

# “华润信托·润享莞盈收益凭证3号集合资金信托计划 第1期”

## 关于标的收益凭证调整增强收益率及开放日设置的公告

尊敬的委托人暨受益人：

我司作为受托人发起设立了“华润信托·润享莞盈收益凭证3号集合资金信托计划第1期”（以下简称“本期信托单位”）。本期信托单位成立时根据信托文件约定投资于中信证券股份有限公司（以下简称“标的收益凭证发行人”）发行的中信证券股份有限公司策略点金系列2444期收益凭证（产品代码【SRW978】，以下简称“标的收益凭证”）。

根据标的收益凭证协议的相关约定，标的收益凭证最后一个敲出观察日为2024年1月5日（逢节假日顺延），若在最后一个敲出观察日之前发生敲入事件，且直到最后一个敲出观察日也没有发生过敲出事件，则该标的收益凭证的投资损益结构将在最后一个敲出观察日变为指数增强线性收益结构。在标的收益凭证存续期间，标的收益凭证发行人有权对增强收益率进行调整。我司代表本期信托单位拟与标的收益凭证发行人签署《中信证券股份有限公司策略点金系列2444期收益凭证补充产品说明书》（内容详见本公告附件，以下简称“标的收益凭证补充产品说明书”），调整标的收益凭证固定收益率（年化）、赎回金额、到期终止兑付金额等约定。除标的收益凭证补充产品说明书修改或新增的产品条款外，标的收益凭证其他条款仍按原产品说明书约定执行。

现根据标的收益凭证协议及补充产品说明书约定，如标的收益凭证的投资损益结构变为指数增强型收益结构，**增强收益率（年化） $1 = 3.61\% \times \text{敲出观察日} 22 \text{ 的挂钩标的收盘价格} \div \text{期初价格}$** ，适用于增强收益区间**1：2024年1月5日（含）至2025年1月6日（不含）**。

根据信托文件的约定，受托人于非保本标的收益凭证最后一个敲出观察日起设置开放日供委托人赎回。本次开放日为2024年1月5日，只能赎回，不得认购。若委托人/受益人不同意标的收益凭证补充产品说明书相关内容及调整后的增强收益率（年化）**1**的，委托人/受益人可于本次开放日（2024年1月5日，赎回申请提交期为2024年1月2日（含）之前）申请赎回本期信托单位份额。

若委托人/受益人不全部赎回信托份额的，即视为委托人/受益人同意并认可非保本标的收益凭证收益结构根据标的收益凭证合同约定变为指数增强线性收益结构及指数增强期包括增强收益期时间、增强收益率（年化）等在内的指数增强期安排，同意本期信托单位与发行人签署标的收益凭证补充产品说明书，并已充分知悉标的收益凭证进入指数增强期及其相关安排的风险。因标的收益凭证的收益结构变为指数增强线性收益结构，导致本期

信托单位投资非保本标的收益凭证存在投资风险及投资损失增大的风险，由信托财产承担，受托人不承担任何责任，委托人和受益人应充分知悉和理解，自愿承担由此产生的所有风险和损失并合理规划自身资金安排。

根据信托文件的约定，本期信托单位的第一个开放日为本期非保本标的收益凭证的最后一个敲出观察日当日，即 2024 年 1 月 5 日，本期信托单位第二个开放日为 2024 年 2 月 6 日，第三个开放日为 2024 年 3 月 6 日，后续开放日以此类推（如当日为非交易日，则顺延至下一交易日）。本期信托单位开放日只能赎回，不得认购。委托人（受益人）需在其拟进行赎回的信托开放日（T 日）3 个交易日前根据受托人或代理推介机构关于赎回的相关要求办理赎回申请手续，并提交相关文件。

特此公告。

**重要提示：**

本信托并不保证盈利，亦不保证投资者本金不受损失，证券投资有风险，投资须谨慎！投资者应仔细阅读信托文件，并与受托人进行充分沟通，审慎做出购买决策。

受托人咨询电话：400-678-8883

华润深国投信托有限公司

2023 年 12 月 19 日

附件：《中信证券股份有限公司策略点金系列 2444 期收益凭证补充产品说明书》

补充产品说明书编号：【SRW978-20231229】

# 中信证券股份有限公司 策略点金系列 2444 期收益凭证补充产品说明书

(非本金保障型浮动收益凭证)



发行人：中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

邮政编码：518048

二〇二三年十二月

甲乙双方已签署《中信证券股份有限公司收益凭证业务协议(柜台市场版)》、《收益凭证产品说明书》及《收益凭证补充产品说明书》(如有),具体名称及产品期次以实际签署为准,以下单独或合并简称“原产品说明书”。

甲方认购了乙方发行的策略点金系列 2444 期收益凭证(产品编码:SRW978)。就策略点金系列 2444 期收益凭证(产品编码:SRW978)而言,除非本补充产品说明书有特别约定,本补充产品说明书所使用的相关术语与该产品对应的原产品说明书具有相同含义。

就策略点金系列 2444 期收益凭证(产品编码:SRW978)而言,除本补充产品说明书修改、删除或新增的产品条款外,该产品对应的原产品说明书的其他条款继续有效。

更改日期	2023-【12】-【29】
补充产品说明书编号	SRW978-20231229

修改的产品条款	修改前	修改后
<b>赎回金额</b>	<p>赎回申请确认日,投资者应获得的赎回金额 = 发行人确认的实际赎回份额数量×赎回申请确认日的收益凭证份额价值,四舍五入精确至 0.01 元,具体以计算机构确定数值为准;</p> <p>赎回申请确认日的收益凭证份额价值 = 每份额收益凭证面值×1 + 每份额收益凭证对应的挂钩标的浮动收益 + 每份额收益凭证对应的增强收益,四舍五入精确到小数点后第四位,具体以计算机构确定数值为准。</p> <p>每份额收益凭证对应的挂钩标的浮动收益 = 份额面值×[赎回申请确认日的挂钩标的收盘价格×(1-赎回费率)÷期初价格-1];</p> <p>每份额收益凭证对应的增强收益以增强收益率(年化)按自然日累计,即每份额收益凭证对应的增强收益 = 每份额收益凭证面值×增强收益率(年化)×敲</p>	<p>赎回申请确认日,投资者应获得的赎回金额 = 发行人确认的实际赎回份额数量×<b>赎回申请确认日的收益凭证份额价值</b>,四舍五入精确至 0.01 元,具体以计算机构确定数值为准;</p> <p><b>赎回申请确认日的收益凭证份额价值</b> = 每份额收益凭证面值 + 每份额收益凭证对应的挂钩标的浮动收益 + 每份额收益凭证对应的固定收益,四舍五入精确到小数点后第四位,具体以计算机构确定数值为准。</p> <p>每份额收益凭证对应的挂钩标的浮动收益 = 份额面值× [赎回申请确认日的挂钩标的收盘价格×(1-提前平仓费率)÷期初价格-1];</p> <p>每份额收益凭证对应的固定收益以<b>增强</b></p>

	<p>出<b>观察日 22</b>(含)至赎回申请确认日(不含)的自然日天数÷365。</p> <p>赎回金额于赎回申请确认日后【5】个营业日内划转至投资者柜台市场账户，逢节假日顺延。</p>	<p><b>收益率(年化)</b>按自然日累计：</p> <p>若赎回申请确认日不晚于期间议息日，则每份额收益凭证对应的固定收益 = 每份额收益凭证面值×<b>(增强收益率(年化) 1)</b>×敲出<b>观察日 22</b>(含)至<b>赎回申请确认日</b>(不含)的自然日天数÷365)；</p> <p>若赎回申请确认日晚于期间议息日，则每份额收益凭证对应的固定收益 = 每份额收益凭证面值×<b>(增强收益率(年化) 1)</b>×敲出<b>观察日 22</b>(含)至<b>期间议息日</b>(不含)的自然日天数÷365+<b>增强收益率(年化) 2</b>×<b>期间议息日</b>(含)至<b>赎回申请确认日</b>(不含)的自然日天数÷365)；</p> <p>赎回金额于<b>赎回申请确认日</b>后【5】个营业日内划转至投资者柜台市场账户，逢节假日顺延。</p>
<p><b>到期终止份额价值</b></p>	<p>若本期收益凭证产品存续至<b>到期日</b>：</p> <p>到期终止份额价值 = 每份额收益凭证面值×1 + 每份额收益凭证对应的挂钩标的浮动收益 + 每份额收益凭证对应的增强收益。</p> <p>每份额收益凭证对应的挂钩标的浮动收益 = 份额面值×(到期日的挂钩标的收盘价格÷期初价格-1)；</p> <p>每份额收益凭证对应的增强收益以<b>增强收益率(年化)</b>按自然日累计，即每份额收益凭证对应的增强收益 = 每份额收益凭证面值×<b>增强收益率(年化)</b>×<b>敲出观察日 22</b>(含)至<b>到期日</b>(不含)的自然日天数÷365。</p> <p>到期终止份额价值四舍五入精确到小数点后第四位，具体以计算机构确定数值为准。</p>	<p><b>终止份额价值</b> = 每份额收益凭证面值 + 每份额收益凭证对应的挂钩标的浮动收益 + 每份额收益凭证对应的固定收益。</p> <p>每份额收益凭证对应的挂钩标的浮动收益 = 份额面值×(到期日的挂钩标的收盘价格÷期初价格-1)；</p> <p>每份额收益凭证对应的固定收益以<b>增强收益率(年化)</b>按自然日累计，即每份额收益凭证对应的固定收益 = 每份额收益凭证面值×<b>(增强收益率(年化) 1)</b>×<b>敲出观察日 22</b>(含)至<b>期间议息日</b>(不含)的自然日天数÷365+<b>增强收益率(年化) 2</b>×<b>期间议息日</b>(含)至<b>到期日</b>(不含)的自然日天数÷365)。</p> <p><b>终止份额价值</b>四舍五入精确到小数点后第四位，具体以计算机构确定数值为准。</p>
<p><b>增强收益率(年化)</b></p>	<p>3.00%×<b>敲出观察日 22</b> 挂钩标的收盘价格÷期初价格</p> <p>在本期收益凭证产品存续期间，发行人可对<b>增强收益率</b>进行调整，实际以发行人公告或双方签署的补充说明书为准。</p>	<p><b>增强收益率(年化) 1</b> = 【3.61%】×敲出<b>观察日 22</b> 的挂钩标的收盘价格÷期初价格，具体以计算机构确定数值为准。</p> <p><b>增强收益率(年化) 2</b> = 【0%】</p>

		经双方协商一致,乙方有权于期间议息日调整 <b>增强收益率(年化) 2</b> ,经调整后的 <b>增强收益率(年化) 2</b> 不低于 0%,实际以发行人公告为准。
--	--	--

<b>新增的产品条款</b>	
<b>期间议息日</b>	2025 年[1]月[6]日

**签字栏**

甲方:

乙方: 中信证券股份有限公司

公章或合同专用章/签字:

公章或合同专用章:

日期: 2023 年 月 日

日期: 2023 年 月 日