

财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划 管理合同变更公告

为了更好地为投资者创造价值，本集合计划管理人与托管人经协商一致，对财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同、说明书、风险揭示书、托管协议的部分条款进行变更，变更内容如下：

1、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第2部分第六条“委托人”。

原条款为：“委托人的身份资料以委托人与各推广机构签订的电子合同及电子签名约定书中所确定的内容为准。”

拟修改为：“

个人填写：

姓名： 证件类型： 证件号码：

通信地址： 邮政编码：

联系电话： 移动电话： 电子信箱：

其他：

机构填写：

机构名称： 法定代表人：

通信地址：

邮政编码： 代理人姓名： 身份证号码：

联系电话： 其他：

对于采用电子签名方式的委托人，委托人的身份资料以委托人与各推广机构签订的电子合同及电子签名约定书中所确定的内容为准。”

2、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第2部分第八条“托管人”。

原条款为：“名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日



法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799”

拟修改为：“名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 元

联系电话：010-66105799”

3、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 3 部分第十条 “目标规模”。

原条款为：“本计划推广期的上限规模为 20 亿份（含管理人自有资金参与和所有参与资金利息转增份额），存续期规模上限为 30 亿份（含所有红利转份额部分），推广期最低募集规模为 1 亿份（不含管理人自有资金参与，但含所有参与资金利息转增份额）。管理人有权以网站公告方式调整存续期的规模上限。”

拟修改为：“本计划推广期的上限规模为 20 亿份（含管理人自有资金参与和所有参与资金利息转增份额），存续期不设规模上限，推广期最低募集规模为 1 亿份（不含管理人自有资金参与，但含所有参与资金利息转增份额）。管理人有权以网站公告方式调整存续期的规模上限。”

4、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 3 部分第十一条 “投资范围和投资组合设计”。

原条款为：“1、集合计划的投资范围：

国债、政策性金融债、央行票据、公司债、短期融资券、中期票据、企业债、中小企业私募债、可转换债券、可分离交易可转债、资产支持受益凭证、债券回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、二级市场外的股票以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。

集合计划投资组合比例：

(1) 国债（到期日在一年期以上，不含一年期）、央行票据、政策性金融债、公司债、企业债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、可转换债券、可分

离交易可转债、期限在 7 天以上的债券逆回购、债券型基金、资产支持受益凭证等固定收益类金融产品占集合计划资产总值：0~100%；其中，投资于中小企业私募债的投资比例不高于集合计划资产总值的 30%，且投资于单支中小企业私募债的投资比例不高于集合计划资产总值的 5%；私募债超过比例限制之后限三十个工作日内调整至符合此比例限制；

(2) 二级市场外的股票，及其所派发的权证、因可转换公司债券转股形成的股票以及因分离交易的可转换公司债券产生的权证等权益类资产：0%~20%，其中因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易债券而产生的权证不超过 3%，不从二级市场买入股票和权证。

投资于二级市场外的股票、持有可转债转股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证应在其可上市交易后的 30 个交易日内全部卖出。

(3) 其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种：配置比例由管理人根据法律法规或政策的规定提出建议，托管人无异议后执行。

因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，管理人应当在 10 个工作日内进行调整。”

拟修改为：“1、集合计划的投资范围：

国债、政策性金融债、央行票据、公司债（含非公开发行的公司债）、短期融资券、中期票据、企业债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券(含非公开发行的可交换债券)、可分离交易可转债、资产支持受益凭证、债券回购、债券型基金、货币市场基金、银行存款、二级市场外的股票以及法律法规或中国证监会允许投资的其他固定收益类品种。

其中企业债、公司债（含非公开发行的公司债）的主体或债项或担保人信用等级不低于 AA，中期票据主体或债项信用等级不低于 A+，短期融资券债项不低于 A-1，可交换债券发行材料中列示的维持担保比例不低于 100%。

集合计划投资组合比例：

(1) 国债（到期日在一年期以上，不含一年期）、央行票据、政策性金融债、公司债（含非公开发行的公司债）、企业债、中小企业私募债、短期融资券、中期票据、可转换债券、可交换债券(含非公开发行的可交换债券)、可分离交易可转债、期限在 7 天以上的债券逆回购、债券型基金、资产支持受益凭证等固定收

益类金融产品占集合计划资产总值：0~100%；其中，投资于中小企业私募债的投资比例不高于集合计划资产总值的 20%，且投资于单支中小企业私募债的投资比例不高于集合计划资产总值的 5%；投资的可交换债券(含非公开发行的可交换债券)的合计占比不得超过资产净值的 30%。

(2) 二级市场外的股票及其所派发的权证、因可转换公司债券转股、可交换公司债券(含非公开发行的可交换债券)换股形成的股票及其所派发的权证、以及因分离交易的可转换公司债券产生的权证等权益类资产：0%~20%，其中因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易债券而产生的权证不超过 3%，不从二级市场买入股票和权证。

投资于二级市场外的股票、持有可转债转股、可交换公司债券(含非公开发行的可交换债券)换股所得的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等权益类资产应在其可上市交易后的 10 个工作日内全部卖出。

(3) 其他法律法规或政策许可投资的固定收益证券品种：配置比例由管理人根据法律法规或政策的规定提出建议，托管人无异议后执行。

因证券市场波动、投资对象合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，管理人应当在具备交易条件的 10 个工作日内进行调整。”

5、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 3 部分第十四条“计划的风险收益特征及推广对象”。

原条款为：“本集合计划主要投资于各类型债券及现金类资产，属于低风险的理财产品。”

拟修改为：“本集合计划主要投资于各类型债券及现金类资产，属于中风险的理财产品。”

6、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 4 部分第十七条第 2 项“存续期参与”。

原条款为：“集合计划成立后仅在开放日办理参与和退出。本集合计划的开放期为每年 10 月最后 10 个工作日。管理人有权根据申赎情况延长开放期，延长开放期不超过 10 个工作日，延长开放期仅接受参与申请，不接受退出申请。另

外，管理人有权设置特别开放期用于办理参与或退出业务。开放期每日办理申购的交易时间结束后，管理人将对当日（T日）净申购规模实行汇总统计，当集合计划总规模达到30亿份时，管理人有权于T+1日上午九点前发出停止申购指令，根据参与时间优先的原则宣布超过预定规模的认购无效，并通过管理人网站等方式对相关信息进行披露。”

拟修改为：“集合计划成立后仅在开放日办理参与和退出。本集合计划每年10月最后10个工作日开放，期间可接受委托人的参与和退出申请，管理人可提前公告该期申购规模限制等开放期安排。此外，本集合计划自每年10月的计划开放期（特别开放期除外）起之后的3个月、6个月、9个月左右分别开放一次，期间可接受委托人的参与申请，具体开放期时间、申购规模限制等开放期安排以管理人公告为准。管理人有权根据申赎情况延长开放期，延长开放期不超过10个工作日，延长开放期仅接受参与申请，不接受退出申请。另外，管理人有权设置特别开放期用于办理参与或退出业务。”

7、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第4部分第二十条“参与原则”。

拟删除条款：“1、委托人参与本计划前，应当是管理人或推广机构的客户；”
其他合同条款序号依次递延调整。

8、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第4部分第二十一条“参与程序”。

原条款为：“第二十一条 参与程序

1、提交申请

本计划的参与申请需采用电子签名方式提交。委托人签署纸质的电子签名约定书，同意以电子签名方式签署本计划合同后，委托人必须根据本计划推广网点规定的手续，在指定参与时间内提出参与申请。委托人可以到集合计划推广机构指定网点的柜台申请参与集合计划，也可以登录推广机构指定网络系统以自主下单方式申请参与集合计划。当日参与申请可以（且只能）在当日交易时间内申请撤销。

2、支付参与款项

委托人提出参与申请时，采用全额缴款方式。委托人须在指定资金账户上存

入足额参与款。如账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔申请。

委托人指定资金账户作为办理红利款项、退出款项、清算款项的收款账户。委托人应承诺在本计划的资产管理合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料。

3、参与申请确认

委托人于 T 日提交参与申请后，可于 T+1 日查询申请受理情况。确认无效的申请，推广机构将退还委托人已交付的参与款项本金。”

拟修改为：“第二十一条 参与程序与确认

(1) 本集合计划的参与申请根据不同推广机构的程序，采用电子签名或纸质签名的方式提交。采用电子签名方式的委托人应当根据推广机构的要求签署纸质的电子签名约定书或如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。采用纸质签名方式的委托人需签署纸质的风险揭示书、签订纸质的合同。委托人根据推广机构的程序，到推广机构指定网点或管理人直销柜台申请参与集合计划，或登录推广机构指定网络系统以自主下单方式申请参与集合计划。

(2) 委托人按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内提交参与申请；

(3) 通过管理人直销方式参与集合计划的，委托人开设管理人认可的集合资产管理计划/基金账户，并在有效时间内将足额资金划入管理人指定的直销账户中，并保证汇款人名称与开立集合资产管理计划/基金账户的持有人名称一致。委托人指定关联的银行卡作为办理红利款项、退出款项、清算款项的收款账户。委托人应承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；通过其他推广机构参与集合计划的，委托人应按照推广机构的相关规定和程序提交参与申请。

(4) 委托人签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；委托人参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销；

(5) 委托人推广期参与的，可于计划成立后到办理参与的推广机构查询参与确认情况。委托人存续期参与的，于 T 日提交参与申请后，可于 T+3 日后在办理参与的推广机构查询参与确认情况。确认无效的申请，推广机构将退还委

托人已交付的参与款项本金。”

9、改动位置：《财通证券财运连连—季季红集合资产管理计划管理合同》第4部分第二十二條“参与费用”。

原条款为：“推广期和开放期内的参与费率随着参与金额增加而递减，参与费率如下表所示：

参与金额 (P)	参与费率
P<100万	0.2 %
P≥100万	1000元/笔

”

拟修改为：“本集合计划不收取参与费，参与费率为0。”

10、改动位置：《财通证券财运连连—季季红集合资产管理计划管理合同》第4部分第二十四條“参与的注册登记”。

原条款为：“委托人参与成功后，注册登记机构在T+1日为委托人登记权益并办理注册登记手续，委托人自T+2日（含当日）后的开放日起有权退出该部分集合计划份额。”

拟修改为：“委托人参与成功后，注册登记机构在T+1日为委托人登记权益并办理注册登记手续，委托人自T+2日（含当日）后的开放日起有权在可办理赎回业务的开放期内退出该部分集合计划份额。”

11、改动位置：《财通证券财运连连—季季红集合资产管理计划管理合同》第5部分“管理人以自有资金参与本集合计划时的特别约定”。

原条款为：“第二十六条 管理人参与本集合计划的自有资金不超过本计划成立规模的5%，并承担相应义务和享有约定的权利。自有资金认购的集合计划份额所取得的现金分红收益归管理人所有，不转增份额。管理人持有计划份额与委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。在集合计划存续期内，管理人自有资金参与的集合计划份额的持有期不少于6个月，满足条件后管理人自有资金若在开放期退出，则会提前5个工作日在管理人网站进行信息披露，告知委托人和托管人。管理人自有资金参与份额及收益不对委托人在本计划中投资的本

金和收益承担任何补偿责任。”

拟修改为：“管理人可以以自有资金参与本集合计划，自有资金参与比例最高不超过计划总份额的 20%。

自有资金的收益分配按照本合同第 11 部分“投资收益与分配”中对收益分配的约定进行。自有资金认购的集合计划份额所取得的现金分红收益归管理人所有。

因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人应当在超限之日起的 10 个工作日内将部分自有资金参与份额退出或提高集合计划规模，以符合法规要求。本集合计划存续期间，管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于 6 个月（因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人退出部分自有资金的情形除外）。参与、退出时，应当提前 5 个工作日告知客户（告知方式包括但不限于通过管理人网站公告）和资产托管机构。

为应对集合计划流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以自有资金参与或退出集合计划可不受前款规定限制，但需事后及时告知客户和资产托管机构。”

12、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 8 部分第二十九条“为维护集合计划委托人的合法权益，本计划投资禁止从事下列行为”。

拟新增条款：“5、本计划投资于可交换债券（含非公开发行的可交换债券）的合计占比超过资产净值的 30%。投资于中小企业私募债的投资比例高于集合计划资产总值的 20%。”

其他合同条款序号依次递延调整。

13、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 9 部分第三十条“管理费”。

原条款为：“本计划不收取管理费。”

拟修改为：“在通常情况下,本计划的管理费按前一日集合计划资产净值 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年实际天数}$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值

管理费按前一日计划资产净值计算，按日计提，按月支付。在每个月最后一个工作日收市后，由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划中支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。”

14、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 9 部分第三十五条“管理人提取业绩报酬”及第三十六条“风险准备金”。

原条款为：“第三十五条 管理人提取业绩报酬

(1) 管理人提取业绩报酬的原则

① 同一委托人不同时间多次参与本计划的，对委托人每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；

② 计划开放期（特别开放期和临时开放期除外）前一个工作日、委托人退出日及计划终止日，对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬；

③ 计划开放期（特别开放期和临时开放期除外）前一个工作日提取业绩报酬的，业绩报酬将从当日分红资金中扣除；在委托人退出及计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

(2) 业绩报酬的计提方法

计划开放期（特别开放期和临时开放期除外）前的一个工作日、委托人退出日及计划终止日，若年化收益率小于或等于 R_0 ，则管理人不提取业绩报酬；若年化收益率大于 R_0 ，则管理人对超出部分按一定的比例累进提取业绩报酬。其中集合计划前一年存续期内的 R_0 为 5.0%，一年之后的 R_0 见管理人网站公告，管理人将提前在网站公告下一年度的 R_0 ，同时告知资产托管人。年化收益率的计算公式如下：

$$r = \frac{(P1 - P0)}{P*} \div D \times 100\%$$

P1 为业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

P0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划份额累计净值；

P* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划份额净值；

D 表示上一个发生业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的年限（1 年按 365 天计算）；

推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一个发生业绩报酬计提日指计划成立日；开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一个发生业绩报酬计提日指参与日。

管理人业绩报酬计提如下：

年化收益率 (r)	计提 比例	业绩报酬 (R) 计算方法
$r \leq R_0$	0	0
$r > R_0$	80%	$R = (r - R_0) \times 80\% \times A \times D$

其中，A = 每笔参与在上一个发生业绩报酬计提日的资产净值总额。

推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一个发生业绩报酬计提日指计划成立日；开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的上一个发生业绩报酬计提日指参与日。

(3) 业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，由管理人向托管人发送划付指令，托管人于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

第三十六条 风险准备金

1、管理人风险准备金的计提

管理人将按照业绩报酬的 30% 的计提比例，从每笔业绩报酬中计提管理人风险准备金，风险准备金规模上限以上一开放期（不包括特别开放期）结束后的第一个工作日集合计划资产净值的 5% 为标准，若风险准备金规模达到上限，则不再计提。若由于集合计划规模的变动导致已经计提的风险准备金超过风险准备金规模上限的，管理人有权提取多余部分。

2、管理人动用风险准备金弥补委托人本金和差额收益的情形

在本集合计划的业绩报酬计提日，若当期实际年化收益率低于当期业绩报酬计提基准，管理人将以风险准备金为限，向委托人弥补本金和当期业绩报酬计提基准与实际年化收益率的差额部分收益。

上述风险准备金和业绩报酬计提基准，不构成保证客户资产本金不受损失或

者取得最低收益的承诺。

3、剩余风险准备金的归属

本集合计划清算时，所有剩余风险准备金归管理人所有。”

拟修改为：“第三十五条 风险准备金与业绩报酬

1、风险准备金的计提方式

风险准备金计提日为计划分红日、委托人退出日及计划终止日。

在每年 10 月计划开放期(不含特别开放期，下同)之前，管理人将公告自当年 10 月计划开放期首日(不含)至下年 10 月计划开放期首日(含)期间适用的风险准备金计提基准；在当年 10 月计划开放期至下年 10 月计划开放期之间的其他可办理参与业务的开放期之前，管理人可以针对该开放期新参与的份额特别公告适用的风险准备金计提基准。

在风险准备金计提日，若实际年化收益率 R 小于或等于不同时点参与份额对应风险准备金计提基准 K ，管理人不提取风险准备金；若实际年化收益率 R 大于不同时点参与份额对应风险准备金计提基准 K ，管理人对超过部分的收益提取 100% 的风险准备金。

风险准备金计算方法如下：

本期实际年化收益率 R	提取比例
$R \leq K$	0
$R > K$	100%

风险准备金计提办法：

$$R_i = \frac{(C'' - C'_i)}{C_i} \times \frac{365}{D_i}$$

$$H = \sum_i S_i \times C_i \times (R_i - K_i) \times \frac{D_i}{365} \times 100\%$$

其中：

R_i ：第 i 个开放日参与份额的当期计提期间的年化收益率

C'' ：第 i 个开放日参与份额在风险准备金计提日的累计净值；

C'_i ：第 i 个开放日参与份额在上一风险准备金计提日的累计净值；

C_i ：第 i 个开放日参与份额在上一风险准备金计提日的单位净值；

D_i : 第*i*个开放日参与份额风险准备金计提日(含)至上一风险准备金计提日(不含)的间隔天数;

H : 风险准备金计提日管理人应提取的风险准备金;

S_i : 风险准备金计提日第*i*个开放日参与份额的份额总数;

K_i : 第*i*个开放日参与份额对应的风险准备金计提基准。

对于开放期(含特别开放期)参与的每笔份额首次计提风险准备金的,上一风险准备金计提日指参与日。

风险准备金的计算和复核工作由管理人完成,托管人不承担复核风险准备金的责任。

2、风险准备金的补偿方式

在不同时点参与份额进行分红、退出和计划终止时,若当期实际年化收益率低于不同时点参与份额对应的风险准备金计提基准,管理人将以风险准备金余额为上限,弥补对应份额持有人的收益至其风险准备金计提基准。若当前风险准备金余额不足以弥补所有需要弥补份额的持有人收益至其风险准备金计提基准,则按照以下办法进行补偿:

T日,对于第*i*个参与开放日参与且需要弥补收益的份额记为 A_i 份额,对于 A_i 份额($i=1,2,3,\dots,n$),假设 $B_{A_i}=A_i$ 份额的份额数 $\times A_i$ 份额当期的风险准备金计提基准 \times 截止T日 A_i 份额在当期收益分配周期内存续的实际天数/365

管理人将以风险准备金余额为限,按T日 B_{A_i} 占 $\sum_i B_{A_i}$ 的权重进行补偿,直到 A_i 份额实际年化收益率达到该类份额风险准备金计提基准或者风险准备金全部补偿完毕为止。若风险准备金全部用于补偿后, A_i 份额的实际年化收益率仍达不到该类份额的当期风险准备金计提基准,管理人不再进行补偿。

3、业绩报酬的计提方式

本集合计划存续期间,自每年10月计划开放期(不含特别开放期)起之后3个月、6个月、9个月左右的开放期间的最后一个工作日若风险准备金有余额,则管理人可以提取不超过此余额的50%作为业绩报酬;每年10月计划开放期(特别开放期除外)的最后一个工作日若风险准备金有余额,则管理人可以提取不超过此余额的80%作为业绩报酬。管理人已计提的业绩报酬不用于本集合计划份额的收益补偿。集合计划终止清算时,所有剩余风险准备金计提为管理人业绩

报酬。

4、业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，由管理人向托管人发送划付指令，托管人于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。托管人不承担复核业绩报酬的责任。”

其他合同条款序号依次递延调整。

15、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 11 部分第四十九条“收益分配原则和方式”。

拟删除条款：“3、本计划当期收益应先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；”

其他合同条款序号依次递延调整。

16、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 11 部分第四十九条“收益分配原则和方式”。

原条款为：“5、在符合上述原则和具备收益分配条件的情况下，自计划成立日起每满 3 个月内至少进行一次收益分配；”

拟修改为：“5、在符合上述原则和具备收益分配条件的情况下，自计划成立日起每 3 个月进行一次收益分配； ”

17、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 11 部分第五十条“收益分配方式”。

原条款为：“本计划默认现金红利方式，可选择红利再投资方式。委托人可修改分红方式。选择红利再投资方式的，分红资金在扣除管理人业绩报酬后按分红除权日当日的单位净值自动转为本计划的份额；选择现金分红方式的，管理人将现金红利款在扣除管理人业绩报酬后划往推广机构账户，再由推广机构划入委托人账户。红利再投资形成的集合计划份额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入集合计划资产的损益。当集合计划接近或达到规模上限时，管理人有权采用全部现金分红的方式。”

拟修改为：“本计划默认现金红利方式，可选择红利再投资方式。委托人可



修改分红方式。选择红利再投资方式的，分红资金在扣除**风险准备金**后按分红除权日当日的单位净值自动转为本计划的份额；选择现金分红方式的，管理人将现金红利款在扣除**风险准备金**后划往推广机构账户，再由推广机构划入委托人账户。红利再投资形成的集合计划份额计算保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的差额计入集合计划资产的损益。当集合计划接近或达到规模上限时，管理人有权采用全部现金分红的方式。”

18、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第12部分第五十三条“对账单”。

原条款为：“计划成立后，每季度结束后15个工作日内向委托人发送对账单；对账单内容包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与和退出明细，计划的特点及风险、收益分配等情况。本计划对账单按照客户选择的方式以书面或电子形式寄送给委托人。委托人应提供有效的联系方式。对账单以快递寄送的，快递寄出之次日视为送达收件人；对账单以挂号信寄送的，挂号信寄出之日起5日后视为送达收件人；对账单以电子邮件形式寄送的，邮件发出之日视为送达收件人。”

拟修改为：“计划成立后，每季度结束后15个工作日内向委托人发送对账单；对账单内容包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与和退出明细，计划的特点及风险、收益分配等情况。本计划对账单按照客户选择的方式以书面或电子形式寄送给委托人，若委托人在参与时未选择，则默认为管理人通过电子形式向委托人提供对账单。委托人应提供有效的联系方式。对账单以快递寄送的，快递寄出之次日视为送达收件人；对账单以挂号信寄送的，挂号信寄出之日起5日后视为送达收件人；对账单以电子邮件形式寄送的，邮件发出之日视为送达收件人。”

19、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第12部分第五十四条第2项“重大事项的披露”。

原条款为：“本集合计划在运作过程中发生下列可能对委托人权益产生重大影响的事项之一时，管理人按照与其他信息披露一致的方式，即管理人网站向委托人披露，并向管理人住所地中国证监会派出机构和行业自律组织报告。”

拟修改为：“本集合计划在运作过程中发生下列可能对委托人权益产生重大影响的事项之一时，管理人按照与其他信息披露一致的方式，即管理人网站向

委托人披露。”

20、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 12 部分第五十四条第 2 项“重大事项的披露”。

原条款为：“6、变更管理费率、托管费率或管理人业绩报酬；”

拟修改为：“6、变更管理费率、托管费率或风险准备金计提基准；”

21、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 13 部分第五十八条第 2 项“债券投资策略”第一段。

拟删除条款：“本计划持有债券品种的债券债项评级或发行人主体评级不低于 A+；持有的短期融资券的主体评级不低于 A+或债项评级不低于 A-1。”

22、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 13 部分第五十八条第 2 项“债券投资策略”。

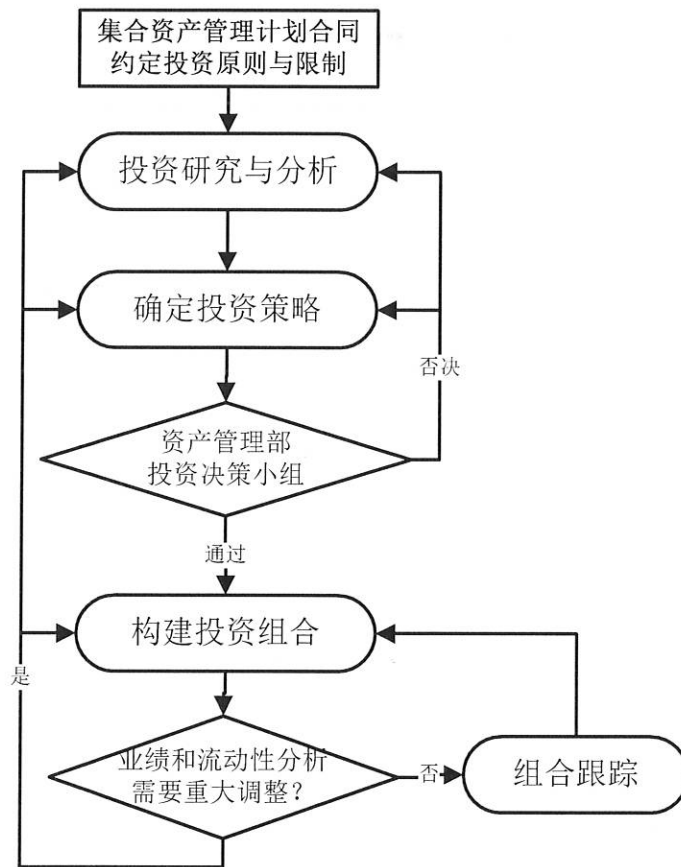
拟增加条款：“(4) 可交换债券投资策略

管理人将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债的战略结构性投资机遇，适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会，选择最具吸引力标的进行配置。”

其他合同条款序号依次递延调整。

23、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 13 部分第六十一条“投资程序”。

原条款为：“投资管理程序分为投资研究、投资决策、投资执行、投资跟踪与反馈、组合业绩和流动性分析五个环节，具体流程图如下：



1、计划管理人研究人员通过自身研究和借助外部研究机构研究成果，形成宏观经济、金融市场、货币政策、行业发展、公司经营等方面的研究报告。计划管理人定期召开投资研究联席会议，投资人员与研究人员相互交流研究成果，为投资决策提供科学的依据。

2、投资经理在本集合资产管理合同约定的投资原则指引下，制作《投资策略报告》，按照投资分级授权的规定报投资决策小组审批。

3、投资决策小组按约定方式召开投资决策会议，就《投资策略报告》是否符合集合计划合同约定的投资原则进行实质性审查，就具体的资产配置方案、投资品种选择等提出意见并形成投资决议。

4、投资经理依据投资决议构建计划的具体投资组合。

5、投资决策小组定期对投资组合的业绩和流动性进行评估，对不符合当前市场情况的组合进行调整，重新构建更为有效投资组合或投资策略。

6、投资交易指令由集中交易室统一执行，严格执行投资与交易分离制度。

7、投资经理每季度至少提交一份《投资总结报告》，对投资组合近期表现与市场表现进行分析，并提出未来投资的计划。

8、投资经理依据计划的参与和退出状况及时控制投资组合的流动性风险。”

拟修改为：“1、管理人研究人员通过自身研究及借助外部研究服务机构的研究服务，为本集合的投资管理提供决策依据。

2、投资主办人根据研究支持体系和本集合计划的收益-风险特征，结合对市场的分析判断，构建投资组合。

3、投资交易指令由集中交易室统一执行，严格执行投资与交易分离制度。

4、管理人合规与风险管理部门对投资计划的过程进行日常监督和风险控制，投资主办人根据本集合计划参与和退出的情况及时控制投资组合的流动性风险。”

24、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第13部分第六十二条“风险控制原则”、第六十三条“风险控制体系”、第六十四条“风险控制制度”、第六十五条“风险控制流程”。

原条款为：“第六十二条 风险控制原则

1、合规性原则：计划的投资范围和比例严格遵守国家相关法律法规、行业规章和有关监管规定。

2、全面性原则：风险管理应是全方位、全过程的，覆盖计划的资金运用的决策、执行、监督、反馈等各项业务和各个投资操作环节。

3、独立性原则：公司稽核与风险管理部、法律合规部应保持高度的独立性和权威性，其工作不受任何外界因素干扰。

4、相互制约原则：计划的组织模式应遵循“共生共存、互为制约”的原则，建立不同部门和岗位之间的制衡机制，消除风险管理的盲点。

5、审慎性原则：风险管理的核心是有效防范各种风险，所以内部各项管理制度和投资指引的制订都以防范和化解风险、审慎管理为出发点。

6、有效性原则：公司所有员工都应在相关国家法律法规、监管部门规章和公司制度的范围内进行投资运作，任何管理人员和员工都不拥有超越制度或违反规章的权力。

7、适时性原则：稽核与风险管理应根据国家法律、法规、政策、公司制度、投资策略的改变而及时进行更新、补充和调整，使其适应市场的发展趋势和最新的法律法规要求。

8、隔离墙原则：计划与公司其他资产管理业务、自营业务、证券承销业务、经纪业务及其他证券业务在空间上和制度上适当分离，以达到风险防范的目的。

因业务需要知悉内幕信息的人员，与公司签订保密协议。

9、定性与定量相结合原则：在风险的识别、计量和控制过程中采用定性与定量分析相结合的办法，界定风险的性质、范围、标准，测算风险的概率、损失率、权重，以建立完备的风险管理体系，使各项风险管理手段具科学性、客观性、操作性。

第六十三条 风险控制体系

(1) 董事会

董事会是公司负责风险管理的最高领导机构，负责制定风险管理战略和风险管理政策，确定风险管理原则，并将风险管理纳入总体发展战略。董事会下设风险管理委员会，风险管理委员会在董事会授权范围内开展工作，负责审查公司风险控制情况、公司各项风险控制指标并对公司风险控制制度的执行情况进行监督。风险管理委员会是董事会的议事机构，对董事会负责并报告工作。

(2) 公司经营管理层

公司经营管理层通过岗位分离制衡机制以及对各自职责范围内的业务进行自查，及时纠正存在的缺点和问题，以达到风险自我控制的目的，并对资产管理业务中合规、风控、清算、技术等方面进行监督控制。

(3) 合规总监

合规总监对公司资产管理业务进行合规审查、检查和监督。

(4) 风险管理部、合规部

风险管理部，负责建立健全内部控制制度、风险控制措施和风险预警机制；对资产管理业务进行独立的风险评估，并定期向管理层提交风险评估报告；通过建立完善的风险预警系统，运用量化指标实现资产管理业务的全过程监控，确保业务管理、投资决策、投资交易在执行过程中的风险得到有效控制，并定期向管理层提交风险监控报告；组织对资产管理新产品、新业务的风险评估，为公司决策提供支持；定期对资产管理业务的各项制度、流程及决议，对各个业务环节的内控执行情况以及经营效益等实施内部审计。

合规部负责为资产管理业务提供法律、合规咨询，当相关政策、法律发生变化时，及时进行合规性研究，提出合规建议及法律支持；对资产管理业务制度、流程和业务方案进行合规性审核；对资产管理业务的重大决策及新产品、新业务进行合规性审核，并提出相关合规建议；健全“隔离墙”机制，防范利益输送，

在必要的时候对特殊交易进行审批；针对资产管理业务和所涉部门进行合规监测、检查，对不合规事项进行调查、处理；对公司资产管理业务的合规风险进行识别、评估；指导公司开展反洗钱工作；审核资产管理业务的合同和相关附件，协助制定标准示范文本。

（5）风险控制小组

资产管理业务部门专设风险控制小组，负责部门的日常风险控制工作，拟订资产管理业务的风险控制制度，完善资产管理业务的风险控制体系，监督内控体系的正常运行，支持配合相关部门和监管机构的检查工作，实现与风控管理部在日常风险控制和监督工作上的对接。

（6）合规联络员

合规联络员为业务部门与合规部进行联系的窗口，合规联络员与合规部积极协作，确保本部门各项业务管理活动与合规要求相一致，提高业务部门对各项法律法规和公司经营管理决策的执行力，保证各项经营管理活动规范稳健运行。合规联络员对业务部门日常经营活动的合规性进行动态监控，向合规部提出合规要求及建议，定期或不定期向合规部提交合规工作报告，配合合规部不断完善合规风险管理工作。

第六十四条 风险控制制度

管理人在公司风险管理层面以及资产管理业务的运作部门层面建立了一系列严格、规范的风险控制制度，为资产管理业务风险控制的执行提供了制度保障。本计划风险控制制度主要体现在以下几项制度中：

1、投资备选库管理制度。资产管理业务建立投资备选库，并对入库品种实行严格筛选。备选库以外的品种禁止投资，有效防范集合计划的投资风险。

2、交易集中管理制度。资产管理业务实行集中交易管理制度，在独立的交易室由专职交易员执行投资经理交易指令，将投资决策过程和交易执行过程分开，保证交易工作的安全性。

3、隔离墙制度。公司建立严格的隔离墙制度，实现资产管理业务与管理人的其他业务（自营、投行、经纪）之间，以及各项集合资产管理业务之间的有效隔离，杜绝内幕交易，维护客户利益。

第六十五条 风险控制流程

1、建立风险控制环境：具体包括制定风险控制战略、目标，设置相应的组

织机构，并配备相应的人力资源与技术系统，设定风险控制的时间范围与空间范围等内容。

2、风险识别：针对计划的各类风险及各个风险点进行全面有效识别，并对风险存在的原因进行分析说明。

3、风险分析：检查现有的控制措施，分析风险发生的可能性及其引起的后果。

4、风险计量：综合运用定性和定量的分析方法，对计划存在的各个风险点进行量化。定性的度量是把风险水平划分为若干级别，每一种风险按其发生的可能性与后果的严重程度分别进入相应的级别。定量的方法则是设计与运用风险指标与模型，计算风险值。

5、风险处理：区别重大风险事件和日常风险事项，采取不同的风险控制策略，基本策略有：拒绝风险、转移风险、降低风险、接受风险。

6、风险检查与监控：通过现有的风险管理系统和专项检查对风险进行持续、动态的跟踪与监视。

7、风险报告与总结：建立风险控制的报告机制，定期评估和总结风险控制工作效果，使公司董事会、高级管理人员了解风险控制状况，指导业务发展。”

拟修改为：“第六十二条 风险控制

管理人根据相关法律法规的要求，遵循健全性、合理性、独立性、制衡性等原则，构建风险管理体系，切实防范和控制风险：

1、董事会

董事会是公司负责风险管理的最高领导机构，负责制定风险管理战略和风险管理政策，确定风险管理原则，审批公司风险管理基本制度与主要指标；

2、公司经营管理层

公司经营管理层实施对公司风险的总体协调，解决公司风险管理中出现的较大问题。公司首席风险官负责全面风险管理工作；

3、合规与风险管理部门

合规与风险管理部门专门履行风险管理职责，在首席风险官领导下推动全面风险管理工作，监测、评估、报告公司整体风险水平，并为业务决策提供风险管理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。”

25、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》

第 14 部分第六十七条“委托人的义务”。

原条款为：“1、保证以真实身份参与集合计划，并承诺委托资金的来源及用途合法，向管理人或代理推广机构如实提供财务状况及投资意愿等基本情况；法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或代理推广机构提供合法筹集资金的证明文件；

2、按照本合同约定划付委托资金，承担相应费用；

3、按本合同约定承担集合计划的投资风险和损失；

4、不得转让本合同；

5、不得转让、质押本合同以及本集合计划份额（法律、行政法规另有规定的除外）；

6、因委托人的问题导致不能正常参与本集合计划的，由此造成的损失由委托人承担；

7、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他义务。”

拟修改为：“1、委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；

2、按照本合同及《说明书》约定交付委托资金，承担本合同约定的管理费、托管费和其他费用；

3、按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；

4、不得违规转让其所拥有的计划份额；

5、委托人保证提供给管理人进行身份信息识别的信息和资料均真实、准确、完整、合法。在其身份信息资料发生变更时，应当及时书面告知管理人。委托人有义务配合管理人进行相应的客户身份识别及反洗钱客户风险等级划分、反洗钱可疑交易报送、涉嫌恐怖融资可疑交易报送等工作。

6、除非在本合同约定的开放期或终止日，不得要求提前终止委托资产管理关系；

7、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同约定的其他义务。”

26、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 17 部分第七十三条“退出的时间”。

原条款为：“本计划的委托人可于每年 10 月最后 10 个工作日办理退出业务申请。”

拟修改为：“本计划的委托人可于每年 10 月最后 10 个工作日或可接受赎回申请的特别开放期办理退出业务申请。”

27、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 19 部分第八十条“集合计划的终止”。

拟删除条款：“4、在计划存续满一年的最后一个工作日，计划累计单位净值低于 1.05 元时；”

其他合同条款序号依次递延调整。

28、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 20 部分第八十九条“特别风险警示”。

拟新增条款：“3、可交换债券投资的风险：

（1）可交换债券的收益波动风险

可交换债券与标的股票挂钩，其波动因素除利率风险、流动性风险外，还受换股价格、标的股票价格、赎回条款、向下修正条款、投资者的预期等诸多因素的影响。具有波动风险的收益包括：①持有期间获取利息，持有至到期被发行人以到期赎回价格赎回而获取的赎回收益，或在存续期内被发行人按照债券面值加应计利息赎回而获取的赎回收益；②当标的股票二级市场价格高于换股价时，通过交换股票获取二级市场价格与换股价之间差价；③在报价系统公司以高于票面价值转让的收益等。

（2）股票质押担保风险

可交换债券可能采用股票质押担保方式，预备用于交换的股票及其孳息（包括送股、转股和现金红利）一并予以质押给受托管理人，用于对债券持有人交换股份和本期私募债券本息偿付提供担保；若标的股票价格大幅下跌，且发行人不对换股价格进行修正时，将影响到质押股票对债券本息偿付的最终保障效果。

（3）换股风险

主要包括：①换股期内标的股票价格可能低于换股价格而影响投资收益的风险；②债券的赎回条款可能导致债券提前兑付或换股期缩短而影响投资收益的风险；③换股价格向下修正条款触发时，董事会未同意修正换股价格的风险；④预备可交换的股票被限售、冻结，或因标的股票重大事项导致暂停换股时间

超过债券存续期等导致投资者无法换股的风险。

（4）发行人资信风险

若由于发行人自身的相关风险或不可控制的因素，发行人的财务状况发生不利变化，导致不能按约定偿付贷款本息或在业务往来中发生严重违约行为，将可能使发行人资信状况恶化，发行人上述受限资产将可能用于对相关债权人的偿付，发行人的资产将会大幅减少，并面临集中偿付的巨大压力，届时发行人的偿债能力将严重下降，从而影响债券还本付息。”

29、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 23 部分“合同的成立与生效”。

原条款为：“第九十六条 本合同已由管理人、托管人盖章，委托人以电子签名方式签署后即告成立。”

拟修改为：“第九十六条 本合同已由管理人、托管人盖章，委托人以电子签名或纸质签名方式签署后即告成立。”

30、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 23 部分“合同的成立与生效”。

拟删除条款：“本合同文本已由管理人在公证机关办理公证，作为证明本合同内容的唯一依据。”

31、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 25 部分“合同的终止”。

拟删除条款：“4、在计划存续满一年的最后一个工作日，计划累计单位净值低于 1.05 元时；”

其他合同条款序号依次递延调整。

32、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》第 25 部分“合同的终止”。

拟在其后增加条款：“第 26 部分 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

第一百零四条 集合计划份额的转让

集合资产管理合同集合计划存续期间，在条件允许的情况下，委托人可以通过柜台交易市场、证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划各类份额。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。

第一百零五条 集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按登记结算机构的有关规定办理。

第一百零六条 集合计划份额的冻结

集合计划登记结算机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。”

33、改动位置：《财通证券财运连连—季季红集合资产管理计划管理合同》第27部分“其他事项”。

拟新增条款：“第一百一十条 本合同下所涉的所有费率（托管费除外）均为含税费率。支付托管费涉及的增值税相关事宜，包括但不限于税率、增值税开票等，管理人、托管人将于相关政策明确后书面协商确认，并在管理人网站上公告。”

34、改动位置：《财通证券财运连连—季季红集合资产管理计划说明书》第三部分第三款“投资目标和特点”。

原条款为：“1. 债券投资，期限匹配

本计划重点投资剩余期限在一年以内的短期融资券、公司债等固定收益类品种，不能从二级市场上买入股票和权证，严格管理计划投资风险。

2. 管理人低费率，客户优先

本计划免收退出费及管理费，有效降低委托人投资成本，保障委托人利益优先。”

拟修改为：“1、寻求流动性和收益性的最优平衡

本集合计划主要投资于银行间及交易所市场债券、货币市场工具等固定收

益类资产，通过组合配置寻求资产流动性及收益性的最优平衡。

2.管理人低费率，客户优先

本计划免收参与费及退出费，有效降低委托人投资成本，保障委托人利益优先。”

35、改动位置：《财通证券财运连连—季季红集合资产管理计划说明书》第三部分第十一款“推广机构和推广方式”。

原条款为：“推广机构包括财通证券、工商银行。

本计划管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的推广机构代理销售本计划，并及时在各推广机构公告并报行业自律组织备案，同时抄送管理人住所地中国证监会派出机构。”

拟修改为：“推广机构包括财通证券、工商银行、财通证券资产管理有限公司。

本计划管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的推广机构代理销售本计划，根据相关法律法规向监管机构或自律组织履行报告义务。”

36、改动位置：《财通证券财运连连—季季红集合资产管理计划说明书》第十五部分第一款第6项“退出费用”。

原条款为：“委托人退出本计划，免收退出费。

当本计划的委托人退出时，退出金额为退出总额扣减风险准备金后的余额，计量单位为人民币元，退出金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失归入集合计划资产损益。

退出总额=退出份额*退出价格

退出金额=退出总额-管理人的业绩报酬

例：假定某投资者在开放日退出 10,000 份计划份额，开放日集合计划份额净值为 1.110 元，另假定本次退出份额的业绩报酬为 500 元，则其获得的退出金额计算如下：

退出总额 = 10,000×1.110 = 11,100.00 元

退出金额 = 11,100.00 - 500.00 = 10,600.00 元”

拟修改为：“委托人退出本计划，免收退出费。

当本计划的委托人退出时，退出金额为退出总额扣减风险准备金后的余额，

计量单位为人民币元，退出金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，由此产生的收益或损失归入集合计划资产损益。

退出总额=退出份额*退出价格

退出金额=退出总额-风险准备金

例：假定某投资者在开放日退出 10,000 份计划份额，开放日集合计划份额净值为 1.110 元，另假定本次退出份额的风险准备金为 500 元，则其获得的退出金额计算如下：

退出总额 = 10,000×1.110 = 11,100.00 元

退出金额 = 11,100.00 - 500.00 = 10,600.00 元”

37、改动位置：《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划风险揭示书》第八部分 “特别风险警示”。

拟新增条款：“3、可交换债券投资的风险：

（1）可交换债券的收益波动风险

可交换债券与标的股票挂钩，其波动因素除利率风险、流动性风险外，还受换股价格、标的股票价格、赎回条款、向下修正条款、投资者的预期等诸多因素的影响。具有波动风险的收益包括：①持有期间获取利息，持有至到期被发行人以到期赎回价格赎回而获取的赎回收益，或在存续期内被发行人按照债券面值加应计利息赎回而获取的赎回收益；②当标的股票二级市场价格高于换股价时，通过交换股票获取二级市场价格与换股价之间差价；③在报价系统公司以高于票面价值转让的收益等。

（2）股票质押担保风险

可交换债券可能采用股票质押担保方式，预备用于交换的股票及其孳息（包括送股、转股和现金红利）一并予以质押给受托管理人，用于对债券持有人交换股份和本期私募债券本息偿付提供担保；若标的股票价格大幅下跌，且发行人不对换股价格进行修正时，将影响到质押股票对债券本息偿付的最终保障效果。

（3）换股风险

主要包括：①换股期内标的股票价格可能低于换股价格而影响投资收益的风险；②债券的赎回条款可能导致债券提前兑付或换股期缩短而影响投资收益的风险；③换股价格向下修正条款触发时，董事会未同意修正换股价格的风险；

④预备可交换的股票被限售、冻结，或因标的股票重大事项导致暂停换股时间超过债券存续期等导致投资者无法换股的风险。

（4）发行人资信风险

若由于发行人自身的相关风险或不可控制的因素，发行人的财务状况发生不利变化，导致不能按约定偿付贷款本息或在业务往来中发生严重违约行为，将可能使发行人资信状况恶化，发行人上述受限资产将可能用于对相关债权人的偿付，发行人的资产将会大幅减少，并面临集中偿付的巨大压力，届时发行人的偿债能力将严重下降，从而影响债券还本付息。

防范措施：为应对以上风险，本集合计划在投资可交换债品种时，将会对发行方的财务状况、偿债能力等进行调研，形成分析报告。同时随时密切跟踪标的股票相关情况及其可交换债市场流动性情况，力争在风险出现前转让。如出现偿付风险，本集合计划将为委托人积极追偿，挽回损失。”

同时修改《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划管理合同》、《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划说明书》、《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划风险揭示书》、《财通证券财运连连一季季红集合资产管理计划托管协议》对应条款。

据合同约定，如果委托人未在通告发出后的5日内提出异议的，应视为其同意管理人对本合同做出变更。委托人不同意管理人对合同进行变更的，可在公告日起至合同变更成立日内的开放日提出退出申请，如在公告日起至合同变更成立日内无开放期，则管理人将合同变更成立日前的3个工作日设置为特别开放日；逾期未退出且未有意见答复的以及答复不同意合同变更但逾期未退出的委托人，均视为同意本合同变更。

咨询电话：95336。

特此公告。

财通证券资产管理有限公司



2016年/0月/0日

