

《创元创优 3 号债券投资集合资产管理计划》告知书

尊敬的投资人：

我司管理的《创元创优 3 号债券投资集合资产管理计划》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 3 号债券投资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 3 号债券投资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
初始业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率 5.8%。	初始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 17 日，不同意上述变更的投资者可于 2024 年 6 月 17 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 18 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 3 号债券投资集合资产管理计划

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 3 号债券投资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 3 号债券投资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 3 号债券投资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>4、管理人的业绩报酬</p> <p>在本计划收益分配、计划份额持有人赎回、本计划终止时进行业绩报酬的提取。本计划提取频率不得超过每 6 个月一次。管理人在份额持有人赎回本计划份额时或在本计划清盘日计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制。</p> <p>对于计划实际年化收益率大于对应份额业绩报酬计提基准的部分，按照 60%的比例计提业绩报酬。业绩报酬计提基准是管理人通过分析国内外宏观经济形势、社会资金及金融市场利率走势，依据所投资品种综合收益预测，并不是管理人向委托人承诺的预期收益或保证收益，委托人将自行承担投资风险。</p> <p>业绩报酬计提基准由管理人确定后通过管理人网站进行公告。随着宏观经济和利率水平变化，为保护投资者的合法权益，管理人有权自行决定按月上调本集合计划业绩报酬计提基准，具体安排在最近一个开放期前在管理人网</p>	<p>4、管理人的业绩报酬</p> <p>在本计划收益分配、计划份额持有人赎回、本计划终止时进行业绩报酬的提取。本计划提取频率不得超过每 6 个月一次。管理人在份额持有人赎回本计划份额时或在本计划清盘日计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制。</p> <p>对于计划实际年化收益率大于对应份额业绩报酬计提基准的部分，按照 60%的比例计提业绩报酬。业绩报酬计提基准是管理人通过分析国内外宏观经济形势、社会资金及金融市场利率走势，依据所投资品种综合收益预测，并不是管理人向委托人承诺的预期收益或保证收益，委托人将自行承担投资风险。</p> <p>业绩报酬计提基准由管理人确定后通过管理人网站进行公告。随着宏观经济和利率水平变化，为保护投资者的合法权益，管理人有权自行决定按月上调本集合计划业绩报酬计提基</p>

站上进行公告，管理人应在调整日将公告告知本计划服务机构及托管人。若经管理人、托管人和全体投资者协商一致同意，管理人有权下调本集合计划业绩报酬计提基准，具体安排在最近一个开放期前在管理人网站上进行公告。

初始业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率 5.8%。

(2) 业绩报酬提取的方法

业绩报酬 (R) 的计提方法:

如果 $r < 5.8\%$, 则 $R = 0$

如果 $r \geq 5.8\%$, 则 $R = F \times C \times (r - 5.8\%) \times 60\% \times T / N$

$$r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

C_T = 本次业绩报酬计提日的份额累计单位净值

C_0 = 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

C = 上一次业绩报酬计提日的份额净值

N = 当年天数

F = 提取业绩报酬的份额

r = 客户每笔份额年化收益率

T = 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

站上进行公告，管理人应在调整日将公告告知本计划服务机构及托管人。若经管理人、托管人和全体投资者协商一致同意，管理人有权下调本集合计划业绩报酬计提基准，具体安排在最近一个开放期前在管理人网站上进行公告。

初始业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率 4.5%。

(2) 业绩报酬提取的方法

业绩报酬 (R) 的计提方法:

如果 $r < 4.5\%$, 则 $R = 0$

如果 $r \geq 4.5\%$, 则 $R = F \times C \times (r - 4.5\%) \times 60\% \times T / N$

$$r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

C_T = 本次业绩报酬计提日的份额累计单位净值

C_0 = 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

C = 上一次业绩报酬计提日的份额净值

N = 当年天数

F = 提取业绩报酬的份额

r = 客户每笔份额年化收益率

T = 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

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6日至2024年6月12日】。本计划设置临时开放日为2024年6月17日，资产委托人不同意变更的，应在【2024年6月17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17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18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。

