

关于旗峰避险增值集合资产管理计划管理人 自有资金 2018 年第三次退出的公告

尊敬的各位委托人：

我公司管理的旗峰避险增值集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）于 2018 年 7 月 25 日开放，当日客户净赎回份额为 4,243,364.02 份，赎回后本集合计划总份额为 78,907,266.24 份，我公司以自有资金出资参与本集合计划 12,795,463.9 份，客户赎回后自有资金规模占本集合计划总规模的比例为 16.22%。根据《证券公司风险控制指标管理办法》《证券公司风险控制指标计算标准规定》附件 6《证券公司风险控制指标计算表》中规定的“持有一种非权益类证券的规模与其总规模的比例预警标准为 $\leq 16\%$ 。”《关于证券公司风险控制指标监管报表填报有关事项的通知》（机构部函[2016]2489 号）及《旗峰避险增值集合资产管理计划资产管理合同》第三十二条“存续期内，管理人自有资金参与比例不得超过监管部门规定的最高比例上限，因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人应当尽快安排自有资金退出事宜并进行公告，以符合法规要求。”的相关规定。我公司决定当日安排自有资金退出 1,128,675.25 份，本集合计划单位净值为 1.0327，退出后总份额为 77,778,590.99 份，自有资金规模占本集合计划总规模的比例为 15.00%，符合法规要求。

特此公告。

东莞证券股份有限公司

2018 年 7 月 26 日