
财富证券财富 606 号集合资产管理计划

合同变更征询及生效公告

财富证券财富 606 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）成立于 2019 年 12 月 25 日，经管理人与托管人协商一致，现拟对《财富证券财富 606 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的相关条款进行变更，相关条款的具体修改详见附件 1，本次合同变更未改变本集合计划的风险等级。

一、合同变更的程序

根据《资产管理合同》第二十四章“资产管理合同的变更、终止与财产清算”的有关约定，我司已就本次合同变更事宜与托管人中国建设银行股份有限公司湖南省分行达成一致。同时，管理人按照《资产管理合同》约定，对不同意变更的投资者，管理人保障其退出集合计划的权利。投资者可于征询意见期，即 2022 年 12 月 22 日至 2022 年 12 月 26 日的交易时间内对本次合同变更做出如下选择：

2、由于其他原因需要变更合同的，管理人和托管人应书面达成一致并在管理人网站公告。管理人须在公告后 5 个工作日内以管理人指定网站公告或邮寄等方式向投资者发送合同变更征询意见函。投资者需于征询意见函规定的期间内回复同意或不同意的意见，管理人对其采取如下权利保障措施及后续安排：

①投资者不同意变更的，应在开放日（即 2022 年 12 月 26 日）的交易时间内提出不同意的意见或退出本集合计划。

②投资者未在征询意见期内回复意见也未在开放日内退出集合计划的，视为投资者同意合同变更。

③对于明确答复不同意合同变更但在开放日内仍未退出本集合计划的投资者，管理人将有权在征询意见期届满后将相关份额做强制退出处理（退出金额以实际退出日前一工作日集合单位净值为基础进行计算），由此产生的相关费用及或有损失由投资者自行承担。

投资者同意,无论其是否提出退出申请,管理人经与托管人书面达成一致后根据本合同规定变更本合同的行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

二、合同变更的生效

本次合同变更的内容将于征询意见期限届满的次一工作日(即 2022 年 12 月 27 日)生效,投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同行使相关权利,履行相应义务。

如有疑问,请您致电咨询本公司资产管理业务客户服务电话 0731-84403481。

附件 1: 《资产管理合同》变更条款对照表

附件 2: 《征询意见函》样本

财信证券股份有限公司

2022 年 12 月 16 日

附件 1：《资产管理合同》变更条款对照表

（本附件仅列举关键变更条款，详情请参考《财富证券财富 606 号集合资产管理计划资产管理合同》、《财富证券财富 606 号集合资产管理计划资产管理合同补充协议》、《财富证券财富 606 号集合资产管理计划说明书》、《财富证券财富 606 号集合资产管理计划风险揭示书》。

| 《财富证券财富 606 号集合资产管理计划资产管理合同》 | |
|---|--|
| 变更前 | 变更后 |
| <p>二、释义</p> | <p>二、释义 新增： 《个人信息保护法》：指 2021 年 8 月 20 日经第十三届全国人民代表大会常务委员会第三十次会议通过的《中华人民共和国个人信息保护法》及颁布机关对其不时做出的修订。</p> |
| <p>三、承诺与声明 （一）管理人承诺</p> | <p>三、承诺与声明 （一）管理人承诺 新增： 4、管理人尊重并保护投资者隐私，在投资者购买本资管计划时，管理人将按照《财信证券股份有限公司个人信息处理规则》（以下简称“《个人信息处理规则》”，详见 https://stock.hnchasing.com）收集、使用、共享、转让、公开披露、存储、保护客户信息。请投资者在使用管理人的服务前仔细阅读相关条款，并确认已经充分理解条款全部内容。管理人承诺对投资者的信息进行严格保密，如确需公开披露时，除法律、法律程序、诉讼或政府主管部门强制性要求的情况下，管理人会征得投资者同意。</p> |
| <p>三、承诺与声明 （三）投资者声明</p> | <p>三、承诺与声明 （三）投资者声明 5、投资者同意管理人根据《中华人民共和国个人信息保护法》的要求提供和处理个人信息，并同意管理人基于为投资者提供产品或服务、本产品成立、备案、投资运作需要以及有权机构要求，包括但不限于向投资者提供各类产品和服务及提高产品和服务质量，与投资者进行联络、沟通，了解投资者的需求，</p> |

| | |
|--|---|
| | <p>建立、复查、维护、发展与投资者的关系，根据法律法规规定的、管理人应履行的反洗钱、投资者适当性管理、合格投资者管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、持续信息服务等法定职责或者法定义务、为订立、履行投资者作为一方当事人的产品合同所必需，以及在合法合规的前提下，为提升投资者对管理人服务的使用体验、增强管理人的安全机制等目的，使用并处理投资者提供的个人信息，并向司法机关、监管机构、行业自律组织、中介机构、投资相关对手方、托管机构及其他在合法合规前提下需取得个人信息的机构或组织提供管理人处理的个人信息。</p> <p>如管理人处理的个人信息不限于投资者自身且投资者同意提供超出投资者自身的个人信息，投资者保证其向管理人提供该等超过投资者自身的个人信息前，已经合法取得该等个人信息且已经告知该等个人信息的信息主体并已经取得了信息主体的授权与同意。</p> |
| <p>四、当事人及权利义务 (二) 当事人权利义务 1、投资者的权利义务 (1) 投资者的权利 6) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。</p> | <p>四、当事人及权利义务 (二) 当事人权利义务 1、投资者的权利义务 (1) 投资者的权利 6) 《个人信息保护法》规定的个人信息处理活动中的权利，包括但不限于知情权、决定权、查阅、复制、请求转移、更正、补充、删除、撤回同意等，权利行使方式以管理人《个人信息处理规则》为准； 7) 法律法规、中国证监会及中国证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。</p> |
| | |
| <p>五、资产管理计划的基本情况 (四) 集合计划的投资 3、投资比例 (1) 债权类资产和资产管理产品：占本集合计划资产总值的 80-100%； (2) 金融衍生品类资产账户权益：占本集合计划资产总值的 0-20%；</p> | <p>五、资产管理计划的基本情况 (四) 集合计划的投资 3、投资比例 (1) 现金及债权类资产：占本集合计划资产总值的 80-100%； (2) 金融衍生品类资产账户权益：占本集合计划资产总值的 0-20%；</p> |

| | |
|---|--|
| <p>(3) 本集合计划参与债券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的100%。</p> <p>如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，穿透后的最终投资比例符合本集合计划要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。</p> | <p>(3) 本集合计划参与债券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的100%。</p> <p>(4) 如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，穿透后的最终投资比例符合本集合计划要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。</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>(1) 债权类资产：现金、银行存款（包括但不限于活期存款、协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、大额存单、在银行间市场、证券交易所市场等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括政策性金融债、金融机构次级债、混合资本债）、企业债券、公司债券（含大公募、小公募和非公开发行公司债和中小企业私募债券）、债券逆回购、中期票据（含长期限含权中期票据）、短期融资券及超短期融资券、可转换债券、非公开定向债务融资工具、次级债、可交换债券（包括私募品种）、证券公司发行的短期公司债券、资产证券化产品（如资产支持证券、资产支持票据等。资产支持证券为在沪深交易所交易的优先级份额，且底层资产不得为资管产品）等标准化债权类资产；</p> <p>(2) 资产管理产品：固定收益类公募基金证券投资基金、货币市场基金；</p> <p>(3) 金融衍生品类资产：国债期货；</p> <p>(4) 本集合计划可参与债券正回购业务。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 债权类资产和资产管理产品：占本</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>(1) 债权类资产：银行存款（包括但不限于活期存款、协议存款、通知存款、定期存款）、同业存单、大额存单、在银行间市场、证券交易所市场等经国务院同意设立的交易市场交易的国债、地方政府债、央行票据、政府支持机构债券、金融债（包括政策性金融债、金融机构次级债、混合资本债）、企业债券、公司债券（含大公募、小公募和非公开发行公司债和中小企业私募债券）、中期票据（含长期限含权中期票据）、短期融资券及超短期融资券、可转换债券、非公开定向债务融资工具、次级债、可交换债券（包括私募品种）、证券公司发行的短期公司债券、固定收益类公募基金证券投资基金、货币市场基金、资产支持票据（ABN）、资产支持证券（具体为信贷资产支持证券、证券交易所挂牌交易的资产支持证券）等标准化债权类资产以及债券逆回购等形成的资产；</p> <p>(2) 金融衍生品类资产：国债期货；</p> <p>(3) 现金；</p> <p>(4) 本集合计划可参与债券正回购业务。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p> <p>2、资产配置比例</p> <p>(1) 现金及债权类资产：占本集合计划资产总值的 80-100%；</p> |

| | |
|--|--|
| <p>集合计划资产总值的 80-100%；</p> <p>(2) 金融衍生品类资产账户权益：占本集合计划资产总值的 0-20%；</p> <p>(3) 本集合计划参与债券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的 100%。</p> <p>如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，穿透后的最终投资比例符合本集合计划要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。</p> | <p>(2) 金融衍生品类资产账户权益：占本集合计划资产总值的 0-20%；</p> <p>(3) 本集合计划参与债券回购融入资金余额不超过集合计划资产净值的 100%。</p> <p>(4) 如投资于资产管理产品的，应穿透核查，确保最终投资标的均为标准化资产，穿透后的最终投资比例符合本集合计划要求。本集合计划应当按照所投资资产管理产品披露投资组合的频率，及时更新计算本集合计划所投资资产的金额或比例。</p> |
| <p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>(六) 投资策略</p> | <p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>(六) 投资策略</p> <p>删除：</p> <p>3、风险控制</p> <p>(1) 内部风险工作</p> <p>1) 风险控制原则</p> <p>①全面性原则。资产管理业务风险管理应当涵盖各类风险、全员参与、实现全流程管理、建立全面风险管理体系。全面风险管理包括资产管理业务面临的所有风险,全面覆盖资产管理的所有业务;资产管理业务条线各部门负责人及全体员工都是风险管理的责任主体,根据部门、岗位职责的要求承担相应的风险管理责任与义务;资产管理业务风险管理工作贯穿决策、执行和监督全过程,体现风险识别、评估、监测、应对、报告等全部流程。</p> <p>②适应性原则。资产管理业务风险管理制度的制订应当适应发展战略、资产规模及经营目标等自身特点,并且随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境的变化和国家法律法规、政策制度等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。</p> <p>③制衡性原则。资产管理业务风险管理应当通过制度、流程、系统等方式,实现前、中、后台相关部门、相关岗位之间的相互制衡、相互监督;风险管理部独立地评估和监控风险。</p> <p>④定性与定量原则。全面合理运用恰当</p> |

的定性和定量方法，对风险进行识别、计量、监测和控制。

2) 风险控制组织结构

管理人建立了由董事会、监事会、经理层、风险管理部门，各部门与分支机构及子公司组成的全面风险管理组织架构，即董事会及其风险控制委员会、监事会—公司经理层—风险管理部—各部门、分支机构及子公司四级管理组织架构。

① 董事会及其风险控制委员会、监事会

董事会是公司风险管理的最高决策机构，承担全面风险管理的最终责任。董事会设立的风险控制委员会按照公司章程和议事规则的相关规定，为董事会审议的风险管理相关事项提供评估意见和建议，在董事会授权范围内履行和协助董事会履行职责。监事会承担全面风险管理的监督责任，负责监督检查董事会和经理层在风险管理方面的履职尽责情况并督促整改。

② 公司经理层

公司经理层对公司全面风险管理承担主要责任,根据公司董事会确定的风险管理战略和政策进行风险管理组织体系建设、定期评估公司整体风险和各类重要风险管理状况等。

③ 风险管理部

公司风险管理部门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、分支机构及子公司的风险管理工作。

④ 资产管理业务条线

资产管理业务条线各部门负责人应当全面了解并在决策中充分考虑与业务相关的各类风险，及时识别、评估、应对、报告相关风险，并承担风险管理的直接责任。资产管理业务条线各部门作为风险管理的第一道防线，在日常工作中应当充分了解并在决策中充分考虑经营管理活动中所包含的各种风险，并为风险所带来的损失承担责任。资产管理业务

条线设专职风险管理人员，业务上接受风险管理部全面指导和考核，负责资产管理业务的日常风险控制工作，并及时向资产管理业务条线各部门负责人和风险管理部报告资产管理业务风险管理工作的有关情况。

3) 风险控制的流程与措施

①管理人风险管理部和资产管理部风控专员通过实时监控系统，全方位监控资产管理业务的风险，并将有关情况通报资产管理部及公司经营管理层面。资产管理部对风险管理部的监控报告和处理建议及时予以反馈。

②根据法律法规和监管要求，通过管理人风险管理部的集中监控系统，在监控系统中设置相应的风险监控值，通过系统的预警触发装置，自动显示资产管理业务风险的动态变化，提高动态监控效率。

③提高资产管理业务运作的透明度，资产管理交易系统、公司风险监控平台设置必要的开放功能或数据接口，以便监管部门及时了解和检查公司资产管理业务情况。

④建立健全资产管理业务风险监控缺陷的纠正与处理机制，由管理人风险管理部根据资产管理业务风险监控的检查情况和评估结果，提出整改意见和纠正措施,并对落实情况进行跟踪检查。

⑤定期对风险控制过程中业务人员的工作效果进行评价和总结，以进一步完善内部控制措施。

⑥对资产管理业务不同投资组合之间发生的同向交易和反向交易进行监控，并定期向中国证券投资基金业协会报告并抄送公司所在地中国证监会派出机构。

4) 投资期货的风险控制

①公司已经建立了完备的业务运作系统支持系统，包括估值、交易、清算等,从系统上保证期货投资的持续、稳定运行。为避免期货交易的损失金额超过委托资产的风险承受能力,针对市场风险具有以下措施:一是交易限额规定,包括合约价值限额的设立等;二是风险衡量及监

| | |
|---|---|
| | <p>控,包括对期货合约规模、保证金变化、亏损等进行动态预测与监管;三是制定止损处理机制,例如一旦期货头寸亏损超过确定的目标,必须强制平仓,避免出现严重的风险事件。</p> <p>保证金管理有以下措施:为避免期货交易因保证金不足而引发的强制平仓所造成的损失,定期制定和调整委托资产参与期货交易可使用的保证金额度和保证金比率预警水平;若因突发事件导致市场剧烈波动,指数快速向已建立的期货敞口不利方向运行,在保证金比率达到预警水平或收到期货公司保证金追加通知后,应启动保证金流动性应急处理机制。</p> <p>②建立有效的内部稽核制度,识别内部控制中的弱点和系统中的不足,提供改进的建议。</p> <p>③经常重新评估,审定风险管理政策、流程。</p> <p>(2) 外部风险监督</p> <p>本集合计划在实行严格的内部风险控制的同时,也接受管理人以外的合作机构、监管机构的监督。</p> <p>1) 托管人的监督</p> <p>托管人监督管理人对本集合计划的投资运作,发现管理人违反法律、法规和本合同的约定进行投资的,托管人有权对违反法律、法规和本合同约定的投资和资金清算指令不予执行,或采取有效措施防止损失扩大,并及时向投资者通报、向监管机构报告。</p> <p>2) 上级监管机构的监管</p> <p>中国证监会及其派出机构、中国证券投资基金业协会等监管机构将对本集合计划募集、交易、投资运作以及相关的业务活动和财务会计资料进行定期或不定期的现场检查、稽核,并要求管理人和托管人就集合计划运作中遇到重大问题作专项报告。</p> |
| <p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>(六) 投资策略</p> <p>4、投资管理的方法和标准</p> <p>(3) 期货投资策略</p> | <p>十一、资产管理计划的投资</p> <p>(六) 投资策略</p> <p>4、投资管理的方法和标准</p> <p>(3) 期货投资策略</p> |

1) 本集合计划投资于期货的目的有套期保值、投机、套利。

2) 期货保证金的流动性应急处理机制

① 应急触发条件

管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后,管理人没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。

② 保证金补充机制

管理人收到追保及强平通知,确认是否追加保证金或减仓。如管理人经过内部决策选择减仓,则在减仓操作完成后,及时通知托管人;如选择追加保证金,管理人应立即向托管人发送指令,托管人在有足够执行时间的前提下最迟应当在下一交易日下午两点前追加保证金到位。

③ 损失责任承担等

管理人所持有某种期货合约的持仓总量超出交易规则的相应限制时,可能会被交易所强行平仓并罚没盈利。因管理人操作失误的原因造成的保证金管理风险,由管理人承担。

3) 期货投资责任承担

管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本集合合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定,因管理人超限交易且未在规定时间内调整等违法违规行而造成的集合计划资产损失,管理人应赔偿损失。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失,管理人不承担赔偿责任,但可代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。投资者同意并确认:有关期货交易中各方的权利义务及违约赔偿等事项,以管理人代表集合计划与各方签订的相关协议(如有)为准。

1) 本集合计划投资于期货的目的有套期保值、投机、套利。

本集合计划参与国债期货的主要目的是套期保值和套利,在控制风险的前提下也会进行少量的投机交易,以期更好地提高产品收益。管理人将根据不同的市场行情动态管理国债期货合约数量,力争在控制风险的前提下萃取收益。

2) 期货保证金的流动性应急处理机制

① 应急触发条件

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。

② 保证金补充机制

如出现保证金不足的情况时,管理人将首先运用集合计划资产从市场上拆借资金;如仍不能满足保证金缺口的,管理人将及时变现集合计划资产,变现时应重点考虑变现资产的流动性,以最大限度的降低损失。

③ 损失责任承担等

管理人不承担委托资产的变现损失及未及时追加保证金的损失(包括穿仓损失)。对于其他相关方的原因给投资者造成的损失,管理人不承担赔偿责任,但应代表集合计划投资者的利益向过错方追偿。

3) 投资期货的风险控制及责任承担

① 风险控制

由于期货交易,尤其是期货交易中的投机交易,会涉及对行情的判断,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控制和监管。首先,投机交易规模不得超过管理人有关规定;其次,监控期货的风险敞口,不得超过合同约定范围。

② 责任承担

管理人的期货投资管理行为应当自觉遵守本合同及其它法律法规和规定中有关期货交易的相关规定,对于其他相关方的原因给投资者造成的损失,由过错方承担赔偿责任,但管理人可代表集合计

| | |
|--|---|
| | 划投资者的利益向过错方追偿。 |
| <p>十一、资产管理计划的投资 (七) 投资限制及禁止行为 1、投资限制 (6) 投资于资产证券化产品优先档的公开债项评级应为 AA 级（含）以上；投资于资产支持证券的，其底层资产不得为资管产品；</p> | <p>十一、资产管理计划的投资 (七) 投资限制及禁止行为 1、投资限制 (6) 本集合计划不得投资于资产支持证券和资产支持票据的劣后级，投资于资产支持证券和资产支持票据优先级的公开债项评级应为 AA 级（含）以上（如无债项评级，则以主体评级为准）。本集合计划如投资于资产支持证券或资产支持票据，其基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权。</p> |
| <p>十九、资产管理计划财产的估值与会计核算 (一) 集合计划财产的估值 3、估值方法： (1) 投资债权类资产的估值方法 ①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。 ②在证券交易所市场挂牌交易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，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。 ③在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去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所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。</p> | <p>十九、资产管理计划财产的估值与会计核算 (一) 集合计划财产的估值 3、估值方法： (1) 投资债权类资产的估值方法 ①证券交易所上市的有价证券的估值 A、交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（本合同另有规定的除外），选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值净价估值； B、交易所上市的可转换债券、可交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； C、交易所市场挂牌转让的资产支持证券、非公开发行可转换债、非公开发行可交换债和私募债券等，选取估值日第三方估值机构（中证指数有限公司）提供的相应品种对应的估值净价估值； D、对于已申报成功回售登记的含投资人回售权的债券（法律法规另有规定的除外），按债券回售实施公告约定的回售价格估值。在选择债券回售时或回售期内，由于债券发行人信用风险显著增</p> |

④首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值。

⑤对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，采用估值技术确定的公允价值进行估值。

⑥在对银行间市场的固定收益品种估值时，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。

⑦对在银行间市场上市交易的资产支持证券，应主要依据第三方估值机构公布的收益率曲线及估值价格估值。对未在银行间市场上市交易且第三方估值机构未提供价格的，采用估值技术确定的公允价值进行估值。对在交易所上市的资产支持证券品种，采用估值技术确定的公允价值进行估值。

⑧中小企业私募债采用估值技术确定的公允价值进行估值。

⑨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，采用估值技术确定公允价值。

⑩持有的银行存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，管理人应及时通知托管人，双方及时进行账务调整。

⑪持有的债券逆回购（正回购）以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入（利息支出）。

（2）投资证券投资基金的估值方法

①持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

②持有的场外基金（包括保管在场外

加或发生其他可能导致债券回售失败的突发、异常情形，按管理人、托管人协商一致的方法处理估值相关事宜。

②首次公开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计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，应对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；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。

③全国银行间市场的有价证券的估值

A、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。

B、对于已申报成功回售登记的含投资人回售权的债券（法律法规另有规定的除外），按债券回售实施公告约定的回售价格估值。在选择债券回售时或回售期内，由于债券发行人信用风险显著增加或发生其他可能导致债券回售失败的突发、异常情形，按管理人、托管人协商一致的方法处理估值相关事宜。

C、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，应采用估值技术确定公允价值；如估值技术难以实现的，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。管理人持续评估该估值方式的适当性，并在情况发生改变时做出适当调整。

D、原则上，第三方估值机构选取中债金融估值中心有限公司。

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。

⑤持有的银行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。如提前支取或利率发生变化，管理人应及时通知托管人，双方及时进行账

| | |
|---|--|
| <p>的上市开放式基金（LOF））以估值日前一工作日基金单位净值估值，估值日前一工作日开放式基金单位净值未公布的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，以此前最近一个工作日基金净值计算。尚未公布过基金单位净值的，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>③持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。</p> <p>（3）国债期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近一日的当日结算价计算。</p> | <p>务调整。</p> <p>⑥持有的债券逆回购（正回购）以本金列示，按约定利率逐日确认利息收入（利息支出）。</p> <p>（2）国债期货等标准化商品及金融衍生品类资产以估值日交易所的当日结算价估值，该日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近一日的当日结算价计算。</p> <p>（3）投资资产管理产品的估值方法</p> <p>①持有的交易所上市基金（包括封闭式基金、上市开放式基金（LOF）），按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；</p> <p>②持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；尚未公布过基金份额净值的，采用估值技术确定公允价值。</p> <p>③持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计算。</p> <p>④持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按成本价估值。</p> |
| <p>二十、资产管理计划的费用与税收</p> <p>（一）本集合计划的各项费用</p> <p>3、管理费：0.4%/年；</p> <p>（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>2、管理费</p> <p>本集合计划的年管理费率为 0.4%，每日管理费计算方法如下：</p> $T=E \times 0.4\% \div 365;$ | <p>二十、资产管理计划的费用与税收</p> <p>（一）本集合计划的各项费用</p> <p>3、管理费：0.6%/年；</p> <p>（二）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>2、管理费</p> <p>本集合计划的年管理费率为 0.6%，每日管理费计算方法如下：</p> $T=E \times 0.6\% \div 365;$ |
| <p>二十一、资产管理计划的收益分配</p> <p>（二）收益分配原则</p> | <p>二十一、资产管理计划的收益分配</p> <p>（二）收益分配原则</p> |

| | |
|---|---|
| <p>4、在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，本集合计划在每个固定开放期进行收益分配，分配比例为 100%。</p> <p>5、收益分配基准、收益分配比例、分配时间由管理人根据计划运作情况决定，并在管理人网站上公告。</p> | <p>4、在符合上述原则和具备收益分配条件的前提下，本集合计划原则上在每个固定开放期进行收益分配。收益分配基准、收益分配比例、分配时间、次数由管理人根据计划运作情况决定，并在管理人网站上公告。</p> |
| <p>二十二、信息披露与报告</p> <p>(四)管理人、托管人应当根据中国证监会和中国证券投资基金业协会等监管机构的要求履行报告义务，报告的种类、内容、时间和途径应符合上述监管机构的要求。</p> | <p>二十二、信息披露与报告</p> <p>(四)管理人、托管人应当根据《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等监管要求履行报告义务，并将向投资者提供的信息披露文件根据相关规定及时报送管理人住所地中国证监会派出机构、中国证券投资基金业协会。如法律法规、监管部门或自律组织对管理人和托管人应履行的信息披露及报告、报备义务另有规定的，从其规定。</p> |
| <p>二十三、风险揭示</p> | <p>二十三、风险揭示</p> <p>(三) 其他风险</p> <p>新增：</p> <p>11、个人信息(含敏感个人信息)泄露、篡改、丢失的风险</p> <p>本资产管理计划在运作过程中，可能需要针对个人信息进行必要的收集、存储、传递、分析、利用、处理，可能存在由于物理、技术或管理防护设施遭到破坏、信息技术系统故障等原因，导致个人信息被非法授权访问、泄露、篡改或损毁、丢失的风险。</p> <p>敏感个人信息是指一旦泄露或者非法使用，容易导致自然人的人格尊严受到侵害或者人身、财产安全受到危害的个人信息，包括生物识别、宗教信仰、特定身份、医疗健康、金融账户、行踪轨迹等信息，以及不满十四周岁未成年人的个人信息。相比其他个人信息，敏感个人信息可能对投资者的个人权益影响更大：敏感个人信息的泄露或者非法使用容易导致个人的人身安全受到危害；其不当处理将容易导致个人财产遭受他人侵害，使得个人的财产安全面临威胁；敏感个人信息与个人的人格尊严高度相关。对于投资者而言，需在谨慎考虑后再向管理人提供敏感个人信息。</p> |

| | |
|--|--|
| 管理人名称： 财信证券有限责任公司 | 管理人名称： 财信证券股份有限公司 |
| 管理人住所： 长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财 富中心 26 层 | 管理人住所： 湖南省长沙市岳麓区茶子山东路 112 号 滨江金融中心 T2 栋(B座)26 层 |
| 管理人指定网站、管理人网站： www.cfzq.com | 管理人指定网站、管理人网站： zg.stock.hnchasing.com |

附件 2：《征询意见函》样本

财信证券股份有限公司：

本投资者确认，已充分阅读并理解《财富证券财富 606 号集合资产管理计划合同变更征询及生效公告》及其附件的相关内容，承诺自行承担投资风险和损失。

本投资者 同意 不同意（请打勾）此次合同变更。

投资者

个人填写：

姓名：_____证件类型：_____证件号码：_____

住所：_____

联系电话：_____

传真：_____电子信箱：_____

通讯地址：_____

联系人：_____

机构填写：

机构名称：_____法定代表人：_____

住所：_____

联系电话：_____

传真：_____电子信箱：_____

通讯地址：_____

联系人：_____

投资者（签字/盖章）：_____

签署日期： 年 月 日

《征询意见函》请本人签字/盖章后扫描发送至 cxzg@hnchasing.com