

“华润信托·盈厦中信中证 500 指数增强 4 号集合资金信托计划”设置特别开放日及标的收益凭证展期的公告

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·盈厦中信中证 500 指数增强 4 号集合资金信托计划”（以下简称“本信托计划”）。本信托计划成立时根据信托文件约定投资于由中信证券股份有限公司发行的中信证券股份有限公司策略点金系列 2562 期收益凭证（产品代码【SUM955】，以下简称“标的收益凭证”）。

按照标的收益凭证协议的相关约定，标的收益凭证到期日原预定为 2024 年 4 月 14 日，逢节假日顺延。现标的收益凭证拟进行展期，展期后标的收益凭证的期间付息日 2 预定为 2024 年 4 月 15 日，到期日预定为 2025 年 4 月 18 日（逢节假日顺延）。

为完成标的收益凭证展期事项，拟通过本信托计划与发行人签署补充产品说明书（详见本公告附件《中信证券股份有限公司策略点金系列 2562 期收益凭证补充产品说明书》以下简称“标的收益凭证补充产品说明书”），对标的收益凭证存续期、到期日、赎回申请日、固定收益率（年化）、赎回金额、到期终止兑付金额、期间付息日、凭证息票金额等约定进行修改，除标的收益凭证补充产品说明书修改、删除或新增的产品条款外，标的收益凭证产品对应的原产品说明书的其他条款继续有效。

根据标的收益凭证补充产品说明书约定，标的收益凭证固定收益率（年化）1（适用于期初观察日（含）至期间付息日 1（不含），即 2022 年 4 月 14 日（含）至 2023 年 4 月 14 日（不含））为【8%】；标的收益凭证固定收益率（年化）2（适用于期间付息日 1（含）至期间付息日 2（不含），即 2023 年 4 月 14 日（含）至 2024 年 4 月 15 日（不含））为【5.1%】；标的收益凭证固定收益率（年化）3（适用于期间付息日 2（含）至到期日（不含），即 2024 年 4 月 15 日（含）至 2025 年 4 月 18 日（不含））为【2.8%】。

一、根据信托文件的约定，受托人设置 2024 年 4 月 15 日为特别开放日，特别开放日仅开放赎回不开放认购/追加认购。

若委托人/受益人经评估认为，本信托计划所投资的标的收益凭证根据标的收益凭证补充产品说明书，调整到期日、固定收益率等要素的安排不符合自身投资需求的，委托人/受益人可于特别开放日（2024 年 4 月 15 日，赎回申请提交期为 2024 年 4 月 3 日（含）至 2024 年 4 月 9 日（含））申请赎回本信托计划信托份额。

若委托人/受益人不全部赎回信托份额的，即视为委托人/受益人同意非保本标的收益凭证展期安排，同意本信托计划与发行人通过签署标的收益凭证补充产品说明书确认标的收益凭证调整到期日、调整(包括下调)的固定收益率(年化)等展期安排，自2024年4月15日起，非保本标的收益凭证采用调整后的标的收益凭证固定收益率(年化)3。

二、调整本信托计划2024年4月18日赎回开放日的赎回申请期。

根据信托合同，受托人有权调整赎回申请截止日及认购赎回规则。根据合同约定调整赎回申请截止日及认购赎回规则，受托人可以直接修改信托合同及相关信托文件，不需要召开受益人大会，也不需要取得委托人或受益人的同意。

受托人基于信托合同相关约定，对本信托计划2024年4月18日赎回开放日的赎回申请提交期调整为2024年4月10日(含)至2024年4月12日(含)。

因非保本标的收益凭证延长期限、调整固定收益率(年化)等展期安排，本信托计划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，由本信托计划财产承担，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。

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

2024年3月29日

附件：《中信证券股份有限公司策略点金系列 2562 期收益凭证补充产品说明书》

补充产品说明书编号：【SUM955-20240414】

中信证券股份有限公司 策略点金系列 2562 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

二〇二四年四月

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 2562 期收益凭证（产品编码：SUM955）。就策略点金系列 2562 期收益凭证（产品编码：SUM955）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 2562 期收益凭证（产品编码：SUM955）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	2024-【4】-【14】
补充产品说明书编号	SUM955-20240414

修改的产品条款	修改前	修改后
凭证存续期	预定为[731]天，即起始日（含）至到期日（不含）的自然日天数。	预定为[1104]天，即起始日（含）至到期日（不含）的自然日天数。
到期日	预定为 2024 年[4]月[14]日，逢节假日顺延； 若本期收益凭证募集期限提前终止或延长，实际到期日以中信证券股份有限公司另行公告为准； 若挂钩标的在预定到期日发生对冲干扰事件，则实际到期日向后顺延至发行人实际完成挂钩标的的头寸平仓日。	预定为 2025 年[4]月[18]日，逢节假日顺延； 若本期收益凭证募集期限提前终止或延长，实际到期日以中信证券股份有限公司另行公告为准； 若挂钩标的在预定到期日发生对冲干扰事件，则实际到期日向后顺延至发行人实际完成挂钩标的的头寸平仓日。
赎回申请日	2022 年[10]月[11]日（含）至 2024 年[4]月[7]日（不含）间的营业日。	2022 年[10]月[11]日（含）至 2025 年[4]月[11]日（不含）间的营业日。
固定收益率（年化）	固定收益率（年化）1：8% 固定收益率（年化）2：5.1%	固定收益率（年化）1：8% 固定收益率（年化）2：5.1% 固定收益率（年化）3：2.8%
赎回金额	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，四舍五入精确到小数点后第 2 位，具体以计算机机构确定	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，四舍五入精确到小数点后第 2 位，具体以计算机机构确定

	<p>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 + 每份收益凭证对应的 挂钩标的浮动收益 + 每份收益凭证对应 的固定收益，四舍五入精确到小数点后第 4 位，具体以计算机构确定数值为准。</p> <p>每份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>每份收益凭证对应的固定收益以固定收益 率（年化）按自然日累计：</p> <p>若赎回申请日早于期间付息日，则每份收 益凭证对应的固定收益 =每份收益凭证面 值×固定收益率（年化）1×期初观察日（含） 至赎回申请确认日（不含）的自然日天数÷ 365；</p> <p>若赎回申请日不早于期间付息日，则每份 收益凭证对应的固定收益 =每份收益凭证 面值×固定收益率（年化）2×期间付息日 （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>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 + 每份收益凭证对应的 挂钩标的浮动收益 + 每份收益凭证对应 的固定收益，四舍五入精确到小数点后第 4 位，具体以计算机构确定数值为准。</p> <p>每份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>每份收益凭证对应的固定收益以固定收益 率（年化）按自然日累计：</p> <p>若赎回申请确认日早于期间付息日 1，则每份 收益凭证对应的固定收益 = 每份收益 凭证面值×固定收益率（年化）1×期初观察 日（含）至赎回申请确认日（不含）的自然日 天数÷365；</p> <p>若赎回申请确认日不早于期间付息日 i（i=1） 且早于期间付息日（i+1），则每份收益凭证 对应的固定收益 = 每份收益凭证面值× 固定收益率（年化）2×期间付息日 i（含）至 赎回申请确认日（不含）的自然日天数÷365；</p> <p>若赎回申请确认日不早于期间付息日 2，则每 份收益凭证对应的固定收益 = 每份收 益凭证面值×固定收益率（年化）3×期间付 息日 2（含）至赎回申请确认日（不含）的自 然日天数÷365。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>到期终止兑付金 额</p>	<p>若持有本期收益凭证产品份额至到期日，投 资者应获得的到期终止兑付金额 = 到期日 的收益凭证份额价值×到期日投资者持有的 本期收益凭证产品份额，四舍五入精确到小 数点后第 2 位，具体以计算机构确定数值为 准；</p> <p>到期日的收益凭证份额价值=每份收益证 据面值 + 每份收益凭证对应的挂钩标的 浮动收益 + 每份收益凭证对应的固定收 益，四舍五入精确到小数点后第 4 位，具体 以计算机构确定数值为准。</p> <p>每份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>每份收益凭证对应的固定收益以固定收益 率（年化）2按自然日累计，即每份收益证</p>	<p>若持有本期收益凭证产品份额至到期日，投 资者应获得的到期终止兑付金额 = 到期日 的收益凭证份额价值×到期日投资者持有的 本期收益凭证产品份额，四舍五入精确到小 数点后第 2 位，具体以计算机构确定数值为 准；</p> <p>到期日的收益凭证份额价值=每份收益证 据面值 + 每份收益凭证对应的挂钩标的 浮动收益 + 每份收益凭证对应的固定收 益，四舍五入精确到小数点后第 4 位，具体 以计算机构确定数值为准。</p> <p>每份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>每份收益凭证对应的固定收益以固定收益 率（年化）3按自然日累计，即每份收益证</p>

	<p>证对应的固定收益 = 每份额收益凭证面值 × 固定收益率 (年化) 2 × 期间付息日 (含) 至到期日 (不含) 的自然日天数 ÷ 365。</p> <p>中信证券股份有限公司于本期收益凭证到期日后【5个营业日内】将到期终止兑付金额划转至投资者柜台市场账户, 逢节假日顺延。</p>	<p>证对应的固定收益 = 每份额收益凭证面值 × 固定收益率 (年化) 3 × 期间付息日 2 (含) 至到期日 (不含) 的自然日天数 ÷ 365。</p> <p>中信证券股份有限公司于本期收益凭证到期日后【5个营业日内】将到期终止兑付金额划转至投资者柜台市场账户, 逢节假日顺延。</p>
期间付息日	预定为 2023 年[4]月[14]日	<p>期间付息日 1: 2023 年[4]月[14]日</p> <p>期间付息日 2: 2024 年[4]月[15]日</p>
凭证息票金额	<p>在期间付息日, 每份额凭证息票金额 = 份额面值 × 固定收益率 (年化) 1 × 期初观察日 (含) 至期间付息日 (不含) 间的自然日天数 ÷ 365, 四舍五入精确到小数点后第 4 位, 具体以计算机构确定数值为准;</p> <p>凭证息票金额于对应期间付息日后【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>在期间付息日 1, 每份额凭证息票金额 = 份额面值 × 固定收益率 (年化) 1 × 期初观察日 (含) 至期间付息日 1 (不含) 间的自然日天数 ÷ 365, 四舍五入精确到小数点后第 4 位, 具体以计算机构确定数值为准;</p> <p>在期间付息日 i (i=2), 每份额凭证息票金额 = 份额面值 × 固定收益率 (年化) 2 × 期间付息日 (i-1) (含) 至期间付息日 i (不含) 间的自然日天数 ÷ 365, 四舍五入精确到小数点后第 4 位, 具体以计算机构确定数值为准;</p> <p>凭证息票金额于对应期间付息日后【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>

签字栏

甲方: 华润深国投信托有限公司 (代“华润信托·盈厦中信中证 500 指数增强 4 号集合资金信托计划”)

公章或合同专用章/签字:

日期: 2024 年 月 日

乙方: 中信证券股份有限公司

公章或合同专用章:

日期: 2024 年 月 日