

# 财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划

## 合同变更公告暨投资者告知函

尊敬的投资者：

根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月 27 日联合印发的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、中国证券监督管理委员会于 2018 年 10 月 22 日发布并实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“《管理规定》”）等法律、法规及规范性文件的相关规定，本集合计划管理人与托管人经协商一致，我公司拟对《财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划资产管理合同》的部分条款进行变更，变更内容如下：

合同变动位置	变更前	变更后
特别约定	财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划由财通证券财丰 1 号集合资产管理计划变更而来，《财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划资产管理合同》自管理人公告的生效之日起生效，原《财通证券财丰 1 号集合资产管理计划资产管理合同》同日起失效，产品名称由“财通证券财丰 1 号集合资产管理计划”变更为“财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划”。	由于财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划可能存在规模和参与人数限制，为尽量防止超额认购/申购、保障客户利益，管理人经与销售机构协商后，可在推广期和开放期通过预约方式销售，控制预约购买的客户数和金额均在限额内，再正式开放销售并对预约申请予以确认。投资者办理预约申请的程序和确认按照销售机构的规定执行，投资者预约申请时间以销售机构记录的为准。
一、前言	为规范财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”、“计划”、“集合资产管理计划”、“资产管理计划”或“本集合计划”)运作，明确《财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券公司监督管理条例》、《关	为规范财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”、“计划”、“集合资产管理计划”、“资产管理计划”或“本集合计划”)运作，明确《财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划资产管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券公司监督管理条例》、《关



	<p>于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“《管理规定》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（以下简称《暂行规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》和其他有关规定，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p>	<p>于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“《指导意见》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“《管理办法》”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“《管理规定》”）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（以下简称《暂行规定》）、《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》和其他有关规定，投资者、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《管理规定》、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。</p>
<p>五、资产管理计划的基本情况</p>	<p>（四）资产管理计划的投资目标</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票（含港股通标的股票、新三板股票、科创板股票、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票）、现金、各种固定收益品种、国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期货、证券投资基金以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。</p> <p>其中，证券投资基金投资范围包括开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF、FOF 等；固定收益品种包括新债申购、债券回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单等。</p> <p>在法律法规和金融监管部门允许并且管理人</p>	<p>（四）资产管理计划的投资目标</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票（含港股通标的股票、北京证券交易所上市的股票、新三板股票、科创板股票、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票）、现金、各种固定收益品种、国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期货、证券投资基金以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。</p> <p>其中，证券投资基金投资范围包括<b>公开募集基础设施证券投资基金</b>、开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF、FOF 等；固定收益品种包括新债申购、债券回购、央行票据、短期融资券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单等。</p>

<p>与托管人系统支持的情况下，本集合计划后续可以参与个股期权、ETF 期权、股指期货。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定：</p> <p>(1) 权益类资产（包括股票、股票型基金等）投资占集合计划资产总值的 0%-80%（不含）；其中，投资于 ST 个股的投资比例不高于集合计划资产总值的 30%（不含退市整理期）；投资于在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券的比例不高于集合计划资产总值的 50%；参与港股通业务投资比例不高于集合计划资产总值的 60%；</p> <p>(2) 固定收益类资产（包括债券逆回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券型基金等）投资占集合计划资产总值的 0%-80%（不含）；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产（包括国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期权等）投资的持仓合约价值占集合计划资产总值的 0-80%（不含），或衍生品账户权益占集合计划资产总值的 0-20%（不含）。</p> <p>(4) 债券回购：债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的 40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的 100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(5) 混合类基金占集合计划资产总值的</p>	<p>在法律法规和金融监管部门允许并且管理人与托管人系统支持的情况下，本集合计划后续可以参与场内个股期权、ETF 期权、股指期货。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定：</p> <p>(1) 权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金、存托凭证等）投资占集合计划资产总值的 0%-80%（不含）；其中，投资于 ST 个股的投资比例不高于集合计划资产总值的 30%（不含退市整理期）；投资于在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券的比例不高于集合计划资产总值的 50%；参与港股通业务投资比例不高于集合计划资产总值的 60%；</p> <p>(2) 固定收益类资产（包括债券逆回购、央行票据、短期融资券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券型基金等）投资占集合计划资产总值的 0--80%（不含）；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产（包括国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期权等）投资的持仓合约价值占集合计划资产总值的 0-80%（不含），或衍生品账户权益占集合计划资产总值的 0-20%（不含）。</p> <p>(4) 债券回购：债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的 40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的 100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(5) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的 20%。</p>
--	---

	<p>0-100%</p> <p>(6) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的 20%。</p> <p>(7) 本计划开放退出期，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。</p> <p>(8) 本集合计划总资产不得超过净资产的 200%。</p>	<p>(6) 本计划开放退出期，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。</p> <p>(7) 本集合计划总资产不得超过净资产的 200%。</p>
五、资产管理计划的基本情况	<p>(五) 资产管理计划的存续期限</p> <p>自集合计划成立之日起算，存续期为 10 年。存续期满后管理人可以决定到期清算终止，或满足适当条件后展期。</p>	<p>(五) 资产管理计划的存续期限</p> <p>自集合计划本次合同变更生效之日起算，存续期为 10 年。存续期满后管理人可以决定到期清算终止，或满足适当条件后展期。</p>
五、资产管理计划的基本情况	<p>(十一) 本集合计划的各项费用与业绩报酬</p> <p>1、参与费率：0</p> <p>2、退出费率：0</p> <p>3、管理费率：0.50%/年</p> <p>4、托管费率：0.25%/年</p> <p>5、管理人业绩报酬：</p> <p>本计划的业绩报酬计提日为计划分红日、投资者退出日和计划终止日。</p> <p>在业绩报酬计提日，若投资者在持有期内的实际年化收益率（S）小于或等于业绩报酬计提基准（15%/年），则管理人不提取业绩报酬；若在持有期内的实际年化收益率（S）大于业绩报酬计提基准（15%/年），则管理人对超出部分按一定比例（20%）提取业绩报酬，剩余部分归投资者所有。</p> <p>本计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p>	<p>(十一) 本集合计划的各项费用与业绩报酬</p> <p>1、参与费率：0</p> <p>2、退出费率：0</p> <p>3、管理费率：1.50%/年</p> <p>4、托管费率：0.25%/年</p> <p>5、管理人业绩报酬：</p> <p>本计划的业绩报酬计提日为计划分红日、投资者退出日和计划终止日。</p> <p>在业绩报酬计提日，若投资者在持有期内的实际年化收益率（S）小于或等于持有期间的业绩报酬计提基准（K），则管理人不提取业绩报酬；若在持有期内的实际年化收益率（S）大于持有期间的业绩报酬计提基准（K），则管理人对超出部分按一定比例（Y）提取业绩报酬，剩余部分归投资者所有。自本次合同变更生效日开始，业绩报酬计提基准 K 为 6%，业绩报酬计提比例 Y 为 20%。对于本次合同变更生效前存续客户持有的本计划份额，投资者在持有期内的业绩报酬将按照合同变更生效前及合同生效变更日（含）后分别根据变更生</p>



	<p>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、托管人和销售机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。</p>	<p>效前后的各业绩报酬计提基准计算。</p> <p>本计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p> <p>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、托管人和销售机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>	<p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票(含港股通标的股票、新三板股票、科创板股票、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票)、现金、各种固定收益品种、国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期货、证券投资基金以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。</p> <p>其中，证券投资基金投资范围包括开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF、FOF 等；固定收益品种包括新债申购、债券回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、同业存单等。</p> <p>在法律法规和金融监管部门允许并且管理人与托管人系统支持的情况下，本集合计划后续可以参与个股期权、ETF 期权、股指期货。</p>	<p>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票(含港股通标的股票、北京证券交易所上市的股票、新三板股票、科创板股票、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票)、现金、各种固定收益品种、国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期货、证券投资基金以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。</p> <p>其中，证券投资基金投资范围包括<b>公开募集基础设施证券投资基金</b>、开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF、FOF 等；固定收益品种包括新债申购、债券回购、央行票据、短期融资券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、同业存单等。</p> <p>在法律法规和金融监管部门允许并且管理人与托管人系统支持的情况下，本集合计划后续可以参与<b>场内</b>个股期权、ETF 期权、股指期货。</p>

<p>2、资产配置比例</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定：</p> <p>(1) 权益类资产（包括股票、股票型基金等）投资占集合计划资产总值的 0%-80%（不含）；其中，投资于 ST 个股的投资比例不高于集合计划资产总值的 30%（不含退市整理期）；投资于在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券的比例不高于集合计划资产总值的 50%；参与港股通业务投资比例不高于集合计划资产总值的 60%；</p> <p>(2) 固定收益类资产（包括债券逆回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券型基金等）投资占集合计划资产总值的 0%-80%（不含）；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产（包括国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期权等）投资的持仓合约价值占集合计划资产总值的 0-80%（不含），或衍生品账户权益占集合计划资产总值的 0-20%（不含）。</p> <p>(4) 债券回购：债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的 40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的 100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(5) 混合类基金占集合计划资产总值的 0-100%</p> <p>(6) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净</p>	<p>2、资产配置比例</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定：</p> <p>(1) 权益类资产（包括股票、股票型基金、混合型基金、存托凭证等）投资占集合计划资产总值的 0%-80%（不含）；其中，投资于 ST 个股的投资比例不高于集合计划资产总值的 30%（不含退市整理期）；投资于在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券的比例不高于集合计划资产总值的 50%；参与港股通业务投资比例不高于集合计划资产总值的 60%；</p> <p>(2) 固定收益类资产（包括债券逆回购、央行票据、短期融资券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券型基金等）投资占集合计划资产总值的 0%-80%（不含）；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产（包括国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期权等）投资的持仓合约价值占集合计划资产总值的 0-80%（不含），或衍生品账户权益占集合计划资产总值的 0-20%（不含）。</p> <p>(4) 债券回购：债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的 40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的 100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(5) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的 20%。</p> <p>(6) 本计划开放退出期，资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于计划资产净值的 10%。</p>
--	--

	<p>值的 20%。</p> <p>(7) 本计划开放退出期, 资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于计划资产净值的 10%。</p> <p>(8) 本集合计划总资产不得超过净资产的 200%。</p>	<p>(7) 本集合计划总资产不得超过净资产的 200%。</p>
<p>十八、越权交易的界定</p>	<p>(三) 托管人根据本合同的规定对管理人的如下投资行为行使监督权:</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票(含港股通标的股票、新三板股票、科创板股票、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票)、现金、各种固定收益品种、国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期货、证券投资基金以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。</p> <p>其中, 证券投资基金投资范围包括开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF、FOF 等; 固定收益品种包括新债申购、债券回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、同业存单等。</p> <p>在法律法规和金融监管部门允许并且管理人与托管人系统支持的情况下, 本集合计划后续可以参与个股期权、ETF 期权、股指期货。</p> <p>2、投资比例</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例, 将严格遵守相关法律法规的规定:</p>	<p>(三) 托管人根据本合同的规定对管理人的如下投资行为行使监督权:</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票(含港股通标的股票、北京证券交易所上市的股票、新三板股票、科创板股票、存托凭证及其他中国证监会核准上市的股票)、现金、各种固定收益品种、国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期货、证券投资基金以及中国证监会认可的其他投资品种。本集合计划可参与债券回购业务。</p> <p>其中, 证券投资基金投资范围包括<b>公开募集基础设施证券投资基金</b>、开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF、FOF 等; 固定收益品种包括新债申购、债券回购、央行票据、短期融资券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款(包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款)、同业存单等。</p> <p>在法律法规和金融监管部门允许并且管理人与托管人系统支持的情况下, 本集合计划后续可以参与<b>场内</b>个股期权、ETF 期权、股指期货。</p> <p>2、投资比例</p> <p>本集合计划投资组合在各类资产上的投资比例, 将严格遵守相关法律法规的规定:</p> <p>(1) 权益类资产(包括股票、股票型基金、<b>混合型基金</b>、存托凭证等)投资占集合计划资</p>

<p>(1) 权益类资产（包括股票、股票型基金等）投资占集合计划资产总值的 0%-80%（不含）；其中，投资于 ST 个股的投资比例不高于集合计划资产总值的 30%（不含退市整理期）；投资于在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券的比例不高于集合计划资产总值的 50%；参与港股通业务投资比例不高于集合计划资产总值的 60%；</p> <p>(2) 固定收益类资产（包括债券逆回购、央行票据、短期融资券、资产支持证券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券型基金等）投资占集合计划资产总值的 0%—80%（不含）；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产（包括国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期权等）投资的持仓合约价值占集合计划资产总值的 0-80%（不含），或衍生品账户权益占集合计划资产总值的 0-20%（不含）。</p> <p>(4) 债券回购：债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的 40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的 100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(5) 混合类基金占集合计划资产总值的 0-100%。</p> <p>(6) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的 20%。</p> <p>(7) 本集合计划总资产不得超过净资产的 200%。</p> <p>(8) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 25%；银行活期存款、</p>	<p>产总值的 0%-80%（不含）；其中，投资于 ST 个股的投资比例不高于集合计划资产总值的 30%（不含退市整理期）；投资于在全国中小企业股份转让系统挂牌转让的证券的比例不高于集合计划资产总值的 50%；参与港股通业务投资比例不高于集合计划资产总值的 60%；</p> <p>(2) 固定收益类资产（包括债券逆回购、央行票据、短期融资券、中期票据、国债、金融债、企业债、公司债、地方政府债券、可分离交易债券、可转换债券、可交换债券、银行存款（包括但不限于银行定期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金、债券型基金等）投资占集合计划资产总值的 0%—80%（不含）；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产（包括国债期货、股指期货、个股期权、ETF 期权、股指期权等）投资的持仓合约价值占集合计划资产总值的 0-80%（不含），或衍生品账户权益占集合计划资产总值的 0-20%（不含）。</p> <p>(4) 债券回购：债券正回购融入资金余额不得超过上一日资产净值的 40%，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的 100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(5) 本计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过计划资产净值的 20%。</p> <p>(6) 本集合计划总资产不得超过净资产的 200%。</p> <p>(7) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。中国证监会另有规定的除外。非因管理人主观因素导致突破该比例限制的，管理人应当在资产</p>
--	--



	<p>国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。中国证监会另有规定的除外。非因管理人主观因素导致突破该比例限制的，管理人应当在资产可出售、可转让或恢复交易的 15 个工作日内调整至符合要求。</p> <p>(9) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>	<p>可出售、可转让或恢复交易的 15 个工作日内调整至符合要求。</p> <p>(8) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p>
<p>十九、资产管理计划的估值和会计核算</p>	<p>(三) 估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的、且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(2) 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(3) 交易所上市未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p>	<p>(三) 估值方法</p> <p>1、证券交易所上市的有价证券的估值</p> <p>(1) 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的、且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以最近交易日的市价（收盘价）估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格；</p> <p>(2) 对在交易所市场上市交易或挂牌转让的固收品种（另有规定的除外）选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值；具体估值机构由管理人与托管人另行协商约定。</p> <p>(3) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；</p> <p>(4) 对在交易所上市交易的可交换债券、可转换债券，按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。如最近交易日后经济环境发生了</p>

	<p>(4)交易所上市不存在活跃市场的有价证券,采用估值技术确定公允价值;交易所上市的资产支持证券,采用估值技术确定公允价值;在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下,按成本估值。</p>	<p>重大变化的,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易市价,确定公允价值。</p>
<p>二十、资产管理计划的费用与税收</p>	<p>(一)资产管理计划的费用种类、费率、费率的调整、计提标准与支付方式</p> <p>1、托管费:</p> <p>托管费按前一日的集合计划资产净值的0.25%年化费率计算,成立日当日按照成立规模计提托管费。具体计算方法如下:</p> $H=E \times 0.25\% \div 365$ <p>H为每日应计提的托管费</p> <p>E为前一日的集合计划资产净值</p> <p>托管费每日计提,按季支付。由管理人向托管人发送委托财产托管费划付指令,托管人复核后于五个工作日内从委托财产中一次性支付给托管人。若遇不可抗力致使无法按时支付或现金类委托财产不足以支付的,顺延至最近可支付日支付。集合计划终止后,依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。</p> <p>2、管理费:</p> <p>管理费按前一日的集合计划资产净值的0.50%年化费率计算,成立日当日按照成立规模计提管理费。具体计算方法如下:</p> $H=E \times 0.50\% \div 365$ <p>H为每日应计提的管理费</p> <p>E为前一日的集合计划资产净值</p> <p>管理费每日计提,按季支付。由管理人向托管人发送委托财产管理费划付指令,托管人复核后于五个工作日内从委托财产中一次性支付给管理人。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的,则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。集合计划终止后,依据清</p>	<p>(一)资产管理计划的费用种类、费率、费率的调整、计提标准与支付方式</p> <p>1、托管费:</p> <p>托管费按前一日的集合计划资产净值的0.25%年化费率计算,成立日当日按照成立规模计提托管费。具体计算方法如下:</p> $H=E \times 0.25\% \div 365$ <p>H为每日应计提的托管费</p> <p>E为前一日的集合计划资产净值</p> <p>托管费每日计提,按季支付。由管理人向托管人发送委托财产托管费划付指令,托管人复核后于五个工作日内从委托财产中一次性支付给托管人。若遇不可抗力致使无法按时支付或现金类委托财产不足以支付的,顺延至最近可支付日支付。集合计划终止后,依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。</p> <p>2、管理费:</p> <p>管理费按前一日的集合计划资产净值的1.50%年化费率计算,成立日当日按照成立规模计提管理费。具体计算方法如下:</p> $H=E \times 1.50\% \div 365$ <p>H为每日应计提的管理费</p> <p>E为前一日的集合计划资产净值</p> <p>管理费每日计提,按季支付。由管理人向托管人发送委托财产管理费划付指令,托管人复核后于五个工作日内从委托财产中一次性支付给管理人。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的,则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。集合计划终止后,依据清</p>

	<p>算程序支付管理人尚未支付的管理费。管理人有权根据市场情况调低管理费率 and 支付频率，在管理人网站公告，并最迟于新的费率实施日前三个工作日通知托管人，无需另行征询投资者的意见。</p>	<p>算程序支付管理人尚未支付的管理费。管理人有权根据市场情况调低管理费率 and 支付频率，在管理人网站公告，并最迟于新的费率实施日前三个工作日通知托管人，无需另行征询投资者的意见。</p>						
<p>二十、资产管理计划的费用与税收</p>	<p>(三) 管理人业绩报酬</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>在业绩报酬计提日，若投资者在持有期内的实际年化收益率 (S) 小于或等于业绩报酬计提基准 (K=15%/年)，则管理人不提取业绩报酬；若在持有期内的实际年化收益率 (S) 大于业绩报酬计提基准 (K=15%/年)，则管理人对超出部分按一定比例 (Y=20%) 提取业绩报酬，剩余部分归投资者所有。</p> <p>本计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p> <p>业绩报酬计算方法如下：</p> <table border="1" data-bbox="295 1272 818 1444"> <thead> <tr> <th>本期实际年化收益率 S</th> <th>计提比例 (Y)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>S \leq 15\%/年</math></td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><math>S &gt; 15\%/年</math></td> <td>20%</td> </tr> </tbody> </table> <p>业绩报酬计提办法：</p> $S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$ $H = Q \times C \times (S - K) \times \frac{D}{365}$ <p>其中：</p> <p><math>C''</math>：在业绩报酬计提日的累计单位净值；</p> <p><math>C'</math>：在上一业绩报酬计提日的累计单位净值；</p>	本期实际年化收益率 S	计提比例 (Y)	$S \leq 15\%/年$	0	$S > 15\%/年$	20%	<p>(三) 管理人业绩报酬</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>(1) 管理人提取业绩报酬的原则</p> <p>1) 本集合计划有权对投资者持有的计划份额实际年化收益率超过业绩报酬计提基准的部分按一定比例计提业绩报酬；</p> <p>2) 同一投资者不同时间多次参与本计划的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；</p> <p>3) 业绩报酬计提日为：本计划的业绩报酬计提日为收益分配日、投资者退出日和计划终止日。</p> <p>(2) 业绩报酬的计提方法</p> <p>在业绩报酬计提日，若投资者在持有期内的实际年化收益率 (S) 小于或等于持有期间的业绩报酬计提基准 (K)，则管理人不提取业绩报酬；若在持有期内的实际年化收益率 (S) 大于持有期间的业绩报酬计提基准 (K)，则管理人对超出部分按一定比例 (Y) 提取业绩报酬，剩余部分归投资者所有。自本次合同变更生效日开始，业绩报酬计提基准 K 为 6%，业绩报酬计提比例 Y 为 20%。对于本次合同变更生效前存续客户持有的本计划份额，投资者在持有期内的业绩报酬将按照合同变更生效前及合同生效变更日 (含) 后分别根据变更生效前后的各业绩报酬计提基准计算。</p> <p>管理人有权根据市场情况，通过公告形式调整本计划的业绩报酬收取比例和业绩报酬计提基准，并向投资者披露，届时投资者注意公告</p>
本期实际年化收益率 S	计提比例 (Y)							
$S \leq 15\%/年$	0							
$S > 15\%/年$	20%							

<p><math>C</math>：在上一业绩报酬计提日的单位净值；</p> <p><math>D</math>：业绩报酬计提日（含）至上一业绩报酬计提日（不含）的间隔天数；</p> <p><math>H</math>：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；</p> <p><math>Q</math>：业绩报酬计提日投资者退出份额数或计划分红、终止时持有份额总数。</p> <p>对于推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的，上一业绩报酬计提日的单位净值和累计净值均为1.00元，<math>D</math>为业绩报酬计提日（含）至计划成立日（含）的间隔天数；对于开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的，上一业绩报酬计提日指参与日。</p> <p>业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于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。</p> <p>业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人根据业绩报酬划付指令进行划款。</p>	<p>信息。本计划业绩报酬提取频率不得超过每 6 个月一次，提取比例不得超过业绩报酬计提基准以上投资收益的 60%。因投资者退出资产管理计划，管理人按照本合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p> <p>业绩报酬计算方法如下：</p> <table border="1" data-bbox="874 510 1396 683"> <thead> <tr> <th>本期实际年化收益率 <math>S</math></th> <th>计提比例 (<math>Y</math>)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>S \leq 6\%/年</math></td> <td>0</td> </tr> <tr> <td><math>S &gt; 6\%/年</math></td> <td>20%</td> </tr> </tbody> </table> <p>业绩报酬计提办法：</p> $S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$ $H = Q \times C \times (S - K) \times \frac{D}{365}$ <p>其中：</p> <p><math>C''</math>：在业绩报酬计提日的累计单位净值；</p> <p><math>C'</math>：在上一业绩报酬计提日的累计单位净值；</p> <p><math>C</math>：在上一业绩报酬计提日的单位净值；</p> <p><math>D</math>：业绩报酬计提日（含）至上一业绩报酬计提日（不含）的间隔天数；</p> <p><math>H</math>：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；</p> <p><math>Q</math>：业绩报酬计提日投资者退出份额数或计划分红、终止时持有份额总数。</p> <p>对于推广期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的，上一业绩报酬计提日的单位净值和累计净值均为1.00元，<math>D</math>为业绩报酬计提日（含）至计划成立日（含）的间隔天数；对于</p>	本期实际年化收益率 $S$	计提比例 ( $Y$ )	$S \leq 6\%/年$	0	$S > 6\%/年$	20%
本期实际年化收益率 $S$	计提比例 ( $Y$ )						
$S \leq 6\%/年$	0						
$S > 6\%/年$	20%						



		<p>开放期参与的每笔份额首次计提业绩报酬的，上一业绩报酬计提日指参与日。</p> <p>业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于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。</p> <p>业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人根据业绩报酬划付指令进行划款。</p>
<p>二十三、风险揭示</p>		<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>增加以下条款：</p> <p><b>22、北京证券交易所上市股票投资风险</b></p> <p>(1) 北交所主要服务创新型中小企业，企业多处于成长期，规模可能偏小，往往具有依赖核心技术人员和供应商、客户集中度高、应对外部冲击能力较弱等特点，企业上市后的持续创新能力、收入及盈利水平等仍具有较大不确定性。</p> <p>(2) 北交所设置四套上市标准，其中允许未盈利企业上市。因此可能存在企业向不特定合格投资者公开发行股票并在北交所上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，以及在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情况。</p> <p>(3) 因北交所上市企业多聚焦行业细分领域，业绩受外部环境影响大，可比公司较少，传统估值方法可能不适用，上市后可能存在股价波动的风险。</p> <p>(4) 发行人发行承销过程中，出现预计发行后总市值无法满足招股文件所选上市标准的，将按规定中止发行。</p> <p>(5) 公开发行股票并上市时，发行人和主承销商可以采用超额配售选择权，即存在超额配</p>

	<p>售选择权实施结束后,发行人增发股票的可能性。</p> <p>(6) 北交所股票可能因触及退市情形被终止上市。因触及交易类情形被终止上市的北交所股票,不进入退市整理期;因触及财务类、规范类及重大违法类情形被终止上市的,进入退市整理期交易 15 个交易日,且首个交易日不设价格涨跌幅限制。</p> <p>(7) 北交所允许上市公司存在表决权差异安排。根据此项安排,上市公司可能存在控制权相对集中,以及因每一特别表决权股份拥有的表决权数量大于每一普通股份拥有的表决权数量等情形,而使普通投资者的表决权及对公司日常经营等事务的影响力受到限制。出现北交所上市规则及上市公司章程规定的情形时,特别表决权股份将按 1:1 的比例转换为普通股份,股份转换自相关情形发生时生效,并可能与相关股份转换登记时点存在差异。</p> <p>(8) 北交所股票上市首日不设涨跌幅限制,其后涨跌幅限制为 30%,可能产生股价波动的风险。</p> <p>(9) 北交所股票交易具有盘中临时停牌情形,设有异常波动股票核查制度。</p> <p>(10) 北交所证券相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件(以下简称法律法规)和交易所业务规则,可能根据公开征求意见结果和市场情况进行修改,或者由相关部门制定新的法律法规和业务规则。</p> <p>投资北交所上市股票可能存在上述风险,从而对本计划资产净值带来影响,请投资者关注。</p>
--	---

同时修改《财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划说明书》和《财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划风险揭示书》对应条款。

管理人特别提示，本次合同变更修改了管理费和管理人业绩报酬提取条款。对于本次合同变更生效前存续客户持有的本计划份额，投资者在持有期内的业绩报酬将按照合同变更生效前及合同生效变更日（含）后分别根据变更生效前后的各业绩报酬计提基准计算。

根据合同约定，如果投资者未在管理人网站公告发出后的 3 个工作日内提出异议的，应视为其同意管理人对本合同做出变更。投资者不同意管理人对合同进行变更的，可在管理人设置的临时开放期（2022 年 3 月 28 日、29 日）提出退出申请，逾期未退出且未有意见答复的投资者，均视为同意本合同变更；对于合同变更生效日前书面答复不同意合同变更但逾期未退出的投资者，管理人对该部分投资者在合同变更生效日办理强制退出。

管理人在此特别提示：管理人于 2022 年 3 月 9 日发布了《财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划合同变更公告暨投资者告知函》，自本次合同变更生效之日起，变更公告内容即成为合同组成部分。自本次合同变更公告日至本次合同变更生效日之间参与本集合计划的委托人，请仔细阅读财通证券资管财丰 1 号集合资产管理计划原合同以及变更公告，知晓相关变更内容。

咨询电话：95336。

财通证券资产管理有限公司  
2022 年 3 月 9 日

