

财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划 管理合同变更生效公告

尊敬的投资者：

根据我司于 2016 年 12 月 14 日正式发布的《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划管理合同变更公告》，《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划管理合同》、《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划说明书》、《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划风险揭示书》、《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划托管协议》的部分条款变更内容如下：

1、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第四部分第四款第 1 项“投资范围”。

原条款为：“本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、短期融资券、中期票据(含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具)、证券回购、资产支持证券、债券型基金、货币市场型基金、商业银行理财计划、银行存款、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会认可的其他固定收益类投资品种。

其中企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、中期票据、资产支持证券的债项或发行人主体或担保人主体信用等级不低于 AA；短期融资券发行人主体信用等级不低于 AA。”

拟修改为：“本集合计划主要投资于国内依法发行的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、债券回购、资产支持证券、债券型基金、货币市场型基金、银行存款、同业存单、现金以及法律法规或中国证监会认可的其他固定收益类投资品种。

其中企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券的债项或发行人主体或担保人主体信用等级不低于 AA；短期融资券发行人主体信用等级不低于 AA。”

2、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第四部分第四款第 2 项“投资比例”。



原条款为：“（1）固定收益类资产：占计划资产总值的 0-100%；包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、短期融资券、中期票据（含非公开定向债务融资工具等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具）、资产支持证券、债券型基金、商业银行理财计划、债券逆回购等；本集合计划投资于单只债券的比例（按券面计算）不高于计划资产总值的 30%；”

拟修改为：“（1）固定收益类资产：占计划资产总值的 0-100%；包括国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债(含非公开发行的公司债)、短期融资券、中期票据、非公开定向债务融资工具、资产支持证券、债券型基金、债券逆回购等；本集合计划投资于单只债券的比例（按券面计算）不高于计划资产总值的 30%；”

3、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第四部分第四款第 2 项“投资比例”。

原条款为：“（3）证券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 40%，中国证监会另有规定的除外。”

拟修改为：“（3）债券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的 40%，中国证监会另有规定的除外。”

4、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第四部分第十二款第 5 项“业绩报酬”。

原条款为：“本计划有权对委托人持有的集合计划各类份额年化收益率超过对应份额当期业绩报酬计提基准的部分按 100%的比例计提业绩报酬。”

拟修改为：“本计划有权对委托人持有的集合计划各类份额年化收益率超过对应份额当期业绩报酬计提基准的部分按 100%的比例计提业绩报酬。”

管理人确定本计划业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券、货币市场基金、债券回购、银行存款所构成的投资组合的收益测算。管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证本集合计划资产本金不受损失，也不保证最低收益。本计划的业绩报酬计提基准不构成管理人、托管人和推广机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。”

5、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第七部分“集合计划的份额分类”。

原条款为：“A1、A2、A3 类份额的运作周期均为 21 天左右，每期的运作周期起始日为对应份额上一运作周期到期日之后的首个工作日，每期的运作周期到期日为对应份额上一运作周期到期日当周结束后第三周的周三，若该周三为非工作日，则顺延至下一个工作日；对于在推广期推广的各类份额的首个运作周期，其运作周期起始日为计划成立日，到期日为计划成立日当周结束后第三周的周三，若该周三为非工作日，则顺延至下一个工作日；对于未在推广期推广的各类份额的首个运作周期，前述“上一运作周期到期日”指的是对应份额的首个参与日。对于 A1、A2、A3 类份额，单个委托人参与单类份额的规模上限为 3000 万份，管理人有权公告调整该上限。A4、A5……An 类份额的运作周期由管理人公告确定。

管理人有权在各类份额每期运作周期开始前公告设定对应份额的参与日、运作周期到期日、开放规模上限、委托人数量上限、业绩报酬计提基准、参与安排及单个委托人参与规模上限等规则。对于 A4、A5……An 类份额，经过该类份额所有委托人及管理人的同意，该类份额的运作周期到期日可以提前或者延后，且管理人有权重新公告约定该类份额当期的业绩报酬计提基准。对于提前到期的份额，管理人重新公告的当期业绩报酬计提基准原则上不高于原基准的 70%。”

拟修改为：“A1、A2、A3 类份额的运作周期均为 21 天左右，每期的运作周期起始日为对应份额上一运作周期到期日之后的首个工作日，每期的运作周期到期日具体见管理人公告；对于在推广期推广的各类份额的首个运作周期，其运作周期起始日为计划成立日，到期日为计划成立日当周结束后第三周的周三，若该周三为非工作日，则顺延至下一个工作日；对于未在推广期推广的各类份额的首个运作周期，前述“上一运作周期到期日”指的是对应份额的首个参与日。对于 A1、A2、A3 类份额，单个委托人参与单类份额的规模上限为 3000 万份，管理人有权公告调整该上限。A4、A5……An 类份额的运作周期由管理人公告确定。

管理人有权公告设定对应份额的参与日、运作周期到期日、开放规模上限、委托人数量上限、业绩报酬计提基准、参与安排及单个委托人参与规模上限等规则。对于 A4、A5……An 类份额，经过该类份额所有委托人及管理人的同意，该类份额的运作周期到期日可以提前或者延后，且管理人有权重新公告约定该



类份额当期的业绩报酬计提基准。对于提前到期的份额，管理人重新公告的当期业绩报酬计提基准原则上不高于原基准的 70%。”

6、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第十二部分第七款“估值方法”。

拟删除条款：“4、商业银行理财计划按成本估值，每日按预期收益率计提理财计划利息，到期按到帐收益结转或冲减应计利息。”

7、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第十三部分第一款“费用种类”。

拟新增条款：“本合同下所涉的所有费率均为含税费率。”

8、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第十三部分第五款“风险准备金”。

原条款为：“管理人按照 100%的比例从每笔业绩报酬中计提管理人风险准备金，风险准备金余额上限为计提日前一工作日计划总份额数的 0.1%，风险准备金余额达到上限后不再计提。

在每个业绩报酬计提日，若风险准备金余额未达上限，且当期计提的业绩报酬大于或等于风险准备金余额上限与实际余额的差额，则将风险准备金余额上限与实际余额的差额部分计提为风险准备金；若风险准备金余额未达上限，且当期计提的业绩报酬小于风险准备金余额上限与实际余额的差额，则将当期业绩报酬全部计提为风险准备金；若由于本集合计划总份额数减少，导致风险准备金余额超过风险准备金余额上限的，管理人有权提取多余部分。

在各类份额进行现金分红、退出和计划终止时，若对应份额当期实际年化收益率低于当期对应份额的业绩报酬计提基准，管理人将以风险准备金余额及已计提未提取的管理人业绩报酬为上限，弥补对应份额持有人的收益至其业绩报酬计提基准。若不同类的份额同时发生需要弥补收益的情形，管理人将以风险准备金余额及已计提未提取的管理人业绩报酬为上限，按照各类份额的份额数占所有需要弥补的份额数的比例，弥补对应份额持有人的收益至其业绩报酬计提基准。集合计划终止清算时，所有剩余风险准备金归管理人所有。”

拟修改为：“在每个业绩报酬计提日，管理人按照 100%的比例从每笔业绩

报酬中计提管理人风险准备金。

在各类份额进行现金分红、退出和计划终止时，若对应份额当期实际年化收益率低于当期对应份额的业绩报酬计提基准，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业绩报酬计提基准。若不同类的份额同时发生需要弥补收益的情形，管理人将以风险准备金余额为上限，按照同时发生需要弥补收益情形的各类份额的份额数占所有需要弥补的份额数的比例，弥补对应份额持有人的收益至其业绩报酬计提基准。

若在每个自然季度（不包含第四季度）的最后一个工作日，本计划风险准备金余额大于零，管理人可以以不超过 50%的比例提取风险准备金归管理人所有；若在每个会计年度的最后一个工作日，本计划风险准备金余额大于零，管理人可以部分或全部提取风险准备金归管理人所有。集合计划终止清算时，所有剩余风险准备金归管理人所有。”

9、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第十六部分第二款“集合计划的投资程序”。

原条款为：“4、管理人合规风控部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。”

拟修改为：“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。”

10、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第十六部分第三款“风险控制”。

原条款为：“3、合规风控部

合规风控部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。”

拟修改为：“3、合规与风险管理部门

合规与风险管理部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

管
742

理建议，协助、指导和检查各部门、分支机构的风险管理工作。”

11、改动位置：《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》第二十四部分第十款第 6 项“风险准备金弥补顺序导致的风险”。

原条款为：“在各类份额进行现金分红、退出和计划终止时，若对应份额当期实际年化收益率低于当期对应份额的业绩报酬计提基准，管理人将以风险准备金余额及已计提未提取的管理人业绩报酬为上限，弥补对应份额持有人的收益至其业绩报酬计提基准。若不同类的份额同时发生需要弥补收益的情形，管理人将以风险准备金余额及已计提未提取的管理人业绩报酬为上限，按照各类份额的份额数占有需要弥补的份额数的比例，弥补对应份额持有人的收益至其业绩报酬计提基准。

对于现金分红或退出时间较晚的份额，委托人可能面临风险准备金及已计提未提取的管理人业绩报酬因先用于弥补现金分红或退出时间较早的份额收益而不足以弥补其收益的风险。”

拟修改为：“在各类份额进行现金分红、退出和计划终止时，若对应份额当期实际年化收益率低于当期对应份额的业绩报酬计提基准，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业绩报酬计提基准。若不同类的份额同时发生需要弥补收益的情形，管理人将以风险准备金余额为上限，按照同时发生需要弥补收益情形的各类份额的份额数占有需要弥补的份额数的比例，弥补对应份额持有人的收益至其业绩报酬计提基准。

对于现金分红或退出时间较晚的份额，委托人可能面临风险准备金因先用于弥补现金分红或退出时间较早的份额收益而不足以弥补其收益的风险。”

同时修改《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》、《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划托管协议》《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划说明书》、《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划风险揭示书》对应条款。

从即日起，变更后的《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划管理合同》、《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划托管协议》、《财通证券资管润富 2

号集合资产管理计划说明书》、《财通证券资管润富 2 号集合资产管理计划风险揭示书》正式生效。

咨询电话：

95336。

特此公告。

财通证券资产管理有限公司

2016年12月17日



财通证券资产管理有限公司

