

关于方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划 合同变更的公告

尊敬的委托人：

由我司担任管理人的“方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划”（以下简称“本集合计划”）已于2020年1月17日成立。经与托管人协商一致，管理人拟对《方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“原资管合同”）进行变更，现将变更事宜进行公告，并向委托人征询意见。

一、合同变更主要内容

本次变更主要调整投资范围、投资比例、投资限制，同时根据投资范围的变更调整估值时间并相应调整投资者参与/退出确认时间等内容，具体为：

1、投资范围

删除投资范围中的LOF基金。

2、投资比例

原资管合同：本计划的总资产（按照穿透原则合并计算所投资公募证券投资基金的总资产）不得超过净资产的140%。

变更为：本计划的总资产（按照穿透原则合并计算所投资公募证券投资基金的总资产）不得超过净资产的200%。

3、投资限制

增加“本集合计划不得投资于LOF。”

4、估值时间

由“T+2日终完成对估值结果的最终核对”变更为“当日日终完成对估值结果的最终核对”。

5、参与、退出确认时间

原资管合同：投资者可于T+4日后在办理参与的网点查询参与（退出）确认情况。

变更为：投资者可于T+2日后在办理参与的网点查询参与（退出）确认情况。

6、其他具体变更内容详见“附件2《方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划合同》变更条款对照表”。

《方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划说明书》和《方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划风险揭示书》相关内容按照资管合同同步变更，具体变更条款参见资管

合同相应部分，不再单独列示。

二、委托人征询意见及委托人回复意见安排

根据原资管合同第二十四条的规定，管理人已将合同变更事项与托管人协商并书面达成一致，特于2025年7月14日在管理人网站进行公告及征询委托人意见并将2025年7月18日设置为临时开放期保障投资者退出的权利。

委托人同意合同变更的，可在本公告征询意见发出后的5个工作日内（即2025年7月14日-2025年7月18日，含）提交同意变更的书面回复。

委托人不同意变更的，应在本公告征询意见发出后的5个工作日内（即2025年7月14日-2025年7月18日，含）提交不同意变更的回复或在合同变更临时开放期（即2025年7月18日）内提出退出本集合计划的申请；

委托人未在前述时间回复意见或继续持有本集合计划的，视为委托人同意本次合同变更。

委托人不同意变更的，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划本集合计划的委托人，管理人将统一在合同变更生效日次一工作日做强制退出处理。退出价格均以退出当日的计划单位净值计算，业绩报酬（如有）将从委托人退出资金中扣除。

管理人将根据委托人异议情况宣布本次合同变更是否生效，具体生效时间以管理人公告为准。

委托人填写附件1《关于方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划合同变更的回复意见》或其他形式的意见，可以采用以下任一方式回复我司：

(1) 电子邮件: xiaoxuan@foundersc.com

(2) 传真: 010-56992708

(3) 邮寄: 北京市朝阳区朝阳门南大街10号兆泰国际中心A座18层方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司（邮编: 100020, 联系电话: 010-56992720）。

委托人如有疑问，可致电咨询，电话: 95571/010-56992720。

特此公告！

附件：

- 1、《关于方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划合同变更的回复意见》
- 2、《方正证券全天候FOF2号集合资产管理计划合同》变更条款对照表



附件1

关于方正证券全天候 FOF2 号集合资产管理计划合同变更的回复意见

委托人姓名（或机构名称）：_____

委托人身份证号码（或统一社会信用代码）：_____

委托人持有份额的产品名称：方正证券全天候 FOF2 号集合资产管理计划_____

关于方正证券官方网站公布的《方正证券全天候 FOF2 号集合资产管理计划合同变更的公告》所述合同变更事项，本委托人在充分阅读前述变更内容的基础上，回复意见如下（请划勾“√”确认）：

☐ 同意

☐ 不同意并申请退出

委托人（签字或盖章）：

法定代表人或授权代表签章：

年 月 日

附件 2：《方正证券全天候 FOF2 号集合资产管理计划合同》变更条款对照表

原合同	变更后
鉴于：方正证券全天候 FOF2 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）已于 2020 年 1 月 17 日成立，本集合计划成立后，管理人根据《方正证券全天候 FOF2 号集合资产管理计划资产管理合同》的约定于 2020 年 2 月、2020 年 12 月、2024 年 1 月完成了合同变更。2024 年 8 月，管理人对本集合计划合同进行变更，变更内容及变更生效日以管理人发布的公告为准。自本合同成立并变更生效之日起按本合同执行，所有先前版本的合同或补充协议自动终止。	鉴于：方正证券全天候 FOF2 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）已于 2020 年 1 月 17 日成立，本集合计划成立后，管理人根据《方正证券全天候 FOF2 号集合资产管理计划资产管理合同》的约定于 2020 年 2 月、2020 年 12 月、2024 年 1 月、 2024 年 8 月 完成了合同变更。 2025 年【】 月，管理人对本集合计划合同进行变更，变更内容及变更生效日以管理人发布的公告为准。自本合同成立并变更生效之日起按本合同执行，所有先前版本的合同或补充协议自动终止。
五、资产管理计划的基本情况	五、资产管理计划的基本情况
（五）投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级 1、投资目标 本计划以公募证券投资基金为主要投资对象，在控制风险的前提下，力求客户收益最大化，通过多品种投资，保障产品净值稳健增长。	（五）投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级 1、投资目标 本计划以 证券交易所 交易的公募证券投资基金为主要投资对象，在控制风险的前提下，力求客户收益最大化，通过多品种投资，保障产品净值稳健增长。
2、主要投资方向及投资比例 （1）投资范围 本计划主要投资于银行存款（包括活期存款、定期存款、协议存款）、债券逆回购、交易所交易的公开募集证券投资基金（包含 QDII 基金、各类 ETF 及 LOF 基金，以下简称“公募证券投资基金”）	2、主要投资方向及投资比例 （1）投资范围 本计划主要投资于银行存款（包括活期存款、定期存款、协议存款）、债券逆回购、 证券交易所 交易的公开募集证券投资基金（包含 QDII 基金、 各类 ETF 基金等 ，以下简称“公募证券投资基金”）
（2）投资比例 ②本计划的总资产（按照穿透原则合并计算所投资公募证券投资基金的总资产）不得超过净资产的 140%；	（2）投资比例 ②本计划的总资产（按照穿透原则合并计算所投资公募证券投资基金的总资产）不得超过净资产的 200% ；
八、资产管理计划的参与、退出与转让	八、资产管理计划的参与、退出与转让
（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认 5、参与和退出的程序及确认 （1）参与的程序及确认 ⑤投资者于 T 日提交参与申请后，管理人按照“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对参与总规模实行限量控制。投资者可于 T+4 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。	（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认 5、参与和退出的程序及确认 （1）参与的程序及确认 ⑤投资者于 T 日提交参与申请后，管理人按照“时间优先，时间相同情况下金额优先”方法对参与总规模实行限量控制。投资者可于 T+2 日后在办理参与的网点查询参与确认情况。

(2) 退出的程序及确认 ②退出申请的确认和款项划付 委托人可在 T+4 日(包括该日)之后到销售机构取得 T 日退出申请成交确认单。	(2) 退出的程序及确认 ②退出申请的确认和款项划付 委托人可在 T+2 日(包括该日)之后到销售机构取得 T 日退出申请成交确认单。
十一、资产管理计划的投资	十一、资产管理计划的投资
(二) 投资范围及比例 1、投资范围 本计划主要投资于银行存款(包括活期存款、定期存款、协议存款)、债券逆回购、交易所交易的公开募集证券投资基金(包含 QDII 基金、各类 ETF 及 LOF 基金,以下简称“公募证券投资基金”)。	(二) 投资范围及比例 1、投资范围 本计划主要投资于银行存款(包括活期存款、定期存款、协议存款)、债券逆回购、证券交易所交易的公开募集证券投资基金(包含 QDII 基金、各类 ETF 基金等,以下简称“公募证券投资基金”)。
2、投资比例 ②本计划的总资产(按照穿透原则合并计算所投资公募证券投资基金的总资产)不得超过净资产的 140%;	2、投资比例 ②本计划的总资产(按照穿透原则合并计算所投资公募证券投资基金的总资产)不得超过净资产的 200%;
(六) 投资策略 3、投资管理的方法和标准 (1) 整体投资策略 本计划以公募证券投资基金为主要投资对象,基于大类资产轮动相关理论,确定本计划在各类公募证券投资基金上的分布,并通过投资于在交易所交易的 QDII 基金捕捉海外市场投资机会,在控制风险的前提下,力求客户收益最大化,通过多品种投资,保障产品净值稳健增长。	(六) 投资策略 3、投资管理的方法和标准 (1) 整体投资策略 本计划以证券交易所交易的公募证券投资基金为主要投资对象,基于大类资产轮动相关理论,确定本计划在各类公募证券投资基金上的分布,并通过投资于在交易所交易的 QDII 基金捕捉海外市场投资机会,在控制风险的前提下,力求客户收益最大化,通过多品种投资,保障产品净值稳健增长。
(2) 主要投资策略 本计划采取定量与定性相结合的分析方法综合筛选投资风格鲜明、投资业绩卓越的证券投资基金。	(2) 主要投资策略 本计划采取定量与定性相结合的分析方法综合筛选投资风格鲜明、投资业绩优秀的公募证券投资基金。
4、本集合计划所投资公募证券投资基金的选择标准 本计划所投资的公募证券投资基金的评价和筛选由对资产管理产品管理人的定性分析和对其所管理及拟投资标的的定量分析相结合的方式完成。 对公募证券投资基金的定量分析主要考察公募基金的收益率、波动率、最大回撤等绩效指标,再进行定性调研分析。 根据上述分析结果,在筛选优质公募证券投资基金进行投资。	4、本集合计划所投资公募证券投资基金的选择标准 本计划所投资的公募证券投资基金的评价和筛选由对资产管理产品管理人的定性分析和对其所管理及拟投资标的的定量分析相结合的方式完成。 对公募证券投资基金的定量分析主要考察基金的收益率、波动率、最大回撤等绩效指标,再进行定性调研分析。 根据上述分析结果,在筛选优质公募证券投资基金进行投资。
(七) 投资限制	(七) 投资限制 增加: 3、本集合计划不得投资于 LOF;
十五、投资经理的指定与变更	十五、投资经理的指定与变更

1、投资经理的指定 资产管理计划投资经理由管理人负责指定。本集合计划的投资经理为陈潇先生、刘海川先生，简介如下： 陈潇，男，中国科学技术大学博士；曾任北京聚宽投资管理有限公司研究员、投资经理。2023年4月起任方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司量化研究员，现任投资经理。未在其他公司兼职。已取得基金从业资格，且已在基金业协会登记为私募资产管理业务投资经理，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。 刘海川，男，辽宁大学经济学硕士，曾任中天证券权益投资小组负责人、民族证券权益投资部高级投资经理、民族证券资管部权益投资总监；2016年至今，任方正证券股份有限公司北京证券资管分公司投资经理。具有成熟的投资理念和丰富的证券市场投资经验。未在其他公司兼职。已取得基金从业资格，且已在基金业协会登记为私募资产管理业务投资经理，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。	1、投资经理的指定 资产管理计划投资经理由管理人负责指定。本集合计划的投资经理为陈潇先生、李理先生，简介如下： 陈潇，男，中国科学技术大学博士，曾在北京聚宽投资管理有限公司等机构任职。现已取得基金从业资格，未在其他公司兼职，已在基金业协会登记为私募资产管理业务投资经理，具备投资管理相关经验，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。 李理，男，北京大学金融学硕士、清华大学经济学博士，曾在中国工商银行、广州证券、中信证券等机构任职。现已取得基金从业资格，未在其他公司兼职，已在基金业协会登记为私募资产管理业务投资经理，具备投资管理相关经验，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。
十八、越权交易的界定	十八、越权交易的界定
(三)集合计划托管人对管理人越权交易的监督 1、除本合同特别规定外，集合计划托管人对管理人的越权交易行使监督权，仅对下述投资事宜进行监督： (1) 托管人对以下投资范围进行监督： 本计划主要投资于银行存款（包括活期存款、定期存款、协议存款）、债券逆回购、交易所交易的公开募集证券投资基金（包含QDII基金、各类ETF及LOF基金，以下简称“公募证券投资基金”）。	(三)集合计划托管人对管理人越权交易的监督 1、除本合同特别规定外，集合计划托管人对管理人的越权交易行使监督权，仅对下述投资事宜进行监督： (1) 托管人对以下投资范围进行监督： 本计划主要投资于银行存款（包括活期存款、定期存款、协议存款）、债券逆回购、证券交易所交易的公开募集证券投资基金（包含QDII基金、各类ETF基金等，以下简称“公募证券投资基金”）。
十九、资产管理计划的估值和会计核算	十九、资产管理计划的估值和会计核算
(一) 集合计划的估值 8、估值方法 (1) 证券投资基金估值方法 1) 非上市基金估值 ①本计划投资的境内非货币市场基金，按所投资基金估值日的基金份额净值估值。 ②本计划投资的境内货币市场基金，按所投资基金前一估值日至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。 2) 上市基金估值	(一) 集合计划的估值 8、估值方法 (1) 证券投资基金估值方法 ①本计划投资的ETF基金，按所投资基金估值日的收盘价估值。 ②本计划投资的境内上市开放式基金（LOF），按所投资基金估值日的基金份额净值估值。

①本计划投资的ETF基金,按所投资基金估值日的收盘价估值。 ②本计划投资的境内上市开放式基金(LOF),按所投资基金估值日的基金份额净值估值。 ③本计划投资的境内上市定期开放式基金、封闭式基金,按所投资基金估值日的收盘价估值。 ④本计划投资的境内上市交易型货币市场基金,如所投资基金披露份额净值,则按所投资基金估值日的份额净值估值;如所投资基金披露万份(百份)收益,则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益。 3)如遇所投资基金不公布基金份额净值、进行折算或拆分、估值日无交易等特殊情 况,基金管理人根据以下原则进行估值: ①以所投资基金的基金份额净值估值的,若所投资基金与本计划估值频率一致但未公布估值日基金份额净值,按其最近公布的基金份额净值为基础估值。 ②以所投资基金的收盘价估值的,若估值日无交易,且最近交易后市场环境发生重大变化,按最近交易日的收盘价估值;如最近交易日后市场环境发生了重大变化的,可使用最新的基金份额净值为基础或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。 ③如果所投资基金前一估值日至估值日期间发生分红除权、折算或拆分,基金管理人应根据基金份额净值或收盘价、单位及份额分红金额、折算拆分比例、持仓份额等因素合理确定公允价值。 ④当管理人认为所投资基金按上述第①至第③项进行估值存在不公允时,应与托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。	
9、估值程序 管理人应每个工作日对集合计划资产估值并与托管人于T+2日终完成对估值结果的最终核对,但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。	9、估值程序 管理人应每个工作日对集合计划资产估值并与托管人于当日终完成对估值结果的最终核对,但管理人根据法律法规或本合同的规定暂停估值时除外。
二十三、风险揭示	二十三、风险揭示
(八) 本集合计划特有风险 9、通过第三方销售机构购买基金的风险	(八) 本集合计划特有风险 9、通过第三方销售机构购买公募证券投资

	基金的风险
10、投资策略、投资理论失效风险 本产品基于大类资产轮动理论进行各类公募基金投资,试图通过公募基金在不同资产类别之间进行配置,降低风险。但实际投资管理过程中,需要投资经理对市场和经济形势有深入的了解和判断,由于经济运行的复杂性,任何单一理论均无法覆盖、判断现实经济,大类资产轮动理论与实际经济表现不一致将导致策略失效的风险,从而导致投资组合风险敞口进一步扩大投资者收益受损的风险。同时它并不能完全消除市场波动对投资组合的影响,在极端市场条件下,所有资产类别都可能同时遭受损失,导致投资组合的整体价值下降。	10、投资策略、投资理论失效风险 本产品基于大类资产轮动理论进行各类ETF投资,试图通过ETF在不同资产类别之间进行配置,降低风险。但实际投资管理过程中,需要投资经理对市场和经济形势有深入的了解和判断,由于经济运行的复杂性,任何单一理论均无法覆盖、判断现实经济,大类资产轮动理论与实际经济表现不一致将导致策略失效的风险,从而导致投资组合风险敞口进一步扩大投资者收益受损的风险。同时它并不能完全消除市场波动对投资组合的影响,在极端市场条件下,所有资产类别都可能同时遭受损失,导致投资组合的整体价值下降。
(九) 特别提示 1、投资于公募证券投资基金的特定风险 (7) 投资于 QDII 基金的特定风险 1) 市场风险 <u>④如该 QDII 基金属于境内上市开放式基金(LOF)的,如遇 QDII 基金所投资的主要境外市场节假日不开放时,根据 LOF 基金按所投资基金估值日估值的原则,本计划开放日估值时采用的为最近一个交易日该 LOF 基金份额净值,届时可能无法真实反映所投 QDII 基金净值真实情况的风险,从而影响投资者收益;</u>	(九) 特别提示 1、投资于公募证券投资基金的特定风险 (7) 投资于 QDII 基金的特定风险 1) 市场风险 删除④
(8) LOF 基金估值的特别风险提示 <u>本计划可能通过交易所买卖 LOF 基金,但 LOF 基金采用收市后计算的基金份额净值进行估值。受到市场供需关系、投资者情绪、流动性水平等的影响,LOF 可能出现溢价(即交易价格高于其基金份额净值)或折价(即交易价格低于其基金份额净值),如本计划买入 LOF 时该 LOF 存在溢价,即买入价格高于用于估值的基金份额净值,将导致本产品净值下降,从而影响投资者利益。</u>	删除(8)
6、退出款项划付风险 委托人的退出申请确认后,退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出。由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则退出款顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后划往委托人账户。对于委托人而	6、退出款项划付风险 委托人的退出申请确认后,退出款项将在 T+5 日内从托管账户划出。由于交易所或交易市场数据传输延迟、通讯系统故障、银行数据交换系统故障或其它非管理人及托管人所能控制的因素影响业务处理流程,则退出款顺延至管理人及托管人无法控制的因素消除后划往委托人账户。对于委托人而

言，在开放期赎回计划资产可能面临至少 5 日收到退出款项的风险。	言，在开放期赎回计划资产可能面临至少 5 个工作日收到退出款项的风险。
---	--

三