

# 财通证券资管双周赢 6 号集合资产管理计划 合同变更公告

根据 2023 年 1 月 12 日由中国证券监督管理委员会发布的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令【第 203 号】）（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》（证监会公告（2023）2 号）（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，对《财通证券资管双周赢 6 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
四、当事人及 权利义务	<p>（二）管理人</p> <p>机构名称：财通证券资产管理有限公司</p> <p>法定代表人：马晓立</p> <p>注册地址：浙江省杭州市上城区白云路 26 号 143 室</p> <p>邮政编码：310008</p> <p>办公地址：浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院 B 幢</p> <p>邮政编码：310007</p> <p>联系电话：95336</p>	<p>（二）管理人</p> <p>机构名称：财通证券资产管理有限公司</p> <p>法定代表人：马晓立</p> <p>注册地址：浙江省杭州市上城区白云路 26 号 143 室</p> <p>邮政编码：310008</p> <p>办公地址：上海市浦东新区栖霞路 26 弄富汇大厦 B 座 8、9 层</p> <p>邮政编码：200120</p> <p>联系电话：(021)20568233</p>
四、当事人及 权利义务	<p>（六）管理人的权利与义务</p> <p>1、管理人的权力</p> <p>.....</p> <p>（5）根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告证监会派出机构及证券投资基金业协会；</p>	<p>（六）管理人的权利与义务</p> <p>1、管理人的权力</p> <p>.....</p> <p>（5）根据资产管理合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反资产管理合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告证监会派出机构；</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>本集合计划全部投资于证监会规定的标准化资产，具体包括：在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所发行、交易的国债、地方政府债、中央银行票据、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，以及债券型基金、货币市场基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、现金。</p>	<p>(四) 资产管理计划的投资目标</p> <p>1、投资范围</p> <p>本集合计划全部投资于证监会规定的标准化资产，具体包括：在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所发行、交易的国债、地方政府债、中央银行票据、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，以及债券型基金、货币市场基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、现金、国债期货。</p>
<p>五、资产管理计划的基本情况</p>	<p>2、资产配置比例</p> <p>固定收益类资产：占计划资产总值的 80-100%；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、债券逆回购、债券型基金、现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金等。</p>	<p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 本资产管理计划投资固定收益类资产合计市值占计划资产总值的比例为 80-100%。本计划持有的固定收益类净头寸价值不得超过计划资产净值的 180%；（固定收益类净头寸：指固定收益类多头头寸价值减去固定收益类空头头寸价值的差的绝对值；固定收益类多头头寸价值：指买入持有的固定收益类证券市值、买入国债期货的合约价值及买入其他固定收益类工具的价值合计值；固定收益类空头头寸价值：指卖出国债期货的合约价值及卖空其他固定收益类工具的价值合计值）。</p> <p>(2) 本资产管理计划投资期货和衍生品的持仓合约价值占集合计划资产总值的比例为 0-80%，或期货和衍生品账户权益占集合计划资产总值的 0-20%。</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>(二) 投资范围及比例</p> <p>1、投资范围</p>

	<p>本集合计划全部投资于证监会规定的标准化资产，具体包括：在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所发行、交易的国债、地方政府债、中央银行票据、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，以及债券型基金、货币市场基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、现金。</p>	<p>本集合计划全部投资于证监会规定的标准化资产，具体包括：在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所发行、交易的国债、地方政府债、中央银行票据、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，以及债券型基金、货币市场基金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、现金、国债期货。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>	<p>2、资产配置比例</p> <p>固定收益类资产：占计划资产总值的 80-100%；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、债券逆回购、债券型基金、现金、银行存款（包括但不限于银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款等各类存款）、同业存单、货币市场基金等。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。</p>	<p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 本资产管理计划投资固定收益类资产合计市值占计划资产总值的比例为 80-100%。本计划持有的固定收益类净头寸价值不得超过计划资产净值的 180%；（固定收益类净头寸：指固定收益类多头头寸价值减去固定收益类空头头寸价值的差的绝对值；固定收益类多头头寸价值：指买入持有的固定收益类证券市值、买入国债期货的合约价值及买入其他固定收益类工具的价值合计值；固定收益类空头头寸价值：指卖出国债期货的合约价值及卖空其他固定收益类工具的价值合计值）。</p> <p>(2) 本资产管理计划投资期货和衍生品的持仓合约价值占集合计划资产总值的比例为 0-80%，或期货和衍生品账户权益占集合计划资产总值的 0-20%。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>		<p>(六) 投资策略</p> <p>新增：4、国债期货投资策略</p> <p>本计划对国债期货的投资以套期保值为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流</p>

		<p>动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。</p> <p><b>A、风险控制</b></p> <p>由于期货交易尤其是进行投机交易会涉及到对行情进行判断，因而存在着较高的市场风险，管理人会对以投机为目的的交易进行严格的控制和监管。首先，严格控制投机交易的规模，不得超过管理人有关规定的规模进行交易；其次，管理人将对期货的风险敞口进行监控，不得超过合同约定的范围。</p> <p><b>B、期货保证金的流动性应急处理机制</b></p> <p><b>1) 应急触发条件</b></p> <p>管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，管理人未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。</p> <p><b>2) 保证金补充机制</b></p> <p>如出现保证金不足的情况时，管理人将通过及时变现集合计划资产或其他合法合规的方式处理，以最大限度地降低损失。</p>
<p>十一、资产管理计划的投资</p>	<p>(九) 投资限制</p> <p>1、投资限制</p> <p>.....</p> <p>(2) 债券回购：债券正回购资金余额或逆回购资金余额不超过其上一日资产净值的 100%。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>(3) 本集合计划总资产不得超过净资产的 200%。</p>	<p>(九) 投资限制</p> <p>1、投资限制</p> <p>.....</p> <p>(2) 债券回购：债券正回购融入资金余额不超过上一日计划资产净值的 80%，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>(3) 本集合计划总资产不得超过净资产的 180%。</p>
<p>十四、关联方</p>	<p>(一) 利益冲突情形</p>	<p>(一) 利益冲突情形</p>

<p>及关联交易</p>	<p>本集合资产管理计划存在的或可能存在利益冲突情形，包括但不限于：</p> <p>1、管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行交易买卖，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项；</p> <p>2、管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划；</p> <p>3、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出本计划；</p> <p>4、法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>（二）利益冲突的处理</p> <p>1、全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将本合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署本合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以本合同为依据进行上述关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利，对于书面答复管理人不同意但未</p>	<p>本集合资产管理计划存在的或可能存在利益冲突情形，包括但不限于：</p> <p>1、管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行交易买卖，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项；</p> <p>2、管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划；</p> <p>3、证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出本计划；</p> <p>4、法律、行政法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>（二）利益冲突的处理</p> <p>1、全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将本合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署本合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以本合同为依据进行上述关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利，对于书面答复管理人不同意但未</p>
--------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------



<p>退出的投资者，管理人对该部分投资者在关联交易发生之日办理强制退出，事后单独向投资者和托管人进行信息披露和报告。</p> <p>管理人旗下管理的私募资产管理产品的关联方范围、一般关联交易与重大关联交易的区分标准、公司对关联方交易的内部管控机制以及关联交易的处理方式等内容如下：</p> <p>（1）关联交易的范围</p> <p>管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行交易买卖，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项；</p> <p>（2）关联方范围</p> <p>管理人管理的私募资产管理产品的关联方主要包括：管理人、管理人的关联方、该投资组合的资产托管人及其关联方、监管法规规定的其他关联方。管理人的关联方是指符合法规定义的关联法人和关联自然人、管理人管理或担任投资顾问的产品、管理人的关联方作为管理人发行的资管产品。托管人的关联方包含其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司。托管人的关联方认定将以托管人提供的关联方名单为依据，并由管理人及托管人共同认定为准，若托管人未及时提供或更新其关联方名单，管理人将根据托管人公布的年度报告或其他定期报告的披露信息进行控制。管理人的关联方名单将于管理人网站</p>	<p>退出的投资者，管理人对该部分投资者在关联交易发生之日办理强制退出，事后单独向投资者和托管人进行信息披露和报告。</p> <p>管理人旗下管理的私募资产管理产品的关联方范围、一般关联交易与重大关联交易的区分标准、公司对关联交易的内部管控机制以及关联交易的处理方式等内容如下：</p> <p>（1）关联交易的范围</p> <p>管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及管理人、托管人的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，投资前述机构管理的公开募集证券投资基金，集合计划投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划，与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项；</p> <p>（2）关联方范围</p> <p>管理人管理的私募资产管理产品的关联方主要包括：管理人、管理人的关联方、该投资组合的资产托管人及其关联方、监管法规规定的其他关联方。管理人的关联方是指符合法规定义的关联法人和关联自然人、管理人管理或担任投资顾问的产品、管理人的关联方作为管理人发行的资管产品。托管人的关联方包含其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司。托管人的关联方认定将以托管人提供的关联方名单为依据，并由管理人及托管人共同认定为准，若托管人未及时提供或更新其关联方名单，管理人将根据托管人公布的年度报告或其他定期报告的披露信息</p>
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>披露，托管人的关联方名单以本合同或托管协议约定为准或以托管人公布的年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准，投资者可按上述路径进行查阅。</p> <p>(3) 一般关联交易、重大关联交易的区分标准          私募资产管理产品关联交易分为一般关联方交易和重大关联方交易。</p> <p>私募资产管理产品的重大关联方交易是指以下情形：</p> <p>1) 管理人管理的单个私募资产管理产品与其关联方之间发生的交易金额超过前一日组合资产净值10%以上的单笔股票交易、发生的交易金额超过前一日组合资产净值50%的单笔债券回购交易、发生的交易金额超过前一日组合资产净值20%的单笔债券现券交易。</p> <p>2) 管理人管理的私募资产管理产品投资管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券单笔投资超过组合净值25%，累计超过组合净值50%；</p> <p>3) 管理人管理的私募资产管理产品投资管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司管理的资产管理产品单笔超过组合净值25%；管理人管理的私募组合由于现金管理的需要，申购管理人作为管理人的货币市场基金除外；</p> <p>除上述之外的其他关联交易为一般关联交易。</p> <p>(4) 管理人对关联方交易的内部管控机制          管理人制定并实施了《财通证券资产管理有限公</p>	<p>进行控制。管理人的关联方名单将于管理人网站披露，托管人的关联方名单以托管人公布的年度报告或其他定期报告中披露的关联方名单为准，投资者可按上述路径进行查阅。</p> <p>(3) 一般关联交易、重大关联交易的区分标准          私募资产管理产品关联交易分为一般关联交易和重大关联交易。</p> <p>私募资产管理产品的重大关联交易是指以下情形：</p> <p>1) 管理人管理的单个私募资产管理产品与其关联方之间发生的交易金额超过前一日组合资产净值10%以上的单笔股票交易、发生的交易金额超过前一日组合资产净值50%的单笔债券回购交易、发生的交易金额超过前一日组合资产净值20%的单笔债券现券交易。</p> <p>2) 管理人管理的私募资产管理产品投资管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券单笔投资超过组合净值15%且金额超过5000万元；</p> <p>3) 管理人管理的私募资产管理产品认、申购管理人、托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司管理的公募基金单笔超过组合净值20%；投资管理人及其关联方管理的私募资产管理计划、资产支持计划单笔超过组合净值20%；管理人管理的私募组合由于现金管理的需要，认、申购管理人管理的货币市场基金除外；</p> <p>除上述之外的其他关联交易为一般关联交易。</p> <p>(4) 管理人对关联方交易的内部管控机制</p>
-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

<p>司关联交易管理办法》，规范关联交易的审批、信息披露、交易管理等。管理人按资产管理合同约定及管理人制度履行对关联方交易的审批、披露、报告等程序。</p> <p>1) 禁止以下关联交易</p> <p>A、管理人直接或间接为公司股东或股东的关联方提供融资或者担保；</p> <p>B、管理人管理的投资组合直接或间接投向控股股东、实际控制人及其控制企业的非标资产；</p> <p>C、管理人管理的投资组合以借款、代偿债务、担保、虚假转让资产、非正常交易等方式为控股股东、实际控制人及其控制企业提供融资，通过多层嵌套等手段隐匿关联交易和资金真实去向，通过“抽屉协议”“阴阳合同”等形式规避监管；</p> <p>D、将管理人管理的分级资产管理计划资产，直接或者间接为该分级资产管理计划劣后级投资者及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资；</p> <p>E、允许投资顾问及其关联方以其自有资金或者募集资金投资于分级资产管理计划的劣后级份额；</p> <p>F、其他不正当关联交易。</p> <p>2) 在决策机制方面</p> <p>资管产品从事重大关联方交易的，应经由管理人董事会或其授权机构审批；从事一般关联方交易的，应经管理人风险管理部门审批通过后方可执行。</p> <p>3) 在交易定价机制方面</p> <p>管理人参与关联交易，关联交易价格应当遵循诚实信用的一般原则，所确定的价格应当为市场公</p>	<p>管理人制定并实施了《财通证券资产管理有限公司关联交易管理办法》，规范关联交易的审批、信息披露、交易管理等。管理人按资产管理合同约定及管理人公司制度履行对关联交易的审批、披露、报告等程序。</p> <p>1) 禁止以下关联交易</p> <p>A、管理人直接或间接为公司股东或股东的关联方提供融资或者担保；</p> <p>B、管理人管理的投资组合直接或间接投向控股股东、实际控制人及其控制企业的非标资产；</p> <p>C、管理人管理的投资组合以借款、代偿债务、担保、虚假转让资产、非正常交易等方式为控股股东、实际控制人及其控制企业提供融资，通过多层嵌套等手段隐匿关联交易和资金真实去向，通过“抽屉协议”“阴阳合同”等形式规避监管；</p> <p>D、将管理人管理的分级资产管理计划资产，直接或者间接为该分级资产管理计划劣后级投资者及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资；</p> <p>E、允许投资顾问及其关联方以其自有资金或者募集资金投资于分级资产管理计划的劣后级份额；</p> <p>F、其他不正当关联交易。</p> <p>2) 在决策机制方面</p> <p>资管产品从事重大关联交易的，应经由管理人公司董事会审批，并经三分之二以上的独立董事通过；从事一般关联交易的，应经管理人公司风险管理部门审批通过后方可执行。</p> <p>3) 在交易定价机制方面</p> <p>管理人参与关联交易，关联交易价格应当遵循诚</p>
-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------



<p>允价格。如所涉交易有国家定价或政府指导价的，按国家定价或政府指导价执行。</p> <p>(5) 关联方交易的特别风险提示</p> <p>管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据私募资产管理产品资产管理合同的约定，在实际投资操作中可能会参与投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行交易买卖，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项。尽管管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险，管理人也无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响投资者的利益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将本合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署本合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以本合同为依据进行上述关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确</p>	<p>实信用的一般原则，所确定的价格应当为市场公允价格。如所涉交易有国家定价或政府指导价的，按国家定价或政府指导价执行。</p> <p>(5) 关联交易的特别风险提示</p> <p>管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据私募资产管理产品资产管理合同的约定，在实际投资操作中可能会参与投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，投资前述机构管理的公开募集证券投资基金，集合计划投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划，与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项。尽管管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险，管理人也无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响投资者的利益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将本合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署本合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以本合同为依据进行上述关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，</p>
---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利，对于书面答复管理人不同意但未退出的投资者，管理人对该部分投资者在关联交易发生之日办理强制退出，事后单独进行信息披露和报告。</p> <p>管理人有权调整上述内容并在调整后公告披露调整情况。若后续中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织对私募资产管理产品关联交易另有规定的，管理人届时将另行公告，并按届时有效的规定执行。投资者应当及时查阅上述公告信息。</p> <p>2、若管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划，管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>3、针对证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出本计划的情形，参见本合同第八条第(十三)款进行处理。</p> <p>(三) 管理人根据法律法规、监管规定、本合同约定履行关联交易的信息披露义务。</p>	<p>并按法律法规、监管规定履行报告义务。对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利，对于书面答复管理人不同意但未退出的投资者，管理人对该部分投资者在关联交易发生之日办理强制退出，事后单独进行信息披露和报告。</p> <p>管理人有权调整上述内容并在调整后公告披露调整情况。若后续中国证监会、中国证券投资基金业协会等相关监管部门或自律组织对私募资产管理产品关联交易另有规定的，公司届时将另行公告，并按届时有效的规定执行。投资者应当及时查阅上述公告信息。</p> <p>2、若管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与管理人设立的资产管理计划，管理人应当向投资者进行披露，对该计划账户进行监控，并向中国证监会相关派出机构报告。</p> <p>3、针对证券期货经营机构及其子公司自有资金参与和退出本计划的情形，参见本合同第八条第(十二)款进行处理。</p> <p>(三) 管理人根据法律法规、监管规定、本合同约定履行关联交易的信息披露义务。</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>本集合计划全部投资于证监会规定的标准化资产，具体包括：在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所发行、交易的国债、地</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>本集合计划全部投资于证监会规定的标准化资产，具体包括：在证券交易所、银行间市场等国务院同意设立的交易场所发行、交易的国债、地</p>

	<p>方政府债、中央银行票据、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，以及债券型基金、货币市场基金、银行存款（包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款）、同业存单、现金。</p> <p>2、投资比例</p> <p>固定收益类资产：占计划资产总值的 <b>80-100%</b>；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、债券逆回购、债券型基金、现金、银行存款（包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款）、同业存单、货币市场基金。本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 <b>25%</b>，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。</p> <p>3、投资限制</p> <p>（1）债券回购：债券正回购资金余额或逆回购资金余额不超过其上一日资产净值的 <b>100%</b>。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>（2）本集合计划总资产不得超过净资产的 <b>200%</b>。</p>	<p>方政府债、中央银行票据、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，以及债券型基金、货币市场基金、银行存款（包括银行定期存款、活期存款、协议存款、同业存款）、同业存单、现金、国债期货。</p> <p>2、投资比例</p> <p>（1）本资产管理计划投资固定收益类资产合计市值占计划资产总值的比例为 <b>80-100%</b>。</p> <p>（2）本资产管理计划投资期货和衍生品的持仓合约价值占集合计划资产总值的比例为 <b>0-80%</b>，或期货和衍生品账户权益占集合计划资产总值的 <b>0-20%</b>。</p> <p>3、投资限制</p> <p>（1）债券回购：债券正回购融入资金余额不超过上一日计划资产净值的 <b>80%</b>，债券逆回购不得超过上一日计划资产净值的 <b>100%</b>。中国证监会另有规定的除外。</p> <p>（2）本集合计划总资产不得超过净资产的 <b>180%</b>。</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>新增（序号顺延）：7、国债期货以估值当日结算价进行估值，估值当日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。</p>
<p>十九、资产管理计划的估值</p>	<p>（五）估值程序</p> <p>集合计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数</p>	<p>（五）估值程序</p> <p>集合计划单位净值的计算精确到 0.0001 元，小数</p>

和会计核算	点后第五位四舍五入。	点后第五位四舍五入。因集合计划发生巨额赎回等情形的，管理人与托管人协商一致后有权提高集合计划单位净值精度并由管理人公告告知投资者。
二十二、信息披露与报告	<p>(一) 定期报告</p> <p>2、集合计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人在每季度向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告。上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制、披露当期的季度报告。</p> <p>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人在每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告和托管年度报告。上述报告应于每年度结束之日起四个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人和托管人可以不编制、披露当期的年度报告。</p> <p>4、年度审计报告</p> <p>管理人应当聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向投资者提供。</p>	<p>(一) 定期报告</p> <p>2、集合计划的资产管理季度报告</p> <p>管理人在每季度向投资者提供一次准确、完整的管理季度报告。上述报告应于每季度结束之日起一个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制、披露当期的季度报告。本集合计划投资国债期货的，管理人应当在资产管理季度报告中充分披露集合资产管理计划参与国债期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。</p> <p>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人在每年度向投资者提供一次准确、完整的管理年度报告和托管年度报告。上述报告应于每年度结束之日起四个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人和托管人可以不编制、披露当期的年度报告。本集合计划投资国债期货的，管理人应当在资产管理年度报告中充分披露集合资产管理计划参与国债期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资国债期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的。</p> <p>4、年度审计报告</p>

		<p>管理人应当聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，审计机构应当对资产管理计划会计核算及净值计算等出具意见，并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给管理人，通过管理人网站向投资者提供。</p>
<p>二十三、风险揭示</p>		<p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>新增(序号顺延)：</p> <p>6、期货投资风险</p> <p>(1) 流动性风险</p> <p>本计划在期货市场成交不活跃时，可能在建仓和平仓期货时面临交易价格或者交易数量上的风险。</p> <p>(2) 基差风险</p> <p>基差是指现货价格与期货价格之间的差额。若产品运作中出现基差波动不确定性加大、基差向不利方向变动等情况，则可能对本计划投资产生影响。</p> <p>(3) 合约展期风险</p> <p>本计划所投资的期货合约主要包括期货当月和近月合约。当计划所持有的合约临近交割期限，即需要向较远月份的合约进行展期，展期过程中可能发生价差损失以及交易成本损失，将对投资收益产生影响。</p> <p>(4) 期货保证金不足风险</p> <p>由于期货价格朝不利方向变动，导致期货账户的资金低于金融期货交易所或者期货经纪商的最低保证金要求，如果不能及时补充保证金，期货头寸将被强行平仓，导致无法规避对冲系统性风险，</p>



		<p>直接影响本计划收益水平，从而产生风险。</p> <p>(5) 衍生品杠杆风险</p> <p>期货作为金融衍生品，其投资收益与风险具有杠杆效应。若行情向不利方向剧烈变动，计划可能承受超出保证金甚至计划资产本金的损失。</p> <p>(6) 跟踪误差风险</p> <p>由于管理人构建的组合通常并不能和指数构成相吻合，从而形成一定的跟踪误差。这将给整个计划的套期保值策略造成一定的风险敞口。</p>
<p>二十三、风险揭示</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>9、其他风险</p> <p>1) 关联交易的风险</p> <p>管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据私募资产管理产品资产管理合同的约定，在实际投资操作中可能会参与投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，投资前述机构管理的资产管理产品（含公开募集证券投资基金），与前述机构作为对手方进行交易买卖，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项。尽管管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险，管理人也无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响投资者的利益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了解相关的投资信息。全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将</p>	<p>(二) 一般风险揭示</p> <p>9、其他风险</p> <p>1) 关联交易的风险</p> <p>管理人遵循投资者利益优先和审慎原则，根据私募资产管理产品资产管理合同的约定，在实际投资操作中可能会参与投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，投资前述机构管理的公开募集证券投资基金，集合计划投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理计划，与关联方开展证券等交易，交易对手方、质押券涉及关联方，或从事法律法规和中国证监会规定为关联交易的其他事项。尽管管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、防范利益输送，但该等交易仍构成关联交易，存在利益冲突风险，管理人也无法确保选择进行交易的实际交易结果（就投资结束后的实际损益情况而言）比进行类似的非关联交易的实际交易结果更优，进而可能影响投资者的利益，投资者应密切关注关联交易的信息披露，知悉了</p>

	<p>本合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署本合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以本合同为依据进行上述关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利，对于书面答复管理人不同意但未退出的投资者，管理人对该部分投资者在关联交易发生之日办理强制退出，事后单独进行信息披露和报告。</p>	<p>解相关的投资信息。全体投资者不可撤销地同意并授权管理人可以将本合同项下的集合计划的资产从事除重大关联交易以外的其他关联交易，投资者签署本合同视为对本集合计划运作期间所有可能发生的除重大关联交易以外的其他关联交易投资的同意答复，管理人以本合同为依据进行上述关联交易。交易完成后，管理人应定期通过管理人指定网站公告等方式告知投资者和托管人，并按法律法规、监管规定履行报告义务。对于开展重大关联交易，管理人应当事前采取逐笔征求投资者意见或公告确认等方式取得投资者同意，保障不同意的投资者的退出权利，对于书面答复管理人不同意但未退出的投资者，管理人对该部分投资者在关联交易发生之日办理强制退出，事后单独进行信息披露和报告。</p>
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

同时修改《财通证券资管双周赢6号集合资产管理计划说明书》、《财通证券资管双周赢6号集合资产管理计划风险揭示书》对应条款。

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，可在公告日起至合同变更生效日内的开放期（2024年6月11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2024年6月6日发布了《财通证券资管双周赢6号集合资产管理计划合同变更公告》，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，自本次合同变更生效之日起，合同变更公告内容即成为合同组成部分。请委托人仔细阅读原财通证券资管双周赢6号集合资产管理计划合同以及变更公告，知晓相关变更内容。

咨询电话：400-116-7888。

特此公告。

财通证券资产管理有限公司

2024年6月6日

