

太平洋证券合盈2号  
集合资产管理计划说明书

2016年05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》)、《太平洋证券合盈2号集合资产管理合同》(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》、《管理合同》、本说明书及有关规规定享有权利、承担义务。

集 合 计 划 基 本 信 息	名称	太平洋证券合盈2号集合资产管理计划。
	类型	集合资产管理计划。
	目标规模	本集合计划推广期及存续期规模上限为50亿份,户数在200人(含)以下。
	管理期限	本集合资产管理计划无固定存续期限。经委托人、管理人、托管人协商同意,本集合计划运作满1.5年后可提前结束。
	推广期	本集合计划将自推广开始之日起60个工作日内完成集合计划的推广、设立活动,具体时间见管理人公告。
	封闭期、 开放期	本集合计划运作每满1.5年后开放一次,每次为5个工作日; 开放申购赎回期:开放期的5个工作日内均可办理申购和赎回; 临时开放日:管理人可根据产品运作需要,安排临时开放日。封闭期:除开放申购期和开放赎回期外,本集合计划存续期均封闭运作。
	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1,000,000元(扣除认/申购费后),追加参与的最低金额为人民币10,000元(扣除认/申购费后)。
	相关费率	1、认购/申购费:1%; 2、退出费:0; 3、管理费:1%/年; 4、托管费:0.1%/年。
投资范围	本集合计划主要参与认购在证券交易所上市股票的非公开发行的股票,也可投资中国境内依法公开发行上市的股票(主要为二级市场上跌破增发价的股票和新股申购)。闲置资金可投资于国债、金融债、企业债、可转换债券、债券正回购、债券逆回购、公司债、中小企业私募债、证券投资基金、证券公司专项资产管理计划、银行存款、商业银行理财计划、集合资金信托计划等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。 权益类资产占本集合计划总值的比例为0-100%,包括参与证券交易所上市股票的定向增发获得的股票、二级市场上买入跌破增发价的股票、打新股中签股票等; 固定收益类资产占本集合计划总值的比例为0-100%,包括国债、金融债、企业债、可转换债券、债券正回购、债券逆回购、公司债、中小企业私募债、证券公司专项资产管理计划、商业银行理	



		<p>财计划、集合资金信托计划等；</p> <p>现金类资产占本集合计划总值的比例为 0-100%，包括现金、银行存款、货币市场基金等。</p>
	风险收益特征	高风险、高收益的投资产品。
	适合推广对象	适合风险承受能力较强、追求高收益的且法律法规允许的积极型投资者。
当 事 人	管理人	太平洋证券股份有限公司
	托管人	平安银行股份有限公司
	推广机构	上海陆金所资产管理有限公司及其他符合条件的代销机构。
集 合 计 划 的 参 与	办理时间	在推广期内，投资者在推广机构的工作日内可以参与本集合计划。 本集合计划存续期内，委托人可在开放申购期内办理参与业务。
	办理场所	推广机构指定的场所。
	办理方式、 程序	<p>①投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，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/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>③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有效，构成本合同的有效组成部分；</p> <p>④投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；</p> <p>⑤投资者推广期参与的，可于计划成立后 2 个工作日内到办理参与的营业网点查询参与确认情况。委托人认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。</p>
	参与费	<p>本集合计划参与费率为 1%；</p> <p>推广期：净参与金额=参与金额÷（1+参与费率）；</p> <p style="padding-left: 2em;">参与费=参与金额×参与费率÷（1+参与费率）；</p> <p style="padding-left: 2em;">参与份额=（净参与金额+推广期利息）÷集合计划份额面值；</p> <p>存续期：净参与金额=参与金额÷（1+参与费率）；</p> <p style="padding-left: 2em;">参与费=参与金额×参与费率÷（1+参与费率）；</p> <p style="padding-left: 2em;">参与份额=净参与金额÷集合计划单位净值。</p>
	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	办理时间	本集合计划存续期内，委托人可在开放赎回期内办理退出业务。
	办理场所	推广机构指定的场所。

<p>合 计 划 的 退 出</p>	<p>办理方式、 程序</p>	<p>(1) 申请方式：书面申请或管理人公布的其它方式； (2) 确认与通知：当日（T日）在交易时间内提交的申请，投资者通常可在 T+2 日到网点查询退出的确认情况； (3) 款项支付：委托人退出申请确认后，退出款项将在 T+3 日内划往委托人帐户。在发生延期退出的情形时，款项的支付办法参照相关条款处理；</p>
	<p>退出费</p>	<p>(1) 退出费用：0 (2) 退出金额的计算方法：退出金额= 退出份额×退出日计划单位净值</p>
	<p>单个委托人 大额退出及 预约申请</p>	<p>(1) 单个委托人大额退出的认定：对单个委托人单日退出份额超过上一日集合计划总份额 5%，或者超过 300 万份，即视为单个委托人大额退出。 (2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式：委托人必须提前 2 个工作日直接向管理人预约申请；大额退出未预约申请，管理人有权拒绝接受其退出申请。</p>
	<p>巨额退出 (认定标 准、退出顺 序、退出价 格确定、退 出款项支 付、告知委 托人的方 式)</p>	<p>(1) 巨额退出的认定 单个开放日，本计划净退出申请份额（退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额）超过上一日计划份额总份数的 10%，即认为是发生了巨额退出。 (2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付 当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分退出。 ①全额退出：当管理人认为有能力支付委托人的退出申请时，按正常退出程序执行。 ②部分延期退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为兑付委托人的退出申请可能对本计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出计划份额不低于上一日计划总份额的 10%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个帐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申请；未受理部分可延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的退出申请不享有优先权并以该开放日的计划净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。 (3) 告知客户的方式 当发生巨额退出并顺延退出时，管理人应立即通过在管理人的公司网站刊登公告等途径向委托人公布信息，并说明有关处理方法。</p>
	<p>连续巨额退 出（认定标 准、退出顺 序、退出价 格确定、退 出款项支</p>	<p>(1) 连续巨额退出的认定 本集合计划连续两个开放日（含两日）以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。 (2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付 出现连续巨额退出时，管理人可采用全额退出或部分顺延退出（具体含义见前款巨额退出的处理方式）方式处理，当管理人认为有必要时，也可拒绝或暂停接受退出申请，并对已经接受的退出申请，采用全额退出或部分顺延退出方式处理。</p>

	付、告知委托人的方式)	
管理人自有资金参与情况		管理人可以以不超过集合计划总规模 20% 的自有资金参与本集合计划。
集合计划成立的条件、时间		集合计划的参与资金总额不低于 3000 万元人民币且其委托人的人数为 2 人（含）以上，并经管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告后，管理人宣布本集合计划成立。 集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入集合计划份额登记机构指定的专门账户，不得动用。
集合计划设立失败（本金及利息返还方式）		集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币 3000 万元或者委托人人数低于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划全部推广费用，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，各方互不承担其他责任。利息金额以本集合计划注册与过户登记人的记录为准。
集合计划份额转让		集合计划存续期间，如果监管允许，且各方面条件成熟的情况下，管理人将参照相关规定制定发布集合计划份额转让公告。客户可以按照该公告建议的流程和方式，通过证券交易所、柜台交易平台等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。
费用、业绩报酬	费用种类  (计提标准、方法、支付方式)	<p>（一）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、托管费： 本集合计划自成立之日起计提托管费。本计划的托管费按前一日的计划资产净值 0.1% 的年费率计提，计算方法如下：  <math display="block">H = E \times 0.1\% \div 365</math> （首日按集合计划初始资金金额）  H 为每日应计提的托管费  E 为前一日计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）。  托管费每日计提，按季支付。由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次季首日起 5 个工作日内从计划资产中一次性支付给托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>2、管理费： 本集合计划自成立之日起计提管理费。本计划的管理费按前一日的计划资产净值 1% 的年费率计提，计算方法如下：  <math display="block">H = E \times 1\% \div 365</math> （首日按集合计划初始资金金额）  H 为每日应计提的管理费  E 为前一日计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）。  管理费每日计提，按季支付。由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次季首日起 5 个工作日内从计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>3、证券交易费用 本集合计划应按规定比例支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金等费用。 本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定。在每季度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。</p> <p>4、与本集合计划相关的审计费 在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。 本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签订协议所规定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。</p>

	<p>5、按照国家有关规定可以列入的其他费用</p> <p>银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、注册与过户登记人收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用；</p> <p>银行结算费用，一次计入集合计划费用；</p> <p>银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间一次性计入费用；</p> <p>开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；</p> <p>与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销；</p> <p>上述计划费用中第3至5项费用由管理人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>不由集合计划承担的费用</p>	<p>集合计划推广期间的费用，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，以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入本集合计划费用。</p>								
<p>业绩报酬</p>	<p>1、管理人收取业绩报酬的原则：</p> <p>(1) 按委托人每笔参与份额分别计算收益率并计提业绩报酬。</p> <p>(2) 符合业绩报酬计提条件时，在委托人退出日、本集合计划收益分配日和终止日计提业绩报酬。</p> <p>(3) 集合计划分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除；委托人退出日和集合计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。</p> <p>2、业绩报酬的计提方法</p> <p>(1) 业绩报酬的提取条件和提取比例如下：</p> <p>本集合计划业绩报酬计提日为委托人退出日、本集合计划收益分配日和终止日。以上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，则为推广期或存续期参与日）至本次业绩报酬计提日的年化收益率R，作为计提业绩报酬的基准，累计提取业绩报酬。当两个业绩报酬日期间的年化收益率小于等于8%，管理人不提取业绩报酬；两个业绩报酬日期间的年化收益率高于8%且小于等于50%，管理人对超过8%收益部分提取20%作为管理人业绩报酬；当两个业绩报酬日期间的年化收益率高于50%，管理人则对超过50%收益部分收取30%作为业绩报酬。</p> <p>(2) 用公式表示如下：</p> <p>A=上次业绩报酬计提日的单位净值；</p> <p>B=本次业绩报酬计提日的累计单位净值；</p> <p>C=上一次业绩报酬计提日的累计单位净值；</p> <p>D=两次业绩报酬集体日的间隔天数；</p> <p>E=委托人每笔参与份额应计提的管理人业绩报酬；</p> <p>F=本次提取业绩报酬的份额；</p> $R = [(B - C) / A] \times [365 \div D] \times 100\%$ <p>委托人每笔参与份额应计提的管理人业绩报酬计算方法如下：</p> <table border="1" data-bbox="400 1733 1404 1944"> <thead> <tr> <th>年化收益率 (R)</th> <th>管理人浮动报酬 (E)</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td><math>R \leq 8\%</math></td> <td><math>E = 0</math></td> </tr> <tr> <td><math>8\% &lt; R \leq 50\%</math></td> <td><math>E = F \times A \times (R - 8\%) \times 20\% \times D \div 365</math></td> </tr> <tr> <td><math>R &gt; 50\%</math></td> <td><math>E = [F \times A (50\% - 8\%) \times 20\% + F \times A (R - 50\%) \times 30\%] \times D \div 365</math></td> </tr> </tbody> </table> <p>3、业绩报酬支付：</p>	年化收益率 (R)	管理人浮动报酬 (E)	$R \leq 8\%$	$E = 0$	$8\% < R \leq 50\%$	$E = F \times A \times (R - 8\%) \times 20\% \times D \div 365$	$R > 50\%$	$E = [F \times A (50\% - 8\%) \times 20\% + F \times A (R - 50\%) \times 30\%] \times D \div 365$
年化收益率 (R)	管理人浮动报酬 (E)								
$R \leq 8\%$	$E = 0$								
$8\% < R \leq 50\%$	$E = F \times A \times (R - 8\%) \times 20\% \times D \div 365$								
$R > 50\%$	$E = [F \times A (50\% - 8\%) \times 20\% + F \times A (R - 50\%) \times 30\%] \times D \div 365$								

		<p>由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个工作日内将业绩报酬划拨给管理人。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。</p> <p>因涉及注册登记机构数据，业绩报酬由管理人负责计算并复核，托管人不承担业绩报酬的复核责任。</p>
收益分配	收益构成	本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划收益减去公允价值变动收益后的余额。
	分配原则	<p>1、收益采用现金分配或红利再投资方式，每位委托人获得的分红收益金额保留小数点后两位，第三位四舍五入。</p> <p>2、集合计划份额均享有同等分配权。</p> <p>3、计划收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于初始面值。</p> <p>4、本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。选择采取现金分配的，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配划入注册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应推广机构结算备付金账户，由推广机构划入委托人的交易账户，现金红利扣除管理人业绩报酬后在 T+7 日内划转到委托人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金扣除管理人应提业绩报酬后按除权除息日的单位净值转成相应的集合计划单位。</p> <p>5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。</p> <p>6、法律法规另有规定的从其规定。</p>
集合计划展期		本集合计划无展期条款。
终止和清算		<p>(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <p>1、计划存续期间，客户少于 2 人；</p> <p>2、计划存续期满且不展期；</p> <p>3、管理人认定本集合计划的目的已经无法实现时；</p> <p>4、集合计划存续期满 1.5 年后，管理人可根据市场行情变化以及实际投资情况，经委托人、管理人、托管人协商一致后，决定提前终止本集合计划；</p> <p>5、其他终止的情形。</p> <p>(二) 集合计划的清算</p> <p>1、自集合计划终止之日起 5 个工作日内成立集合计划清算小组，集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算；</p> <p>2、清算过程中的有关重大事项应当及时公布；</p>

	<p>3、清算结束后 15 个工作日内，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费及托管费等费用后，将集合计划资产按照委托人拥有集合计划份额的比例或集合资产管理合同的约定以货币资金的形式全部分派给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户；</p> <p>4、清算结束后 15 个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果；</p> <p>5、若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，该方案应经集合计划清算小组认可，并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定，对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算，并将变现后的资产扣除相关费用后按照委托人拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定，以货币形式全部分配给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行二次清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。</p>
<p><b>特别说明</b></p>	<p>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。</p>



