

# 关于东莞证券旗峰半年盈 10 号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，宁波银行股份有限公司（以下简称“托管人”）托管的东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划（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《东莞证券旗峰半年盈 10 号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“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拟对原《资产管理合同》资产管理计划的投资、资产管理计划的费用与税收、风险揭示等内容进行变更，本次变更主要内容见附件 1《关于东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划合同变更对照表》。《东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划说明书》《东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划风险揭示书》等法律文件涉及相关内容一并进行修订。

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 2025 年 11 月 5 日至 2025 年 11 月 11 日，本集合计划委托人可通过对《关于东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划合同变更意见回复函》(附件 2) 签字捺印或盖章的形式回复“同意”或“不同意”合同变更。委托人未在前述时间回复意见的，视为委托人同意本次资产管理合同变更。

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、电子邮件：zcg1@dgzq.com.cn
- 2、邮寄地址：广东省东莞市可园南路一号金源中心 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，务必在 2025 年 11 月 5 日至 2025 年 11 月 11 日征询意见期间内向管理人书面反馈“不同意”本次合同变更的意见，并于临时开放日 2025 年 11 月 13 日提出退出本集合计划的申请，进行份额退出。对于明确书面回复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的委托人，管理人将统一在 2025 年 11 月 13 日当日对该委托人持有的全部份额做强制退出处理。逾期未回复的，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 2025 年 11 月 14 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: 关于东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划合同变更对照表

附件 2: 关于东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划合同变更意见回复函

附件 3: 东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划资产管理合同（第一次合同变更）

附件 4: 东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划说明书（第一次变更）

附件 5: 东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划风险揭示书（第一次变更）

东莞证券股份有限公司

2025 年 10 月 31 日

附件 1:

关于东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划  
合同变更对照表

变更前	变更后
<b>三、承诺与声明</b>	
(三) 投资者声明 <p>1、符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。</p> <p>2、财产的来源及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。</p> <p>3、已充分理解本合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。</p> <p>4、本投资者确认并同意东莞证券基于委托代理销售、宣传、营销、风险提示、告知等业务开展需要或因中国证监会、证券业协会等监管机构要求，在合法、正当、必要原则下通过电话、短信、即时通讯工具、电子邮件、信函等方式收集、存储、使用、加工、传输、提供和公开本投资者的信息。</p> <p>5、本投资者确认，本投资者的信息是以电子或者其他方式记录的能够单独或者与其他信息结合识别本投资者的各种信息，包括本投资者的姓名（名称）、出生日期、身份证件号码（统一社会信用代码）、生物识别信息、住址、电话号码、电子邮箱、健康信息、行踪信息等。</p> <p>6、本投资者同意东莞证券通过电话、短信、即时通讯工具、电子邮件、信函等方式向本投资者传递或</p>	(三) 投资者承诺与声明 <p>1、符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况真实、完整、准确、合法，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。前述信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或者销售机构。</p> <p>2、财产的来源以及用途符合国家有关规定，未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定以及业务决策程序的要求。</p> <p>3、已充分理解资产管理合同条款，了解相关权利义务，了解有关法律法规以及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人以及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或者本金不受损失作出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险。</p> <p>4、本投资者确认并同意东莞证券基于委托代理销售、宣传、营销、风险提示、告知等业务开展需要或因中国证监会、证券业协会等监管机构要求，在合法、正当、必要原则下通过电话、短信、即时通讯工具、电子邮件、信函等方式收集、存储、使用、加工、传输、提供和公开本投资者的信息。</p> <p>5、本投资者确认，本投资者的信息是以电子或者其他方式记录的能够单独或者与其他信息结合识别本投资者的各种信息，包括本投资者的姓名（名称）、出生日期、身份证件号码（统一社会信用代码）、生物识别信息、住址、电话号码、电子邮箱、健康信息、行踪信息等。</p> <p>6、本投资者同意东莞证券通过电话、短信、即时通讯工具、电子邮件、信函等方式向本投资者传递或</p>

险。	发送证券账户信息、业务风险提示、业务告知信息及金融营销信息等。
<b>四、当事人及权利义务</b>	
<p><b>管理人</b></p> <p>机构名称：东莞证券股份有限公司 法定代表人：陈照星 住所/通信地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 24 楼 邮政编码：523000 联系电话：0769-22119271</p> <p><b>托管人</b></p> <p>机构名称：宁波银行股份有限公司 法定代表人：陆华裕 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 邮政编码：510620 联系电话：0755-22661805</p> <p><b>(三) 委托人</b></p> <p><b>2、委托人的义务</b></p> <p>(1) 委托人应认真阅读并遵守本合同及《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) 委托人应当以真实身份参与集合计划；自然人不得用筹集的他人资金参</p>	<p><b>管理人</b></p> <p>机构名称：东莞证券股份有限公司 法定代表人：陈照星 住所/通信地址：广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 21 楼 邮政编码：523000 联系人：杨云露 联系电话：0769-22119271</p> <p><b>托管人</b></p> <p>机构名称：宁波银行股份有限公司 法定代表人：陆华裕 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 邮政编码：315100 联系人：李季 联系电话：0755-22661998</p> <p><b>(三) 投资者的权利和义务</b></p> <p><b>2、投资者的义务</b></p> <p>(1) 认真阅读并遵守本合同及说明书，保证投资资金的来源及用途合法；</p> <p>(2) 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，应当向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(4) 按照规定向管理人或者资产管理计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，配合管理人或者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>(5) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；</p>

<p>与集合计划，法人或者依法成立的其他组织，用筹集的资金参与集合计划的，应当向管理人或其他推广机构提供合法筹集资金的证明文件；</p> <p>(4) 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>(5) 委托人应认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(6) 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>(7) 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>(8) 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>(9) 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>(7) 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、审计费及税费（包括法律法规规定的增值税及附加税费等）等合理费用；</p> <p>(8) 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) 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以及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>(10) 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) 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、投资信息等，依法依规提供信息的除外；</p> <p>(12) 本集合计划可以采用电子签名或纸质合同手写签名、盖章方式签订，委托人应当如实提供与签署电子签名合同或纸质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，并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；</p> <p>(13) 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>(14) 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；投资者预留的有效联系方式发生变更的，应及时通知管理人。如投资者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投资者的，因此而产生的责任和风险由投资者自行承担；</p> <p>(15) 不得违规转让其所拥有的计划份额；</p> <p>(16) 承诺本次投资行为是为本人/本机构购买集合</p>
--	--

<p>(10) 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>(11) 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>(12) 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，并承诺在本合同有效期内，不得撤销该账户，并妥善保管账户资料；</p> <p>(13) 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>计划；</p> <p>(17) 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>(18) 法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他义务。</p>
--	--

<p>(14) 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>(15) 委托人不得违规转让其所拥有的计划份额；</p> <p>(16) 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>(17) 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>(18) 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。</p>	
---	--

## 五、资产管理计划的基本情况

<p>.....</p> <p>(四) 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级</p> <p>1、投资目标：在追求集合计划资产长期安全的基础上，力争为集合计划份额持有人获取稳定的投资收益。</p> <p>2、主要投资方向</p>	<p>.....</p> <p>(五) 投资目标、主要投资方向、投资比例、产品风险等级</p> <p>1、 投资目标：在追求集合计划资产长期安全的基础上，力争为集合计划份额持有人获取稳定的投资收益。</p> <p>2、 主要投资方向</p>
--	--

<p>持有人获取稳定的投资收益。</p> <p><b>2、投资范围</b></p> <p>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。</p> <p>本集合计划可投资于债券正回购。</p> <p>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。</p> <p><b>3、资产配置比例及限制</b></p> <p>本集合计划资产的配置比例如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 债券、银行存款、货币市场基金等债权类资产占资产总值的比例不低于80%；</li> <li>(2) 固定收益类资产中投资可转债、可交换债占资产总值的比例不高于20%；</li> <li>(3) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、</li> </ol>	<p>(1) 本集合计划资产投资于标准化资产，包括国内依法发行的国债、金融债（含金融机构次级债、混合资本债、二级资本债、政策性金融债）、中期票据、公司债、企业债、永续债、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具（PPN）、银行存款、同业存单、大额存单、央行票据。</p> <p>(2) 经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品，公募基金包含债券型基金(含QDII基金)、货币市场基金。</p> <p>(3) 本集合计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）。</p> <p>(4) 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。</p> <p><b>3、投资比例</b></p> <p>本集合计划资产的配置比例如下：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>(1) 债券、银行存款等债权类资产占资产总值的比例不低于80%。</li> <li>(2) 投资同一资产的比例不超过计划资产净值的25%；投资银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</li> <li>(3) 管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%；投资银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</li> <li>(4) 集合计划的总资产占净资产的比例不得超过200%。</li> <li>(5) 本集合计划投资于其他资产管理产品的，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算；本集合计划如投资于其他私募资产管理产品的，应当按照穿透原则合并计算投资同一资产的比例以及投资同一或者同类资产的金额。</li> </ol> <p>产品风险等级：本集合计划属于中低风险收益品种，适销对象是具有中低风险、中等风险、中高风险和</p>
--	--

<p>政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>(4) 管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。投资银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>(5) 债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外；</p> <p>(五) 存续期限 本集合计划存续期限为 10 年，可展期。 .....</p>	<p>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。</p> <p>以上风险等级仅供委托人参考，本集合计划风险等级若发生变化，以管理人公告为准。</p> <p>(六) 存续期限 本集合计划存续期限为自本集合计划成立之日起 10 年，可展期。若本集合计划存续期届满之日为非交易日的，则顺延至下一交易日终止。 .....</p>
<h3>八、资产管理计划的参与、退出与转让</h3>	
<p>2、开放日安排 本集合计划的参与退出在开放期办理。本集合计划自成立之日起 6 个月内为建仓期，建仓期内只办理参与业务，不办理退出业务；本集合计划每个运作周期原则上为 6 个月，每个运作周期结束后开放一次，开放期不超过 10 个工作日，为委托人办理参与、退出业务，具体运作周期、开放期安排由管理人提前 2 个工作日公告确定。</p> <p>4、参与和退出的方式</p> <p>(1) “金额参与、份额退出”原则，即参与以金额申请、退出以份额申请。</p> <p>(2) “先进先出”原则，委</p>	<p>2、开放日安排 本集合计划自成立之日起 6 个月为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务；本集合计划每个运作周期原则上为 6 个月，每个运作周期结束后开放一次，开放期为每个运作周期结束后首三个工作日，开放期均可办理参与业务，但退出业务仅在开放期第一个工作日办理。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。</p> <p>4、参与和退出的方式 .....</p> <p>(3) 管理人有权要求投资者按照管理人或销售机构公告的规则进行退出预约。投资者未按要求预约的，管理人有权拒绝投资者的退出申请。若需要预约的，管理人或销售机构应在最近一次开放期前，通过管理人或销售机构网站通知投资者本次预约退出的具体安排。</p> <p>4、参与和退出的方式</p> <p>(1) “金额参与、份额退出”原则，即参与以金额申</p>

<p>托人在退出集合计划份额时，按先进先出的原则，即对该委托人在该销售机构参与的集合计划份额进行处理时，参与确认日期在先的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出。</p> <p><b>(四) 管理人自有资金参与</b></p> <p>1、自有资金参与的条件 管理人可以自有资金参与本集合计划，应符合《管理办法》、《运作规定》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 在初始募集期、每个开放日，管理人可以自有资金参与本集合计划。</p> <p>3、自有资金参与的比例和限制 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15%，管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划份额不得超过本集合计划总份额的50%，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，管理人应当及时公告退出安排，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>请的方式、退出以份额申请的方式。</p> <p>(2) “先进先出”原则，委托人在退出集合计划份额时，按先进先出的原则，即对该委托人在该销售机构参与的集合计划份额进行处理时，参与确认日期在先的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出。</p> <p>(3) 管理人有权要求投资者按照管理人或销售机构公告的规则进行退出预约。投资者未按要求预约的，管理人有权拒绝投资者的退出申请。若需要预约的，管理人或销售机构应在最近一次开放期前，通过管理人或销售机构网站通知投资者本次预约退出的具体安排。</p> <p><b>(四) 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与、退出</b></p> <p>1、自有资金参与、退出的条件 证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出本集合计划，应符合《管理办法》《运作规定》和中国证监会、中国证券业协会及协会的相关规定。</p> <p>2、自有资金的参与、退出方式 委托人、托管人在此同意，证券期货经营机构及其子公司可以以其自有资金在初始募集期认购本资产管理计划。本集合计划存续期间，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出本集合计划时，管理人应当提前5个工作日在管理人网站公告取得全体委托人同意，并通过邮件或双方认可的方式告知托管人取得其同意。 针对委托人不同意证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与、退出的，管理人应保障其退出的权利，具体退出安排以管理人公告为准。证券期货经营机构及其子公司自有资金参与本集合计划的持有期限不得少于6个月。</p> <p>3、自有资金参与、退出金额和比例限制 在集合计划存续期内，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本集合计划份额合计不得超过本集合计划总份额的50%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的，从其规定。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，证券期货经营机构应当及时</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>为应对本集合计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及其后续退出可不受前款限制，但应及时告知委托人和托管人，并向相关派出机构及证券投资基金管理业协会报告。</p> <p><b>4、自有资金的收益分配</b> 管理人以自有资金参与份额与其他份额投资者享有同等收益分配权利和义务。</p> <p><b>5、自有资金责任承担方式和金额</b> 管理人以自有资金参与份额与其他份额投资者享有同等权利和义务。</p> <p><b>6、风险揭示和信息披露</b> 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个工作日通过管理人网站公告，告知委托人和托管人。</p>	<p>安排自有资金参与份额退出，以符合法规要求，且该自有资金退出可不受前述第2项的限制，但事后应及时告知委托人和托管人。</p> <p><b>4、为应对本集合计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可的其他情形，在不存在利益冲突并遵守本合同约定的前提下，证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与及其后续退出可不受前述第2、3项的限制，但应及时告知委托人和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告或按监管要求报备。</b></p> <p><b>5、自有资金的收益分配</b> 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与其他投资者份额享有同等收益分配权利和义务。</p> <p><b>6、自有资金责任承担方式和金额</b> 证券期货经营机构及其子公司自有资金参与份额与其他投资者份额享有同等权利和义务。</p> <p><b>7、风险揭示</b> 证券期货经营机构及其子公司按上述约定以自有资金参与本集合计划份额，不构成对本集合计划份额本金及收益不受损失的保证。 在本集合计划存续期内，当法律法规或有关自有资金参与、退出本集合计划的规定或政策发生变更，管理人经与托管人协商一致并公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整。委托人对修改或调整的内容有异议，可在修改或调整的内容生效前按照公告要求申请退出集合计划。委托人未退出的，视为同意修改或调整的内容。</p>
--	---

.....	
<b>九、份额持有人大会及日常机构</b>	
本集合计划不设份额持有人大会。	本集合计划不设份额持有人大会及日常机构。
<b>十一、资产管理计划的投资</b>	
<p>.....</p> <p><b>(二) 投资范围及比例</b></p> <p><b>1、投资范围</b></p> <p>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。</p> <p>本集合计划可投资于债券正回购。</p> <p>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。</p> <p><b>2、资产配置比例及限制</b></p> <p>本集合计划资产的配置比如下：</p> <p>(1) 债券、银行存款、货币市场基金等债权类资产占资产总值的比例不低于80%；</p> <p>(2) 固定收益类资产中投资可转债、可交换债占资产总值的比例不高于</p>	<p>.....</p> <p><b>(二) 投资范围</b></p> <p>(1) 本集合计划资产投资于标准化资产，包括国内依法发行的国债、金融债（含金融机构次级债、混合资本债、二级资本债、政策性金融债）、中期票据、公司债、企业债、永续债、资产支持证券（ABS）优先级、资产支持票据（ABN）优先级、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、短期融资券、超短期融资券、非公开定向债务融资工具（PPN）、银行存款、同业存单、大额存单、央行票据。</p> <p>(2) 经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品，公募基金包含债券型基金(含QDII基金)、货币市场基金。</p> <p>(3) 本集合计划可参与债券回购（含正回购、逆回购）。</p> <p>(4) 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。</p> <p><b>(三) 投资策略</b></p> <p>本集合计划将在审慎考虑各类资产的收益性、流动性及风险性特征的前提下，实现风险与收益的合理配比，将采取多策略进行债券资产的组合资产管理，争取为投资者提供稳定的投资回报。</p> <p><b>1、资产配置策略</b></p> <p>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，密切跟踪央行公开市场操作、资金供求、市场流动性、货币市场与资本市场的资金互动、市场参与成员特征等，合理预测利率变化趋势，并据此确定投资组合的总体资产配置策略。</p> <p><b>2、组合久期管理策略</b></p>

<p>20%;</p> <p>(3) 本集合计划投资同一资产的比例不超过计划资产净值的 25%；投资银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>(4) 管理人所管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。投资银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>(5) 债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外。</p> <p><b>(六) 投资策略</b></p> <p><b>1、资产配置策略</b></p> <p>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。</p> <p><b>2、固定收益资产投资策略</b></p> <p>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</p>	<p>本集合计划将结合宏观经济和利率预测的分析，预测未来收益率曲线变动趋势，动态确定并控制投资组合的平均剩余期限。当市场利率上升时，通过增加持有剩余期限较短债券并减持剩余期限较长债券等方式降低组合久期，在预测市场收益率下降时，通过增持剩余期限较长债券等方式提高组合久期。</p> <p><b>3、期限结构配置策略</b></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><b>4、动态增强型策略</b></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><b>5、可转换债券/可交换债券的投资策略</b></p> <p>可转换债券/可交换债券不同于一般企业债券，其持有人具有在一定条件下转股/换股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转换债券/可交换债券内含选择权的价值。本资产管理计划投资于可转换债券/可交换债券，主要目标是降低本资产管理计划净值的下行风险，同时也可分享股票升值的收益潜力。管理人将对可转换债券/可交换债券的发行公司的基本面、利率水平、票息率、派息频率及信用风险等因素进行分析，判断其债券投资价值，制定可转换债券/可交换债券的投资策略。</p> <p><b>6、现金管理类资产投资策略</b></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> <p><b>7、基金投资策略</b></p>
--	--

<p>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。</p>	<p>从基金管理人、基金产品两个角度对基金进行定量定性的全方位评估，全市场筛选公募基金，深度把握其市值、因子、行业等风格，在综合考虑业绩持续性、风格偏好、可交易性等因素后结合市场环境及集合计划特性，自上而下和自下而上相结合地选择投资标的。</p>
<p><b>(1) 久期选择</b></p> <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><b>8、资产支持证券/资产支持票据投资策略</b></p> <p>本集合计划投资资产支持证券/资产支持票据将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规规定和本合同约定的基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。</p>
<p><b>(2) 期限结构配置</b></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><b>2、决策程序</b></p> <p>(1) 管理人资产管理投资决策委员会是本计划投资运作的最高决策机构，负责贯彻落实有关法律法规、管理人的公司制度，授权并监督管理人的资产管理业务部门的工作。</p>
<p><b>(3) 动态增强型策略</b></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</p>	<p>(2) 管理人资产管理部门负责人负责领导资产管理业务的投资团队，监控投资决策和投资执行过程；参与产品重大投资项目审核。</p> <p>(3) 管理人资产管理部门投资管理机构确定产品的投资策略。</p> <p>(4) 管理人投资经理依据投资管理机构决议，制定交易策略，进行具体品种的交易。</p>
	<p>管理人有权根据环境变化和实际需要调整决策程序，具体决策程序以管理人内部制度规定的决策程序为准。</p>
	<p><b>(六) 投资限制</b></p> <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"> <li>1、投资可转换债券、可交换债券合计金额占资产总值比例不超过 20%；</li> <li>2、投资永续债占资产总值的比例不高于 25%；</li> <li>3、投资于 QDII 基金占资产总值的比例不高于 15%；</li> <li>4、投资于债项评级 AA 级及以下（对于无债项评级的，以担保人评级为准，对于无债项且无担保人评级的，以主体评级为准）的债券按成本计算合计不</li> </ol>

<p>动捕捉潜在的趋势交易机会。</p>	<p>得高于集合计划资产净值的 30%;</p>
<p><b>3、现金管理类资产投资策略</b></p>	<p>5、债券正回购：融入资金余额不超过集合计划净资产的 100%，中国证监会另有规定的除外；</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>	<p>6、当本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%时，本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%。投资国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外；</p> <p>7、本集合计划开放退出日，其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于本集合计划资产净值的 10%；</p>
<p><b>5、决策程序</b></p>	<p>8、本集合计划参与债券等证券发行申购时，本集合计划所申报的金额原则上不得超过本集合计划的总资产，本集合计划所申报的数量原则上不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p>
<p>(1) 管理人资产管理投资决策委员会是本集合计划管理人进行资产管理投资运作的最高决策机构，贯彻落实有关法律法规、管理人的公司制度，授权并监督管理人的资产管理业务部门的工作。</p>	<p>9、本集合计划不得投资于资产支持证券和资产支持票据的劣后级；如投资于资产支持证券或资产支持票据，其基础资产不得包含信托计划、私募基金、资管产品及其收（受）益权；</p> <p>10、相关法律法规以及监管部门规定的其它禁止或者限制的投资事项。 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> <p>.....</p>
<p>(2) 管理人资产管理部门投资总监负责领导资产管理业务的投资团队管理所属各资产管理计划，监控投资决策和投资执行过程；在公司资产管理投资决策委员会授予的权限范围内，对产品重大资产投资项目进行审核。</p>	
<p>(3) 管理人深圳分公司投资决策小组对本集合计划的资产配置比例等提出指导性意见，负责本集合计划的营运和管理；如遇重</p>	

<p>大事项按制度规定上报公司资产管理投资决策委员会批准。</p> <p>(4) 管理人投资经理依据资产管理投资决策委员会及投资决策小组决议，制定交易策略，进行具体品种的交易。</p> <p>(5) 管理人深圳分公司风控专员根据市场变化对投资计划提出风险防范措施，投资经理依据本集合计划参与退出的情况控制投资组合的流动性风险。</p> <p>(6) 管理人在确保集合计划委托人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整，但应在调整之日起五个工作日内公告。</p> <p><b>(七) 投资限制</b></p> <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> <p>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；</p> <p>2、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%；</p> <p>3、集合计划的总资产占净资产的比例不得超过200%；</p> <p>4、不得将委托资产投向高污染、高能耗行业等不符</p>	
--	--

<p>合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外）；</p> <p>5、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。</p> <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> <p>.....</p>	
<b>十一二、服务机构及投资顾问</b>	
本集合计划不聘用投资顾问。	<p>(一) 本集合资产管理计划份额登记机构为中登公司，估值与核算、信息技术系统服务机构为东莞证券股份有限公司。</p> <p>(二) 本集合计划不聘用投资顾问。</p>
<b>十四、利益冲突及关联交易</b>	
<p><b>(一) 利益冲突</b></p> <p>管理人应切实履行集合资 产管理业务与公司自营业 务、投行业务、经纪业务、 其他证券业务以及不同投 资经理管理的资产管理计 划之间的有效隔离，防范 内幕交易和不同资产管理 计划间的交易，避免利益 冲突；</p> <p>当发生利益冲突时，管理人 应当坚持“委托人利益 优先”原则进行处理，并在 发生之日起5个工作日内通 过管理人网站进行披露。</p> <p><b>(二) 关联交易</b></p> <p>委托人在此同意并授权管 理人可以将集合计划的资 产投资于管理人及管理人 有关联方关系的公司发行</p>	<p>(一) 资产管理计划存在的或者可能存在利益冲突的情形</p> <p>1、从事关联交易；</p> <p>资产管理计划关联方包括：</p> <p>(1) 管理人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方（关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定）；</p> <p>(2) 托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方（关联方范围按照《企业会计准则》的规定确定）；</p> <p>(3) 法律法规、监管机构、行业协会规定的其他情形。</p> <p>关联交易是指：</p> <p>(1) 管理人将本资产管理计划资产投资于资产管理计划关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>(2) 管理人将本资产管理计划资产投资于管理人及其关联方担任管理人的其他资产管理计划；</p> <p>(3) 本资产管理计划以资产管理计划关联方为交易对手，开展现券交易、回购交易；</p> <p>(4) 本资产管理计划接受资产管理计划关联方发行</p>

<p>的证券或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），管理人从事关联交易的，应当符合集合计划的投资目标和策略，遵循集合计划份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，按照公司内部审批机制执行，事后管理人应及时、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>的证券或者承销期内承销的证券作为质押券的逆回购交易；</p> <p>（5）法律法规、监管规定、自律规则等规定为关联交易的其他事项。</p> <p>2、证券期货经营机构及其子公司以自有资金参与本资产管理计划；</p> <p>3、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本资产管理计划；</p> <p>4、其他可能产生利益冲突的情形。</p> <p>除本合同另有约定外，委托人签署本合同，即视为已经充分理解并同意管理人开展上述事项，并自愿承担相关投资风险。</p> <p><b>（二）发生利益冲突时的处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率</b></p> <p>1、管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本资产管理计划财产，公平对待全体委托人，当管理人利益与委托人利益发生重大冲突时，以委托人合法利益为优先，当不同委托人之间发生利益冲突时，应当坚持公平性原则。</p> <p>2、在发生本合同约定的利益冲突情形时，管理人应当视具体利益冲突情形通过公告或定期报告或临时报告的方式，充分向托管人和委托人披露该利益冲突情形的具体内容，并按监管要求报备。</p> <p>3、关于关联交易的特殊约定：</p> <p>资产管理计划的关联交易分为重大关联交易和一般关联交易。</p> <p>（1）重大关联交易是指交易金额达到或超过人民币3000万元的关联交易以及行业协会和监管机构确定的重大关联交易。在开展重大关联交易前，管理人应事先采取逐笔征求意见或公告确认等方式征得投资者的同意；投资者不同意的，管理人保障其退出的权利或终止从事重大关联交易的投资计划。管理人应当在完成重大关联交易后，及时告知托管人并以公告方式及时向委托人披露，并按监管要求报备。</p> <p>（2）一般关联交易是指除重大关联交易以外的关联交易，委托人签署本合同即视为其已经充分理解并同意管理人开展一般关联交易，并自愿承担相关投</p>
--	---

	<p>资风险。管理人应当在定期报告中充分向托管人和委托人披露一般关联交易情况，并按监管要求报备。</p> <p><b>4、关联方的披露查询方式</b></p> <p>管理人应定期或不定期更新管理人关联方名单。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，托管人应及时以邮件等书面形式告知管理人。</p> <p>管理人将在管理人网站披露管理人和托管人的关联方范围。关联方范围披露方式有变化的，管理人通过公告等书面形式予以披露。</p> <p><b>(三) 关联交易的内部控制措施</b></p> <p>管理人已制定资产管理业务投资管理相关制度，并严格按照内部制度规定履行关联交易内部控制程序，按照市场公平合理价格执行。资产管理计划参与一般关联交易的，应经对应投资管理小组、深圳分公司投资总监（或其授权人员）审批同意后交易。涉及重大关联交易的，应经对应投资管理小组、深圳分公司投资总监（或其授权人员）、对应投决委审批同意后交易。具体决策程序以管理人内部制度规定的决策程序为准。</p> <p>管理人关联交易内部控制措施有重大变化的，管理人将在管理人网站中予以披露。</p> <p><b>(四) 前述内容如法律法规或监管部门另有规定的，按其规定处理，管理人通过管理人网站、短信或其他方式告知委托人和托管人相关事宜，无需另行履行合同变更程序。</b></p>
<b>十五、投资经理的指定与变更</b>	
<p><b>(一) 资产管理计划投资主办人由管理人负责指定。</b></p> <p>管理人经研究决定指定雍加兴先生为本集合计划投资经理。</p> <p>雍加兴，男，毕业于中南财经政法大学投资学专业，经济学硕士，2013年以来在东莞证券股份有限</p>	<p><b>(一) 投资经理基本信息与相关业务经验</b></p> <p>本集合计划投资经理为赵夏女士。</p> <p>赵夏，武汉理工大学应用数学专业硕士，通过 FRM。历任中华联合财产保险财务企划、平安数据科技财务中心运营分析、东莞证券深圳分公司风控岗、信用研究员，现任深圳分公司投资经理，具备数学与金融综合学科背景，擅长数据分析、个券挖掘和风险把控。</p> <p>.....</p>

<p>公司深圳分公司从事债券研究和投资工作，历任债券交易员、研究员和产品投资经理助理，现任东莞证券投资经理。债券研究投资经验丰富，擅长宏观研判和投资组合管理。已经取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。</p> <p>.....</p>	
<h2>二十、资产管理计划财产的估值和会计核算</h2>	
<p>.....</p> <p><b>(二) 集合计划财产的估值方法:</b></p> <p>1、固定收益品种的估值方法</p> <p>(1)在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：</p> <p>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。</p> <p>在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券</p>	<p>.....</p> <p><b>(四) 集合计划财产的估值方法及其调整</b></p> <p>1、对于已上市或已挂牌转让的不含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。</p> <p>2、对于已上市或已挂牌转让的含权固定收益品种，选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值。</p> <p>对于含投资者回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值基准服务机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值，同时应充分考虑发行人的信用风险变化对公允价值的影响。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。</p> <p>3、对于在交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。</p> <p>4、对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够的可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。</p> <p>5、对于发行人已破产、发行人未能按时足额偿付本</p>

<p>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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>2、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。</p> <p>3、持有的交易所上市基金，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；持有的场外基金，按估值日前</p>	<p>金或利息，或者有其它可靠信息表明本金或利息无法按时足额偿付的债券投资品种，第三方估值基准服务机构可在提供推荐价格的同时提供价格区间作为公允价值的参考范围以及公允价值存在重大不确定性的相关提示。管理人在与托管人协商一致后，可采用价格区间中的数据作为该债券投资品种的公允价值。</p> <p>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。</p> <p>7、基金（含比照公募基金管理的资产管理产品）的估值方法</p> <p>证券交易所基金，按照估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以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重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定，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；</p> <p>场外基金按照估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值未公布、截止至资产管理计划估值时点前基金管理人未披露或基金管理人未提供的，按照此前最近交易日的基金份额净值估值；</p> <p>货币市场基金，如所投资基金披露份额净值的，则按照所投资基金估值日前一交易日的份额净值估值；如所投资基金披露万份（百份）收益，则按照估值日前一交易日的每万份（百份）收益计算；</p> <p>基金处于封闭期的，按照最新公布或基金管理人提供的份额净值估值；如果未公布份额净值的，按照成本估值。</p> <p>8、回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。</p> <p>9、有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。</p> <p>10、相关法律法规以及监管部门有强制规定，从其</p>
---	---

<p>一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；持有的货币市场基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。</p> <p>4、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值。</p> <p>5、相关法律法规以及监管部门有强制规定，从其规定，如有新增事项，按国家最新规定估值。</p> <p>6、如管理人或托管人发现集合估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护委托人利益的时候，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。</p> <p>7、根据相关法律法规，资产净值计算和会计核算义务由管理人承担，本集合的会计责任方由管理人承</p>	<p>规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。如本合同约定的估值方法与本集合计划存续期新发布的法律法规规定不一致的，按法律法规最新规定估值。 .....</p>
--	--

<p>担，因此，就与本集合有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布，但托管人有权向监管部门报告。由此导致委托人或委托财产遭受损失的，托管人予以免责。</p> <p>.....</p>	
<b>二十二、资产管理计划的费用与税收</b>	
<p><b>(二)可列入集合计划费用的项目</b></p> <p><b>1、证券交易费用</b> 集合计划投资运作期间发生的交易手续费、开放式基金的认（申）购和赎回费、债券交易经纪费用、印花税等有关税费，在收取时从集合计划中扣除。委托人在此同意并授权管理人以管理人指定网站公告的方式披露交易手续费的种类及费率。</p> <p><b>2、其他费用</b> 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，例如证券账户开户费用、审计费、律师费、集合计划信息披露费用、注册登记费用、电子合同费用等，由管理人根据有关法律法规及相应的合同或协议的具体规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从集合计划资产中支付。</p>	<p><b>(一) 集合计划费用的种类</b></p> <p>1、管理人的管理费及业绩报酬（如有）；      2、托管人的托管费；      3、证券交易费用（包括但不限于本计划投资运作期间发生的交易手续费、开放式基金的认购/申购费及赎回费、证管费、经手费、过户费、佣金、印花税等投资运作、交易过程中发生的有关税费）；      4、其他费用（除证券交易费用、管理费及业绩报酬（如有）、托管费之外的本计划费用，例如证券账户开户费用及维护费用、银行汇划费用、审计费、公证费、律师费、信息披露费用、纠纷处理费用（诉讼费、仲裁费、公证费、评估费、鉴定费、查询费、差旅费、拍卖费等）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规定，按费用实际支出金额列入当期费用，从本计划受托资产中支付）；      5、增值税等应纳税费；      6、按照法律法规及本合同的约定可以在受托资产中列支的其他费用。      上述费用中第3至6项费用根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。</p> <p><b>(二) 费率、计提标准、计提方式与支付方式</b></p> <p><b>4、管理人业绩报酬</b> 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，管理人根据集合计划份额的实际年化收益率提取业绩报酬，业绩报酬应当计入总管理费。从分红资金中提取业绩报酬的提取频率</p>

<p>银行间费用（如有）：资产管理人应根据银行间费用相关法律法规及本合同约定，将账户开户、结算管理等各项费用列入或摊入当期委托财产运作费用，经管理人和托管人核对无误后，由管理人授权后划付，管理人收到托管人通知后一个月内未授权划付的，由托管人从委托资产中扣划，无须资产管理人出具指令。资产委托人和资产管理人在此申明已了解委托资产投资会产生的银行费用，并确保账户中有足够资金用于银行费用的支付，如因托管账户中的资金不足以支付银行费用影响到指令的执行，资产托管人不承担由此产生的损失和责任。如委托资产未起始运作，由管理人在收到托管人的缴费通知后完成支付，托管人不承担垫付费用义务。</p>	<p>不超过每6个月一次。 管理人对集合计划实际年化收益率R超过业绩报酬计提基准的部分分档计提业绩报酬，本集合计划的两档业绩报酬计提基准分别为a和b，其中a&lt;b。当业绩报酬计提基准a&lt;R≤业绩报酬计提基准b时，管理人按照40%的比例计提业绩报酬，当业绩报酬计提基准b&lt;R时，管理人计提超过b以上部分收益的60%以及b-a部分的40%作为业绩报酬。 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设定的提取业绩报酬的基准，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。业绩报酬计提基准由管理人确定后通过管理人网站进行公告。随着宏观经济和利率水平变化，管理人有权调整业绩报酬计提基准，并提前在管理人网站上进行公告。</p>
<p><b>3、增值税等应纳税费</b> 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</p>	<p>委托人和托管人签署本合同即视为同意并授权管理人可以直接调低业绩报酬计提比例或调高业绩报酬计提基准，并在管理人指定网站公告。但若管理人拟调高业绩报酬计提比例，应事先按照资产管理合同的约定履行合同变更程序。若管理人拟调低业绩报酬计提基准（应在开放期内调整），应事先履行告知程序，委托人对调低业绩报酬计提基准事项有异议的，可在开放期提出退出本集合计划的申请，具体办理要求和相关事项以管理人公告为准。</p> <p><b>(2) 业绩报酬计算方法：</b> 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。 年化收益率计算公式如下：  <math display="block">R=100\%*(P1-P0)/(P*D)*(当年天数)</math> </p> <p>P1为业绩报酬计提日的单位累计净值；      P0为上一业绩报酬计提日的单位累计净值；      P为上一业绩报酬计提日的单位净值；      D为计提区间存续天数；</p>

<p>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> <p><b>(四) 管理人业绩报酬</b></p> <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>本集合计划每个运作周期为6个月，以后随着宏观经济和利率水平变化，管理人有权调整每个运作周期内的业绩报酬计提基</p>	<p>R 为年化收益率；</p> <p>管理人按照如下标准和方法提取业绩报酬：</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>R</th><th>提取比例</th><th>业绩报酬 E 的计算方式</th></tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>R \leq a</math></td><td>0%</td><td><math>E=0</math></td></tr> <tr> <td><math>a &lt; R \leq b</math></td><td>40%</td><td><math>E=K*(R-a)*40%*D/(当年天数)</math></td></tr> <tr> <td><math>R &gt; b</math></td><td>60%</td><td><math>E=K*(b-a)*40%*D/(当年天数)+K*(R-b)*60%*D/(当年天数)</math></td></tr> </tbody> </table> <p>其中：</p> <p>a、b=业绩报酬计提基准，由管理人公告确定；  E=业绩报酬；  K=业绩报酬计提日对应的份额×上一业绩报酬计提日单位资产净值。</p> <p>.....</p>			R	提取比例	业绩报酬 E 的计算方式	$R \leq a$	0%	$E=0$	$a < R \leq b$	40%	$E=K*(R-a)*40%*D/(当年天数)$	$R > b$	60%	$E=K*(b-a)*40%*D/(当年天数)+K*(R-b)*60%*D/(当年天数)$
R	提取比例	业绩报酬 E 的计算方式													
$R \leq a$	0%	$E=0$													
$a < R \leq b$	40%	$E=K*(R-a)*40%*D/(当年天数)$													
$R > b$	60%	$E=K*(b-a)*40%*D/(当年天数)+K*(R-b)*60%*D/(当年天数)$													
R	提取比例	业绩报酬 E 的计算方式													
$R \leq a$	0%	$E=0$													
$a < R \leq b$	40%	$E=K*(R-a)*40%*D/(当年天数)$													

准，并应在开放期前2个工作日之前在管理人网站上进行公告。

## 2、业绩报酬计算方法：

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。

年化收益率计算公式如下：

$$R=100\%*(P1-P0)/(P01*D)$$

\*(当年天数)

P1 为业绩报酬计提日的单位累计净值；

P0 为上一业绩报酬计提日的单位累计净值；

P01 为上一业绩报酬计提日的单位净值；

D 为计提区间存续天数；

R 为年化收益率；

业绩报酬的计算公式为：

$$E=K*(R-R0)*60\%*D/( \text{当年天数})$$

E= 业绩报酬；

R0=业绩报酬计提基准；

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。

.....

## 二十一\_二、收益分配

<p><b>(五) 收益分配的执行方式</b></p> <p>本集合计划收益分配方式为现金分红。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。</p>	<p><b>(二) 收益分配原则</b></p> <p>集合计划收益分配应遵循下列原则：</p> <p>1、收益分配方式：委托人可选择现金分红或将现金红利按除权日的份额净值自动转为计划份额进行再投资。本集合计划收益分配方式默认为现金分红。</p>
<p><b>二十四、风险揭示</b></p> <p>.....</p>	<p><b>8、投资债券回购的风险</b></p> <p>本计划在进行债券正回购操作时，可能由于回购利率大于债券投资收益以及由于正回购操作导致投资总量放大，致使整个组合风险放大。此外，在进行正回购操作对组合收益进行放大的同时，也对组合的波动性进行了放大，致使组合的风险将会加大。正回购比例越高，风险暴露程度也就越高，对组合造成损失的可能性也就越大。</p> <p>本计划在进行债券逆回购操作时，可能由于逆回购对手方未能按时履约给投资者本金及收益带来风险。</p> <p><b>9、可转换债券和可交换债券投资风险</b></p> <p>(1) 正股价格波动的风险。可转换债券、可交换债券价格与股票市场价格有正向联动性，当股票市场价格下跌时，一定期间内可转换债券价格、可交换债价格下跌甚至跌破票面价的情况也时有发生。虽然不影响到期收益，但正股价格一直下跌，会增加可转换债券、可交换债券的持有风险，也会增加持有的时间成本。</p> <p>(2) 利息损失的风险。当可转换债券、可交换债券发行公司股价一直下跌，转股价（换股价）高于正股价格时，可转换债券（可交换债券）持有人若大部分都不愿转股/换股，造成上市公司短期内面临巨大的偿债压力，最终偿付的利率可能不达预期。</p> <p>(3) 提前赎回的风险。可转换债券、可交换债券发行人在发行可转换债券、可交换债券时就会明确在特定条件下将以某一价格赎回债券，而赎回债券往</p>

往限定了持有人收益率上限，计划投资可转换债券、可交换债券可能面临机会成本的损失。

#### 10、公募基金投资风险

本集合计划投资于公募基金，可能由于管理人对发行公募基金公司的内控信息获取不全，控制力不强，并且所投资公募基金的管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如变更投资经理、管理人判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当等影响公募基金的收益水平，从而产生风险。本集合计划可能投资于 QDII 基金，由于境外投资受到各个国家/地区宏观经济运行情况、货币政策、财政政策、产业政策、税法、汇率、交易规则、结算、托管以及其他运作风险等多种因素的影响，上述因素的波动和变化可能会使 QDII 基金资产面临潜在的风险。境外投资的成本、境外市场的波动性也可能高于国内市场，存在一定的市场风险。此外，受 QDII 基金估值频率、估值提供时间影响，本集合计划单位净值反映底层基金估值提供的最新净值、相对市场或存在延迟情况，从而使得本集合计划单位净值可能无法反映真实投资管理情况。

#### 11、资产支持证券/资产支持票据投资风险

本集合计划投资的资产支持证券/资产支持票据具有一定的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险、与基础资产相关的风险、利率风险、流动性风险等风险。交易结构风险指的是若原始权益人的资产出售是作为资产负债表内融资处理，则当原始权益人破产时，其他债权人对证券化融资工具仍享有追索权，从而导致资产支持证券/资产支持票据的持有人面临本息损失的风险。信用风险指的是资产支持证券/资产支持票据之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于资产支持证券/资产支持票据信用质量降低导致证券价格下降，造成集合计划财产损失。提前偿还风险指的是资产支持证券/资产支持票据一般有提前偿还条款，发行人有权在到期前提前偿还全部或部分债务，可能使得持有人在现金流的时间管理上面临不确定性，同时面临再投资风险。与基础资产相关的风险主要包括特定原始权

益人破产风险、现金流预测风险等与基础资产相关的风险。利率风险指的是市场利率波动会导致资产支持证券/资产支持票据的收益率和价格波动。流动性风险指的是受资产支持证券/资产支持票据市场规模及交易活跃程度的影响，资产支持证券/资产支持票据可能无法在同一价格水平上进行较大量买入或卖出，存在一定的流动性风险。

#### 12、次级债的投资风险

次级债券本金和利息的清偿顺序在发行人的普通债券之后、先于发行人的股权资本，存在次级性风险。受国民经济总体运行状况、国家宏观货币政策等因素的影响，市场利率水平和结构存在波动可能性从而对次级债的投资收益产生影响。如发行人公司所处的宏观经济环境、行业政策和资本市场状况等外部因素发生变化，加上公司本身生产经营中存在的不确定性，可能导致公司不能从预期的还款来源中获得足够的资金，从而影响公司按期偿付本期债券本息的能力，使投资者面临一定的偿付风险。

#### 13、混合资本债与二级资本债的投资风险

混合资本债券是一种介于股本和债务之间的非权益资本工具。从满足资本配置的特定需要来看，通过支持业务增长、满足竞争和监管的要求，它可以提高资本结构的效率。混合资本债券因其较长的期限、特有的股本/债务属性结构可能会给发行人及投资者带来一定的风险。

二级资本债是商业银行发行的一种债券，用于补充银行的二级资本。监管政策变化、债券市场的价格波动均可能对二级资本债的投资价值产生影响，如果市场利率上升或整体市场下跌，二级资本债的价格可能会下降，导致投资者的资本损失。此外，二级资本债的市场流动性可能相对较低，会导致在市场紧张时期无法及时变现的风险，增加了投资的不确定性。

#### 14、永续债投资风险

永续债赋予发行人延期选择权及赎回选择权，没有约定债务偿还期限且条款设置可能较为灵活，且一般设有利率重置条款。本集合计划投资永续债具有一定的信用风险、提前赎回风险、利率风险、流动

	<p>性风险等风险，导致可能在开放期不足以支付委托人退出款项，委托人的本金及收益可能存在较大不确定性的风险。</p> <p><b>15、管理人计提业绩报酬的相关风险</b></p> <p>本集合计划业绩报酬的计提，以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。在集合计划分红日、委托人份额退出或集合计划终止清算，管理人可能计提业绩报酬，该业绩报酬从委托人分红资金、份额退出资金或清算资金中扣除，本集合计划披露的单位净值尚未扣除可能产生的业绩报酬（如有），因此可能存在投资者实际得到的分红资金、份额退出资金或清算资金与其预期不一致的情形。同时由于各笔份额计提业绩报酬的计提区间可能不同，在扣除业绩报酬（如有）后每笔集合计划份额实际得到的分红资金、份额退出资金或清算资金可能有所不同。</p> <p><b>16、投资者参与、退出风险</b></p> <p>(1) 集合计划发生巨额退出或连续巨额退出而引起投资者无法全部退出或因暂停退出使投资者在一定时间内的退出申请被拒绝，从而导致投资者无法按时退出的风险。</p> <p>(2) 投资者需要部分退出本集合计划的，应确保其退出后持有的资产管理计划份额对应的资产净值应当不低于本合同约定的合格投资者最低参与金额，否则管理人有权自动将该投资者的集合计划全部份额一次性退出给投资者，从而导致投资者剩余份额被强制退出的风险。</p>
--	--

注：本次合同变更，管理人按照中国证券投资基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》对《东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划资产管理合同》进行了重述，以上表格列举本次合同变更的核心条款对照，并未涵括全部变更内容，具体以《东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划资产管理合同（第一次合同变更）》为准。

## 附件 2

### 关于东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划 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《关于东莞证券旗峰半年盈 10 号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《东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划资产管理合同（第一次合同变更）》《东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划说明书（第一次变更）》《东莞证券旗峰半年盈 10 号集合资产管理计划风险揭示书（第一次变更）》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：