

关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更的公告

尊敬的各位委托人：

由东莞证券股份有限公司（以下简称“管理人”）管理，兴业银行股份有限公司（以下简称“托管人”）托管的东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）已成立运作。为了给委托人提供更加优质的投资理财服务，根据相关法律法规及《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“原《资产管理合同》”）第二十四条“资产管理合同的变更、终止与财产清算”关于“由于其他原因需要变更合同的（除本合同另有约定外），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 个工作日内通过管理人网站或其他适当方式向委托人发送合同变更征询意见。委托人应在征询意见发出后的 5 个工作日内给出书面或其他约定方式的答复。委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意合同变更”的相关约定，现管理人与托管人经协商一致对原《资产管理合同》部分条款及相关文字表述进行第一次变更，并同时按照监管机构要求变更相关备案和报告的报送条款，本次变更主要内容见附件 1《关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划合同变更对照表》。

《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书》《东

莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划托管协议》《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书》以及相关推广发行资料等法律文件涉及相关内容一并进行修订。

本集合计划已于 2022 年 2 月 23 日进行估值方法调整并在管理人官网进行公告披露，本次资产管理合同变更仅针对相关合同条款进行配套更新，不涉及估值方法调整。

本次资产管理合同变更已取得托管人的同意，现管理人以公告形式向委托人征询意见。本次资产管理合同变更征询意见期间为 2022 年 6 月 10 日至 2022 年 6 月 16 日，本集合计划委托人可通过《关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划合同变更意见回复函》签字捺印或盖章的形式回复“同意”或“不同意”合同变更。

本次资产管理合同变更征询意见期间内，委托人可以通过下列任一方式反馈意见：

- 1、传真号码：0769-22119402
- 2、电子邮件：zcgl@dgzq.com.cn
- 3、邮寄地址：广东省东莞市可园南路 1 号金源中心 21 楼深圳分公司

本着尊重客户意愿的原则，委托人不同意本次资产管理合同变更的，应于临时开放日 2022 年 6 月 17 日提出退出本集合计划的申请，进行份额退出。逾期未提出退出申请的，则视为委托人已以行为表明其最终确定的意思表示为同意公告中载明的全部变更事项。

本次资产管理合同变更将于 2022 年 6 月 20 日生效。

变更后的资产管理合同等材料通过管理人网站进行披露，敬请各位委托人认真阅读。

特此公告！

附件 1：关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划
合同变更对照表

附件 2：关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划
合同变更意见回复函

附件 3：东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产
管理合同（第一次合同变更）

附件 4：东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划托管
协议（第一次合同变更）

附件 5：东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划风险
揭示书（第一次合同变更）

附件 6：东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划说明
书（第一次合同变更）

东莞证券股份有限公司

年 月 日

附件 1:

关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划
合同变更对照表

变更前	变更后
二、释义	
单位净值：指集合计划资产净值除以计划总份额。	单位净值、份额净值：指集合计划资产净值除以计划总份额。 单位累计净值：指每份额净值与集合计划成立日以来每份额累计分红派息及历次清算分配所得之和。
五、资产管理计划的基本情况	
5.5 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级 5.5.3 投资比例 本集合计划资产的配置比例如下： (4)本集合计划投资于债权类底层资产的比例不超过 80%；投资于股权类底层资产的比例不超过 80%。底层资产的投资比例应当按照所投资的资产管理产品披露投资组合的频率进行计算； 投资于公募基金的，不穿透计算底层资产比例；	5.5 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级 5.5.3 投资比例 本集合计划资产的配置比例如下： (4) 本集合计划投资于债权类底层资产的比例不超过 80%；投资于股权类底层资产的比例不超过 80%。底层资产的投资比例应当按照所投资的资产管理产品披露投资组合的频率进行计算；
八、资产管理计划的参与、退出与转让	
8.1 集合计划的参与和退出安排 8.1.2 开放日安排 本集合计划自成立之日起 6 个月内为封闭期，封闭期内不办理参与退出业务；本集合计划成立满 6 个月后，每满 3 个月的首个工作日开放一次，管理人可依据实际情况酌情延长开放期，但延长日期原则上不得超过 10 个工作日，具体开放安排以管理人公告为准。投资者每笔份额持有时间不得少于 365 天（自然日），最短持有期满后，投资者可在开放期办理退出业务。开放期内，投资者可以根据本合同约定办理参与和持有期满	8.1 集合计划的参与和退出安排 8.1.2 开放日安排 本集合计划自成立之日起 6 个月内为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务；本集合计划成立满 6 个月后，每满 3 个月的首个工作日开放一次，管理人可依据实际情况酌情延长开放期，但延长日期原则上不得超过 10 个工作日，具体开放安排以管理人公告为准。投资者每笔份额持有时间不得少于 360 天（自然日），最短持有期满后，投资者可在开放期办理退出业务。开放期内，投资者可以根据本合同约定办理参与

份额的退出业务。在存续期内，管理人可视运作情况对开放期净参与规模上限及单个委托人参与金额上限进行限制，具体由管理人公告确定。	和持有期满份额的退出业务。在存续期内，管理人可视运作情况对开放期净参与规模上限及单个委托人参与金额上限进行限制，具体由管理人公告确定。
十一、资产管理计划的投资	
11.2 投资范围及比例 11.2.2 投资比例 本集合计划资产的配置比例如下： (4)本集合计划投资于债权类底层资产的比例不超过 80%；投资于股权类底层资产的比例不超过 80%。底层资产的投资比例应当按照所投资的资产管理产品披露投资组合的频率进行计算；投资于公募基金的，不穿透计算底层资产比例；	11.2 投资范围及比例 11.2.2 投资比例 本集合计划资产的配置比例如下： (4) 本集合计划投资于债权类底层资产的比例不超过 80%；投资于股权类底层资产的比例不超过 80%。底层资产的投资比例应当按照所投资的资产管理产品披露投资组合的频率进行计算；
十四、利益冲突及关联交易	
14.2 本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率 14.2.1 管理人将本计划资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，或进行其他关联交易（包括重大关联交易）的，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，交易完成后，管理人应书面通知托管人，以公告的形式通知委托人。 14.2.2 委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事前文已经明确列明的关联交易情形，管理人无需就前述具体关联交易再行分别取得委托人的授权，但该等关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。	14.2 本计划存在利益冲突的处理方式、披露方式、披露内容和披露频率 14.2.1 管理人将本计划资产投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券的，管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，交易完成后，管理人应书面通知托管人，以公告的形式通知委托人。 14.2.2 委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事前文已经明确列明的关联交易及利益冲突情形，管理人无需就前述具体关联交易及利益冲突再行分别取得委托人的授权，但该等关联交易及利益冲突投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待委托财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益。
十七、指令的发送、确认和执行	

17.8 其它事项 	17.8 其它事项 17.8.6 资金前端控制安排 根据上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则等有关规定，证券交易所、中国结算对管理人、托管人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，管理人、托管人需按照规定进行最高额度及自设额度的申报，通过证券交易所对本集合计划实施资金前端控制。如因管理人或托管人原因导致额度申报出现异常，并进而导致本集合计划无法交易，造成损失的，由过错方承担相应责任。
十九、资产管理计划财产的估值和会计核算	
19.3集合计划财产的估值方法： 19.3.1固定收益品种的估值方法 （1）在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理： 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；估值日无交易的，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，可参考监管机构和行业协会估值意见，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。 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；估值日无交易的，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	19.3集合计划财产的估值方法： 19.3.1 固定收益品种的估值方法 （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

交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考监管机构和行业协会估值意见，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)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，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。 (3)全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，采用中债登公布的收益率曲线及估值价格确定公允价值。 (4)同一债券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。	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。
二十二、信息披露与报告	
22.4 托管人履职报告 1、托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的	22.4 托管人履职报告 22.4.1 托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人出具托管人履职报告。管理人根据本合同约定的方式向投资者披露本集合计划的季度报告、年度报告。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。	
28.2 管理人、托管人确认，已向委托人明确说明集合计划的风险，不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益；本合同内第十一条、第十四条、第二十条、第二十四条、第二十五条、第二十八条等涉及与投资者有重大利害关系的条款，委托人确认，已充分理解本合同的内容，自行承担投资风险和损失。	28.2 管理人、托管人确认，已向委托人明确说明集合计划的风险，不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益；本合同内第三条、第四条、第五条、第八条、第十一条、第十四条、第二十条、第二十一条、第二十三条、第二十四条、第二十五条、第二十六条、第二十八条等涉及与投资者有重大利害关系的条款，委托人确认，已充分理解本合同的内容，自行承担投资风险和损失。

附件 2

关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划 合同变更意见回复函

本委托人于此声明和承诺已详细、认真阅读并知悉《关于东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同变更的公告》（以下简称《公告》）的相关内容，清楚相关投资风险。本委托人书面答复“同意内容变更”或在“同意内容变更”栏目进行勾选，则视为委托人同意本次合同变更，并愿意根据《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划资产管理合同（第一次合同变更）》《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划说明书（第一次合同变更）》《东莞证券德宝 1 号 FOF 集合资产管理计划风险揭示书（第一次合同变更）》和《公告》的规定享有收益和自行承担损失，承担相应的决策后果。本委托人书面答复“不同意内容变更”或在“不同意内容变更”栏目进行勾选，则视为委托人不同意本次合同变更，要求退出本集合计划，并承担相应的决策后果。

本委托人于此声明和承诺本委托人的决策行为及本委托人据以实施决策行为的权限是合法的、正当的、完全的，不存在任何法律法规、已生效或即将生效的任何合同、协议、承诺等方面的约束和障碍。

意见	同意内容变更	不同意内容变更
签字/盖章		

年 月 日

如委托人为自然人

姓 名：

所 属 网 点：

资 金/TA 账 号：

身 份 证 件 号 码：

联 系 地 址：

邮 政 编 码：

联 系 电 话：

电 子 邮 件：

如委托人为机构客户

名 称：

所 属 网 点：

资 金/TA 账 号：

法 定 代 表 人/授 权 签 字 人 姓 名：

营 业 执 照 号 码：

住 所 地：

邮 政 编 码：

联 系 电 话：

电 子 邮 件：