

《太平洋证券季季盈1号集合资产管理合同》

第一次变更的征询函

尊敬的委托人：

经与托管人包商银行股份有限公司书面达成一致，管理人拟对《太平洋证券季季盈1号集合资产管理合同》（以下简称合同）进行变更。

合同变更征询意见截止日为2018年6月15日。本集合计划于2018年6月15日开放办理退出业务。如不同意本集合计划合同变更，请您于上述开放日申请退出本集合计划；如您在截止日前意见答复不同意变更且未在上述开放日申请退出的，管理人会将相关份额强制退出本集合计划；如您在截止日前未回复意见且未退出的，视为同意本集合计划合同变更。

开放期结束之后，本次合同变更将于2018年6月16日生效。

(1)、本计划合同变更内容具体如下：

修改前	修改后
三、释义	
合格投资者：指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合下列条件之一的单位和个人：（1）个人或者家庭金融资产合计不低于100万元人民币；（2）公司、企业等机构净资产不低于1000万元人民币。依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者。	合格投资者：指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。： 1、具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于300万元，家庭金融资产不低于500万元，或者近3年本人年均收入不低



	<p>于 40 万元；</p> <p>2、最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位；</p> <p>3、金融管理部门视为合格投资者的其他情形。</p> <p>投资者不得使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理产品。</p>
五、集合资产管理计划的基本情况	
(二) 类型：集合资产管理计划	(二) 类型：固定收益类集合资产管理计划
<p>(四) 投资范围和投资比例</p> <p>2、投资组合比例</p> <p>无</p>	<p>(四) 投资范围和投资比例</p> <p>2、投资组合比例</p> <p>(1) 本集合计划投资于存款、债券等债权类资产的比例不低于 80%。”</p> <p>相应调整后续序号。</p>
<p>(七) 参与本集合计划的最低金额</p> <p>单个委托人首次参与份额的最低金额为人民币 101 万(含认购/申购费)元。对于已经是本集合计划的持有人，其新增参与资金的最低金额为人民币 1 万元(含认购/申购费)(整数倍)。</p>	<p>(七) 参与本集合计划的最低金额</p> <p>单个委托人首次参与份额的最低金额为人民币 101 万(含认购/申购费)元。对于已经是本集合计划的持有人，其新增参与资金的最低金额为人民币 1 万元(含认购/申购费)。</p>
<p>(八) 封闭期、开放期及临时赎回期</p> <p>2、开放期：在开放期可办理参与、退出业务。本集合计划原则上定期开放，开放时间为自运作起始日起每满 91 天的次日(第一个运作起始日指本计划成立日，之后运作起始日指每满 91 天的次日)。若遇到节假日或者其他特殊</p>	<p>(八) 封闭期、开放期及临时赎回期</p> <p>2、开放期：在开放期可办理参与、退出业务。本集合计划原则上定期开放，开放时间为自运作起始日起每满 91 天的当日(第一个运作起始日指本计划成立日，之后运作起始日指每满 91 天的次日)开放申购及赎回。若遇到节</p>

<p>情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应调整并公告。</p> <p>但管理人可根据业务实际情况，设置临时开放日。临时开放前，管理人应在指定网站公告具体安排。</p>	<p>假日或者其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应调整并公告。每满 91 天之后的前 N 个工作日管理人可根据业务情况开放申购，N 由管理人在管理人官网公告确认。</p> <p>管理人还可根据业务实际情况，设置临时开放日。临时开放前，管理人应在指定网站公告具体安排。</p>
<p>(十) 本集合计划的推广</p> <p>1、推广机构:太平洋证券股份有限公司及其他符合条件的机构</p>	<p>(十) 本集合计划的推广</p> <p>1、推广机构:太平洋证券股份有限公司、包商银行股份有限公司及其他符合条件的机构</p>
<p>六、集合计划的参与和退出</p>	
<p>(二) 集合计划的退出</p> <p>3、退出的程序和确认</p> <p>(1) 退出申请的提出</p> <p>委托人申请退出本集合计划的，如部分退出时，当退出前委托人在该推广机构持有的本集合计划份额大于或等于 100 份时，委托人每笔最低退出份额为 100 份，当退出前委托人在该推广机构持有的本集合计划份额不足 100 份时，委托人办理退出时只能选择全部退出，部分退出申请视为无效申请。</p>	<p>(二) 集合计划的退出</p> <p>3、退出的程序和确认</p> <p>(1) 退出申请的提出</p> <p>委托人申请退出本集合计划的，如部分退出时，当退出前委托人在该推广机构持有的本集合计划份额大于或等于 100 份时，委托人每笔最低退出份额为 100 份，如退出后委托人在该推广机构持有的本集合计划份额不足 100 份时，则委托人办理退出时只能选择全部退出，部分退出申请视为无效申请。</p>
<p>十四、集合计划的费用、业绩报酬</p>	
<p>(三) 业绩报酬</p> <p>(2) 业绩报酬的计提方法涉及“该笔</p>	<p>(三) 业绩报酬</p> <p>(2) 业绩报酬的计提方法涉及“该笔</p>

<p>份额持有期收益”计算公式部分</p> <p>该笔份额持有期收益=（本次业绩报酬计提日的单位净值-上一次业绩报酬计提日的单位净值）*该笔份额数</p>	<p>份额持有期收益”计算公式部分</p> <p>该笔份额持有期收益=（本次业绩报酬计提日的累计单位净值-上一次业绩报酬计提日的累计单位净值）*该笔份额数</p>
<p>十五、集合计划的收益分配</p>	
<p>（一）收益的构成</p> <p>集合计划收益由债券（含票据）利息收入、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入构成。</p>	<p>（一）收益的构成</p> <p>集合计划收益由债券利息收入、买卖证券价差、公允价值变动、银行存款利息以及其他合法收入扣除相关费用后的余额。</p>
<p>十七、投资决策与风险控制</p>	
<p>（二）投资程序</p> <p>1、投资决策程序</p> <p>管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理投资决策委员会、投资主办人两级体系组成。</p> <p>资产管理投资决策委员会负责对管理人所管理的资管产品的投资运作进行决策管理，具体职责包括：对客户资产管理业务的投资方向、仓位控制、投资策略等提出总体意见；审核资产管理产品的资产配置方案；审核投资主办拟定的投资策略；月度投资总结和重大项目投资计划书；确定证券池入池品种的选择原则及其品种调整；确定投资主办人选以及对投资主办做出投资授权；对资产管理产品的运作及绩效状况进行业绩评估等。</p>	<p>（二）投资程序</p> <p>1、投资决策程序</p> <p>管理人资产管理业务投资决策体系由管理人资产管理投资决策委员会、投资主办人两级体系组成。</p> <p>资产管理投资决策委员会负责对管理人所管理的资管产品的投资运作进行决策管理，具体职责包括：对客户资产管理业务的投资方向、仓位控制、投资策略等提出总体意见；审核资产管理产品的资产配置方案；审核投资主办拟定的投资策略；月度投资总结和重大项目投资计划书；确定证券池入池品种的选择原则及其品种调整；确定投资主办人选以及对投资主办做出投资授权；对资产管理产品的运作及绩效状况进行业绩评估等。</p>

投资主办人是具体资产管理产品的直接管理人，具体职责包括：在投资决策委员会的授权范围内，负责所管理的资产管理产品的日常投资运作、风险管理；制定资产管理产品的整体投资策略报告；指定和执行资产管理产品投资组合方案并下达日常交易指令；根据资产管理产品参与、退出状况及市场情况的变化，调整投资组合、控制流动性风险和市场风险；参与证券池维护等。

2、投资交易程序

管理人采用集中交易模式，投资主办人下达的投资指令通过集中交易室实施。集中交易室负责客户资产管理业务所有交易指令的具体执行及相关内部控制。交易室接到投资主办人的投资指令后，根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查，防范投资管理过程中的违规风险，确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

3、投资风险的监控与绩效评估

管理人建立各部门协同合作下对资产管理产品投资风险进行监控，其中：风险监控部建立与客户资产管理业务同步的电脑风险监测系统，根据公司对投资风险管理的要求，对投资异常情况

投资主办人是具体资产管理产品的直接管理人，具体职责包括：在投资决策委员会的授权范围内，负责所管理的资产管理产品的日常投资运作、风险管理；制定资产管理产品的整体投资策略报告；指定和执行资产管理产品投资组合方案并下达日常交易指令；根据资产管理产品参与、退出状况及市场情况的变化，调整投资组合、控制流动性风险和市场风险；参与证券池维护等。

2、投资交易程序

管理人采用集中交易模式，投资主办人下达的投资指令通过集中交易室实施。集中交易室负责客户资产管理业务所有交易指令的具体执行及相关内部控制。交易室接到投资主办人的投资指令后，根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查，防范投资管理过程中的违规风险，确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

3、投资风险的监控与绩效评估

管理人建立各部门协同合作下对资产管理产品投资风险进行监控，其中：风险管理部建立与客户资产管理业务同步的电脑风险监测系统，根据公司对投资风险管理的要求，对投资异常情况进行监控及核对检查；交易室负

责对资产管理产品投资的日常交易行为进行实时监控，防止违法、违规和异常交易行为的发生；资产管理总部合规风控岗对客户资产管理业务投资制度的执行情况、投资过程的合法性、合规性进行日常具体的检查。

资产管理投资决策委员定期对各资产管理产品资产运作及投资主办的绩效状况进行业绩评估。绩效评估的衡量标准主要是评估资产管理产品的风险收益特征是否符合产品合同规定、评估期内资产管理产品单位净值的实际增减值和增减率、资产管理产品业绩与参照基准的对照。

（三）风险控制

1、风险控制的原则

在建立风险管理体系时应严格遵循以下原则：

（1）全面性原则：内部风险管理必须覆盖客户资产管理业务的所有相关部门和岗位，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各项业务过程和业务环节；

（2）全员性原则：员工是风险管理的基础，风险管理必须涵盖与客户资产管理业务相关全体员工，不断提高员工对风险的识别和防范能力，树立全员风险意识；

（3）独立性原则：管理人合规部、风险监控部、稽核部及资产管理业务总

责对资产管理产品投资的日常交易行为进行实时监控，防止违法、违规和异常交易行为的发生；资产管理总部合规风控岗对客户资产管理业务投资制度的执行情况、投资过程的合法性、合规性进行日常具体的检查。

资产管理投资决策委员定期对各资产管理产品资产运作及投资主办的绩效状况进行业绩评估。绩效评估的衡量标准主要是评估资产管理产品的风险收益特征是否符合产品合同规定、评估期内资产管理产品单位净值的实际增减值和增减率、资产管理产品业绩与参照基准的对照。

（三）风险控制

1、风险控制的原则

在建立风险管理体系时应严格遵循以下原则：

（1）全面性原则：内部风险管理必须覆盖客户资产管理业务涉及的所有业务流程环节，包含事前风险控制、事中风险监控、事后风险报告和处置。

（2）独立性原则：管理人合规部、风险管理部、稽核部应保持高度的独立性和权威性，负责对管理人客户资产管理业务的内部控制、风险控制措施进行监督和检查。

（3）信息隔离原则：管理人的客户资产管理业务与自营业务、投行业务等

部合规风控岗应保持高度的独立性和权威性，负责对管理人客户资产管理业务内部风险管理制度的执行进行监督、稽核与检查；

(4) 相互制衡原则：管理人在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系，强化稽核部对客户资产管理业务的监察稽核功能。

(5) 信息隔离原则：管理人的客户资产管理业务与自营业务、投行业务等涉及利益冲突的业务应在空间上和制度上严格隔离。对因业务需要知悉内幕信息和跨越隔离墙的人员，应制定严格的批准程序和监督处罚措施。客户资产管理业务中的投资管理业务、交易清算、风险管理要严格实行岗位、人员分离。

(6) 适时有效性原则：在保证所有风险管理措施切实有效的基础上，客户资产管理业务风险管理制度的制定应具有前瞻性，并且必须随着公司经营战略、经营方针、经营理念等内部环境和国家法律法规、市场变化等外部环境的改变及时进行相应的修改和完善。

2、风险控制组织架构

(1) 管理人的资产管理总部全面负责客户资产管理业务的各类风险管理，

涉及利益冲突的业务应在机构、人员、信息、账户等方面严格隔离。资产管理业务中的投资管理业务、交易清算、风险管理要严格实行岗位、人员分离。

(4) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，对风险进行识别、判断、评估和控制，使风险控制更具客观性和操作性。

2、风险控制组织架构

(1) 管理人的资产管理总部全面负责客户资产管理业务的各类风险管理，其他部门按照自身职责及公司相关制度各司其职。其中：风险管理部作为公司风险管理的核心部门，协助指导和检查各部门的风险管理工作，建立与客户资产管理业务同步的电脑风险监测系统，主要负责客户资产管理业务风险限额管理、日常交易行为监控、风险查询和提示等；合规部主要负责客户资产管理业务相关的制度合规性审核、业务开展过程中相关协议的法律文本及合规性审核、组织资产管理总部开展信息隔离工作、对监管部门要求公司出具合规意见的资产管理业务及产品进行合规审查并出具意见、对业务的日常开展进行合规管理等；稽核部主要负责对客户资产管理业务的各种风险实施定期或不定期的稽核审计、专项检查；计划财务部主要负

其他部门按照自身职责及公司相关制度各司其职。其中：合规部主要负责客户资产管理业务相关的制度合规性审核、合同审核、对客户资产管理业务涉及的敏感信息进行信息隔离管理、对监管部门要求公司出具合规意见的客户资产管理业务及产品进行合规审查并出具意见、客户资产管理业务相关的合规提示和质询等；风险监控部主要负责客户资产管理业务风险限额管理、日常监控、风险查询和提示等；稽核部主要负责对客户资产管理业务的各种风险实施定期或不定期的稽核审计、专项检查；计划财务部主要负责对客户资产管理业务进行财务监控，及时纠正违反相关会计制度的行为；运营中心主要负责客户资产管理业务的部分参数设置、席位开立和清算工作。

(2) 资产管理总部设立合规风控岗。合规风控岗人员由合规部、风险监控部审核并授权，负责对客户资产管理业务的合规性和风险情况进行实质性监察和控制。

(3) 必要时，管理人可聘请外部专业机构或专业人士对客户资产管理业务的风险管理提供建议，如独立审计机构、律师事务所和投资顾问等。

3、投资风险程序

责对客户资产管理业务进行财务监控，及时纠正违反相关会计制度的行为；运营中心主要负责客户资产管理业务的部分参数设置、席位开立和清算工作。

(2) 资产管理总部设立合规风控岗，负责对客户资产管理业务的合规性和风险情况进行监察和控制。

(3) 必要时，管理人可聘请外部专业机构或专业人士对客户资产管理业务的风险管理提供建议，如独立审计机构、律师事务所和投资顾问等。

3、投资风险程序

管理人在实施客户资产管理业务风险管理时主要以业务流程为主导，按风险识别、风险评估、风险管理措施的实施、风险管理制度的监控及风险管理制度的完善5个步骤进行。

(1) 风险识别：是指对所有可能存在的、对客户资产管理业务运作有重大影响的潜在风险点进行考察和识别，它是有效实施风险管理的前提和基础。

风险识别主要由资产管理总部各业务条线、前中后台对潜在的风险点进行识别，根据需要及时出具风险自查报告，经部门负责人确认后报风险管理部讨论。

(2) 风险评估：是指由资产管理总部

管理人在实施客户资产管理业务风险管理时主要以业务流程为主导，按风险识别、风险评估、风险管理措施的实施、风险管理制度的监控及风险管理制度的完善5个步骤进行。

(1) 风险识别：是指对所有可能存在的、对客户资产管理业务运作有重大影响的潜在风险点进行考察和识别，它是有效实施风险管理的前提和基础。

风险识别主要采用由内至外分析法，由资产管理总部各业务条线、前中后台对潜在的风险点进行识别，根据需要及时出具风险自查报告，经部门负责人确认后报风险监控部讨论。

鉴于由内至外分析法不足以识别所有可能存在的风险点，管理人同时采用由外至内分析法，由公司管理层、风险监控部将风险尤其是外部风险进行指标分解，下达风险限额到资产管理总部及各业务部门。

(2) 风险评估：是指由资产管理总部各业务条线、前中后台根据客户资产管理业务中风险发生的可能性以及由此对公司运作造成的潜在影响进行评估，准确的风险评估是风险管理有效的科学依据。风险评估可采取定性分析和定量分析相结合的方法。

(3) 风险管理措施的实施：是指在风

各业务条线、前中后台根据客户资产管理业务中风险发生的可能性以及由此对公司运作造成的潜在影响进行评估，准确的风险评估是风险管理有效的科学依据。风险评估可采取定性分析和定量分析相结合的方法。

(3) 风险管理措施的实施：是指在风险评估的基础上，资产管理总部采取相应的控制措施，并组织具体实施。其主要程序如下：

①资产管理总部根据风险识别和风险评估情况，提出相应的控制措施；

②若风险管理部认为控制措施不全面，提出相应的补救措施的指导；

③资产管理总部根据上述控制措施具体实施，并通报风险管理部。

险评估的基础上，资产管理总部采取相应的控制措施，并组织具体实施。

其主要程序如下：

- ①资产管理总部根据风险识别和风险评估情况，提出相应的控制措施；
- ②若风险监控部认为控制措施不全面，提出相应的补救措施的指导；
- ③资产管理总部根据上述控制措施具体实施，并通报风险监控部。

（4）风险管理制度的监控：为保证风险管理的有效性，由稽核部对资产管理总部实施定期或不定期的稽核审计、专项检查。

（5）风险管理制度的完善：稽核部将根据既定的监控程序对资产管理总部进行监督核查，并对认为风险管理有缺陷的情况进行重点核查。如果发现风险控制制度有不足之处时，应及时提出改进建议和报告，并监督资产管理总部对风险控制制度不足之处进行完善。

请投资者在《〈太平洋证券季季盈1号集合资产管理合同〉第一次变更的征询函的回函》中做出意见表示并邮寄至相应代销机构处。

感谢您的支持与配合！

太平洋证券股份有限公司

2018年6月12日



《太平洋证券季季盈1号集合资产管理合同》

第一次变更的征询函的回函

请投资者根据以上内容作出意见表示：

同意本次合同变更之投资者，请于“同意”栏签字或盖章；不同意合同变更之投资者，请于“不同意”栏签字或盖章。

意见	委托人签字/盖章
同意	
不同意	
时间	2018 年 年 月

产品持有人姓名_____

身份证号码_____

联系电话_____

客户所在销售机构_____

