

# 关于财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金及法律文件变更之第二次提示性公告

尊敬的投资者：

财通证券资产管理有限公司决定将财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金，并已于2022年12月2日和2022年12月9日在财通证券资产管理有限公司网站（[www.ctzg.com](http://www.ctzg.com)）发布了《关于财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金及法律文件变更的公告》和《关于财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金及法律文件变更之第一次提示性公告》。为使本次合同变更顺利完成，现发布《关于财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金及法律文件变更之第二次提示性公告》。

具体变更公告内容如附。

财通证券资产管理有限公司

2022年12月16日

附件：

## 关于财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金及法律文件变更的公告

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）、《现金管理产品运作管理指引》（以下简称“《运作管理指引》”）等法律法规的规定及中国证券监督管理委员会《关于准予财通证券现金聚财集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2022〕1646号），我司作为财通证券现金聚财集合资产管理计划的管理人，经与托管人中国证券登记结算有限责任公司协商一致，拟将财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金，并按照《财通证券现金聚财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》”）、《财通证券现金聚财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。

财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金涉及法律文件全文变更，即由原财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金的法律文件，包括《财通资管现金聚财货币市场基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）、《财通资管现金聚财货币市场基金托管协议》（以下简称“《托管协议》”）、《财通资管现金聚财货币市场基金招募说明书》（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。本次财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场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“财通证券现金聚财集合资产管理计划”变更为“财通资管现金聚财货币市场基金”。

### （二）变更产品类型

产品类型由“限定性集合资产管理计划”变更为“契约型开放式货币市场基金”。

### （三）调整投资相关条款

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

	财通证券现金聚财集合资产管理计划	财通资管现金聚财货币市场基金
投资目标	在满足客户资产流动性与安全性要求的前提下，争取委托人的分红收益率超过同期活期存款利率。	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。
投资范围	试运行期投资范围仅包括期限在1年以内（含1年）银行存款。 试运行期结束后可扩大投资范围，包括现金、活期存款、定期存款（期限在1年以内（含1年））、协议存款（期限在1年以内（含1年））、通知存款（期限在1年以内（含1年））、大额存单（期限在1年以内（含1年））、货币市场基金、债券逆回购（期限在1个月以内），剩余存续期限在397天以内（含397天）的国债、央行票据、政策性金融债，以及发行人主体和债项信用评级均为最高级的中期票据（含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）、短期融资券、企业债、公司债、证券公司短期债，以	本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体如下： （一）现金； （二）期限在1年以内（含1年）的银行存款、中央银行票据、同业存单； （三）期限在1个月以内的债券回购； （四）剩余期限在397天以内（含397天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券； （五）中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。 本基金投资于本条第（四）项的，其中企业债、公司债、短期融资券、中期票据的主体信用评级和债项信用评级均

	<p>及其他法律、法规和政策允许的固定收益类投资品种。</p> <p>基于审慎原则，根据法律、法规、行政章程、相关业务规则及市场变化等，管理人有权将本集合计划资产投资于中国证监会批准集合计划可投资的其他金融产品，管理人在履行相关程序后，可将该金融产品划入相应类别进行管理，但管理人应在投资实施当日的3个工作日之前对委托人进行通告。</p>	<p>应当为最高级；超短期融资券的主体信用评级应当为最高级。发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级。</p> <p>本基金持有的企业债、公司债、短期融资券、中期票据及逆回购质押品信用等级下降、不再符合投资标准的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，中国证监会另有规定的除外。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，在不改变基金投资目标、不改变基金风险收益特征的前提下，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。具体投资比例限制按届时有效的法律法规和监管机构的规定执行。</p>
<p>投资比例</p>	<p>试运行期资产配置比例为：</p> <p>(1) 活期存款：0-100%；</p> <p>(2) 一年以内（含1年）的定期存款（含协议存款，下同）：0-100%；</p> <p>(3) 现金及活期存款的比例在任何连续五个交易日的平均值不低于总资产的10%。</p> <p>试运行期结束后资产配置比例为：</p> <p>(1) 投资于现金、活期存款、定期存款（期限在1年以内（含1年））、协议存款（期限在1年以内（含1年））、通知存款（期限在1年以内（含1年））、大额存单（期限在1年以内（含1年））</p>	<p>基金的投资组合应遵循以下限制：</p> <p>(1) 本基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天，平均剩余存续期不得超过240天；</p> <p>(2) 本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券占基金资产净值的比例合计不得低于5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等（下同）；</p> <p>(3) 现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及五个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于10%；</p>

<p>的比例为计划资产净值的 0-100%；</p> <p>(2) 投资于剩余存续期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、央行票据、政策性金融债，以及发行人主体和债项信用评级均为最高级的中期票据（含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）、短期融资券、企业债、公司债、证券公司短期债的比例为计划资产净值的 0-90%；</p> <p>(3) 投资于货币市场基金的比例为计划资产净值的 0-90%；</p> <p>(4) 投资于债券逆回购（期限在 1 个月以内）的比例为计划资产净值的 0-90%；</p> <p>(5) 现金及活期存款的比例在任何连续五个交易日的平均值不低于总资产的 10%；</p> <p>(6) 其他法律法规或政策允许投资的固定收益类投资品种：配置比例由管理人根据法律法规或政策的规定提出建议，托管人无异议后执行。</p> <p>因证券市场波动、证券发行人合并、集合资产管理计划规模变动等外部因素致使集合资产管理计划的组合投资比例不符合集合资产管理合同约定的，管理人应当在 10 个工作日内进行调整。</p>	<p>(4) 到期日在 10 个交易日以上的逆回购、银行定期存款（可提前支取的除外）等流动性受限资产投资占基金资产净值的比例合计不得超过 30%；</p> <p>(5) 除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例不得超过 20%；</p> <p>(6) 本基金持有同一机构发行的企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，国债、中央银行票据、政策性金融债券除外；</p> <p>(7) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；</p> <p>(8) 本基金投资于有固定期限银行存款的比例，不得超过基金资产净值的 30%，但投资于有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款不受上述比例限制；</p> <p>(9) 本基金投资于具有基金托管人资格的同业商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 20%，投资于不具有基金托管人资格的同业商业银行的银行存款、同业存单占基金资产净值的比例合计不得超过 5%；</p>
---	--

		<p>(10) 在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；债券回购最长期限为1个月，债券回购到期后不得展期；</p> <p>(11) 本基金的资产总值不得超过基金资产净值的140%；</p> <p>(12) 当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过60天，平均剩余存续期不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%；</p> <p>(13) 当本基金前10名份额持有人的持有基金份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；</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基金资产净值的10%；因证券市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前述比例限制的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；</p> <p>(15) 同一基金管理人管理的全部货币</p>
--	--	---

		<p>市场基金投资于同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券，不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%；</p> <p>（16）本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%；前述金融工具包括银行存款、同业存单、中国证监会认定的其他品种；本基金拟投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的，应当经基金管理人董事会审议批准，相关交易应当事先征得基金托管人的同意，并作为重大事项履行信息披露程序；</p> <p>（17）逆回购资金余额不得超过上一交易日基金资产净值的 40%，采用净额担保结算的 1 天期债券质押式回购交易除外；</p> <p>（18）对于逆回购资金余额超过基金资产净值 5% 的交易对手，基金管理人对该交易对手及其质押品均应当有内部独立信用研究支持，采用净额担保结算的债券质押式回购交易除外；</p> <p>（19）本基金投资于同一金融机构发行的债券及以该金融机构为交易对手的逆回购资金余额，合计不得超过基金资产净值的 10%，同一基金管理人管理的</p>
--	--	--

		<p>现金管理产品和货币市场基金投资于同一金融机构的存款、同业存单、债券及以该金融机构为交易对手的逆回购资金余额，合计不得超过该金融机构最近一个年度净资产的 10%；</p> <p>（20）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>（21）以私募资产管理计划为交易对手的逆回购资金余额合计不得超过基金资产净值的 10%，其中单一交易对手的逆回购资金余额不得超过基金资产净值的 2%；</p> <p>（22）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>除上述（1）、（2）、（14）、（20）项外，因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动、债券信用评级调整等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>投资限制</p>	<p>为维护委托人的合法权益，本集合计划投资的投资限制为：</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%；投资于</p>	<p>1、本基金不得投资于以下金融工具：</p> <p>（1）股票；</p> <p>（2）可转换债券、可交换债券；</p> <p>（3）以定期存款利率为基准利率的浮</p>



<p>指数基金或者完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划除外；</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%；完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合计划除外；</p> <p>3、将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关关联方关系的公司发行的证券，投资比例超过资产净值的 7%；投资于指数基金或者完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的集合资产管理计划可以不受上述限制；</p> <p>4、集合计划申购新股，申报的金额超过集合计划的现金总额，申报的数量超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；</p> <p>5、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>6、投资于股票、可转债、可分离交易债等权益类或权益挂钩类资产；</p> <p>7、其他投资限制法律法规、集合计划资产管理合同以及中国证监会规定的其他限制。</p> <p>如因证券市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券公司之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。</p>	<p>动利率债券，已进入最后一个利率调整期的除外；</p> <p>(4) 主体信用评级和债项信用评级在最高级以下的企业债、公司债、短期融资券、中期票据（若无债项信用评级，按主体信用评级），主体信用评级在最高级以下的超短期融资券；信用评级主要参照最近一个会计年度的信用评级，发行人同时有两家以上境内评级机构评级的，按照孰低原则确定评级；</p> <p>(5) 期限在 1 个月以上的债券回购；</p> <p>(6) 资产支持证券；</p> <p>(7) 其他基金；</p> <p>(8) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。</p> <p>法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。</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>投资策略</p>	<p>1、银行存款投资策略</p> <p>管理人将密切跟踪客户股票交易数据，并考虑新股申购、节假日取款等事件性因素，合理分配活期存款与定期存款的投资比例，在以活期存款满足客户证券交易资金交收、取款需求的同时，通过配置一定比例的定期存款提高存款组合收益率。</p> <p>在综合考察银行的信用状况、存款规模、资金需求等情况基础上，管理人将建立银行交易对手库，在保障流动性与安全性的前提下，择优选择利率较高的银行进行存款。同时，管理人将严格控制单笔存款规模，适当增加存款笔数，并根据分红时点合理安排存款期限。</p> <p>2、货币基金投资策略</p> <p>货币基金考虑的主要因素包括：收益率、收益波动幅度、基金规模、划款周期和管理费率，并根据以下几个方面的因素进行基金筛选：（1）货币市场基金管理现金的安全性；（2）货币市场基金管理现金的流动性；（3）货币市场基金管理现金的成本等。</p> <p>3、债券逆回购</p> <p>一是流动性控制，管理人将回购到期日</p>	<p>本基金主要为投资人提供现金管理工具，通过积极的投资组合管理，同时充分把握市场短期失衡带来的套利机会，在安全性、流动性和收益性之间寻求最佳平衡点。</p> <p>1、剩余期限结构配置</p> <p>基于对国内外宏观经济形势、国家货币政策和财政政策、短期资金市场利率波动、资金供求、市场结构变化等因素的深入研究，对利率期限结构变动趋势进行研判，预测货币市场利率水平，确定基金投资组合的平均剩余期限及期限分配结构。当预期短期利率上升时，缩短组合的平均剩余期限；当预期短期利率下降时，适度延长组合的平均剩余期限。</p> <p>2、类属资产配置策略</p> <p>根据市场环境，结合各债券品种之间的流动性、相对收益水平、信用等级、参与主体资金的供求变化及到期期限等因素，灵活运用哑铃形策略、梯形策略及纺锤形策略等，确定组合中各债券品种的配置比例。</p> <p>3、个券选择，构建投资组合</p> <p>构建不同券种的收益率曲线预测模</p>

<p>做合理延后假设，以此来安排资产的流动性；同时控制回购到期日，在控制总量的前提下，滚动操作，以提高回购的真实流动性。二是注重回购的安全性，只接受足额抵押资产。</p>	<p>型，对货币市场工具进行估值，确定价格中枢的变动趋势，在综合考虑风险收益匹配水平及流动性的基础上，投资于各类属债券中价值低估的个券。在保证投资组合低风险、高流动性的前提下，构建投资组合，并根据投资环境的变化相机调整，尽可能提升组合的收益。</p> <p>4、现金流均衡管理策略</p> <p>对市场资金面的变化及本基金申购/赎回变化的动态预测，通过现金库存管理、回购滚动操作、债券品种的期限结构安排及资产变现等措施，动态调整并有效分配现金流，在保证基金资产充分流动性的基础上，获取稳定的收益。</p> <p>5、充分把握市场短期失衡带来的套利机会</p> <p>由于市场分割、信息不对称、发行人信用等级发生突然变化等情况会造成市场在短期内的非有效性；由于新股、新债发行以及季节效应等因素会使市场资金供求关系发生短期失衡。本基金管理人将积极把握由于市场短期失衡而带来的套利机会，通过跨市场套利、跨品种套利、跨期限套利、正回购放大等策略获取超额收益。</p> <p>6、债券回购杠杆策略</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</p>
---	---

		交易，放大固定收益类资产投资比例，追求固定收益类资产的超额收益。
业绩比较基准	无	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### （四）调整合同终止条款

财通证券现金聚财集合资产管理计划	财通资管现金聚财货币市场基金
<p>（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>1、管理人因重大违法违规行为，被中国证监会取消相关业务许可，或因解散、破产、撤销等原因不能履行职责；</p> <p>2、托管人因重大违法、违规行为，被取消业务资格，或因解散、破产、撤销等原因不能继续担任集合计划托管人，而无其他适当的托管机构承接其原有权利、义务的；</p> <p>3、存续期内，委托人人数少于 2 人；</p> <p>4、战争、自然灾害等不可抗力力的发生导致本集合计划不能存续；</p> <p>5、连续两个分红期的客户实际收益率低于同期活期存款利率，则管理人有权决定是否提前终止产品；</p> <p>6、投资品种或交易对手发生严重信用违约，专户存款银行发生严重信用风险、破产、倒闭，则管理人有权决定是否提前终止产品；</p> <p>7、产品代销、估值或清算系统发生重大故障，产品在一段时间内都无法正常运行，则管理人有权决定是否提前终止产品；</p> <p>8、法律、行政法规及中国证监会规定的其他终</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：</p> <p>1、基金份额持有人大会决定终止的；</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>

止情形；	
9、如果监管规定发生调整，则以新规定为准。	

### (五) 调整估值方法

财通证券现金聚财集合资产管理计划	财通资管现金聚财货币市场基金
<p>本集合计划按以下方式进行估值：</p> <p>集合计划每周公布预估年化收益率，该收益率并非可作为分红依据的实际年化收益率水平。</p> <p>1、银行存款参照银行存款计息方法。银行存款以成本列示，每日按照约定利率进行预提收益，直至季末按累计收益除累计份额确定实际分配的收益率，分红期内遇定期存款提前解付，按调整后利率计提收益，同时冲减前期已经预提的收益；</p> <p>2、回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提利息；</p> <p>3、货币市场基金的预提收益为基金公司公布的前一日每万份基金净收益；</p> <p>4、债券估值方法：未上市的债券以其成本价计算，其应计利息在实际持有期间内逐日计提。</p> <p>交易所上市流通的债券遵从摊余成本法估值，以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提损益。同时，每一估值日交易所收盘价对持有的估值对象进行重新评估并计算偏离度（即影子定价），若当日无收盘价的，以最近一日收盘价作为影子价格进行重</p>	<p>基金管理人采用计算暂估收益率的方法每日对本基金进行估值，并按照下列方法确认各类金融工具的暂估收益：</p> <p>1、银行存款以成本列示，每日按照约定利率预提收益，直至分红期末按累计收益除以累计份额确定实际分配的收益率；分红期内遇银行存款提前解付的，按调整后利率预提收益，同时冲减前期已经预提的收益；</p> <p>2、回购交易以成本列示，按约定利率在实际持有期间内逐日预提收益；</p> <p>3、债券采用摊余成本法估值，以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价和折价，在其剩余期限内平均摊销，每日预提收益；</p> <p>4、为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到</p>

<p>新评估并计算偏离度。</p> <p>在银行间同业市场上市交易的债券遵从摊余成本法估值，以买入成本列示，按票面利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内平均摊销，每日计提损益。同时，每一估值日，采用公允价值（第三方中债登公布）对持有的估值对象进行重新评估并计算偏离度，即影子定价。</p> <p>资产净值的偏离度=（“影子定价”确定的资产净值 - “摊余成本”确定的资产净值）/ “摊余成本”确定的资产净值。</p> <p>管理人应将计划资产净值的偏离度控制在0.5%以内。当偏离度接近0.25%时，管理人应从风险控制角度主动调整投资组合；当偏离度达到或超过0.5%时，管理人应与托管人商定后调整估值方法，并及时进行公告。</p> <p>5、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值；</p> <p>6、如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值；</p> <p>7、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其它原因暂停营业时，或因其它任何不可抗力致使管理人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人必须按规定</p>	<p>0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。</p> <p>5、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>6、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，按国家最新规定估值。</p> <p>基金管理人计算基金暂估净收益时，应当在基金预提收入的基础上，扣除基金运作过程中发生的各项费用。</p> <p>如基金管理人或基金托管人发现基金估值违反基金合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护基金份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。</p> <p>根据有关法律法规，基金资产净值、每万</p>
---	---

<p>完成估值工作；</p> <p>8、管理人按以上估值方法进行估值时，所造成的误差不作为集合计划单位资产净值错误处理。</p>	<p>份基金暂估净收益及7日年化暂估收益率计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。本基金的基金会计责任方由基金管理人担任，因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对基金资产净值、每万份基金暂估净收益及7日年化暂估收益率的计算结果对外予以公布。</p>
--	--

**(六) 调整信息披露条款**

<b>财通证券现金聚财集合资产管理计划</b>	<b>财通资管现金聚财货币市场基金</b>
<p>(一) 定期报告</p> <p>定期报告包括集合计划单位净值报告、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、集合计划单位净值报告</p> <p>本集合计划的单位净值报告主要是披露集合计划预估收益率和每月度集合计划实际收益率，每月度集合计划实际收益率详见月度收益分配方案。管理人有权基于委托人利益，调整收益分配的时间，届时管理人将在官网公告，新的收益分配时间以管理人公告为准。</p> <p>披露时间：管理人每周都将通过管理人网站披露经托管人审核的前一交易日的预估收益率。该收益率只是预估值，不作为分红的依据。</p> <p>披露方式：管理人网站。</p> <p>2、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、托管人在每季度分别向委托人提供一</p>	<p>(一) 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，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</p>

<p>次准确、完整的管理季度报告和托管季度报告，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 15 个工作日内通过管理人网站通告，并报中国证券业协会备案，同时抄报住所地中国证监会派出机构。集合计划成立不足 2 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的季度报告。</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、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 3 个月内通过管理人网站通告，并报中国证券业协会备案，同时抄报住所地中国证监会派出机构。集合计划成立不足 3 个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。</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，并在每年度结束之日起 3 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，并报中国证券业协会备案，同时抄报住所地中国证监会派出机构。</p> <p>5、对账单</p> <p>管理人在每季度结束后的 20 个工作日内以书面、短信或电子邮件等方式向委托人提供对账</p>	<p>招募说明书。</p> <p>3、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，将招募说明书、基金产品资料概要、《基金合同》和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》、托管协议登载在规定网站上。</p> <p>（二）《基金合同》生效公告</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>（三）每万份基金暂估净收益和 7 日年化暂估收益率</p> <p>在开始办理基金份额申购或者赎回后，基金管理人将在每个开放日的次日，通</p>
---	---



<p>单。对账单内容应包括委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，以及收益分配等情况。</p> <p>由于委托人未及时向推广人更新联系方式，而造成无法收到对账单，管理人不承担责任。</p> <p>6、临时报告</p> <p>本集合计划在运作过程中发生下列可能对委托人权益产生重大影响的事项之一时，管理人必须按照法律法规及中国证监会的有关规定，在重大事项发生之日起两个工作日内通过管理人网站向委托人披露。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) 单位份额收益计算错误超过 0.5%的；</p> <p>(4) 集合计划提前终止；</p> <p>(5) 集合计划终止和清算；</p> <p>(6) 终止报告和清算结果报告；</p> <p>(7) 管理人以自有资金参与和退出；</p> <p>(8) 合同的补充、修改与变更；</p> <p>(9) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(10) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；</p> <p>(11) 集合计划投资于管理人及与管理人有关</p>	<p>过规定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露开放日每万份基金暂估净收益和 7 日年化暂估收益率。若遇法定节假日，应于节假日结束后第二个自然日，公告节假日期间的每万份基金暂估净收益、节假日最后一日的 7 日年化暂估收益率，以及节假日后首个交易日的每万份基金暂估净收益和 7 日年化暂估收益率。</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每万份基金暂估净收益和 7 日年化暂估收益率。</p> <p>(四) 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，将基金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</p>
--	---

<p>关联方关系的公司发行的证券；</p> <p>(12) 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>(13) 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>(14) 其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。</p>	<p>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>本基金持续运作过程中，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流动性风险分析等。</p> <p>本基金应当在基金年度报告和中期报告中至少披露报告期末基金前 10 名份额持有人的类别、持有份额及占总份额的比例等信息。</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。</p> <p>(五) 临时报告</p> <p>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。</p> <p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、基金份额持有人大会的召开及决定的事项；</li> <li>2、《基金合同》终止、基金清算；</li> </ol>
---	--

- 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、基金管理人委托相关服务机构代为办理基金的份额登记、核算、估值等事项，基金托管人委托相关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、基金投资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；
- 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；
- 11、基金管理人或其高级管理人员、基金投资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；
- 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；

13、基金收益分配事项；

14、管理费、托管费、销售服务费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

15、基金资产净值估值错误达基金资产净值百分之零点五；

16、本基金开始办理申购、赎回；

17、本基金发生巨额赎回并延期办理；

18、本基金连续发生巨额赎回并暂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、调整本基金的份额类别设置；

22、当发生影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的正偏离度绝对值达到 0.5%、负偏离度绝对值达到 0.5%以及负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%的情形；

23、本基金投资于主体信用评级低于 AA+ 的商业银行的银行存款与同业存单的；

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。

#### （六）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。

#### （七）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，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。

#### （八）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。

#### （九）中国证监会规定的其他信息。

### 六、信息披露事务管理

基金管理人、基金托管人应当建立健全信息披露管理制度，指定专门部门及高级管理人员负责管理信息披露事务。

基金信息披露义务人公开披露基金信

息，应当符合中国证监会相关基金信息披露内容与格式准则等法规的规定。

基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、每万份基金暂估净收益、7 日年化暂估收益率、基金定期报告、更新的招募说明书、基金产品资料概要、基金清算报告等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人进行书面或电子确认。

基金管理人、基金托管人应当在规定媒介中选择一家披露本基金信息。基金管理人、基金托管人应当向中国证监会基金电子披露网站报送拟披露的基金信息，并保证相关报送信息的真实、准确、完整、及时。

基金管理人、基金托管人除依法在规定媒介上披露信息外，还可以根据需要在其他公共媒介披露信息，但是其他公共媒介不得早于规定媒介披露信息，并且在不同媒介上披露同一信息的内容应当一致。

为基金信息披露义务人公开披露的基金信息出具审计报告、法律意见书的专业机构，应当制作工作底稿，并将相关档案至少保存到《基金合同》终止后 10 年。

基金管理人、基金托管人除按法律法规要求披露信息外，也可着眼于为投资者决策提供有用信息的角度，在保证公平

	<p>对待投资者、不误导投资者、不影响基金正常投资操作的前提下，自主提升信息披露服务的质量。具体要求应当符合中国证监会及自律规则的相关规定。前述自主披露如产生信息披露费用，该费用不得从基金财产中列支。</p> <p>七、信息披露文件的存放与查阅</p> <p>依法必须披露的信息发布后，基金管理人、基金托管人应当按照相关法律法规规定将信息置备于各自住所，供社会公众查阅、复制。</p>
--	--

### （七）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《财通资管现金聚财货币市场基金基金合同》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、生效与公告等。

### 二、相关流程安排

根据《财通证券现金聚财集合资产管理计划集合资产管理合同》的约定，我司将于 2022 年 12 月 2 日在公司官网公告《关于财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金及法律文件变更的公告》。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间的 15 个工作日内（即 2022 年 12 月 5 日至 2022 年 12 月 23 日）提出解约财通证券现金聚财集合资产管理计划的申请，投资者申请解约财通证券现金聚财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解约财通证券现金聚财集合资产管理计划申请的，视为投资者同意财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场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 15 个工作日后(即 2022 年 12 月 26 日)起生效,《基金合同》同日生效,原《财通证券现金聚财集合资产管理计划集合资产管理合同》同日起失效。

### 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、如您需更详细了解财通证券现金聚财集合资产管理计划变更为财通资管现金聚财货币市场基金相关事宜,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

2022 年 12 月 2 日