东莞证券股份有限公司关于旗下集合资产管理计划估值方法调整的公告

尊敬的投资者：

我公司旗下管理的部分集合资产管理计划资产管理合同（以下简称“资产管理合同”）约定：如有确凿证据表明按资产管理合同约定的估值方法进行估值不能客观反映集合资产管理计划公允价值的，管理人可根据具体情况并与托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。经与相关集合资产管理计划托管人协商一致，现我公司决定自2022年2月23日（含）起，将旗下管理的部分集合资产管理计划持有的固定收益类品种的估值方法作统一调整，具体情况如下：

一、固定收益类品种的估值方法统一调整为：

（1）证券交易所上市的有价证券的估值：

交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日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进行估值。

交易所上市交易的可转换债券以每日收盘价作为估值全价。

交易所上市不存在活跃市场的有价证券，选取估值日

第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。交易所市场挂牌转让的资产支持证券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

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，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

（2）首次公开发行未上市的债券，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值，在第三方估值机构还未提供估值净价前按成本估值。

（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的变动的情况下，按成本估值。

（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）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。

（6）银行存款以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

二、估值方法调整涉及的集合资产管理计划包括：

序号	产品名称
1	东莞证券旗峰半年盈1号集合资产管理计划
2	东莞证券旗峰半年盈3号集合资产管理计划
3	东莞证券旗峰半年盈4号集合资产管理计划
4	东莞证券旗峰半年盈5号集合资产管理计划
5	东莞证券均益1号集合资产管理计划
6	东莞证券旗峰半年盈8号集合资产管理计划
7	东莞证券旗峰季季盈1号集合资产管理计划
8	东莞证券旗峰周周盈集合资产管理计划
9	东莞证券均益2号集合资产管理计划
10	东莞证券旗峰半年盈9号集合资产管理计划
11	东莞证券旗峰季季盈2号集合资产管理计划
12	东莞证券旗峰半年盈10号集合资产管理计划
13	东莞证券旗峰周周盈2号集合资产管理计划
14	东莞证券均益3号集合资产管理计划
15	东莞证券旗峰月月盈1号集合资产管理计划
16	东莞证券旗峰季季盈3号集合资产管理计划

17	东莞证券旗峰年年盈1号集合资产管理计划
18	东莞证券旗峰半年盈12号集合资产管理计划
19	东莞证券旗峰年年盈2号集合资产管理计划
20	东莞证券旗峰半年盈13号集合资产管理计划
21	东莞证券怡合达创业板员工持股集合资产管理计划
22	东莞证券均益6号集合资产管理计划
23	东莞证券德宝1号FOF集合资产管理计划
24	东莞证券德宝2号FOF集合资产管理计划

三、估值方法调整当日（即 2022 年 2 月 23 日），上述集合资产管理计划的资产净值和单位净值可能受估值方法调整影响发生变动，敬请投资者注意。

四、本次估值方法调整事项将不再通过书面修改资产管理合同的方式进行修改，资产管理合同等文件中约定的估值方法与本公告不一致的，以本公告为准。

特此公告。

东莞证券股份有限公司

2022年2月23日