

《创元鼎盛1号集合资产管理计划》告知书

尊敬的投资人：

您购买的《创元鼎盛1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《关于创元鼎盛1号集合资产管理计划变更的征询意见函》（以下简称“征询意见函”）的方式变更《创元鼎盛1号集合资产管理计划资产管理合同（第三版）》，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5.5%。	初始业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率4%。
本计划投资经理为：雷浩	本计划投资经理为：雷浩、刘汗青

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%。

管理人：创元期货股份有限公司

日期：2024年5月24日



附件：

关于创元鼎盛 1 号集合资产管理计划

变更的征询意见函

各位资产委托人：

根据《创元鼎盛 1 号集合资产管理计划资产管理合同（第三版）》（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鼎盛 1 号集合资产管理计划业绩报酬计提基准、投资经理，具体内容如下：

1、变更内容

《创元鼎盛 1 号集合资产管理计划资产管理合同（第三版）》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>（1）业绩报酬提取的时点与方式</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 50%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>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</p>	<p>（1）业绩报酬提取的时点与方式</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 50%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>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</p>

<p>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。</p> <p>初始业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率 5.5%。</p> <p>(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 $r < 5.5\%$，则 $R = 0$</p> <p>如果 $r \geq 5.5\%$，则 $R = F \times C \times (r - 5.5\%) \times 50\% \times T/N$</p> $r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p>C_T = 本次业绩报酬计提日的份额累计单位净值</p> <p>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</p> <p>C = 上一次业绩报酬计提日的份额净值</p> <p>N = 当年天数</p> <p>F = 提取业绩报酬的份额</p> <p>r = 客户每笔份额年化收益率</p> <p>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</p>	<p>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。</p> <p>初始业绩报酬计提基准为客户每笔份额年化收益率 4%。</p> <p>(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 $r < 4\%$，则 $R = 0$</p> <p>如果 $r \geq 4\%$，则 $R = F \times C \times (r - 4\%) \times 50\% \times T/N$</p> $r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ <p>C_T = 本次业绩报酬计提日的份额累计单位净值</p> <p>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</p> <p>C = 上一次业绩报酬计提日的份额净值</p> <p>N = 当年天数</p> <p>F = 提取业绩报酬的份额</p> <p>r = 客户每笔份额年化收益率</p> <p>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</p>
---	---

<p>“十五、投资经理的指定与变更”中“（一）投资经理的指定”</p>	<p>2. 本计划投资经理为：雷浩先生。</p> <p>投资经理简介：雷浩先生，伦敦大学国王学院金融工程硕士，金融风险管理（FRM）持证人。2011年至2015年历任创元期货股份有限公司研究所、投资咨询部研究员、主管。2016年至2018年于新海天资本、上海信隆行等机构历任高级投行经理，负责一级市场、一级半市场投资。2019年加入苏州创元和赢资本管理有限公司，担任衍生品部负责人，负责场外衍生品产品策略设计及风险控制。2020年7月加入创元期货股份有限公司，担任资产管理总部投资经理，从事风险管理和投资管理工作。雷浩先生最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，已取得期货从业资格证，已通过期货投资分析考试，已取得基金从业资格，未有其他兼职。</p>	<p>2. 本计划投资经理为：雷浩先生、刘汗青先生。</p> <p>投资经理简介：</p> <p>雷浩先生，伦敦大学国王学院金融工程硕士，金融风险管理（FRM）持证人。2011年至2015年历任创元期货股份有限公司研究所、投资咨询部研究员、主管。2016年至2018年于新海天资本、上海信隆行等机构历任高级投行经理，负责一级市场、一级半市场投资。2019年加入苏州创元和赢资本管理有限公司，担任衍生品部负责人，负责场外衍生品产品策略设计及风险控制。2020年7月加入创元期货股份有限公司，担任资产管理总部投资经理，从事风险管理和投资管理工作。雷浩先生最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚，已取得期货从业资格证，已通过期货投资分析考试，已取得基金从业资格，未有其他兼职。</p> <p>刘汗青先生，CFA，英国阿伯丁大学金融与投资管理专业硕士。2020年加入创元期货，现任资产管理总部投资经理。刘汗青先生具有多年债券研究经验，擅长城投债的信用分析与定价分析，有充足的固定收益相关业内投研资源。刘汗青先生目前未在其他单位兼职，已取得期货从业资格、基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</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14日至2024年6月20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。

