p> <p>（七）委托人通过代理销售机构参与、退出本计划的，应根据代理销售机构制定的规则和流程办理参与、退出业务。</p>
认购费/参与费	本计划不收取认购费。
退出费/赎回费	本计划不收取退出费。
认购、参与、退出办理的方式、程序	<p>“未知价”原则，即委托人按约提交参与申请或/且退出申请后，资产管理计划份额的参与和退出价格以开放期（即：T 日）当日的计划份额净值为基准进行计算。</p> <p>资产管理计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。</p> <p>委托人办理参与、退出等业务时应提交的文件和办理手续、办理时间、处理规则等在遵守本合同规定的前提下，以管理人或销售机构的具体规定为准。</p> <p>参与和退出申请的确认。销售机构受理参与和退出申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售机构确实收到了参与和退出申请。参与和退出申请的确认以份额登记机构的确认结果为准。</p> <p>本计划的人数规模上限为 200 人。管理人按照“时间优先、金额优先”的原则确认有效参与申请。超出计划人数上限的参与申请为无效申请。</p> <p>在正常情况下，份额登记机构在【T+3】日内对 T 日参与和退出申请的有效性进行确认。若参与不成功，管理人应在【T+3】日起三十日内无息退还委托人已缴纳的款项。</p> <p>参与和退出申请的款项支付。参与采用全额交款方式，若资金在规定时间内未全额到账则参与不成功，为无效申请，已交付的委托款项将无息退回委托人指定资金账户。参与资金在份额确认之前不计利息。委托人退出申请成交后，管理人应按规定向委托人支付退出款项，退出款项自开放日起 10 个工作日内划往委托人的退出账户或者销售机构指定的账户。在发生巨额退出时，退出款项的支付办法按本合同和有关法律法规规定处理。</p> <p>管理人在不损害委托人权益的情况下可更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前 5 个工作日告知委托人。管理人通过公司网站公告或以委托人认可的其他形式告知即视为履行了告知义务。</p>
募集期间	2020 年 1 月 6 日至 2020 年 1 月 17 日
最低认购金额	单个资产委托人初始参与资产管理计划的财产不得低于 30 万元人民币
产品期限	5 年



风险提示：投资有风险。当您参与资产管理计划投资时，可能获得投资收益，但同时也面临着投资亏损的风险。您在作出投资决策之前，请仔细阅读《中信期货信安 1 号集合资产管理计划风险揭示书》和《中信期货信安 1 号集合资产管理计划资产管理合同》及其他相关

文件，知悉并理解其中列示的计划可能面临的各项风险。其中，《中信期货信安1号集合资产管理计划风险揭示书》的揭示事项仅为列举性质，未能详尽列明投资者参与期货资产管理计划投资所面临的全部风险和可能导致投资者资产损失的所有因素。投资者在参与期货资产管理计划投资并签署本合同前，应认真阅读并理解相关业务规则、资产管理合同及产品风险揭示书等相关文件的全部内容，并确保自身已做好足够的风险评估与财务安排，避免因参与期货资产管理计划投资而遭受超过自身风险承受能力的损失。

特别提示：投资者签署资产管理合同及产品风险揭示书即表明已充分了解并谨慎评估自身风险承受能力，理解并愿意自行承担参与期货资产管理计划投资的风险和损失。

特此公告。

