

## 《创元创优 2 号集合资产管理计划》告知书

尊敬的投资人：

我司管理的《创元创优 2 号集合资产管理计划》将于 2024 年 6 月进行以下变更事项：

### 一、产品合同变更

我司将以《关于创元创优 2 号集合资产管理计划变更业绩报酬计提基准的征询意见函》（以下简称“征询意见函”）的方式变更《创元创优 2 号集合资产管理计划资产管理合同》，以征询意见函方式征询意见。征询意见函详见附件。

主要变更内容为：

原合同	变更为
业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率 5.8%。	业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率 4.5%。

### 二、变更生效

本计划设置临时开放日为 2024 年 6 月 24 日，不同意上述变更的投资者可于 2024 年 6 月 24 日及之前的固定开放日赎回全部份额退出本计划。

上述变更将于 2024 年 6 月 25 日（含）生效，生效日及之后日期的业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率 4.5%。

管理人：创元期货股份有限公司

日期：2024 年 05 月 23 日

附件：

## 关于创元创优 2 号集合资产管理计划 变更业绩报酬计提基准的征询意见函

各位资产委托人：

根据《创元创优 2 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“合同”）第二十四节第（二）条第 2 款规定，管理人以征询意见函方式变更创元创优 2 号集合资产管理计划业绩报酬计提基准，具体内容如下：

### 1、变更内容

《创元创优 2 号集合资产管理计划资产管理合同》变更前后对照表

章节	变更前	变更后
“二十、资产管理计划的费用与税收”中“（二）费用计提方法、计提标准和支付方式”中“4、管理人的业绩报酬”	<p style="text-align: center;">（2）业绩报酬提取的方法</p> <p>业绩报酬（R）的计提方法：</p> <p>如果 <math>r &lt; 5.8\%</math>，则 <math>R = 0</math></p> <p>如果 <math>r \geq 5.8\%</math>，则 <math>R = F \times C \times (r - 5.8\%)</math></p> $\times 60\% \times T / 365, r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p><math>C_T</math> = 本次业绩报酬计提日的份额累计单位净值</p> <p><math>C_0</math> = 上一次业绩报酬计提日的份额累计单位净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额对应的认购价格或申购时的份额累计净值</p> <p><math>C</math> = 上一次业绩报酬计提日的份额净值</p> <p><math>F</math> = 提取业绩报酬的份额</p> <p><math>r</math> = 客户每笔份额年化收益率</p> <p><math>T</math> = 上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为成立日或申购确认日至本次业绩报酬计提日的自然日天数</p>	<p style="text-align: center;">（2）业绩报酬提取的方法</p> <p>业绩报酬（R）的计提方法：</p> <p>如果 <math>r &lt; 4.5\%</math>，则 <math>R = 0</math></p> <p>如果 <math>r \geq 4.5\%</math>，则 <math>R = F \times C \times (r - 4.5\%)</math></p> $\times 60\% \times T / 365, r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p><math>C_T</math> = 本次业绩报酬计提日的份额累计单位净值</p> <p><math>C_0</math> = 上一次业绩报酬计提日的份额累计单位净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额对应的认购价格或申购时的份额累计净值</p> <p><math>C</math> = 上一次业绩报酬计提日的份额净值</p> <p><math>F</math> = 提取业绩报酬的份额</p> <p><math>r</math> = 客户每笔份额年化收益率</p> <p><math>T</math> = 上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为成立日或申购确认日至本次业绩报酬计提日的自然日天数</p>

## 2、征询流程

根据合同中“二十四、资产管理合同的变更、终止与财产清算”中“(二)非因法律、法规及有关政策发生变化的原因而导致合同变更时,可采用以下两种方式中的一种进行合同变更”中第2款的约定,本公司现就上述变更事项征询各份额持有人意见。

本公司以书面或电子方式向资产委托人发送合同变更征询意见函,征询意见期为【2024年6月13日至2024年6月19日】。本计划设置临时开放日为2024年6月24日,资产委托人不同意变更的,应在【2024年6月24日】及之前的固定开放日赎回全部份额并退出本计划,本公司作为管理人不得拒绝该次赎回申请;资产委托人未在【2024年6月24日】及之前的固定开放日赎回全部份额退出本计划的,视为资产委托人默认同意该次业绩报酬计提基准的调整。

上述变更事项自【2024年6月25日】(含)开始生效,对合同各方均具有法律效力。变更事项生效后,本公司将及时在网站(www.cyqh.com.cn)公告合同变更生效事宜,向托管人出具盖章的变更生效通知。

## 3、风险揭示

(1) 本计划降低了初始业绩报酬计提基准,可能会提高业绩报酬。提高业绩报酬有助于激励管理人更好地管理本计划、为投资者创造更高的收益;但在计划收益率没有明显提高的情况下,也可能造成投资者获得的投资收益减少。

(2) 管理人通过公告并以短信等方式告知投资者调整业绩报酬计提基准,如投资者未及时赎回则视为默认同意该次变更。若管理人下调业绩报酬计提基准,将可能会被计提更多的业绩报酬,从而造成投资者获得的投资收益减少。

## 4、其他需要说明的事项

本公司已按相关法律法规、合同及其他有关规定,妥善履行资产管理人职责,并向全体资产委托人征询本次变更的具体内容。

特发此函。

创元期货股份有限公司

2024年05月23日