

关于中信期货信安1号集合资产管理计划

合同变更的公告

尊敬的委托人、托管人：

因相关法律法规、监管规则的变化，根据《中信期货信安1号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）关于合同变更的约定，经管理人与托管人协商一致，决定变更《合同》的部分条款。本次变更方案如下：

一、合同变更依据

根据《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（2018年10月22日证监会公告〔2018〕31号公布、2023年1月12日证监会公告〔2023〕2号修订），以及《合同》第二十四节“资产管理合同的变更、终止与财产清算”，对《合同》相关条款进行变更。

二、合同变更内容

1、对《合同》第四节“当事人及权利义务”作出修改：

原合同约定为：

“第八条 管理人基本情况

名称：中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305、14层

通信地址：上海市杨高南路799号陆家嘴世纪金融广场三号楼2304室

邮政编码：200127

法定代表人：张皓

联系人：王健

电话：021-60812923

传真：021-60819988

邮箱：wangjian@citicsf.com

第九条 托管人基本情况

名称：中信银行股份有限公司济南分行

住所：济南市泺源大街150号

通讯地址：济南市泺源大街150号

负责人：孙波

联系人：段娟

联系地址：济南市泺源大街150号

联系电话：0531-85180504

传真：0531-85180290

邮箱：duanjuan_jn@citicbank.com”

现变更为：

“第八条 管理人基本情况

名称：中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305、14 层

通信地址：上海市杨高南路 799 号陆家嘴世纪金融广场三号楼 2304 室

邮政编码：200127

法定代表人：张皓

联系人：金桂萍

电话：021-60812925

传真：021-60819988

邮箱：jinguiping@citicsf.com

第九条 托管人基本情况

名称：中信银行股份有限公司济南分行

住所：济南市泺源大街 150 号

通讯地址：济南市泺源大街 150 号

负责人：杜晓峰

联系人：孙文韬

联系地址：济南市泺源大街 150 号

联系电话：0531-85181103

传真：/

邮箱：zichantuoguan_jn@citicbank.com”

2、对合同第十一节“资产管理计划的投资”第七项“投资限制”新增第 11 条，后续条款序号以此递延：

新增条款：

“七、投资限制

11. 资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，本资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。本资产管理计划投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种不受此规定限制；”

3、对《合同》第二十节“资产管理计划的费用与税收”第三项“管理人业绩报酬”作出修改：

原合同约定为：

“（三）管理人业绩报酬

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。

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。

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。

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。

①期间年化收益率计算

$$\text{期间年化收益率 } R = [(P1-P0) / P0x] \times (365 \div T)$$

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

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：

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

N=投资者所持的单笔份额数

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（ ΣE ）。

$$\Sigma E = E1 + E2 + E3 + \dots + En$$

其中的 n 为所对应的份额笔数。

管理人业绩报酬由管理人负责计算，托管人不进行复核。

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。

管理人业绩报酬收取账户与管理费收款账户相同。

如交易所或第三方金融机构调整相关费率，则管理人根据有关法律法规及相应协议的要求，于费用发生时，在管理资产中列支。”

现变更为：

“（三）管理人业绩报酬

本计划于资产委托人【退出时、分红时、计划终止清算】时采用单人单笔高水位净值法计提业绩报酬。

于退出时计提业绩报酬，退出确认日为计提日，退出日为基准日，业绩报酬从投资者的退出资金中扣除。

于分红时计提业绩报酬，分红确认日为计提日，业绩报酬从投资者的可分红资金中扣除且不超过可分红资金。

于终止清算时计提业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除。

业绩报酬的计算公式如下：

$$R_{ij} = \frac{NAV_{ij}^k - NAV_{ij}^h}{NAV_{ij}^l} \times 365 \div T$$

年化收益率	计提公式
$R_{ij} < R_b$	$E=0$
$R_{ij} \geq R_b$	$E=\sum_{i=1}^n \sum_{j=1}^m [S_{ij} \times NAV_{ij}^k \times (R_{ij} - R_b) \times P \times T \div 365]$

本计划将根据投资者每笔投资的年化收益率，对年化收益率超过业绩报酬计提基准 R_b （6.0%）以上部分按比例 P （50%）收取业绩报酬。

其中， R_{ij} 为第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的年化收益率；

NAV_{ij}^k 为本次业绩报酬计提基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额累计净值；

NAV_{ij}^h 为前一次成功计提业绩报酬基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额累计净值（首次计提时，则为初始面值或参与时份额累计净值）；

NAV_{ij}^l 为前一次成功计提业绩报酬基准日第 i 个投资者持有的第 j 笔份额的份额净值（首次计提时，则为初始面值或参与时份额净值）；

P 为业绩报酬计提比例；

T 为前一次成功计提业绩报酬日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数（首次计提时，则为参与确认日（含）到本次业绩报酬计提日（不含））；

E 为此次应计提的业绩报酬；

S_{ij} 为此次业绩报酬计提时第 i 投资者持有的第 j 笔计划份额；

n 为此次业绩报酬计提时涉及的投资者数量；

m 为此次业绩报酬计提时涉及的每个投资者涉及的持有份额笔数。

管理人业绩报酬由管理人负责计算，托管人不进行复核。管理人业绩报酬由资产管理人于计提日后向资产托管人发送划款指令，资产托管人收到划款指令后从资产管理计划财产中将管理人业绩报酬支付给资产管理人账户。

管理人的业绩报酬收入账户信息与管理费收入账户信息一致。

相邻两次业绩报酬计提的时间间隔不得少于6个月，资产委托人退出时、计划终止清算时除外。”

4、《合同》其他内容不变。

三、委托人退出方案的安排

根据《合同》约定，管理人将2023年03月09日至2023年03月15日设置为本次合同变更的征询期。如委托人不同意本次合同变更，可选择在2023年03月15日开放日申请退出本资产管理计划，管理人将受理委托人的退出申请，并为委托人办理退出业务。委托人没有办理退出申请的，视为委托人同意变更。

四、合同变更的效力

本次合同变更自2023年03月16日起生效。委托人、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。本次合同变更未涉及事项，仍以合同的约定为准。

特此公告。

中信期货有限公司

2023年03月09日

