

东莞证券旗峰月月盈1号集合资产管理计划说明书
二〇二〇年

特别提示:

本说明书依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令第151号,以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(证监会公告〔2018〕31号,以下简称《运作管理规定》)及《东莞证券旗峰月月盈1号集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《管理合同》或合同)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。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》、《运作管理规定》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

集 合 计 划 基 本 信 息	名称	东莞证券旗峰月月盈1号集合资产管理计划
	类型	【固定收益类】 集合资产管理计划
	管理期限	本集合计划存续期限为10年,可展期。
	相关费率	1、参与费:0%; 2、退出费:0%; 3、管理费:0.5%; 4、托管费:0.02%; 5、业绩报酬:提取规则参见《管理合同》“资产管理计划的费用与税收”部分。 6、其他费用:参见《管理合同》“资产管理计划的费用与税收”部分。
	风险收益特征	本集合计划风险等级为中低风险等级。
	适合推广对象	本集合计划的适销对象是具有中低风险、中等风险、中高风险和高风险承受能力的谨慎型、稳健型、积极型和激进型合格投资者。
投 资 安 排	风险承担安排	管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用委托财产,但不保证委托财产一定盈利,也不保证最低收益。本集合计划的风险和损失由委托人自行承担。
	投资范围	本集合计划资产投资于国内依法发行的国债、金融债、中期票据、公司债、企业债、地方政府债券、可转债、分离交易可转债、可交换债、短期融资券、债券逆回购、非公开定向债务融资工具(PPN)、银行存款、同业存单、央行票据、债券型基金、货币市场基金。 本集合计划可投资于债券正回购。 法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的,资产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。
投 资 策 略	投资策略	1、资产配置策略 通过深入分析国内外宏观经济指标、各项宏观经济政策及资金流动方向对金融市场特别是货币市场和债券市场的影响,充分利用固定收益类资产的特性,结合本计划的流动性需求,将计划资产在债券资产及其他中短期固定收益类资产间进行合理配置。 2、固定收益资产投资策略 立足于对债券市场内在运行逻辑的深刻理解,把握收益率曲线运动和宏观经济走势的关系;综合使用定性和定量的方法分析不同债券投资品种的绝对价值和相对价值,捕捉潜在的趋势交易机会和套利交易机会;在此基础上,结合对个券风险收益特征的分析构建投资组合,实现投资收益最大化。 (1)久期选择

		<p>通过对宏观经济状况和货币政策的分析,根据中长期的宏观经济走势和经济周期性特征,对债券市场走势作出判断,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整组合的久期。</p> <p>(2) 期限结构配置</p> <p>在确定组合久期后,根据对未来收益率曲线形态变化的预期以及本集合计划的现金流特征确定合理的久期期限结构,相应构建哑铃型、子弹型或阶梯型债券组合。</p> <p>(3) 动态增强型策略</p> <p>积极发现市场失衡和定价错误,运用骑乘策略(根据债券收益曲线形状变动预期为依据来建立和调整组合头寸)、息差策略(利用回购利率低于债券收益率,通过正回购将所获资金投资于债券)、利差策略(对两个期限相近债券利差进行分析并对利差水平未来走势作出判断,从而进行相应债券置换)等主动捕捉潜在的趋势交易机会。</p> <p>3、现金管理类资产投资策略</p> <p>本计划以严谨的市场价值分析为基础,采用稳健的投资组合策略,通过对现金管理类金融品种的组合操作,在保持本金的安全性与资产流动性的同时,追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流,保持投资组合的流动性,满足本计划投资运作的要求。</p>
	投资限制	<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> <ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划参与债券正回购融入资金余额不得超过集合计划资产净值的100%,中国证监会另有规定的除外; 2、除本合同另有约定外,集合计划投资于同一证券资产的资金比例,不得超过集合计划资产净值的25%; 3、集合计划的总资产占净资产的比例不得超过200%; 4、不得将委托资产投向高污染、高能耗行业等不符合国家产业政策、环境保护政策的项目(证券市场投资除外); 5、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。 <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制,履行合同变更程序后,本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。</p>
	投资风险揭示	<p>管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产,但不能完全防止风险出现的可能,本集合可能面临的风险包括但不限于市场风险、流动性风险、管理风险、信用风险、操作风险及其他风险。</p> <p>具体风险揭示内容详见《东莞证券月月盈1号集合资产管理计划风险揭示书》。</p>
当事人概况	管理人	<p>机构名称:东莞证券股份有限公司</p> <p>法定代表人:陈照星</p> <p>住所/通信地址:广东省东莞市莞城区可园南路1号金源中心24楼</p> <p>邮政编码:523000</p>
	托管人	<p>机构名称:宁波银行股份有限公司</p> <p>法定代表人:陆华裕</p> <p>住所/通信地址:浙江省宁波市鄞州区宁东路345号宁波银行大厦</p> <p>邮政编码:510620</p> <p>联系电话:0755-22661805</p>
	投资顾问	本集合计划不聘用投资顾问。
	收益分配	<p>集合计划收益分配应遵循下列原则:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、每一份份额享有同等的分配权; 2、集合计划投资当期出现净亏损,不进行收益分配; 3、集合计划当期收益应先弥补上期亏损后,才可进行当期收益分配; 4、集合计划每个自然年度最多分配2次,具体分配基准、金额、比例、时间等以管理人公告

		<p>为准。</p> <p>5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>
委托人权利及义务	重要权利	<p>(1) 分享资产管理计划财产收益；</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；</p> <p>(3) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；</p> <p>(4) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；</p> <p>(5) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>(6) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他权利。</p>
	重要义务	<p>(1) 委托人应认真阅读并遵守《管理合同》及本说明书，并保证委托资金的来源及用途合法；</p> <p>(2) 委托人应接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；</p> <p>(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，委托人应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(4) 委托人应认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(5) 委托人应按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；</p> <p>(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，委托人承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；</p> <p>(7) 委托人应向管理人或资产管理计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；</p> <p>(8) 委托人不得违反资产管理合同的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(9) 委托人不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>(10) 委托人应保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；</p> <p>(11) 本集合计划采用电子签名合同，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。委托人应当以自己的名义开立资金账户，办理指定手续，用于办理委托划款、红利款项、退出款项以及清算款项的收取。并承诺在《管理合同》有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；</p> <p>(12) 委托人承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》等反洗钱相关法律法规的规定，并承诺将严格遵守上述规定，不会实施任何违反前述规定的非法行为；积极配合管理人进行相应的客户身份识别及反洗钱客户风险等级划分、反洗钱可疑交易报送、涉嫌恐怖融资可疑交易报送等工作；</p> <p>(13) 委托人保证提供给管理人进行身份信息识别的信息和资料均真实、准确、完整、合法。在其身份信息资料发生变更时，应当及时书面告知管理人；委托人预留的有效联系方式发生变更的，应及时通知管理人。如委托人预留联系方式变更未及时通知管理人导致管理人在其认为需要时无法及时联系到委托人的，因此而产生的责任和风险由委托人自行承担；</p> <p>(14) 委托人不得违规转让其所拥有的计划份额；</p> <p>(15) 委托人承诺本次投资行为是为本人/本机构购买集合计划；</p> <p>(16) 委托人承诺不以非法拆分转让为目的购买集合计划，不会突破合格投资者标准，将金融产品份额或其收益权进行非法拆分转让；</p> <p>(17) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和资产管理合同约定的其他义务风险由委托人自行承担。</p>

费用、报酬	费用种类（计提标准、方法、支付方式）	<p>集合计划的费用按照《管理合同》中的约定支付，具体如下：</p> <p>1、集合计划管理人的管理费</p> $T = E \times 0.5\% \div \text{当年实际天数}$ <p>T 为每日应计提的集合计划管理费；</p> <p>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，每季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每季度第一个月首日起 3 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>2、集合计划托管人的托管费</p> $T = E \times 0.02\% \div \text{当年实际天数}$ <p>T 为每日应计提的集合计划托管费；</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，每季度支付一次。经管理人与托管人双方核对无误后，由托管人于每季度第一个月首日起 3 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>委托人在此同意并授权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。委托人签署《管理合同》即同意以上约定。</p> <p>3、参与费、退出费：集合计划不收取参与费、退出费。</p> <p>4、其他费用</p> <p>本集合计划投资运作期间若产生其他费用，在其他费用产生时按照《管理合同》的约定由委托资产列支。</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。原则上业绩报酬的提取频率不超过每 6 个月一次，因委托人退出本集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。</p> <p>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，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>随着宏观经济和利率水平变化，管理人有权按月调整或不调整本集合计划业绩报酬计提基准，具体安排在最近一个开放期前在管理人网站上进行公告。</p> <p>1、管理人业绩报酬提取原则：</p> <p>(1) 在符合业绩报酬计提条件时，本集合计划在分红日、委托人退出和本集合计划终止时计提业绩报酬；</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”，如未发生业绩报酬计提，初始募集期内认购的，以本集合计划成立日为上一个业绩报酬计提日，存续期内认购的，以认购当日为上一个业绩报酬计提日，下同）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>年化收益率计算公式如下：</p> $R = 100\% \times (P1 - P0) / (P0 \times D) \times (\text{当年天数})$ <p>P1 为业绩报酬计提日的单位累计净值；</p> <p>P0 为上一业绩报酬计提日的单位累计净值；</p> <p>P01 为上一业绩报酬计提日的单位净值；</p>

		<p>D 为计提区间存续天数；</p> <p>R 为年化收益率；</p> <p>业绩报酬的计算公式为：</p> $E=K*(R-RO)*60\%*D/(当年天数)$ <p>E= 业绩报酬；</p> <p>RO=业绩报酬计提基准；</p> <p>K= 提取业绩报酬的份额×上一业绩报酬计提日单位资产净值。</p> <p>3、当集合计划份额分红、退出或集合计划终止时，托管人根据管理人指令，将应付给管理人的业绩报酬从托管账户中划拨给管理人，托管人不承担复核职责。</p>
募集期间	募集对象	本集合计划面向合格投资者募集。
	募集期	初始募集期为自本集合计划份额发售之日起不超过 60 天，具体推广时间以本集合计划推广公告为准。
	最低认购金额	本集合计划单个委托人首次认购最低金额为 30 万元人民币，超过最低认购金额的部分不设金额级差。最低认购金额不包含认购费。
	认购安排	<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) 投资者应开设推广机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内认购资金不足，推广机构不受理该笔认购申请；</p> <p>(3) 投资者签署本合同后，方可申请认购集合计划。认购申请经管理人确认有效后，构成本合同的有效组成部分；</p> <p>(4) 在本集合计划初始募集期内，每份额认购价格均为每份额的面值，集合计划的每份面值均为 1.00 元人民币；</p> <p>(5) 投资者认购申请确认成功后，其认购申请和认购资金不得撤销；当日办理业务申请仅能在当日业务办理时间内撤销；</p> <p>(6) 在每日（T 日）办理认购的交易时间结束后，管理人将对委托人认购规模实行汇总统计，以集合计划份额募集规模上限为依据，按“时间优先”的原则，来确定认购成功的份额，认购时间以份额登记系统的确认结果为准；当委托人认购集合计划时间相同时，按“规模优先”原则确定认购成功的份额，认购规模以集合计划管理人的确认结果为准；</p> <p>(7) 投资者于 T 日提交认购申请后，可于 T+2 日后在办理认购的推广机构查询认购确认情况。</p>
信息披露内容、方式、频率	<p>(一) 管理人、托管人应按照《管理办法》和《运作规定》的规定和委托人的要求，向委托人全面披露委托资产的运作情况。管理人应向委托人提供下列信息披露文件：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、资产管理合同、计划说明书和风险揭示书； 2、资产管理计划净值； 3、资产管理计划定期报告，至少包括季度报告和年度报告； 4、重大事项的临时报告； 5、资产管理计划清算报告； 6、中国证监会规定的其他事项。 <p>投资者可按照《管理合同》约定的时间和方式查阅或者复制所披露的信息资料。</p> <p>(二) 集合计划单位净值报告</p> <p>集合计划存续期内应每工作日披露上一工作日集合计划的单位净值。</p> <p>披露方式：管理人指定网站披露。</p> <p>(三) 定期报告</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告 <p>管理人应当在每季度结束之日起一个月内，编制完成产品季度报告并经托管人复核，向委托人</p>	

披露投资状况、投资表现等信息。管理人在季度报告完成后，将有关报告提供托管人复核，托管人在收到后3个工作日内复核，并将复核结果书面通知管理人。委托财产运作不到3个月的，不提供季度报告。管理人应当在每季度结束之日起一个月内，将完成的集合计划资产管理业务季度报告报中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会备案。

2、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人应当在每年度结束之日起四个月内，编制完成产品年度报告并经托管人复核，向委托人披露投资状况、投资表现等信息。管理人在年度报告完成后，将有关报告提供托管人复核，托管人在收到后15个工作日内复核，并将复核结果书面通知管理人。委托财产运作不到3个月的，不提供年度报告。管理人应当在每年度结束之日起四个月内，将完成的集合计划资产管理业务年度报告报中国证监会相关派出机构及中国证券投资基金业协会备案。

年度报告包括但不限于下列信息：

- (1) 管理人履职报告；
- (2) 托管人履职报告；
- (3) 资产管理计划投资表现；
- (4) 资产管理计划投资组合报告；
- (5) 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- (6) 资产管理计划财务会计报告；
- (7) 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用，包括计提基准、计提方式和支付方式；
- (8) 资产管理计划投资收益分配情况；
- (9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- (10) 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

3、年度审计报告

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，管理人应当在每年度结束之日起4个月内将审计结果报中国证券投资基金业协会备案，同时抄送证券公司住所地、资产管理分公司所在地中国证监会派出机构，并将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人提供。

4、对账单

管理人应当每个季度以电子邮件方式向委托人寄送对账单。对账单内容应包括委托人持有集合计划份额的数量及净值，认购、退出明细，以及收益分配等情况。如委托人提供的通讯地址或联系方式不正确等原因导致对账单未能成功送达时，委托人应当联系推广机构，更新通讯地址或联系方式，管理人不对此承担任何责任。委托人亦可以直接登录本集合计划管理人网站（www.dgzq.com.cn）进行查阅。

（四）临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人指定网站、推广机构网站、或其他途径和方式，在事项发生之日起五日内向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- (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；
- (2) 暂停受理或者重新开始受理认购或者退出申请；
- (3) 集合计划终止和清算；
- (4) 管理费、托管费等费用计提方式或费率发生变更；
- (5) 合同的补充、修改与变更；

	<p>(6) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；</p> <p>(7) 负责本集合计划的代理推广机构发生变更；</p> <p>(8) 集合计划投资于管理人、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；</p> <p>(9) 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>(10) 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>(11) 管理人、托管人托管业务部门与《管理合同》项下资产管理计划财产相关的行为受到监管部门的调查；</p> <p>(12) 管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、投资经理受到严重行政处罚，托管人的托管业务或托管业务部门负责人受到严重行政处罚；</p> <p>(13) 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>(五) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。</p> <p>(六) 管理人、托管人应按照监管要求的内容和方式及时向监管机构提供相应的报告。</p>
<p>利益冲突情况及可能影响委托人合法权益的其他重要事项</p>	<p>(一) 关联交易及利益冲突情形</p> <p>在不违反法律法规的强制性规定、不违反本合同约定并严格遵守管理人内部有关投资决策管理及关联交易管理等制度的前提下，本产品可能投资于管理人、托管人及其关联方所发行、管理、保荐、托管、销售或存在其他法律关系或利益联系的金融产品，或者与该等金融产品以公平合理的价格进行交易。</p> <p>托管人应在本计划成立5个工作日内向管理人提供托管人关联方名单，以便履行关联方信息披露义务，如后续托管人关联方名单发生变动的，应在变动之日起20个工作日内书面通知管理人。</p> <p>(二) 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</p> <p>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（包括重大管理交易）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。</p> <p>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。</p> <p>3、本计划在投资运作过程中存在利益冲突情形的，管理人应当坚持委托人利益优先原则，从充分维护委托人利益角度积极处理该等利益冲突情形，防范利益输送等违法违规行为。在发生该等利益冲突时，管理人应当视具体利益冲突情形选择在向委托人提供的定期报告或临时报告中披露。</p>

	<p>(三) 管理人运用受托管理资产从事关联交易的，事后应及时、全面、客观的以公告的方式向投资者披露，并书面通知托管人。</p> <p>管理人运用受托管理资产从事重大关联交易的，应向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。</p> <p>管理人及托管人关联方名单更新以管理人与托管人提供的名单为准。</p>
特别说明	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。