

# 关于财通证券月月福集合资产管理计划 变更为财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资 基金及法律文件变更公告

尊敬的投资者：

根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》（证监会公告〔2018〕39号）等法律法规的规定及中国证券监督管理委员会《关于准予财通证券月月福集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2021〕2896号），我司作为财通证券月月福集合资产管理计划的管理人，经与托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，拟将财通证券月月福集合资产管理计划变更为财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金，并按照《财通证券月月福集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）、《财通证券月月福集合资产管理计划说明书》（以下简称“《说明书》”）有关约定履行法律文件变更程序。

财通证券月月福集合资产管理计划变更为财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金涉及法律文件全文变更，即由原财通证券月月福集合资产管理计划变更为财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金的法律文件，包括《财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）、《财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）等，上述法律文件已同步在我司官网网站披露，敬请投资者仔细阅读。本次财通证券月月福集合资产管理计划变更为财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金涉及的主要变更和具体流程说明如下：

## 一、主要变更

### （一）变更产品名称

产品名称由“财通证券月月福集合资产管理计划”变更为“财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金”。

## **（二）变更产品类型**

产品类型由“非限定性集合资产管理计划”变更为“契约型开放式债券型证券投资基金”。

## **（三）增加份额类别设置**

《财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》生效后，原财通证券月月福集合资产管理计划份额变更为财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金 B 类基金份额，不设置滚动持有期。基金管理人自基金合同生效后，B 类份额不开放申购，仅开放赎回业务，红利再投资份额除外。增设三类份额，分别为 A 类、C 类、E 类份额。

对每份 A 类、C 类、E 类份额设置 3 个月滚动持有期。

（1）在每个运作期到期日前，基金份额持有人不能提出赎回申请。

对于 A 类、C 类、E 类基金份额，第一个运作期指该类基金份额申购确认日起（即第一个运作期起始日），至该类基金份额申购申请日 3 个月后的月度对日（即第一个运作期到期日）。第二个运作期指该类基金份额第一个运作期到期日后的下一日（即第二个运作期起始日）起，至该类基金份额申购申请日 6 个月后的月度对日（即第二个运作期到期日），以此类推。

（2）每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。

每个运作期到期日，基金份额持有人可提出赎回申请。如果基金份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起该基金份额进入下一个运作期。

## **（四）调整申购相关条款**

《财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》生效后，本基金对申购金额的限制、申购费用等条款进行变更，具体情况如下：

（1）申购金额的限制

直销柜台每个账户首次申购的最低金额为 50,000 元，追加申购的最低金额为单笔 1 元；通过基金管理人网上直销交易平台办理基金申购业务的不受直销柜台单笔申购最低金额的限制，申购最低金额为单笔 1 元。本基金直销柜台单笔申购最低金额可由基金管理人酌情调整。其他各销售机构每个账户单笔申购的最低

金额为单笔 1 元，如果销售机构业务规则规定的最低单笔申购金额高于 1 元，以销售机构的规定为准。

(2) 申购费用

本基金对通过基金管理人直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

通过基金管理人直销柜台申购本基金 A 类基金份额的养老金客户适用下表特定申购费率，其他投资人申购本基金 A 类基金份额的适用下表一般申购费率：

申购金额 (M)	一般申购费率	特定申购费率
M<100 万元	0.40%	0.16%
100 万元≤M<500 万元	0.20%	0.08%
M≥500 万元	每笔 1000 元	每笔 1000 元

本基金 B 类、C 类、E 类基金份额不收取申购费。

(五) 调整投资相关条款

根据公募基金相关法律法规规定，调整原财通证券月月福集合资产管理计划的投资范围、投资比例、投资限制、投资策略。具体如下：

	财通证券月月福集合资产管理计划	财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金
投资目标	在控制和分散投资组合风险的前提下，实现组合资产长期稳定增值。	在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。
投资范围	本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、中小企业私募债、公司债（含非公开发行的公司债）、可分离债、可转换债券、可交换公司债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、非公开定向债务融资工具	本基金的投资范围为国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存

<p>等经银行间交易商协会批准发行的各类债务融资工具、债券回购、资产支持证券、货币市场型基金、债券型基金、分级基金的优先级份额、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、银行存款、同业存单、现金、因可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票及其派发的权证、因分离交易的可转换公司债券产生的权证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、不含可交换公司债券）、可分离债、中期票据的债项评级或发行人主体评级或担保人主体评级不低于 AA-，短期融资券（含超短期融资券）债项评级不低于 A-1 或发行人主体评级不低于 A+，中小企业私募债的债项评级或其担保人主体评级不低于 AA-，非公开定向债务融资工具的发行人主体评级不低于 AA-。资产支持证券和可转换债券（不含可交换公司债券）的债项评级或发行人主体评级或担保人主体评级不低于 AA。</p>	<p>款、通知存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金不参与一级市场新股申购或增发新股，也不直接从二级市场上买入股票，但可持有因可转换债券、可交换债券转股所形成的股票。因上述原因持有的股票，本基金应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p>
---	---

<p>投资比例</p>	<p>(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、中小企业私募债、公司债（含非公开发行的公司债）、可分离债、可转换债券、可交换公司债券、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据、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、分级基金优先级份额、保证收益及保本浮动收益商业银行理财计划、债券逆回购等。其中，投资于中小企业私募债的比例不高于集合计划资产总值的 40%；投资于非公开定向债务融资工具的比例不高于集合计划资产总值的 40%；投资于单只可交换债券的比例按面值计算不得超过集合计划资产净值的 5%；投资于所有可交换债券和可转换债券的比例按面值计算不得超过集合计划资产净值的 20%。</p> <p>(2) 现金类资产：占计划资产净值的 0-100%；包括现金、银行存款（包括但不限于银行定</p>	<p>本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p>
-------------	---	---

	<p>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、期限为7天内(含7天)的债券逆回购、期限在1年内(含1年)的国债、到期日在1年内(含1年)的央行票据、到期日在1年内(含1年)的政府债券等高流动性短期金融产品等。</p> <p>(3) 权益类资产: 仅包括因可转换债券转股或可交换债券换股形成的股票及其派发的权证、因分离交易的可转换公司债券产生的权证, 占资产净值的0-20%, 其中权证占资产总值的0-3%。不从二级市场买入股票和权证。</p> <p>投资于上述权益类资产应在其具备交易条件后的五个交易日内全部卖出。</p> <p>(4) 债券正回购: 融入资金余额不超过计划资产净值的40%。</p> <p>(5) 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, 经与托管人协商一致后执行。</p>	
<p>投资限制</p>	<p>为维护委托人的合法权益, 本集合计划的投资限制为:</p>	<p>(1) 本基金投资债券的比例不低于基金资产的80%;</p>

<p>1、将集合计划资产投资于一家公司发行的证券超过资产净值的 10%；因证券市场波动、投资对象合并、计划规模变动等管理人之外的因素致使投资不符合本规定的，管理人应在具备调整机会的十个工作日内进行调整，以符合上述规定。</p> <p>2、管理人将其所管理的客户资产投资于一家公司发行的证券，超过该证券发行总量的 10%；因证券市场波动、投资对象合并、计划规模变动等管理人之外的因素致使投资不符合本规定的，管理人应在具备调整机会的十个工作日内进行调整，以符合上述规定。</p> <p>3、集合计划参与证券回购融入资金余额超过集合计划资产净值的 40% ，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>4、集合计划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 40%；</p> <p>5、集合计划投资于所有可交换债券和可转换债券的比例按面值计算超过集合计划资产净值的 20%；</p> <p>6、集合计划投资于非公开定向</p>	<p>(2) 每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；</p> <p>(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；</p> <p>(5) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；</p> <p>(6) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；</p> <p>(7) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；</p> <p>(8) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；</p> <p>(9) 本基金应投资于信用评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支</p>
--	---

<p>债务融资工具的投资比例高于集合计划资产总值的 40%；</p> <p>7、集合计划投资于单只可交换债券的比例按面值计算超过集合计划资产净值的 5%；</p> <p>8、将集合计划资产用于二级市场股票投资；</p> <p>9、将集合计划资产投资于除债券型、货币型证券投资基金以及分级基金的优先级份额以外的证券投资基金。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定，则本集合计划不受上述限制。</p>	<p>持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；</p> <p>（10）本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年，债券回购到期后不得展期；</p> <p>（11）本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；</p> <p>（12）本基金参与国债期货投资后，应遵循下列限制：</p> <p>1) 基金在任何交易日日终，持有的买入国债期货合约价值，不得超过基金资产净值的 15%；</p> <p>2) 基金在任何交易日日终，持有的卖出国债期货合约价值不得超过基金持有的债券总市值的 30%；</p> <p>3) 基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%；基金所持有的债券（不含到期日在一年以内的政府债券）市值和买入、卖出国债期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于债券</p>
--	--



		<p>投资比例的有关约定；</p> <p>(13) 本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；</p> <p>(14) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合该比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(15) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；</p> <p>(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。</p> <p>除第 (2)、(9)、(14)、(15) 项外，因证券、期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等</p>
--	--	---

		<p>基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。</p>
<p>投 资 策 略</p>	<p>1、资产配置策略</p> <p>本集合计划主要资产投资于固定收益类金融工具，并在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，动态调整计划各类资产的投资比例，力争为计划资产获取稳健回报。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>（1）利率预期策略</p> <p>管理人通过对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，主动地调整债券投资组合的久期，提高债券投资组合的收益水平。</p> <p>（2）收益率曲线策略</p> <p>管理人通过对债券市场微观因素的分析判断，形成对未来收</p>	<p>本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金将采用自上而下的方法，在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上，对市场基本利率和债券、货币市场工具等投资品种收益率水平变化进行评估，并结合波动性以及流动性状况分析，针对不同行业、不同投资品种选择投资策略，以此做出最佳的资产配置及风险控制。</p> <p>2、固定收益类投资策略</p> <p>（1）普通债券投资策略</p> <p>1) 久期控制：根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，</p>

<p>益率曲线形状变化的预期，获取收益率曲线形变带来的投资收益。</p> <p>(3) 信用策略</p> <p>信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债个券的利差水平产生重要影响，因此，一方面，本计划将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势；另一方面，采用内外结合的信用研究和评级制度，研究债券发行主体企业的基本面，以确定企业主体债的实际信用状况。</p> <p>(4) 个券优选策略</p> <p>管理人根据债券市场收益率数据，对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。</p> <p>(5) 中小企业私募债券投资策略</p> <p>中小企业私募债具有高信用风险、低流动性以及高收益率的</p>	<p>有效的控制整体资产风险。</p> <p>2) 期限结构配置：在确定组合久期后，基金管理人将针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，通过采用子弹策略、杠铃策略、梯子策略等，对组合的期限结构进行动态调整，以提高投资组合的总投资收益。</p> <p>3) 市场比较：不同债券子市场的运行规律不同，本基金在充分研究不同债券子市场风险—收益特征、流动性特性的基础上构建调整组合（包括跨市场套利操作），以提高投资收益。</p> <p>4) 相对价值判断：本基金将在相近的债券品种之间选取价值相对低估的债券品种进行投资。</p> <p>5) 信用风险评估：本基金将根据发债主体的经营状况与现金流等情况对其信用风险进行评定与估测，以此作为品种选择的基本依据。</p> <p>(2) 可转换债券投资策略</p> <p>可转换债券兼具股票资产与债券资产的特点，具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本基金着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究，重点关注盈利能力或成长前景较好的上市</p>
--	---

<p>特点，因此本集合计划将全面分析中小企业私募债券的期望收益率、流动性、利率风险、信用风险及操作风险，评定相对风险收益比，选择最具吸引力标的进行配置。</p> <p>在风险控制方面，本集合计划将通过以下措施保障投资安全：1) 建立专门的信用违约评级模型，仔细甄别发行人资质，建立风险预警机制；2) 严格控制私募债的投资比例上限，并在允许的投资比例内针对发行人不同资质情况细化投资比例；3) 对拟投资或已投资的品种进行流动性分析和监测，选择流动性相对较好的品种进行投资；4) 适当控制所在投资组合的久期，保证账户总体的流动性。</p> <p>3、新券申购策略</p> <p>对于新发行的证券品种，管理人将凭借丰富的资产管理经验以及新券定价能力，可在询价与配售过程中把握主动、发挥优势，追求可控风险之下的收益最大化。</p> <p>4、基金投资策略</p> <p>本计划坚持从研究基金价值入</p>	<p>公司的转债，确定不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值，同时考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征，选择合适的投资品种，分享正股上涨带来的收益。</p> <p>(3) 可交换债券投资策略</p> <p>本基金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。</p> <p>(4) 息差策略</p> <p>息差策略是指通过正回购融资并买入债券的操作，获取债券全价变动和融资成本之间的利差收益。只要回购资金成本低于债券收益率，就可以达到进一步提升组合收益的目标。</p> <p>本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大债券资产投资比例，适当追求债券资产的超额收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p>
--	--

	<p>手，采用定性分析与定量分析相结合的方法，选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金构建备选基金池，对基金的投资理念和投资价值进行判断。</p>	<p>本基金资产支持证券的投资将采用自下而上的方法，结合信用管理和流动性管理，重点考察资产支持证券的资产池现金流变化、信用风险情况、市场流动性等，采用量化方法对资产支持证券的价值进行评估，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。</p> <p>4、国债期货投资策略</p> <p>本基金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，获取超额收益。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>无</p>	<p>中债综合财富（1年以下）指数收益率×60%+中债综合财富（1-3年）指数收益率×20%+一年期定期存款利率（税后）×20%</p>

#### （六）调整合同终止条款

<p>财通证券月月福集合资产管理计划</p>	<p>财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金</p>
<p>（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止： 1、计划存续期间委托人少于2人；</p>	<p>有下列情形之一的，经履行相关程序后《基金合同》应当终止： 1、基金份额持有人大会决定终止的；</p>

<p>2、计划存续期满且不展期；</p> <p>3、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>4、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务资格，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；</p> <p>5、管理人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>6、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>7、因战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>8、法律、行政法规及中国证监会规定的其他终止情形；</p> <p>9、管理人认为必要时可以终止本计划。</p>	<p>2、基金管理人、基金托管人职责终止，在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；</p> <p>3、《基金合同》约定的其他情形；</p> <p>4、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。</p>
---	---

**(七) 调整估值方法**

<p><b>财通证券月月福集合资产管理计划</b></p>	<p><b>财通资管鸿越3个月滚动持有债券型证券投资基金</b></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，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且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，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</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，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且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的</p>

生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，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；

(2) 交易所上市实行净价交易的固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市实行全价交易的可转换债券、可交换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含的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，按最近交易日收盘价减去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；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值；

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或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件的，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；

(2) 交易所上市实行净价交易的固定收益品种按估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值，具体估值机构由基金管理人与基金托管人另行协商约定；

(3) 交易所上市实行全价交易的可转换债券、可交换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含的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，按最近交易日收盘价减去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；

(4) 对在交易所市场发行未上市或未挂牌转让的债券，对存在活跃市场的情况下，应以活跃市场上未经调整的报价作为估值日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表估值日公允价值的情况下，应对市场报价进行调

<p>(5) 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。交易所挂牌转让的资产支持证券，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>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券，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>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大</p>	<p>整以确认估值日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，则应采用估值技术确定其公允价值；</p> <p>(5) 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。交易所挂牌转让的资产支持证券，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>2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：</p> <p>(1) 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；</p> <p>(2) 首次公开发行未上市的股票、债券，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>3、对全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价估值。对银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值净价或推荐估值净价估值。对于含投资人回售权的固定收益品种，回售登记期截止日</p>
---	--



<p>的变动的情况下，按成本估值。</p> <p>4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>5、存款的估值方法 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。</p> <p>6、同业存单的估值方法 投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。</p> <p>7、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>	<p>（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。对银行间市场未上市，且第三方估值机构未提供估值价格的债券，在发行利率与二级市场利率不存在明显差异，未上市期间市场利率没有发生大的变动的情况下，按成本估值。</p> <p>4、同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值。</p> <p>5、国债期货合约，一般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>6、存款的估值方法 持有的银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。</p> <p>7、同业存单的估值方法 投资同业存单，按估值日第三方估值机构提供的估值净价估值；选定的第三方估值机构未提供估值价格的，按成本估值。</p> <p>8、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。</p>
---	---

	<p>9、当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。</p> <p>10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按法律法规以及监管部门最新规定估值。</p>
--	---

**(八) 调整信息披露条款**

财通证券月月福集合资产管理计划	财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型 证券投资基金
<p>(一) 定期报告</p> <p>定期报告包括集合计划的资产管理季度（年度）报告、托管季度（年度）报告、年度审计报告和对账单。</p> <p>1、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告</p> <p>管理人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的管理季度报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后一个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可不编制当期的季度报告。</p> <p>2、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、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的管理年度报告和托管年度报告，对报告期内集合</p>	<p>公开披露的基金信息包括：</p> <p>1、基金招募说明书、《基金合同》、基金托管协议、基金产品资料概要</p> <p>(1)《基金合同》是界定《基金合同》当事人的各项权利、义务关系，明确基金份额持有人大会召开的规则及具体程序，说明基金产品的特性等涉及基金投资者重大利益的事项的法律文件。</p> <p>(2)基金招募说明书应当最大限度地披露影响基金投资者决策的全部事项，说明基金申购和赎回安排、基金投资、基金产品特性、风险揭示、信息披露及基金份额持有人服务等内容。《基金合同》生效后，基金招募说明书的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金招募说明书并登载在规定网站上；基金招募说明书其他信息发生变更的，</p>

<p>计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后 4 个月内通过管理人网站通告。本集合计划成立不足 3 个月时，管理人可以不编制当期的年度报告。</p> <p>3、年度审计报告</p> <p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行年度审计，并由管理人在每年度结束之日起 4 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人应当每个季度以邮寄或电子邮件方式向委托人寄送对账单，委托人可以选择寄送方式，默认的寄送方式为电子邮件。对账单内容应包括委托人持有集合计划的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>上述管理报告和托管报告由管理人根据相关法律法规报监管机构或自律组织备案。</p> <p>（二）临时报告</p> <p>集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、推广机构网站或网点、或其他途径和方式及时向客户披露。</p>	<p>基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金招募说明书。</p> <p>（3）基金托管协议是界定基金托管人和基金管理人在基金财产保管及基金运作监督等活动中的权利、义务关系的法律文件。</p> <p>（4）基金产品资料概要是基金招募说明书的摘要文件，用于向投资者提供简明的基金概要信息。《基金合同》生效后，基金产品资料概要的信息发生重大变更的，基金管理人应当在三个工作日内，更新基金产品资料概要，并登载在规定网站及基金销售机构网站或营业网点；基金产品资料概要其他信息发生变更的，基金管理人至少每年更新一次。基金终止运作的，基金管理人不再更新基金产品资料概要。</p> <p>基金管理人应将基金招募说明书提示性公告和《基金合同》提示性公告登载在规定报刊上，将基金招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和基金托管协议登载在规定网站上，并将基金产品资料概要登载在基金销售机构网站或营业网点；基金托管人应当同时将《基金合同》、基金托管协议登载在网站上。</p> <p>2、《基金合同》生效公告</p>
---	---

<p>临时报告的情形包括但不限于：</p> <p>(1) 集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；</p> <p>(2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；</p> <p>(3) 发生巨额退出并延期支付；</p> <p>(4) 集合计划终止和清算；</p> <p>(5) 集合计划存续期满并展期；</p> <p>(6) 管理人以自有资金参与和退出；</p> <p>(7) 合同的补充、修改与变更；</p> <p>(8) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(9) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；</p> <p>(10) 集合计划投资于管理人及与管理人有关联方关系的公司发行的证券；</p> <p>(11) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</p> <p>(12) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；</p> <p>(13) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；</p> <p>(14) 其他管理人认为需披露的重大事项。</p> <p>(三) 澄清公告与说明</p>	<p>基金管理人应当在规定媒介上登载《基金合同》生效公告。</p> <p>3、基金净值信息</p> <p>《基金合同》生效后，在开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周在规定网站披露一次各类基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>基金管理人应当在不晚于半年度和年度最后一日的次日，在规定网站披露半年度和年度最后一日的各类基金份额净值和基金份额累计净值。</p> <p>4、基金份额申购、赎回价格</p> <p>基金管理人应当在《基金合同》、招募说明书等信息披露文件上载明基金份额申购、赎回价格的计算方式及有关申购、赎回费率，并保证投资者能够在基金销售机构网站或营业网点查阅或者复制前述信息资料。</p> <p>5、基金定期报告，包括基金年度报告、基金中期报告和基金季度报告</p> <p>基金管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成基金年度报告，将</p>
---	---

<p>在任何公共传播媒介中出现或者在市场上流传的消息可能对委托人的收益预期产生误导性影响或引起较大波动时，以及可能损害委托人权益的，相关的信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行澄清，并根据相关法律法规向监管机构或自律组织履行报告义务。</p>	<p>年度报告登载在规定网站上，并将年度报告提示性公告登载在规定报刊上。基金年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计。</p> <p>基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内，编制完成基金中期报告，将中期报告登载在规定网站上，并将中期报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>基金管理人应当在季度结束之日起 15 个工作日内，编制完成基金季度报告，将季度报告登载在规定网站上，并将季度报告提示性公告登载在规定报刊上。</p> <p>《基金合同》生效不足 2 个月的，基金管理人可以不编制当期季度报告、中期报告或者年度报告。</p> <p>如报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过基金总份额 20% 的情形，为保障其他投资者的权益，基金管理人至少应当在基金定期报告“影响投资者决策的其他重要信息”项下披露该投资者的类别、报告期末持有份额及占比、报告期内持有份额变化情况及本基金的特定风险，中国证监会认定的特殊情形除外。</p> <p>基金管理人应当在基金年度报告和中期报告中披露基金组合资产情况及其</p>
--	---

流动性风险分析等。

## 6、临时报告

本基金发生重大事件，有关信息披露义务人应当在 2 日内编制临时报告书，并登载在规定报刊和规定网站上。前款所称重大事件，是指可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的下列事件：

（1）基金份额持有人大会的召开及决定的事项；

（2）《基金合同》终止、基金清算；

（3）转换基金运作方式、基金合并；

（4）更换基金管理人、基金托管人、基金份额登记机构，基金改聘会计师事务所；

（5）基金管理人委托基金服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托基金服务机构代为办理基金的核算、估值、复核等事项；

（6）基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更；

（7）基金管理人变更持有百分之五以上股权的股东、基金管理人的实际控制人变更；

（8）基金管理人的高级管理人员、基金经理和基金托管人专门基金托管部门负责人发生变动；

（9）基金管理人的董事在最近 12 个

	<p>月内变更超过百分之五十，基金管理人、基金托管人专门基金托管部门的主要业务人员在最近 12 个月内变动超过百分之三十；</p> <p>(10) 涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁；</p> <p>(11) 基金管理人或其高级管理人员、基金经理因基金管理业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚，基金托管人或其专门基金托管部门负责人因基金托管业务相关行为受到重大行政处罚、刑事处罚；</p> <p>(12) 基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、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，或者从事其他重大关联交易事项，但中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(13) 基金收益分配事项；</p> <p>(14) 管理费、托管费、销售服务费、申购费、赎回费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；</p> <p>(15) 基金份额净值错误达基金份额净值百分之零点五；</p> <p>(16) 本基金开始办理申购、赎回；</p> <p>(17) 本基金发生巨额赎回并延期办理；</p> <p>(18) 本基金连续发生巨额赎回并暂</p>
--	--

停接受赎回申请或延缓支付赎回款项；

（19）本基金暂停接受申购、赎回申请或重新接受申购、赎回申请；

（20）发生涉及基金申购、赎回事项调整或潜在影响投资者赎回等重大事项时；

（21）基金管理人采用摆动定价机制进行估值；

（22）调整本基金的份额类别设置；

（23）本基金连续 30 个工作日、40 个工作日及 45 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的；

（24）基金信息披露义务人认为可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的其他事项或中国证监会规定的其他事项。

#### 7、澄清公告

在《基金合同》存续期限内，任何公共媒介中出现的或者在市场上流传的消息可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动，以及可能损害基金份额持有人权益的，相关信息披露义务人知悉后应当立即对该消息进行公开澄清。

#### 8、基金份额持有人大会决议

基金份额持有人大会决定的事项，应当依法报中国证监会备案，并予以公



告。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会时，基金管理人、基金托管人对基金份额持有人大会决定的事项不依法履行信息披露义务的，召集人应当履行相关信息披露义务。

#### 9、清算报告

基金合同终止的，基金管理人应当依法组织基金财产清算小组对基金财产进行清算并作出清算报告。基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

10、本基金投资国债期货，基金管理人应在季度报告、中期报告、年度报告等定期报告和招募说明书（更新）等文件中披露国债期货交易情况，包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等，并充分揭示国债期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标等。

11、本基金投资资产支持证券，基金管理人应在基金年度报告及中期报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资产的比例和报告期内所有的资产支持证券明细。基金管理人应在基金季度报告中披露本基金持有的资产支持证券总额、资产支持证券市值占基金净资

	<p>产的比例和报告期末按市值占基金净资产比例大小排序的前 10 名资产支持证券明细。</p> <p>12、实施侧袋机制期间的信息披露 本基金实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、基金合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见本招募说明书“侧袋机制”章节的规定。</p> <p>13、中国证监会规定的其他信息。</p>
--	---

### （九）增加基金份额持有人大会

根据《基金法》和《运作办法》的规定，在《财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金基金合同》中设置基金份额持有人大会机制，约定须召开基金份额持有人大会的事项，并明确持有人大会会议召集人、召集方式；召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式；基金份额持有人出席会议的方式；议事内容与程序；表决、计票规则、生效与公告以及实施侧袋机制期间基金份额持有人大会的额特殊约定等。

## 二、相关流程安排

根据《财通证券月月福集合资产管理计划集合资产管理合同》的约定，我司于 2021 年 11 月 5 日在公司官网公告《关于财通证券月月福集合资产管理计划变更为财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金及法律文件变更公告》。委托人对更新或修改的内容有异议的，可在合同变更公告日至合同变更生效日期期间的 10 个工作日内（即 2021 年 11 月 8 日至 2021 年 11 月 19 日）提出退出财通证券月月福集合资产管理计划的申请，投资者申请退出财通证券月月福集合资产管理计划应当于推广机构指定的推广营业网点进行办理。投资者未在前述时间内提出退出财通证券月月福集合资产管理计划申请的，视为投资者同意财通证券月月福集合资产管理计划变更为财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金及相关法律文件的变更，按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定享有权

利、承担义务。

本次变更将于变更公告发布之日起 10 个工作日后（即 2021 年 11 月 22 日）起生效，《基金合同》同日生效，原《财通证券月月福集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

投资者自变更公告发布之日起（含）至《基金合同》生效日前（不含）退出财通证券月月福集合资产管理计划的不收取退出费。

### 三、重要提示

1、变更后的《基金合同》、《托管协议》及《招募说明书》于本公告披露的同日于我司官网网站（[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)）上披露，敬请投资者仔细阅读前述信息披露文件。

2、原财通证券月月福集合资产管理计划份额在《基金合同》生效后变更为财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金 B 类基金份额，B 类基金份额仅开放日常赎回业务（红利再投资除外）。基金管理人将在《基金合同》生效后开始办理财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金 A 类、C 类、E 类基金份额的申购业务，具体业务办理时间和办理规则另行公告。

3、如您需更详细了解财通证券月月福集合资产管理计划变更为财通资管鸿越 3 个月滚动持有债券型证券投资基金相关事宜，请登录我公司网站 [www.ctzg.com](http://www.ctzg.com) 或致电 95336 查询。

感谢您一直以来给予的关注和支持。

财通证券资产管理有限公司

2021 年 11 月 5 日