

“华润信托·盈厦金益中证 500 指数增强 2 号集合资金信托计划”

标的收益凭证调整固定增强收益率（年化）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·盈厦金益中证 500 指数增强 2 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国国际金融股份有限公司发行的【中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证】（产品代码【SWX467】，以下简称“标的收益凭证”）。根据标的收益凭证合同约定，标的收益凭证到期日为 2024 年 9 月 30 日。

根据标的收益凭证发行人通知，标的收益凭证拟通过签署标的收益凭证补充协议修改到期日、名义本金、产品份额以及固定增强收益等产品要素（详见附件一《“华润信托·盈厦金益中证 500 指数增强 2 号集合资金信托计划”标的收益凭证修改到期日等产品要素的临时公告》）。根据标的收益凭证补充协议约定，标的收益凭证发行人应在标的收益凭证补充协议约定的固定增强收益调整日之前对下一年度的固定增强收益率进行通知。

现根据标的收益凭证发行人通知（详见附件二），标的收益凭证自 2024 年 09 月 30 日（不含）至 2025 年 09 月 30 日（含）的固定增强收益率 2（年化）为 4.2%。

根据信托文件的约定，受托人设置 2024 年 09 月 30 日为开放日（仅开放赎回不开放认购/追加认购）。委托人应详细阅读标的收益凭证说明书的相关内容，充分评估标的收益凭证调整固定增强收益率的风险，委托人/受益人可于 2024 年 09 月 23 日（含）至 2024 年 09 月 25 日（含）期间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即视为委托人/受益人同意非保本标的收益凭证调整（包括下调）的增强收益率（年化），并指定本信托计划受托人根据已公告披露的标的收益凭证拟调整的年化增强收益率，与标的收益凭证发

行人确认，自 2024 年 09 月 30 日（不含）起，非保本收益凭证采用调整后的年化增强收益率。

因非保本收益凭证调整增强收益率（年化），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 09 月 20 日

附件一：“华润信托·盈厦金益中证 500 指数增强 2 号集合资金信托计划”标的收益凭证修改到期日等产品要素的临时公告

“华润信托·盈厦金益中证 500 指数增强 2 号集合资金信托计划”

标的收益凭证修改到期日等产品要素的临时公告

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·盈厦金益中证 500 指数增强 2 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国国际金融股份有限公司发行的【中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证】（产品代码【SWX467】，以下简称“标的收益凭证”）。

现根据标的收益凭证发行人通知，标的收益凭证拟通过签署标的收益凭证补充协议修改到期日、名义本金、产品份额以及固定增强收益等产品要素的约定，具体见附件《中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证产品补充协议（一）》（下称“补充协议”）。

委托人/受益人应详细阅读补充协议的内容，充分评估标的收益凭证变更产品要素的风险。

根据信托文件的约定，受托人设置 2024 年 09 月 30 日为开放日，该开放日仅开放赎回不开放认购/追加认购。该开放日的赎回申请期为 2024 年 09 月 23 日（含）至 2024 年 09 月 25 日（含）。

委托人应详细阅读补充协议的内容，充分评估标的收益凭证变更产品要素风险，若不同意非保本标的收益凭证相关产品要素变更安排的，委托人/受益人应于前述开放日赎回本信托计划信托份额。

若委托人/受益人未在前述开放日向我司申请赎回所持有的全部信托份额的，均被视作充分了解并认可本次标的收益凭证产品要素变更安排在内的标的收益凭证补充协议全部内容及放弃提出异议的权利，同意受托人代表本信托计划与标的收益凭证产品发行人签署补充协议并自愿承担因标的收益凭证产品要素调整事项带来的信托计划财产可能损失的风险。

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 9 月 6 日

附：《中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证产品补充协议（一）》

中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证产品补充协议（一）

甲方：【华润深国投信托有限公司（代“华润信托·盈厦金益中证 500 指数增强 2 号集合资金信托计划”）】

授权联系人：【彭子洁、李志渊】

联系邮箱：【pengzjl@crctrust.com; lizy3@crctrust.com; cppl@crctrust.com】

联系电话：【028-62781111（分机号 8020）】

乙方：中国国际金融股份有限公司

联系邮箱：

【EQD_PB_Risk@cicc.com.cn; EQD_PB_Trading@cicc.com.cn】

联系电话：【010-65053523/010-65059269/010-65050829/010-65057596/010-65050322/010-65059584】

乙方发行了中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证（以下简称“本收益凭证”）并制作了相应的《中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证产品说明书》（以下简称“产品说明书”），甲方认购了本收益凭证并就认购本收益凭证签署了《中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证产品风险揭示书》（以下简称“风险揭示书”）和《中金公司【金泽 PB0145】号收益凭证产品认购协议》（以下简称“认购协议”）。

有鉴于此，根据甲乙双方当前之真实意思表示，本收益凭证拟修改到期日、名义本金、产品份额以及固定增强收益等产品要素的约定，双方达成补充协议如下：

一、 本产品风险揭示书中第七条“本收益凭证特有风险”第 4 段变更如下：

由“本产品设有展期机制，投资者与发行人协商一致可延长（包括多次延长）本产品期限。若投资者认可发行人向投资者报出的下一次展期期间对应的固定增强收益率报价，则应按照产品说明书约定及时向发行人发送展期申请函。若发行人在约定期限及时间内收到投资者的展期申请函并确认无误的，发行人将向投资者发送展期确认函确认此次展期成功。如果投资者不认可发行人就此次展期的报价的，则本产品将于原定到期日（如从未展期，指未展期到期日；如曾展期，指最

近一次展期的展期到期日)到期终止。特别地,如展期日当日双方协商一致提前终止部分产品份额的,发行人将先行计算该等提前终止部分应兑付金额。同时,本产品展期日当日将自动设置为固定增强收益结算日,按照当日未提前终止的存续产品份额计算固定增强收益。对于展期日当日存续的产品份额,将根据本次展期日挂钩标的的收盘价格进行份额折算。如展期日收盘价格大于期初价格,该次份额折算后投资者持有的产品份额将比初始产品份额增加;如展期日收盘价格大于前一次展期日挂钩标的的收盘价格(多次展期时)的,该次份额折算后投资者持有的产品份额将比该次份额折算前增加;反之,如展期日收盘价格小于期初价格,该次份额折算后投资者持有的产品份额将比初始产品份额减少;如展期日收盘价格小于前一次展期日挂钩标的的收盘价格(多次展期时)的,该次份额折算后投资者持有的产品份额将比该次份额折算前减少。发行人将在展期确认函中告知投资者折算后的产品份额,请投资者充分关注该等机制,并注意发行人在展期确认函中告知的本次展期折算后的产品份额。”

变更为:“本产品到期日为【2027】年【9】月【29】日(如遇非交易日顺延至下一交易日)。在本产品到期日前,本产品设有提前终止机制,但在起始日后的特定期限内,本产品不得提前终止。在该等期限后,如投资者希望提前终止本产品,需与发行人协商一致,并严格按照产品说明书约定流程,否则不得提前终止。投资者应充分关注该等机制,包括提前终止情况下本产品的投资收益(或亏损)计算方式可能对投资者权益的影响。

本产品设有固定增强收益率 j (年化)调整机制,发行人将每年对本产品适用的固定增强收益率 j (年化)做出一次调整。如投资者不接受发行人单方确定的某一阶段的固定增强收益率 j (年化),则应当不晚于该固定增强收益率 j (年化)适用区间起始日前一交易日按照产品说明书约定及时向发行人申请全部提前终止。如投资者未按照约定申请提前终止本产品的,则视为投资者接受发行人单方确定的固定增强收益率 j (年化)。请投资者充分注意该等机制对本产品投资损益的影响,包括固定增强收益率的调整可能对投资者权益的影响。

本产品设有份额及名义本金折算机制,本产品固定增强收益率调整日 j 同时为份额和名义本金折算日 j 。该日发行人对本产品调整固定增强收益率 j (年化)的同时,将根据挂钩标的的收盘价格进行份额折算和名义本金折算。在假设未发生部分提前终止的情形下,如固定增强收益率调整日 j 挂钩标的的收盘价格大于期初价格(首次调整时)或固定增强收益率调整日 $j-1$ 挂钩标的的收盘价格(多次调整时)的,折算后投资者持有的产品份额和对应名义本金将比折算前增加;如固定增强收益率调整日 j 挂钩标的的收盘价格小于期初价格(首次调整时)或固定增强收益率调整日 $j-1$ 挂钩标的的收盘价格(多次调整时)的,折算后投资者持有的产品份额和对应的名义本金将比折算前减少,发行人将在《第 j 次份额及名义本金折算确认函》中告知投资者折算后的产品份额和名义

本金，请投资者充分关注该等机制对本产品投资损益的影响，并注意发行人在《第j次份额及名义本金折算确认函》中告知的本次折算后的产品份额和对应名义本金。”

二、 本产品说明书“二、交易条款”中“1 本产品的产品要素”做出如下变更：

涉及变更项目	变更前	变更后
产品份额	1.投资者初始产品份额=投资本金/收益凭证面值，投资者产品份额的计算保留小数点后两位，小数点后第3位四舍五入； 2.如本产品未展期到期日前发生部分提前终止情形的，则产品的剩余份额=初始产品份额-已确认提前终止份额；多次部分提前终止的，则已确认提前终止份额为每次确认提前终止份额的总和； 3.如本产品发生展期的，由发行人在确认展期成功的当日对本产品进行份额折算，并在本产品第j次展期确认函中告知投资者折算后产品份额。 本产品第j次展期的，本次展期部分折算后份额=本次展期部分初始产品份额×本次展期日挂钩标的收盘价格/期初价格（特别地，无论是首次展期还是多次展期，此处期初价格均指起始日挂钩标的的收盘价格）； 如展期日当日同时为提前终止日和固定增强收益结算日，则本产品优先确认提前终止，其后就存续份额计算当日应结算的固定增强收益，最后进行份额折算。	1.投资者初始产品份额=投资本金/收益凭证面值，投资者产品份额的计算保留小数点后两位，小数点后第3位四舍五入； 2.如本产品发生部分提前终止的，则产品的剩余份额=本次提前终止前产品剩余份额-本次提前终止份额； 3.如本产品发生份额折算的，由发行人在份额折算日j当日对本产品进行份额折算，并在本产品《第j次份额及名义本金折算确认函》（模板见附件4）中告知投资者折算后产品份额。 本产品第j次份额折算时，折算后份额=当日存续投资本金对应的初始产品份额×份额折算日j挂钩标的收盘价格/期初价格； 如份额折算日当日同时为提前终止日和固定增强收益结算日，则本产品优先确认提前终止，其后就存续份额计算当日应结算的固定增强收益，最后进行份额折算。 4.本产品共设置4个份额折算日，具体如下： 份额折算日j（j=1,2,3,4）： j=1: 【2023】年【10】月【9】日

		j=2: 【2024】年【9】月【30】日 j=3: 【2025】年【9】月【30】日 j=4: 【2026】年【9】月【30】日 如上述某一份额折算日为非交易日，则顺延至下一交易日，“潜在调整事件”、“中断事件”、“特殊提前终止事件”另有约定的，从其约定。
名义本金	1. 本产品初始名义本金=投资本金/【100%】（按照四舍五入法精确到小数点后2位）； 2. 如本产品发生展期并进行了份额折算，展期期间名义本金由发行人在本产品第j次展期确认函中告知投资者。	1. 本产品初始名义本金=投资本金/【100%】（按照四舍五入法精确到小数点后2位）； 2. 如本产品名义本金折算日1当日或之前发生部分提前终止情形的，则产品的剩余名义本金=初始名义本金-已确认提前终止份额对应名义本金；多次部分提前终止的，则已确认提前终止份额对应名义本金为每次确认提前终止份额对应名义本金的总和； 3. 如本产品发生名义本金折算的，由发行人在名义本金折算日j当日对本产品进行名义本金折算，并在本产品《第j次份额及名义本金折算确认函》中告知投资者折算后产品名义本金。 本产品第j次名义本金折算时，折算后名义本金=当日存续投资本金对应的初始名义本金×名义本金折算日j挂钩标的收盘价格/期初价格； 如本产品名义本金折算日j-1（不含，j>1）至名义本金折算日j（含，j>1）之间发生部分提前终止情形的，则产品的剩余名义本金=本产品名义本金折算日j-1确认的折算后名义本金-名义本

		金折算日 $j-1$ (不含, $j>1$) 至名义本金折算日 j (含, $j>1$) 之间已确认提前终止份额对应的折算后名义本金; 在此期间发生多次部分提前终止的, 则已确认提前终止份额对应的折算后名义本金为每次确认提前终止份额对应的折算后名义本金的总和; 如名义本金折算日当日同时为提前终止日和固定增强收益结算日, 则本产品优先确认提前终止, 其后就存续名义本金计算当日应结算的固定增强收益, 最后进行名义本金折算。 4. 本产品共设置 4 个名义本金折算日, 具体日期同上述 4 个份额折算日。如某一名义本金折算日为非交易日, 则顺延至下一交易日, “潜在调整事件”、“中断事件”、“特殊提前终止事件”另有约定的, 从其约定。
到期日	1. 本产品未展期的, 到期日为【2023】年【9】月【30】日(即“未展期到期日”); 2. 本产品成功展期的, 到期日为最后一次展期所对应的展期到期日; 3. 若该日为非交易日, 则顺延至下一交易日, “潜在调整事件”、“中断事件”、“特殊提前终止事件”另有约定的, 从其约定	本产品到期日为【2027】年【9】月【29】日, 若该日为非交易日则顺延至下一交易日, “潜在调整事件”、“中断事件”、“特殊提前终止事件”另有约定的, 从其约定
产品期限	1. 如未发生提前终止的, 产品期限指自起始日(不含)至未展期到期日(含)之间的自然日天数。如发生展期的, 产品期限相应延长。 2. 双方协商一致提前终止本产品全部份额的, 产品期限指自起始日(不含)至全部份额提前终止日(含)的自然日天数。 3. 若遇起始日、到期日或提前终止日顺延的, 产品期限相应缩短或延长顺延天数。	1. 未发生全部份额提前终止的情形下, 产品期限指自起始日(不含)至到期日(含)之间的自然日天数。 2. 如本产品在到期日前双方协商一致提前终止全部份额的, 产品期限指自起始日(不含)至全部份额提前终止日(含)的自然日天数。 3. 若遇起始日、到期日或提前终止日顺延的, 产品期限相应缩短或延长顺延天数。

期末价格	到期日挂钩标的的收盘价格 为避免疑义，本产品从未成功展期的，期末价格按照未展期到期日的挂钩标的收盘价格确定；本产品成功展期的，期末价格则按照最后一次展期到期日的挂钩标的收盘价格确定。		到期日挂钩标的的收盘价格
提前终止机制	封闭期届满后，经投资者与发行人协商一致，本产品可以在到期日（包括展期到期日）前全部或部分提前终止。 如投资者申请提前终止，应在不晚于提前终止日前一个交易日【18:00】前（以发行人收到的时间为准）向发行人发送提前终止申请邮件（模板见附件1）。提前终止申请邮件应明确申请提前终止日期、提前终止部分份额对应的投资本金。投资者发送邮件之后应及时电话通知发行人，且发行人接收之后投资者不得再撤销该等申请邮件，双方另行协商一致的除外。发行人不晚于提前终止日当日邮件确认（模板见附件2），经发行人邮件确认之后，提前终止申请生效。投资者最终提前终止的份额以发行人确认的数值为准。		封闭期届满后，经投资者与发行人协商一致，本产品可以在到期日前全部或部分提前终止。 如投资者申请提前终止，应在不晚于提前终止日前一个交易日【18:00】前（以发行人收到的时间为准）向发行人发送提前终止申请邮件（模板见附件1）。提前终止申请邮件应明确申请提前终止日期、提前终止部分份额对应的投资本金。投资者发送邮件之后应及时电话通知发行人，且发行人接收之后投资者不得再撤销该等申请邮件，双方另行协商一致的除外。发行人不晚于提前终止日当日邮件确认（模板见附件2），经发行人邮件确认之后，提前终止申请生效。投资者最终提前终止的份额以发行人确认的数值为准。
投资收益（或损失）（非年化）中“固定增强收益”项	固定增强收益	固定增强收益率 j（年化）（$j=0, 1, 2 \dots$）： 1. 本产品未展期的，适用的固定增强收益率 0 为【7.8】%； 2. 本产品成功展期的，第 j 次展期的期间适用的固定增强收益率 j 根据展期机制中约定确定。 固定增强收益结算总次数 M：【4】	固定增强收益率调整日 j（$j=1, 2, 3, 4$）： 本产品共设置 4 个固定增强收益率调整日，具体日期同上述 4 个份额折算日。如某一固定增强收益率调整日为非交易日，则顺延至下一交易日，“潜在调整事件”、“中断事件”、“特殊提前终止事件”另有约定的，从其约定。

	本产品固定增强收益（含展期期间固定增强收益）在产品存续期内定期结算并支付给投资者，如投资者持有至未展期到期日，固定增强收益最多单独结算并支付M次。本产品发生展期的，M值根据《固定增强收益率j（年化）协商书》重新确定。 固定增强收益结算日i： （i=1,2,...,M） i=1: 【2022】年【12】月【30】日 i=2: 【2023】年【3】月【30】日 i=3: 【2023】年【6】月【30】日 i=4: 【2023】年【9】月【30】日 如遇上述某一约定的固定增强收益结算日i为非交易日，则顺延至下一交易日。本产品发生展期的，展期日（含）开始增设的固定增强收益结算日i根据《固定增强收益率j（年化）协商书》重新确定。 1. 固定增强收益i （i=1,2,...,M）为投资者在第i个固定增强收益结算日可取得的固定增强收益； 2. i=1时，固定增强收益1=固定增强收益结算日1本产品剩余份额对应名义本金×起始	固定增强收益率j（年化）（j=0, 1, 2, 3, 4）： 1.本产品起始日（不含）至固定增强收益率调整日1（含）之间适用的固定增强收益率0（年化）为【7.8】%； 2. 本产品固定增强收益率调整日1（不含）至固定增强收益率调整日2（含）之间适用的固定增强收益率1（年化）为【1.8】%； 4.本产品固定增强收益率j（年化）（j=2, 3, 4）由发行人单方确定，发行人应不晚于固定增强收益率（年化）调整日j前【7】个工作日（含当日）确定固定增强收益率j（年化），并按照约定的方式向投资者发送《固定增强收益率j（年化）调整通知书》（模板见附件3），该固定增强收益率j（年化）适用于固定增强收益率调整日j（不含）至固定增强收益率调整日j+1（含）。如投资者不接受发行人单方确定的某一固定增强收益率j（年化），则应当不晚于该固定增强收益率j（年化）适用区间起始日前一交易日按照产品说明书约定及时向发行人申请全部提前终止。投资者发送邮件之后应及时电话通知发行人，且发行人接收之后投资者不得再撤销该
--	---	---

	日(不含)至固定增强收益结算日1(含)之间适用的固定增强收益率$j \times$(起始日(不含)至固定增强收益结算日1(含)之间的自然日天数)$\div 365$; 3. $1 < i \leq M$时, 固定增强收益i(非年化)=固定增强收益结算日i本产品剩余份额对应名义本金$\times$固定增强收益结算日$i-1$(不含)至固定增强收益结算日i(含)之间适用的固定增强收益率$j \times$(固定增强收益结算日$i-1$(不含)至固定增强收益结算日i(含)之间的自然日天数)$\div 365$; “固定增强收益结算日$i-1$”指第i个固定增强收益结算日的上一个固定增强收益结算日。 4. 如投资者与发行人协商一致部分或全部提前终止本产品的, 则本次提前终止部分固定增强收益=本次提前终止份额对应的名义本金$\times$本次提前终止日前最近一个固定增强收益结算日i(不含)至本次提前终止日(含)之间适用的固定增强收益率$j \times$(本次提前终止日前最近一个固定增强收益结算日i(不含)至本次提前终止日(含)之间的自然日天数)$\div 365$	等申请邮件, 双方另行协商一致的除外。如投资者未按照约定申请提前终止本产品的, 则视为投资者接受发行人单方确定的固定增强收益率j(年化)。 固定增强收益结算总次数M: 本产品固定增强收益在产品存续期内分M次结算并支付给投资者。发行人在每次调整本产品的固定增强收益率j(年化)后可同时增加固定增强收益结算总次数。增加后的M值及新增的固定增强收益结算日i通过《固定增强收益率j(年化)调整通知书》告知投资者。 固定增强收益结算日i: ($i=1, 2, \dots, M$) $i=1$: 【2022】年【12】月【30】日 $i=2$: 【2023】年【3】月【30】日 $i=3$: 【2023】年【6】月【30】日 $i=4$: 【2023】年【9】月【30】日 如遇上述某一约定的固定增强收益结算日i为非交易日, 则顺延至下一交易日。 发行人在每次调整本产品的固定增强收益率j(年化)后可同时增加固定增
--	---	--

	5. 提前终止部分份额在提前终止日后不再计算固定增强收益；如发行人与投资者协商一致的提前终止日为某一固定增强收益结算日<i>i</i>，则提前终止部分份额对应的固定增强收益在提前终止兑付金额中一并计算，不再单独结算或支付该部分份额的固定增强收益。该等情况下，上述第2项和第3项中的“本产品剩余份额对应名义本金”均指提前终止后仍存续份额对应的名义本金。 6. 如本产品发生展期的，展期日（包括后续多次展期的各展期日）当日自动设置为固定增强收益结算日，且当日展期的份额可获得的固定增强收益为： 固定增强收益=展期份额(折算前)对应名义本金×本次展期日之前最近一个固定增强收益结算日(不含)至本次展期日(含)之间适用的固定增强收益率<i>j</i>(年化)×本次展期日之前最近一个固定增强收益结算日(不含)至本次展期日(含)之间的自然日天数÷365 上述公式中的“展期份额”是指展期日当日存续的份额，不包	强收益结算日。新增的固定增强收益结算日<i>i</i>通过《固定增强收益率<i>j</i>(年化)调整通知书》告知投资者。 1. 固定增强收益<i>i</i> (<i>i</i>=1,2,...,M)为投资者在第<i>i</i>个固定增强收益结算日可取得的固定增强收益； 2. <i>i</i>=1时，固定增强收益1=固定增强收益结算日1本产品剩余份额对应名义本金×起始日(不含)至固定增强收益结算日1(含)之间适用的固定增强收益率<i>j</i>(年化)×起始日(不含)至固定增强收益结算日1(含)之间的自然日天数÷365； 3. $1 < i \leq M$时，固定增强收益<i>i</i>(非年化)=固定增强收益结算日<i>i</i>本产品剩余份额对应名义本金×固定增强收益结算日<i>i</i>-1(不含)至固定增强收益结算日<i>i</i>(含)之间适用的固定增强收益率<i>j</i>(年化)×固定增强收益结算日<i>i</i>-1(不含)至固定增强收益结算日<i>i</i>(含)之间的自然日天数÷365； “固定增强收益结算日<i>i</i>-1”指第<i>i</i>个固定增强收益结算日的上一个固定增强收益结算日。 4. 如投资者与发行人协商一致部分或全部提
--	---	--

	括展期日提前终止的部分份额，提前终止的份额按照产品说明书相关约定在提前终止兑付金额中先行计算并支付。 7. 确定展期日的固定增强收益后，本产品将根据展期机制约定于展期日对展期部分的产品份额、名义本金进行份额折算。本次展期日至展期后到期日期间固定增强收益率和展期后的固定增强收益结算日按照展期机制约定确定，展期期间固定增强收益结算日应支付的固定增强收益参照上述第3条和第4条计算，且公式中的“本产品剩余份额对应名义本金”或“本次提前终止份额对应的名义本金”使用折算后份额对应的名义本金计算。 8. 如本产品到期日仍有剩余份额的，到期日就剩余份额投资者可获得固定增强收益为： 固定增强收益=到期日剩余份额对应名义本金×固定增强收益结算日M（不含）至到期日（含）之间适用的固定增强收益率j×（固定增强收益结算日M（不含）至		前终止本产品的，则本次提前终止部分固定增强收益=本次提前终止份额对应的名义本金×本次提前终止日前最近一个固定增强收益结算日i（不含）至本次提前终止日（含）之间适用的固定增强收益率j（年化）×本次提前终止日前最近一个固定增强收益结算日i（不含）至本次提前终止日（含）之间的自然日天数÷365 5. 提前终止部分份额在提前终止日后不再计算固定增强收益；如发行人与投资者协商一致的提前终止日为某一固定增强收益结算日i，则提前终止部分份额对应的固定增强收益在提前终止兑付金额中一并计算，不再单独结算或支付该部分份额的固定增强收益。该等情况下，上述第2项和第3项中的“本产品剩余份额对应名义本金”均指提前终止后仍存续份额对应的名义本金。 6. 如本产品到期日仍有剩余份额的，到期日就剩余份额投资者可获得固定增强收益为： 固定增强收益=到期日剩余份额对应名义本金×固定增强收益结算日M（不含）至
--	--	--	---

	到期日（含）之间的自然日天数）÷365 9. 以上固定增强收益计算结果四舍五入精确到小数点后2位。	到期日（含）之间适用的固定增强收益率j（年化）×固定增强收益结算日M（不含）至到期日（含）之间的自然日天数÷365 7. 以上固定增强收益计算结果四舍五入精确到小数点后2位。
展期机制	1. 经发行人和投资者协商一致，本产品可以展期。发行人在到期日（如从未展期，指未展期到期日；如曾展期，指最近一次展期的到期日，下同）前【10】个工作日通过电子邮件形式向投资者发送《展期固定增强收益率j（年化）协商函》（模板见附件3），明确下一次拟展期期间的增强收益率报价及展期期限等信息；如投资者接受该协商函内容，应当在对应展期起始日前【1】个工作日（含当日）【18:00】之前通过“指定联系方式”中指定邮箱向发行人发送展期申请（模板见附件4），并应当立即电话通知发行人。发行人确认收到该等展期申请并确认信息无误后，于对应展期起始日内通过指定邮箱向投资者发送展期确认邮件（模板见附件5），本次展期即生效。 2. 本产品发生展期时将进行份额折算。第j次展期的，本次展期部分折算后份额=本次展期部分初始产品份额×本次展期日挂钩标的收盘价格/期初价格（特别地，无论是首次展期还是多次展期，此处期初价格均指起始日挂钩标的的收盘价格）；	（删除该条）

	3. 若投资者不认可发行人当次展期安排的，则应当邮件回复发行人不接受报价，本次展期失败。如投资者未按照第 1 项约定时间和流程向发行人发送展期申请，则视为投资者不同意展期，本次展期失败。 4. 如本产品从未展期的，本产品将于未展期到期日终止；如本产品曾展期的，本产品将于最后一次展期到期日终止。本产品存续期间可根据上述流程多次展期。	

三、 本产品说明书“三、产品收益（或损失）情景分析”做出如下变更：

变更前：

投资者投资本产品，可以获得的投资收益或承担的投资损失金额取决于所挂钩的【中证 500 指数(000905.SH)】收盘价格的变化。发行人根据本产品的投资收益（或损失）结构通过市场惯用的方法分析本产品在不同情景下的未来可能收益或损失，但预期收益（或损失）、预计收益（或损失）、测算收益（或损失）或类似表述均不具有法律约束力，投资者投资前仍需结合自身风险承受能力，审慎评估投资本产品所面临的风险。此外，以下情景分析仅为计算示例，发行人不保证与本产品商业要素完全匹配，仅供投资者参考。

假设投资者以【200 万元】资金认购本产品，对应的投资本金为 200 万元，确认初始产品份额 200 万份，初始名义本金 200 万元。固定增强收益率 0（年化）为 10%，产品起始日（不含）至未展期到期日（含）之间的自然日天数为 365 天。起始日挂钩标的的期初价格为 1000.00 元，固定增强收益率结算次数 M=3，对应的起始日（不含）至固定增强收益结算日 1（含）之间的自然日天数为 90 天，固定增强收益结算日 1（不含）至固定增强收益结算日 2（含）之间的自然日天数为 91 天，固定增强收益结算日 2（不含）至固定增强收益结算日 3（含）之间的自然日天数为 92 天，固定增强收益结算日 3（不含）至未展期到期日（含）之间的自然日天数为 92 天。

根据挂钩标的收盘价格变化的不同情形，投资者投资本产品的收益（或亏损）有如下几种情况：

1、极端情景：假设投资者于起始日后 30 天（假设已过封闭期）申请提前终止全部投资本金，对应提前终止名义本金为 200 万元，提前终止日（该日需为交易日）挂钩标的提前终止价格为 0.00 元，则：

本次提前终止日当日应结算的投资收益（或亏损）= $2,000,000 \times (0.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 2,000,000 \times 10\% \times 30 \div 365 = -1983561.64$ 元

2. 较差情形（即假设挂钩标的指数在投资持有期间下跌）

2.1 假设投资者在持有本产品 170 天时提前终止投资本金 50 万对应的份额（即固定增强收益结算日 2 和固定增强收益结算日 3 产品剩余份额为 150 万份），提前终止日挂钩标的收盘价为 900.00 元，剩余份额持有至未展期到期日。则：

固定增强收益结算日 1 结算的固定增强收益= $2,000,000 \times 10\% \times 90 \div 365 = 49,315.07$ 元

持有第 170 天提前终止当日应结算的投资收益（或亏损）= $500,000 \times (900.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 500,000 \times 10\% \times (170 - 90) \div 365 = -39,041.10$ 元

固定增强收益结算日 2 结算的固定增强收益= $1,500,000 \times 10\% \times 91 \div 365 = 37,397.26$ 元

固定增强收益结算日 3 结算的固定增强收益= $1,500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 37,808.22$ 元

2.1.1 在上述 2.1 假设前提下，如未展期到期日投资者未申请展期，当日挂钩标的收盘价为 800.00 元。则：

未展期到期日应结算的投资收益（或亏损）= $1,500,000 \times (800.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 1,500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = -262,191.78$ 元

2.1.2 在上述 2.1 假设前提下，如未展期到期日投资者申请对于当日存续的 150 万份额部分终止 50 万，剩余 100 万份额展期 1 年（假设 367 天，此部分对应投资本金 100 万元），当日挂钩标的收盘价为 800.00 元，第 1 次展期期间适用的固定增强收益率 $1=8\%$ 。

经发行人确认，第 1 次展期期间增设 4 个固定增强收益结算日（即 M 重新确认为 7），原未展期到期日自动设置为固定增强收益结算日 4。且展期后，固定增强收益结算日 4（不含）至固定增强收益结算日 5（含）之间的自然日天数为 90 天，固定增强收益结算日 5（不含）至固定增强收益结算日 6（含）之间的自然日天数为 91 天，固定增强收益结算日 6（不含）至固定增强收益结算日 7（含）之间的自然日天数为 92

天，固定增强收益结算日 7（不含）至第 1 次展期到期日（含）之间的自然日天数为 94 天。则：

展期当日优先确认部分提前终止，提前终止部分当日应结算的投资收益（或亏损）= $500,000 \times (800.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = -87,397.26$ 元

对于剩余存续份额，当日自动设置为固定增强收益结算日 4，应结算的固定增强收益= $1,000,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 25,205.48$ 元

结算完固定增强收益后，发行人当日对该部分存续份额进行份额折算，折算后的产品份额= $1,000,000 \times 800.00 \div 1000.00 = 800,000$ 份

如投资者此后未再申请提前终止，将剩余份额持有至第 1 次展期后到期日全部终止，第 1 次展期后到期日挂钩标的收盘价为 700.00 元。则：

固定增强收益结算日 5 结算的固定增强收益= $800,000 \times 8\% \times 90 \div 365 = 15,780.82$ 元

固定增强收益结算日 6 结算的固定增强收益= $800,000 \times 8\% \times 91 \div 365 = 15,956.16$ 元

固定增强收益结算日 7 结算的固定增强收益= $800,000 \times 8\% \times 92 \div 365 = 16,131.51$ 元

第 1 次展期到期日应结算的投资收益（或亏损）= $1,000,000 \times (700.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 800,000 \times 8\% \times 94 \div 365 = -283,517.81$ 元

3. 较好情形（即假设挂钩标的指数在投资持有期间上涨）

- 3.1 假设投资者在持有本产品 170 天时提前终止投资本金 50 万对应的份额（即固定增强收益结算日 2 和固定增强收益结算日 3 产品剩余份额为 150 万份），提前终止日挂钩标的收盘价为 1100.00 元，剩余份额持有至未展期到期日。则：

固定增强收益结算日 1 结算的固定增强收益= $2,000,000 \times 10\% \times 90 \div 365 = 49,315.07$ 元

持有第 170 天提前终止当日应结算的投资收益（或亏损）= $500,000 \times (1100.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 500,000 \times 10\% \times (170 - 90) \div 365 = 60,958.90$ 元

固定增强收益结算日 2 结算的固定增强收益= $1,500,000 \times 10\% \times 91 \div 365 = 37,397.26$ 元

固定增强收益结算日 3 结算的固定增强收益= $1,500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 37,808.22$ 元

3.1.1 在上述 3.1 假设前提下，如未展期到期日投资者未申请展期，当日挂钩标的收盘价为 1200.00 元。则：

未展期到期日应结算的投资收益（或亏损）= $1,500,000 \times (1200.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 1,500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 337,808.22$ 元

3.1.2 在上述 3.1 假设前提下，如未展期到期日投资者申请对于当日存续的 150 万份额部分终止 50 万，剩余 100 万份额展期 1 年（假设 367 天，此部分对应投资本金 100 万元），当日挂钩标的收盘价为 1200.00 元，第 1 次展期期间适用的固定增强收益率 $1=8\%$ 。

经发行人确认，第 1 次展期期间增设 4 个固定增强收益结算日（即 M 重新确认为 7），原未展期到期日自动设置为固定增强收益结算日 4。且展期后，固定增强收益结算日 4（不含）至固定增强收益结算日 5（含）之间的自然日天数为 90 天，固定增强收益结算日 5（不含）至固定增强收益结算日 6（含）之间的自然日天数为 91 天，固定增强收益结算日 6（不含）至固定增强收益结算日 7（含）之间的自然日天数为 92 天，固定增强收益结算日 7（不含）至第 1 次展期到期日（含）之间的自然日天数为 94 天。则：

展期当日优先确认部分提前终止，提前终止部分当日应结算的投资收益（或亏损）= $500,000 \times (1200.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 112,602.74$ 元

对于剩余存续份额，当日自动设置为固定增强收益结算日 4，应结算的固定增强收益= $1,000,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 25,205.48$ 元

结算完固定增强收益后，发行人当日对该部分存续份额进行份额折算，折算后的产品份额= $1,000,000 \times 1200.00 \div 1000.00 = 1,200,000$ 份

如投资者此后未再申请提前终止，将剩余份额持有至第 1 次展期后到期日全部终止，第 1 次展期后到期日挂钩标的收盘价为 1300.00 元。则：

固定增强收益结算日 5 结算的固定增强收益= $1,200,000 \times 8\% \times 90 \div 365 = 23,671.23$ 元

固定增强收益结算日 6 结算的固定增强收益= $1,200,000 \times 8\% \times 91 \div 365 = 23,934.25$ 元

固定增强收益结算日 7 结算的固定增强收益= $1,200,000 \times 8\% \times 92 \div 365 = 24,197.26$ 元

第 1 次展期到期日应结算的投资收益（或亏损）= $1,000,000 \times (1300.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 1,200,000 \times 8\% \times 94 \div 365 = 324,723.29$ 元

变更为：

“投资者投资本产品，可以获得的投资收益或承担的投资损失金额取决于所挂钩的【中证 500(000905.SH)】收盘价格的变化。发行人根据本产品的产品要素通过市场惯用的方法分析本产品在不同情景下的未来可能收益或损失，但预期收益（或损失）、预计收益（或损失）、测算收益（或损失）或类似表述均不具有法律约束力，投资者投资前仍需结合自身风险承受能力，审慎评估投资本产品所面临的风险。

假设投资者以【200 万元】资金认购本产品，对应的投资本金为 200 万元，确认初始产品份额 200 万份，初始名义本金 200 万元。固定增强收益率 0（年化）为 10%，产品起始日（不含）至固定增强收益率调整日 1（含）之间的自然日天数为 365 天。起始日挂钩标的的期初价格为 1000.00 元，产品成立时在起始日至固定增强收益率调整日 1 之间设置 3 个固定增强收益率结算日（即期初 $M=3$ ），且对应的起始日（不含）至固定增强收益结算日 1（含）之间的自然日天数为 90 天，固定增强收益结算日 1（不含）至固定增强收益结算日 2（含）之间的自然日天数为 91 天，固定增强收益结算日 2（不含）至固定增强收益结算日 3（含）之间的自然日天数为 92 天，固定增强收益结算日 3（不含）至固定增强收益率调整日 1（含）之间的自然日天数为 92 天。

根据挂钩标的收盘价格变化的不同情形，投资者投资本产品的收益（或亏损）有如下几种情况：

- 1、极端情景：假设投资者于起始日后 30 天（假设已过封闭期）申请提前终止全部投资本金，对应提前终止名义本金为 200 万元，提前终止日（该日需为交易日）挂钩标的提前终止价格为 0.00 元，则：

本次提前终止日当日应结算的投资收益（或亏损）= $2,000,000 \times (0.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 2,000,000 \times 10\% \times 30 \div 365 = -1983561.64$ 元

2、较差情形（即假设挂钩标的指数在投资持有期间下跌）

2.1 假设投资者申请在持有本产品 170 天时提前终止投资本金 50 万对应的份额并经发行人确认，提前终止日挂钩标的收盘价为 900.00 元，

剩余份额持有至固定增强收益率调整日 1（由此固定增强收益结算日 2 和固定增强收益结算日 3 产品剩余份额为 150 万份）。则：

固定增强收益结算日 1 结算的固定增强收益 = $2,000,000 \times 10\% \times 90 \div 365 = 49,315.07$ 元

持有第 170 天提前终止当日应结算的投资收益（或亏损） = $500,000 \times (900.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 500,000 \times 10\% \times (170 - 90) \div 365 = -39,041.10$ 元

固定增强收益结算日 2 结算的固定增强收益 = $1,500,000 \times 10\% \times 91 \div 365 = 37,397.26$ 元

固定增强收益结算日 3 结算的固定增强收益 = $1,500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 37,808.22$ 元

2.1.1 在上述 1.1 假设前提下，假设投资者在固定增强收益率调整日 1 申请提前终止全部剩余份额并经发行人确认，且当日挂钩标的收盘价为 800.00 元。则：

本次提前终止应结算的投资收益（或亏损） = $1,500,000 \times (800.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 1,500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = -262,191.78$ 元

2.1.2 在上述 1.1 假设前提下，发行人确定的固定增强收益率 1（年化） = 6%，假设投资者在固定增强收益率调整日 1 申请提前终止 50 万份额并经发行人确认，剩余份额投资者继续持有，当日挂钩标的收盘价为 800.00 元。同时发行人在调整固定增强收益率 1（年化）后，在固定增强收益率调整日 1（含）至固定增强收益调整日 2（不含）之间增设 4 个固定增强收益结算日（即 M 重新确认为 7），其中固定增强收益结算日 4 同固定增强收益率调整日 1，固定增强收益结算日 4（不含）至固定增强收益结算日 5（含）之间的自然日天数为 90 天，固定增强收益结算日 5（不含）至固定增强收益结算日 6（含）之间的自然日天数为 91 天，固定增强收益结算日 6（不含）至固定增强收益结算日 7（含）之间的自然日天数为 92 天，固定增强收益结算日 7（不含）至固定增强收益率调整日 2（含）之间的自然日天数为 94 天。则：

固定增强收益率调整日 1 发行人优先确认部分提前终止，提前终止部分当日应结算的投资收益（或亏损） = $500,000 \times (800.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = -87,397.26$ 元

对于剩余存续份额，当日同时设置为固定增强收益结算日 4，应结算的固定增强收益=1,000,000 × 10% × 92 ÷ 365=25,205.48 元

结算完固定增强收益后，发行人当日对该部分存续份额和名义本金进行折算，折算后的产品剩余份额=1,000,000 × 800.00 ÷ 1000.00=800,000 份，折算后的剩余名义本金=1,000,000 × 800.00 ÷ 1000.00=800,000 元。

假设投资者此后将剩余份额持有至固定增强收益率调整日 2，并在当日申请全部终止并经发行人确认，当日挂钩标的收盘价为 700.00 元。则：

固定增强收益结算日 5 结算的固定增强收益= 800,000 × 6% × 90 ÷ 365= 11,835.62 元

固定增强收益结算日 6 结算的固定增强收益= 800,000 × 6% × 91 ÷ 365= 11,967.12 元

固定增强收益结算日 7 结算的固定增强收益= 800,000 × 6% × 92 ÷ 365= 12,098.63 元

固定增强收益率调整日 2 提前终止应结算的投资收益（或亏损）= 1,000,000 × (700.00-1000.00) ÷ 1000.00 × 100%+ 800,000 × 6% × 94 ÷ 365 = -287,638.36 元

3、较好情形（即假设挂钩标的指数在投资持有期间上涨）

3.1 假设投资者在持有本产品 170 天时申请提前终止投资本金 50 万对应的份额并经发行人确认，提前终止日挂钩标的收盘价为 1100.00 元，剩余份额持有至固定增强收益率调整日 1（由此固定增强收益结算日 2 和固定增强收益结算日 3 产品剩余份额为 150 万份）。则：

固定增强收益结算日 1 结算的固定增强收益= 2,000,000 × 10% × 90 ÷ 365=49,315.07 元

持有第 170 天提前终止当日应结算的投资收益（或亏损）= $500,000 \times (1100.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 500,000 \times 10\% \times (170 - 90) \div 365 = 60,958.90$ 元

固定增强收益结算日 2 结算的固定增强收益= $1,500,000 \times 10\% \times 91 \div 365 = 37,397.26$ 元

固定增强收益结算日 3 结算的固定增强收益= $1,500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 37,808.22$ 元

3.1.1 在上述 2.1 假设前提下，假设投资者在固定增强收益率调整日 1 申请提前终止全部剩余份额并经发行人确认，且当日挂钩标的收盘价为 1200.00 元。则：

本次提前终止应结算的投资收益（或亏损）= $1,500,000 \times (1200.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 1,500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 337,808.22$ 元

3.1.2 在上述 2.1 假设前提下，发行人确定的固定增强收益率 1（年化）=6%，假设投资者在固定增强收益率调整日 1 申请提前终止 50 万份额并经发行人确认，剩余份额投资者继续持有，当日挂钩标的收盘价为 1200.00 元。同时发行人在调整固定增强收益率 1（年化）后，在固定增强收益率调整日 1（含）至固定增强收益调整日 2（不含）之间增设 4 个固定增强收益结算日（即 M 重新确认为 7），其中固定增强收益结算日 4 同固定增强收益率调整日 1，固定增强收益结算日 4（不含）至固定增强收益结算日 5（含）之间的自然日天数为 90 天，固定增强收益结算日 5（不含）至固定增强收益结算日 6（含）之间的自然日天数为 91 天，固定增强收益结算日 6（不含）至固定增强收益结算日 7（含）之间的自然日天数为 92 天，固定增强收益结算日 7（不含）至固定增强收益率调整日 2（含）之间的自然日天数为 94 天。则：

固定增强收益率调整日 1 发行人优先确认部分提前终止，提前终止部分当日应结算的投资收益（或亏损）= $500,000 \times (1200.00 - 1000.00) \div 1000.00 \times 100\% + 500,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 112,602.74$ 元

对于剩余存续份额，当日同时设置为固定增强收益结算日 4，应结算的固定增强收益= $1,000,000 \times 10\% \times 92 \div 365 = 25,205.48$ 元

结算完固定增强收益后，发行人当日对该部分存续份额和名义本金进行折算，折算后的产品剩余份额= $1,000,000 \times 1200.00 \div 1000.00 = 1,200,000$

份，折算后的剩余名义本金=1,000,000 × 1200.00 ÷ 1000.00=1,200,000 元。

假设投资者此后将剩余份额持有至固定增强收益率调整日 2，并在当日申请全部终止并经发行人确认，当日挂钩标的收盘价为 1300.00 元。则：

固定增强收益结算日 5 结算的固定增强收益= 1,200,000 × 6% × 90 ÷ 365= 17,753.42 元

固定增强收益结算日 6 结算的固定增强收益= 1,200,000 × 6% × 91 ÷ 365= 17,950.68 元

固定增强收益结算日 7 结算的固定增强收益= 1,200,000 × 6% × 92 ÷ 365=18,147.95 元

固定增强收益率调整日 2 提前终止应结算的投资收益（或亏损）= 1,000,000 × (1300.00-1000.00) ÷ 1000.00 × 100%+ 1,200,000 × 6% × 94 ÷ 365 = 318,542.47 元”

四、 将收益凭证认购协议第十九条“甲方的声明和保证”（十三）做出如下变更：

变更前：

“（十三）甲方充分知悉本产品设置有提前终止和期间支付固定增强收益机制，完全理解该机制的相关风险。”

变更后：

“甲方充分知悉本产品设置有提前终止机制，在发行人和投资者协商一致的情况下可以提前全部终止或者部分终止，但是自本产品起始日的一定期限内不得提前终止；此外，甲方充分知悉本产品设置有固定增强收益率 j（年化）调整机制、份额及名义本金折算机制，甲方完全理解前述机制的相关风险。”

五、 将收益凭证认购协议第十二章“反商业贿赂”做出如下变更：

变更前：

“合同一方向另一方承诺并保证，在本协议的签署及履行过程中，其自身应当，并应促使其为履行本协议的工作人员、其关联方及关联方的工作人员应当，严格遵守法律法规、行业自律规则、社会公德、商业道德、职业道德和行为规范，不得以任何直接或间接的方式贿赂另一方和/或其关联方的任何人员和/或与该等人员具有利益关系的人员，不得以任何方式直接或间接提供或索取回扣、佣金等不正当财物、利益或机会，不得以任何方式直接或间接提供或获取内幕信息、未公开信息、商业秘密和客户信息，不得以任何方式从事其他商业贿赂或利益输送行为。合同各方理解并同意配合另一方或其监管机构就廉洁从业及反商业贿赂开展的检查调查工作，并提供必要的协助及配合。如合同一方违反前款约定，另一方有权终止本协议，要求违约方承担相应责任并协助消除由此造成的不良影响。乙方制定了廉洁从业管理制度，并规定了投诉举报机制，[投诉举报专项邮箱 CICC_WHISTLEBLOW@cicc.com.cn](mailto:CICC_WHISTLEBLOW@cicc.com.cn)。”

变更后：

“合同一方向另一方承诺并保证，在本协议的签署及履行过程中，其自身应当，并应促使其为履行本协议的工作人员、其关联方及关联方的工作人员应当，严格遵守法律法规、行业自律规则、社会公德、商业道德、职业道德和行为规范，不得以任何直接或间接的方式贿赂另一方和/或其关联方的任何人员和/或与该等人员具有利益关系的人员，不得以任何方式直接或间接提供或索取回扣、佣金等不正当财物、利益或机会，不得以任何方式直接或间接提供或获取内幕信息、未公开信息、商业秘密和客户信息，不得以任何方式从事其他商业贿赂或利益输送行为。合同各方理解并同意配合另一方或其监管机构就廉洁从业及反商业贿赂开展的检查调查工作，并提供必要的协助及配合。如合同一方违反前款约定，另一方有权终止本协议，要求违约方承担相应责任并协助消除由此造成的不良影响。乙方制定了廉洁从业管理制度，并规定了投诉举报机制，投诉举报专项邮箱为 zj_xfjb@cicc.com.cn（举报邮箱以乙方官网不时公布的邮箱为准）。”

六、 附件3“固定增强收益率【j】（年化）协商书”做出如下变更：

变更前：

“附件3

固定增强收益率【j】（年化）协商书

编号：【】-【】

致投资者：

根据贵司与中国国际金融股份有限公司（以下简称“我司”）已签订的《中金公司【】号收益凭证产品风险揭示书》、《中金公司【】号收益凭证产品说明书》、《中金公司【】

号收益凭证产品说明书认购协议》，我司现拟对该产品第【】次展期期间适用的固定增强收益率【】及其展期期间做出如下提议，如贵司同意下述提议，请在不晚于下表中本次展期起始日前【1】个工作日内通过指定邮箱向我司提出展期申请。

第【】次展期起始日	【】年【】月【】日
第【】次展期后到期日	【】年【】月【】日
固定增强收益率【】	【】（年化）
固定增强收益率【】适用期间	【】年【】月【】日（不含）至【】年【】月【】日（含）
如本次产品成功展期，将增设的固定增强收益结算日 i	i=【】：【】年【】月【】日 i=【】：【】年【】月【】日 i=【】：【】年【】月【】日 i=【】：【】年【】月【】日
如本次产品成功展期，固定增强收益结算总次数 M 重新确定为：	【】

如贵司未按照产品说明书约定提出申请的，视为贵司不同意展期，本次展期失败。

中国国际金融股份有限公司

日期： 年 月 日”

变更后：

“附件 3

固定增强收益率【j】（年化）调整通知书

编号：【】-【】

致投资者：

根据贵司与中国国际金融股份有限公司（以下简称“我司”）已签订的《中金公司【】号收益凭证产品风险揭示书》、《中金公司【】号收益凭证产品说明书》、《中金公司【】

号收益凭证产品说明书认购协议》及《中金公司【】号收益凭证产品补充协议（一）》，
我司现拟调整本产品固定增强收益率（年化），调整后的固定增强收益率【】（年化）及其适用区间做出如下：

固定增强收益率【】（年化）	【】（年化）
固定增强收益率【】（年化）适用区间	【】年【】月【】日（不含）至【】年【】月【】日（含）
本产品将增设的固定增强收益结算日 i	i=【】：【】年【】月【】日 i=【】：【】年【】月【】日 i=【】：【】年【】月【】日 i=【】：【】年【】月【】日
本次增设后固定增强收益结算总次数 M 重新确定为：	【】

如贵司不接受我司调整后的固定增强收益率【】（年化），则应当不晚于上述固定增强收益率【】（年化）适用区间起始日前一交易日按照产品说明书约定及时向我司申请全部提前终止贵司持有的全部产品份额。如贵司未按照约定申请全部提前终止的，则视为接受我司本次对固定增强收益率【】（年化）的调整。

中国国际金融股份有限公司

日期： 年 月 日”

- 七、 删除原产品文件“附件 4”和“附件 5”；
- 八、 新增如下附件：

“附件 4

第【j】次份额及名义本金折算确认函

编号：【】-【】

致投资者：

贵司与中国国际金融股份有限公司（以下简称“我司”）已签订《中金公司【】号收益凭证产品风险揭示书》、《中金公司【】号收益凭证产品说明书》、《中金公司【】号

收益凭证产品说明书认购协议》及《中金公司【】号收益凭证产品补充协议（一）》（以下合称“产品文件”），我司根据产品文件约定对本产品份额及名义本金进行了折算，折算结果如下：

份额及名义本金折算日	【】年【】月【】日
折算前剩余份额	【】份（已扣除当日提前终止份额（如有））
折算后剩余份额	【】份
折算前名义本金	【】元（已扣除当日提前终止名义本金（如有））
折算后名义本金	【】元

中国国际金融股份有限公司

日期： 年 月 日”

- 九、甲乙双方认可上述约定真实、准确、完整地反映了双方就变更本收益凭证产品要素达成的一致意见。甲方确认已按照信托计划文件相关约定就本补充协议内容和签署取得信托计划委托人同意，并已向信托计划委托人进行了完整、充分地信息披露。
- 十、本补充协议未提及事项，以产品说明书、风险揭示书、认购协议的约定为准。本补充协议约定与产品说明书、风险揭示书、认购协议的约定不一致的，以本补充协议约定为准。
- 十一、 本补充协议经由甲方法定代表人或授权代表签字/签章并加盖公章、乙方加盖公章或合同专用章并于【2024】年【10】月【1】日起生效。本补充协议自生效之日起构成产品说明书、风险揭示书和认购协议不可或缺的一部分。
- 十二、 本补充协议一式三份，甲方执一份，乙方执二份，具有同等法律效力。
- （以下无正文）

甲方：华润深国投信托有限公司（代“华润信托·盈厦金益中证 500 指数增强 2 号集合资金信托计划”）（公章）

法定代表人或授权代表签字: _____

签署日期: 2024 年 月 日

乙方: 中国国际金融股份有限公司 (公章或合同专用章)

签署日期: 2024 年 9 月 日

附件二：固定增强收益率【2】（年化）调整通知书

【请以此为准】PB0145号固定利率调整通知函

Yunwei Xu (EQ)

发给 cpjl2, ny-zhangxy, pengzj1, EQD_PB_Risk, Xinran Chen (EQ)

2024-09-23 11:15 隐藏信息

发件人: Yunwei Xu (EQ) <yunwei.xu@cicc.com.cn>

收件人: cpjl2 <cpjl2@crctrust.com>, ny-zhangxy <ny-zhangxy@crctrust.com>,

pengzj1 <pengzj1@crctrust.com>

抄送: EQD_PB_Risk <eqd_pb_risk@cicc.com.cn>,

Xinran Chen (EQ) <xinran.chen@cicc.com.cn>

时间: 2024年9月23日 (周一) 11:15

大小: 53 KB

固定增强收益率【2】（年化）调整通知书

编号：【PPB0145】-【1】

致投资者：

根据贵司与中国国际金融股份有限公司（以下简称“我司”）已签订的《中金公司【PB0145】号收益凭证产品风险揭示书》、《中金公司【PB0145】号收益凭证产品说明书》、《中金公司【PB0145】号收益凭证产品说明书认购协议》及《中金公司【PB0145】号收益凭证产品补充协议（一）》，我司现拟调整本产品固定增强收益率（年化），调整后的固定增强收益率【2】（年化）及其适用区间做出如下：

固定增强收益率【2】（年化）	【4.2%】（年化）
固定增强收益率【2】（年化）适用区间	【2024】年【9】月【30】日（不含）至【2025】年【9】月【30】日（含）
本产品将增设的固定增强收益结算日i	i=【9】：【2024】年【9】月【30】日 i=【10】：【2024】年【12】月【30】日 i=【11】：【2025】年【3】月【31】日 i=【12】：【2025】年【6】月【30】日
本次增设后固定增强收益结算总次数M重新确定为：	【12】

如贵司不接受我司调整后的固定增强收益率【2】（年化），则应当不晚于上述固定增强收益率【2】（年化）适用区间起始日前一交易日按照产品说明书约定及时向我司申请全部提前终止贵司持有的全部产品份额。如贵司未

按照约定申请全部提前终止的，则视为接受我司本次对固定增强收益率【2】（年化）的调整。

中国国际金融股份有限公司

日期：2024年 9月 日”

敬启：本邮件内容为保密信息，发件人保留与本邮件相关的一切权利。若您误收到本邮件，敬请立刻删除并通知发件人。有关本邮件的保密性和电子邮件风险，请点击<https://www.cicc.com/column/416/>确保阅读。关于风险披露、利益冲突、非依赖和与本邮件相关的其他方面的披露，请点击<https://www.cicc.com/column/425/>

NOTICE: This message may contain confidential or privileged information. If you are not the intended recipient, please advise us immediately and delete this message. Please see <https://en.cicc.com/column/416/> for further information on confidentiality and the risks inherent in electronic communication. Please See <https://en.cicc.com/column/425/> for risk disclosure, non-reliance, conflicts of interest and other terms and conditions relating to this e-mail.