

关于光大期货月月福1号集合资产管理计划 业绩报酬计提标准调整的通知

尊敬的投资者：

光大期货月月福1号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）由光大期货有限公司（以下简称“管理人”）担任管理人，由国泰君安证券股份有限公司（以下简称“托管人”）担任托管人。根据《光大期货月月福1号集合资产管理计划资产管理合同》的约定，计划存续期间管理人可根据实际情况调整业绩报酬计提标准。经管理人和托管人协商一致，本计划将调整业绩报酬计提标准，具体如下：

一、自2024年2月27日（含该日）起，将本计划的业绩报酬计提标准由年化收益率4.5%调整为年化收益率4.0%，即后续发生业绩报酬计提的，按照最近一次成功提取业绩报酬时对应的业绩报酬计提日（若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额认购/参与确认日或红利再投日）至当次业绩报酬计提日的年化收益率超过4.0%以上部分的60%计提。

即《光大期货月月福1号集合资产管理计划资产管理合同》第二十章 资产管理计划的费用与税收（二）费用计提方法、计提标准和支付方式 1、管理费（2）业绩报酬 2）业绩报酬的计算相关条款调整如下：

1、原表述：

“本计划成立时，业绩报酬计提标准为年化收益率【4.5%】

第*i*个计划份额持有人持有的第*j*笔投资的期间年化收益率 $R_{i,j} = (NAV1 - HWM_{i,j}) / HWM0 \times 365 / T \times 100\%$ ，则业绩报酬计提的条件为：

当 $R_{i,j} \leq 【4.5%】$ 时，不计提业绩报酬；

当 $R_{i,j} > 【4.5%】$ 时，管理人对期间年化收益率超过【4.5%】的部分提取【60%】作为业绩报酬，即

$P_{Fi,j} = F_{i,j} \times (R_{i,j} - 【4.5%】) \times HWM0 \times 【60%】 \times T / 365;$ ”

修改为：

“业绩报酬计提标准为年化收益率【4.0%】

第*i*个计划份额持有人持有的第*j*笔投资的期间年化收益率 $R_{i,j} = (NAV1 -$

$HWM_{i,j} / HWM_0 \times 365 / T \times 100\%$ ，则业绩报酬计提的条件为：

当 $R_{i,j} \leq \text{【4.0\%】}$ 时，不计提业绩报酬；

当 $R_{i,j} > \text{【4.0\%】}$ 时，管理人对期间年化收益率超过 **【4.0%】** 的部分提取 **【60%】** 作为业绩报酬，即

$P_{Fi,j} = F_{i,j} \times (R_{i,j} - \text{【4.0\%】}) \times HWM_0 \times \text{【60\%】} \times T / 365;$ ”

二、如投资者不同意调整后的业绩报酬计提标准，应于 2024 年 2 月 22 日 17:00 前出具书面形式的明确回复不同意意见反馈管理人（收件邮箱：zcglsj@ebfcn.com.cn；电话：4007007979）。投资者逾期未书面回复意见或回复意见不明确的，视为投资者同意本次业绩报酬计提标准的调整。

三、管理人保障投资者选择退出资产管理计划的权利，投资者可在新的业绩报酬计提标准生效前的开放日以及管理人安排的临时开放日（2024 年 2 月 26 日）办理退出业务（不受合同中关于计划退出的期限限制）。投资者回复不同意意见，但未于临时开放日提交退出申请的，由管理人于临时开放日强制赎回其所持全部计划份额。

管理人特别声明：业绩报酬计提标准不是保证收益率。投资者确认并充分了解，本计划相关的业绩报酬计提标准仅供管理人计算提取业绩报酬使用，不构成管理人、托管人对本计划财产本金及收益状况的任何预测、承诺或担保。投资有风险，投资者面临无法取得相应收益甚至损失本金的风险。

本公告仅对本计划业绩报酬计提标准调整的有关事项予以说明，投资者欲了解本计划的详细情况，可查阅本计划资产管理合同、说明书及相关公告。

特此通知。

