

## 旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划说明书

2021 年 月 日

**特别提示：**

本说明书依据《证券公司客户资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）、《证券公司集合资产管理业务实施细则》（以下简称《实施细则》）、《旗峰 1 号策略精选集合资产管理合同》（以下简称《管理合同》）及其他有关规定制作，管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整，不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

委托人承诺以真实身份参与集合计划，保证委托资产的来源及用途合法，并已阅知本说明书和《管理合同》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本说明书对集合计划未来的收益预测仅供委托人参考，不构成管理人、托管人和推广机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

投资者签订《管理合同》且合同生效后，投资者即为《管理合同》的委托人，其认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《管理合同》及本说明书的承认和接受。委托人将按照《管理办法》、《实施细则》、《管理合同》、本说明书及有关的规定享有权利、承担义务。

集 合 计 划 基 本 信 息	名称	旗峰 1 号策略精选集合资产管理计划
	类型	限定性集合资产管理计划
	目标规模	本集合计划不设规模上限。
	管理期限	本集合计划不设固定管理期限。
	推广期	自本集合计划启动推广之日起不超过 60 个工作日的期间，具体推广时间以本集合计划推广公告为准。
	封闭期	除开放期外的管理期间均为封闭期，临时开放期除外。封闭期内，委托人不可办理参与和退出业务。
	开放期	本集合计划每满 3 个月开放一次，每次开放 2 个工作日，开放期内投资者可参与、退出本集合计划，具体安排以管理人网站公告为准。若管理人提前结束或延长开放期，将提前于管理人网站公告。
	份额面值	人民币 1.00 元。
	最低金额	首次参与的最低金额为人民币 5 万元（不含参与费），超过最低参与金额的部分不设金额级差。
	相关费率	1、存续期参与/退出费：无； 2、管理费：1%； 3、托管费：0.15%； 4、业绩报酬：本集合计划业绩报酬计算方式详见《说明书》“费用、报酬”一节； 5、其他费用：参见《管理合同》“集合计划的费用与税收”部分。
投资范围	1、投资范围 主要投资于国内依法发行的债券、债券型基金、中期票据、股票质押回购、商业银行理财计划、货币市场基金、银行存款及中国证监会认可的其他固定收益类投资品种。 2、资产配置比例 (1) 固定收益类资产：包括国债、金融债、中期票据、公司债、中小企业私募债、可转债、分离交易可转债、短期融资券、期限在七天以上的债券逆回购、资产支持受益凭证、资产支持证券、非公开定向债务融资工具（PPN）、股票质押回购、有预期收益率的	

		<p>商业银行理财计划等占资产总值的比例：0—100%；</p> <p>(2) 现金类资产：包括银行存款、一年内到期的央行票据、期限在七天以内（含七天）的债券逆回购、货币市场基金等占资产总值的比例：0-100%；</p> <p>(3) 证券正回购：融入资金余额不超过计划资产净值的40%；</p> <p>委托人知悉，作为证券公司的客户资产管理业务，为了集合计划委托人的权益最大化，本集合计划可以投资于管理人及管理人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券或者从事其他重大关联交易。委托人参与本集合计划即视为同意集合计划资产进行上述投资，事后管理人应告知托管人，同时向证券交易所报告，并在管理人网站以公告方式向委托人披露。</p> <p>委托人在此同意并授权管理人将集合计划的资产投资于股票质押式回购时，质权人登记为管理人，由管理人负责本集合计划作为股票质押式回购交易融出方的交易协议签署、交易申报、盯市管理、违约处置等后续事宜。委托人签署本合同即同意以上约定。</p> <p>如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10 个工作日内将投资比例降至许可范围内；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 个工作日内将投资比例降至许可范围内。</p> <p>如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围</p>
	风险收益特征	本集合计划属于中低风险收益品种。
	适合推广对象	适合具有中低风险、中等风险、中高风险和高风险承受能力的谨慎型、稳健型、积极型和激进型的合格投资者。
当 事 人	管 理 人	东莞证券股份有限公司
	托 管 人	招商银行股份有限公司
	代理推广机构	东莞证券股份有限公司、招商银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司。
集 合 计 划 的 参 与	办理时间	本集合计划每满3个月开放一次，每次开放2个工作日，开放期内投资者可参与、退出本集合计划，具体安排以管理人网站公告为准。若管理人提前结束或延长开放期，将提前于管理人网站公告。
	办理场所	委托人可以以本集合计划推广机构指定方式申请参与集合计划。
	办理方式、程序	<p>1、参与原则</p> <p>(a) 存续期内，本集合计划参与价格为参与申请日集合计划单位净值；；</p> <p>(b) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；</p> <p>(c) 本集合计划可以采用电子签名合同，委托人在签署电子签名约定书，并以电子签名方式签署电子签名合同后方可参与本集合计划。委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。</p> <p>2、办理方式、程序</p> <p>(a) 投资者按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理；</p> <p>(b) 投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购/申购的货币资金；若交易账户内参与资金不足，推广机构不受理该笔参与申请；</p> <p>(c) 投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后，</p>

		<p>构成本合同的有效组成部分；</p> <p>(d) 投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销；</p> <p>(e) 投资者于 T 日提交参与申请后，可于 T+2 日后在办理参与的推广机构查询参与确认情况。</p>
	参与费	本集合计划免收参与费，即参与费率为 0；
	认购资金利息	委托人的参与资金在推广期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有。
集合计划的退出	办理时间	存续期内，投资者可在本集合计划开放日办理退出业务，具体开放安排以管理人的公告为准。
	办理场所	委托人可以以本集合计划推广机构指定方式申请退出集合计划。
	办理方式、程序	<p>1、退出的原则</p> <p>(a) “未知价”原则，即退出份额的价格以退出申请日集合计划单位净值为基准进行计算；</p> <p>(b) “份额退出”原则，即退出以份额申请；</p> <p>(c) “先进先出”原则，即按照委托人份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额；</p> <p>(d) 退出申请一经确认不可更改或撤销。</p> <p>2、退出的程序和确认</p> <p>(1) 投资者按推广机构的具体安排，在规定的交易时间段内办理；</p> <p>(2) 投资者退出申请确认后，其退出申请不得撤销；当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销；</p> <p>(3) 投资者于 T 日提交退出申请后，可于 T+2 日后在推广机构查询退出确认情况。</p> <p>(4) 退出款项划付：委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定账户，退出款项将在 T+10 内从托管账户划出。如集合计划出现暂停估值、拒绝或暂停退出的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。</p>
	退出费	本集合计划免收退出费用。
	大额退出及预约申请	无。
	巨额赎回	<p>1、巨额退出的认定：本集合计划单个开放日，集合计划退出份额确认超过上一日集合计划总份额的 10% 时，为巨额退出。</p> <p>2、巨额退出的处理方式：巨额退出申请发生时，管理人可以根据本集合计划当时的现金情况决定全额退出、顺延退出或者暂停退出；</p> <p>全额退出：当管理人认为有足够能力支付委托人的全额退出申请时，按正常的退出程序办理；</p> <p>顺延退出：巨额退出申请发生时，管理人在当日接受退出份额超过上一日本集合计划</p>

		<p>总份额 10%的前提下,可以对其余退出申请延期办理,但延期时间不得超过二十个工作日。对于当日的退出申请,应当按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例,确定当日受理的退出份额;未受理部分可延迟至下一个工作日办理,退出价格为下一个工作日的单位净值,委托人可在申请退出时选择将当日未获受理部分予以撤消。如顺延后仍发生巨额退出,且管理人未宣布暂停退出,仍继续按比例受理退出份额。</p> <p>暂停退出:本集合计划连续两个开放日发生巨额退出,管理人可按说明书及《集合资产管理合同》载明的约定,暂停接受退出申请,但暂停期限不得超过二十个工作日;已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项,但不得超过正常支付时间二十个工作日,并应当在指定媒体上进行公告。</p> <p>3、告知客户的方式</p> <p>当发生巨额退出并采用超额部分延期退出或者发生暂停退出情形时,管理人应及时将有关情况向管理人所在地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告,并通过管理人网站通告委托人,说明有关处理方法。</p>
	<p>连续大额退出的认定和处理方式</p>	<p>无。</p>
<p><b>管理人自有资金参与情况</b></p>		<p>1、自有资金参与的条件</p> <p>管理人可以自有资金参与本集合计划,应符合《管理办法》、《实施细则》、《证券公司客户资产管理业务规范》和中国证监会及中国证券业协会的相关规定。</p> <p>2、自有资金的参与方式</p> <p>在存续期内,管理人可以自有资金参与本集合计划。</p> <p>3、自有资金参与的金额和比例</p> <p>管理人以自有资金参与本集合计划的份额,不得超过本集合计划总份额的20%,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,管理人应当在超限之日起的最近开放期内将部分自有资金参与份额退出,以符合法规要求。集合计划存续期间,管理人自有资金参与集合计划的持有期限不得少于6个月。</p> <p>4、自有资金的收益分配</p> <p>管理人以自有资金参与份额与同类型其他份额投资者享有同等收益分配权利和义务。</p> <p>5、自有资金责任承担方式和金额</p> <p>管理人以自有资金参与份额与同类型其他份额投资者享有同等权利和义务。</p> <p>6、自有资金退出的条件</p> <p>管理人以自有资金参与、以参与本集合计划持有的份额退出时,应当提前5个工作日通过管理人网站公告,告知委托人和托管人。</p>

		<p>为应对流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以自有资金参与或退出集合计划可不受上述限制，但需事后及时告知委托人和托管人，并向管理人住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构及中国证券投资基金业协会报告；</p> <p>7、风险揭示和信息披露：</p> <p>集合计划管理人按上述约定以自有资金参与本集合计划份额，不能构成对本集合计划份额本金及收益不受损失的保证。</p> <p>管理人自有资金退出时应当提前5个工作日公告委托人和托管人。</p>
<b>集合计划的分类</b>		本集合计划不设分类。
<b>集合计划成立的条件、时间</b>		<p>当集合计划推广期结束后，若符合下列条件：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、推广过程符合法律、行政法规和中国证监会的规定；</li> <li>2、募集金额不低于1亿元人民币（不含管理人资金）；</li> <li>3、委托人不少于2人（不含管理人）；</li> <li>4、符合集合资产管理合同及计划说明书的约定；</li> <li>5、中国证监会规定的其他条件。</li> </ol> <p>则管理人可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募集的资金进行验资并出具验资报告后，宣告本集合计划成立。验资报告出具后的次日为本集合计划的成立日。</p> <p>集合计划募集结束前，委托人的参与资金只能存入证券登记结算机构指定的专门账户，不得动用。</p>
<b>集合计划设立失败（本金及利息返还方式）</b>		<p>集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币1亿元或委托人的人数少于2人条件下，或推广期内发生使本集合计划无法设立的不可抗力事件，则本集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部推广费用，并将已认购资金及同期利息在推广期结束后30个工作日内退还集合计划委托人。</p>
<b>集合计划份额转让</b>		<p>本集合计划份额暂时不可转让；未来，在转让条件及技术成熟的情况下可以转让，且管理人需提前10个工作日公告相关安排。</p>
<b>费用、报酬</b>	费用种类（计提标准、方法、支付方式）	<p>1、托管费：</p> <p>本集合计划托管人托管费按前一日集合计划资产净值的0.15%年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ <p>H 为每日应计提的托管费；</p> <p>E 为前一日集合计划资产净值。</p>

		<p>集合计划托管费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人指令于每季度初5个工作日内将托管费用从集合计划资产中一次性支付给托管人。</p> <p>2、管理费： 本集合计划管理人管理费按前一日集合计划资产净值的1%年费率计提，计算方法如下： <math>H = E \times 1\% \div \text{当年天数}</math> H为每日应计提的管理费； E为前一日集合计划资产净值。</p> <p>集合计划管理费每日计提，按季支付。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人根据管理人指令于每季度初5个工作日内将管理费用从集合计划资产中一次性支付给管理人。。</p> <p>3、管理费和托管费的调整 管理人和托管人可协商调减管理费和托管费，并在新的费率开始实施前3个工作日在管理人指定网站公告。</p> <p>4、证券交易费用：本集合计划证券交易费用包括集合计划运作期间投资所发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、印花税等有关税费，作为交易成本直接扣除。</p> <p>5、证券账户开户费用：证券账户开户费由托管人在开户时先行垫付，产品在证券账户开户一个月内成立的，经管理人与托管人核对无误后，自证券账户开户一个月内由托管人从集合计划中扣划；如证券账户开户一个月内产品未能成立，由管理人在收到托管人缴费通知后的5个工作日内支付给托管人，托管人不承担垫付开户费用义务。</p> <p>6、其他费用：除交易手续费、印花税、管理费、业绩报酬、托管费之外的集合计划费用，例如本集合计划成立后的信息披露费用、注册登记费用等，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体约定，按费用实际支出金额列入费用，从集合计划资产中支付。</p> <p>7、增值税等应纳税费： 本集合计划运营过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，法律法规有其他规定的，从其规定；本集合计划运营过程中发生的增值税及附加税费在本集合计划委托资产中列支，集合计划应每月计征应交增值税及附加税费，由管理人、托管人根据规定在纳税申报期结束前将应交增值税及附加税费款项划至管理人指定的缴税账户，管理人按规定缴纳增值税及附加税费。法律、法规及其他规范性文件对资产管理计划运营过程中发生的应税行为另有规定的，管理人根据规定执行。</p>
	不由集合计划承担的费用	<p>集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与推广有关的费用，不得在集合计划资产中列支。管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失以及处理与集合计划运作无关的事项发生的费用等不得列入集合计划费用，由管理人和托管人根据相应责任各自承担。</p>
	业绩报酬	<p>本集合计划在集合计划分红日、委托人份额退出或集合计划终止清算时，管理人根据实际年化收益率提取业绩报酬。</p> <p>本集合计划业绩报酬计提基准为3.6%，对于集合计划实际年化收益率大于对应份额业绩报酬计提基准的部分，管理人按照60%的比例计提业绩报酬。业绩报酬计提基准是管理人通过深入分析国内外宏观经济形势、社会资金及金融市场利率走势，依据所投资品种综合收益预测，并不是管理人向委托人承诺的预期收益或保证收益，委托人将自行承担投资风险。</p> <p>1、业绩报酬提取原则</p>

		<p>(1) 在符合业绩报酬计提条件时, 本集合计划在分红日、委托人份额退出和本集合计划终止清算时计提业绩报酬;</p> <p>(2) 分红时提取业绩报酬的, 业绩报酬从分红资金中扣除; 委托人份额退出时提取业绩报酬的, 业绩报酬从退出资金中扣除; 集合计划终止清算时提取业绩报酬的, 业绩报酬从清算资产中扣除。</p> <p>2、业绩报酬计算方法</p> <p>以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(以下简称“上一个业绩报酬计提日”)到本次业绩报酬计提日为计提区间计算年化收益率R。</p> <p>年化收益率R计算公式如下:</p> $R=100\%*(P1-P0)/(P*D)*(当年天数)$ <p>P1=业绩报酬计提日的单位累计净值  P0=上一业绩报酬计提日的单位累计净值  P=上一业绩报酬计提日的单位净值  D=计提区间存续天数  R=年化收益率</p> <p>业绩报酬的计算公式为:</p> $E=K*(R-R0)*60%*D/(当年天数)$ <p>E=业绩报酬  R0=业绩报酬计提基准  K=业绩报酬计提日对应的份额×上一业绩报酬计提日单位净值</p> <p>3、业绩报酬的支付</p> <p>提取业绩报酬时, 由管理人向托管人发送业绩报酬划款指令, 托管人根据管理人指令将业绩报酬划拨给注册登记机构, 由注册登记机构支付给管理人。若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延。</p>
收益分配	收益构成	<p>集合计划的收益包括: 集合计划投资所得债券利息、红利、买卖证券价差、股票质押式回购利息、银行存款利息及其他合法收入。</p> <p>集合计划的净收益为集合计划收益扣除按照国家有关规定可以在集合计划收益中扣除的费用后的余额。</p>
	收益分配原则及分配说明	<p>1、收益分配原则</p> <p>(1) 每一份份额享有同等的分配权。</p> <p>(2) T日日终参与成功的计划份额不享有T日分红权益, 自T+1日起享有分红权益; T日退出的计划份额享有T日分红权益, 自T+1日起不享有分红权益。</p> <p>(3) 集合计划收益的分配默认采用红利再投资方式, 委托人可以通过推广机构或交易系统选择采用现金分红方式。</p> <p>(4) 集合计划收益分配次数每年不超过2次; 具体分配基准、比例、时间等以管理人公告为准;</p> <p>(5) 收益分配时发生的银行转账等手续费用由委托人自行承担。</p> <p>(6) 法律法规或监管机构另有规定的, 从其规定。</p> <p>2、收益分配方式说明</p> <p>收益分配方案由管理人公布并实施, 收益分配方案须载明集合计划收益分配对象、分配时间、分配方式等内容。收益分配方案由管理人拟定并通知托管人, 由管理人公告确定。</p> <p>委托人可选择现金红利或红利转投, 本集合计划收益分配方式默认为红利转投。委托人选择红利转投, 即将现金红利按除权日的单位净值自动转为计划份额进行再投资; 委托人选择现金红利, 即管理人将现金红利款划往推广机构账户, 再由推广机构划入委托人账</p>

		户，现金红利款自款项从集合计划托管账户划出之日起7个工作日内到达委托人账户。
集合计划展期		不展期。
终止和清算		<p><b>一、有下列情形之一的，本集合计划应当终止：</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、集合计划存续期内，委托人少于2人（不含管理人）；</li> <li>2、集合计划管理人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；</li> <li>3、集合计划托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消相关业务管理资格，而管理人未能在合理时间与新的托管人签订托管协议；</li> <li>4、计划管理人因解散、破产、撤销、停止营业，不能履行相应职责；</li> <li>5、集合计划托管人因解散、破产、撤销、停止营业等原因不能履行相应职责，而管理人未能在合理时间与新的托管人签订托管协议；</li> <li>6、战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续；</li> <li>7、法律法规及中国证监会规定的其他情形。</li> </ol> <p>自集合计划终止之日，与集合计划有关的所有交易应立即停止。</p> <p><b>二、集合计划的终止时间</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、如果委托人持有集合计划份额至集合计划终止，则其合同自集合计划资产分配结束之日终止；</li> <li>2、如果委托人在开放日将其持有的集合计划份额全部退出，则其合同自其集合计划份额全部退出之日终止；</li> <li>3、法律法规及中国证监会规定的其他情形。</li> </ol> <p><b>三、集合计划的清算</b></p> <p><b>1、资产清算主体</b></p> <p>本集合计划终止后5个工作日内，由管理人、托管人或其接管人组织成立清算小组，共同负责有关计划的清算事宜。</p> <p><b>2、清算原则</b></p> <p>管理人和托管人在扣除清算费用、管理费、托管费等费用并按照合同约定提取业绩报酬后，将集合计划资产按照委托人持有集合计划份额的比例，以现金形式分派给委托人。</p> <p><b>3、清算程序</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 当本集合计划终止后，对计划资产进行清理和确认；</li> </ol>



	<p>(2) 对资产进行评估和变现；</p> <p>(3) 聘请具有证券从业资格的会计师事务所进行审计；</p> <p>(4) 将清算结果报告中国证监会及管理人所在地的派出机构；</p> <p>(5) 将清算结果报告委托人；</p> <p>(6) 对资产进行分配。</p> <p><b>4、清算费用</b></p> <p>清算费用是指管理人在进行资产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由管理人优先从清算资产中支出。</p> <p><b>5、二次清算安排</b></p> <p>委托人同意，如本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案，该方案应经托管人认可，并通过管理人网站进行披露。</p> <p>若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券，管理人应根据上述二次清算方案的约定，对该部分未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产按照委托人拥有份额的比例，以货币形式全部分配给委托人。</p> <p><b>6、清算公告</b></p> <p>本集合计划终止后5个工作日内管理人开始清算集合计划资产；清算过程中的有关重大事项须及时向委托人报告；清算结果由管理人清算结束后10个工作日内向委托人报告，清算结束后15个工作日内报住所地中国证监会派出机构备案。</p> <p><b>7、集合计划剩余资产的分配</b></p> <p>本集合计划终止之日起30个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费及业绩报酬等费用后，将集合资产按照委托人拥有份额的比例，以货币形式分配给委托人。</p> <p><b>8、清算账册及文件的保存</b></p> <p>集合计划清算账册及有关文件由托管人按相关法律法规妥善保存，保存期不少于二十年。</p>
<b>特别说明</b>	本说明书作为《管理合同》的重要组成部分，与《管理合同》具有同等法律效力。