

太平洋证券季季盈4号集合资产管理计划说明书

2018年9月



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》）、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》（以下简称《暂行规定》）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《太平洋证券季季盈4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，不存在任何虚假内容、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》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

名称	太平洋证券季季盈4号集合资产管理计划
类型	固定收益型集合资产管理计划
目标规模	推广期和存续期规模上限为50亿元（不含推广期参与资金在募集

集 合 计 划 基 本 信 息		期产生的利息，下同)。本集合计划的份额持有人总数不超过 200 人，但法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。
	管理期限	本集合计划管理期限为 10 年，在履行本合同约定的合同展期程序后，本集合计划可展期。
	推广期	本集合计划推广期指集合计划接受委托人认购参与至集合计划认购截止日。本集合计划推广期最长不超过 60 个工作日。 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。管理人有权根据实际情况提前结束推广期并通过管理人网站及时向投资者披露。
	开放期	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 天的当个工作日。具体以管理人公告为准。同时，如本集合计划发生展期或《集合资产管理合同》发生补充修改等特殊情况，管理人将设定特别开放期，符合条件的委托人可申请退出集合计划。
	份额面值	人民币 1.00 元。
	最低金额	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）。
	相关费率	1、认购费：0.15%；申购费 0.15%。 2、退出费：在管理人公布的开放退出日申请退出，退出费率为 0；如在临时赎回期，委托人申请退出的，则退出费率为 2%； 3、管理费：0.2%/年，详见本合同第十四章节； 4、托管费：0.05%/年，详见本合同第十四章节；

	<p>5、业绩报酬：详见本合同第十四章节。</p> <p>6、证券交易费用：本集合计划应按规定比例在发生投资交易时计提并支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、基金申购赎回费等税费，作为交易成本从本集合计划资产中直接扣除；</p> <p>7、其它相关服务机构费用：律师费、审计费等其他相关服务机构的费用由管理人根据行业收费标准及业务实际情况，向托管人出具划款指令，从集合计划专用银行账户中扣划。</p> <p>委托人、管理人、托管人作为各纳税主体，应根据取得的收益按照有关法律、法规的规定，自行纳税，管理人不得扣代缴。</p> <p>管理人、托管人在履行管理、托管职责时获得的收入产生的相关税费，由管理人、托管人自行承担。</p> <p>按照法律法规及国家有关部门规定管理人作为纳税人应缴纳的委托资产管理运用过程中的增值税（如有），由委托资产承担。如法律、行政法规和国家有关部门的规定调整的，则按新的规定执行。</p>
<p>投资范围</p>	<p>投资范围：</p> <p>本集合计划主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括现金、通知存款、货币基金、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限（或回售期限）在 438 天（365*1.2）以内（含 438 天（365*1.2））的国债、金融债、地方债、短期融资券（含超短融）、公司债、企业债、资产支持证券、中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购，及法律法规或中国证监</p>

会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种，与本合同约定的投资范围不一致的，则管理人根据本合同约定，在履行合同变更的程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。

投资组合比例：

(1) 本集合计划投资于固定收益类资产占资产总值的比例为：80%-100%。

(2) 本集合计划不得投资于以下金融工具：股票、权证、可转换债券、剩余期限（或回售期限）超过 438 天（ 365×1.2 ）的债券（国债、金融债、地方债、短期融资券（含超短融）、公司债、企业债、资产支持证券、中期票据）、信用等级在 AA 级（不含）以下的企业债券、以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券、非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券以及中国证监会禁止投资的其他金融工具。

(3) 本集合计划所投资资产的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 1.2 年；

(4) 本集合计划持有的单一债券，不超过前一日资产净值的 25%；

(5) 本集合计划参与证券回购融入资金余额不得超过该计划资产净值的 40%。

(6) 本集合计划持有单一债券的比例不超过该债券募集规模的

		<p>25%；持有单一资产支持证券的比例不超过该资产支持证券募集规模的 20%；持有全部资产支持证券的市值不超过基金资产净值的 20%；本集合计划仅投资于外部信用主体评级为 AA 及其以上的债券或资产支持证券。</p> <p>(7) 本集合计划投资的超短期融资券的债项评级不得低于 A-1。</p> <p>(8) 本集合计划投资的预警线为 0.98 元、平仓线为 0.97 元。</p>
	业绩报酬计提基准	本集合计划的业绩报酬计提基准暂定为 5.15%。管理人可根据本计划运作情况及市场情况，在每个开放期前对下一个封闭期的业绩报酬计提基准进行调整，并在管理人网站公告，具体生效时间以管理人公告为准。
	风险收益特征	本计划属于 R2（中低风险）证券投资产品。
	适合推广对象	适合风险承受能力适评级为 C2 谨慎型、C3 稳健型、C4 积极型、C5 激进型的合格投资者。
当 事 人	管理人	太平洋证券股份有限公司
	托管人	包商银行股份有限公司
	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
集 合 计 划	办理时间	<p>(1) 推广期参与</p> <p>本集合计划推广期指集合计划接受委托人认购参与至集合计划认购截止日。本集合计划推广期最长不超过 60 个工作日。</p> <p>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。</p>

的 参 与		<p>管理人有权根据实际情况提前结束推广期并通过管理人网站及时向投资者披露。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>投资者在集合计划开放申购日可以办理参与本集合计划的业务，具体开放申购日以管理人网站公告为准。</p>
	办理场所	推广机构营业场所或者符合法规要求的网上交易平台。
	参与费	认购费：0.15%；申购费 0.15%
	认购资金利息	委托人的参与资金在推广期产生的利息折成集合计划份额归委托人所有，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。推广期利息的利率参照中国人民银行最新公布的同期人民币活期存款利率。
	参与原则	<p>(1) 采用金额参与的方式，即以参与金额申请；</p> <p>(2) “已知价”原则，即推广期参与价格以人民币 1.00 元为基准进行计算份额；</p> <p>(3) “未知价”原则，即存续期开放申购日内集合计划参与价格以委托人申请当日的单位净值为基准进行计算；</p> <p>(4) 本计划出现以下情况之一时，管理人可暂停或拒绝接受委托人的参与：</p> <p>①推广期和存续期内，本集合计划份额接近或达到规模上限；</p> <p>②战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；</p> <p>③证券交易所在交易时间非正常停市；</p> <p>④发生集合资产管理计划管理合同规定的暂停集合计划资产估值</p>

	<p>情况；</p> <p>⑤法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>如果委托人的参与被拒绝，被拒绝的参与款项将与该期间活期存款利息一并退还给委托人，资产管理合同自始无效。</p> <p>(5) “时间优先、金额优先”原则，管理人应将超募当日以前的有效参与委托予以全部确认，再将超募当日所有有效参与委托先按照参与时间先后排序，时间相同的再按照参与金额大小排序，然后根据排序逐笔确认，超过目标规模上限的其他客户委托将不被确认。如果确认某单笔委托将导致规模超限，则该单笔委托将全额不被确认。</p>
<p>办理方 式、程序</p>	<p>委托人在推广期内可在推广机构指定的场所参与本计划。</p> <p>(1) 参与程序和确认</p> <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，推广机构不予受理该笔参与申请；</p> <p>③投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。委托人应当如实提供与签署合同相关的信息和资料，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。投资者参与申请经管理人确认有</p>

效后，构成本合同的有效组成部分，本合同开始生效。

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；

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。

(2) 参与的注册登记

投资者参与成功后，注册与过户登记人在T+1日为委托人登记权益并办理注册登记手续。

(3) 暂停参与的情形

如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请：

①战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

②本集合计划出现或可能出现超额募集情况；

③证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；

④集合计划管理人、集合计划托管人或注册与过户登记人的技术保障或人员支持等不充分；

⑤推广机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；

⑥集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；

⑦法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

		发生上述①到④项暂停参与情形时，集合计划管理人应当通过管理人网站报告委托人。
集合计划的退出	办理时间	投资者在集合计划开放退出日可以办理退出本集合计划的业务，具体开放退出日以管理人网站公告为准。 未到开放退出日，客户如果申请退出的，需要至少提前三个工作日通过推广机构向管理人申请预约，否则管理人可以拒绝。客户需支付退出手续费。
	办理场所	推广机构营业场所或者符合法规要求的网上交易平台。
	退出费	在管理人公布的开放退出日申请退出，退出费率为 0；如在临时赎回期，委托人申请退出的，则退出费率为 2%。
	办理方式、程序	<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>(2) 退出申请的确认</p> <p>投资者于 T 日提交退出申请后，可于 T+1 日后在办理参与的网点查询退出情况。委托人退出申请确认后，管理人应指示托管人将退出款项从集合计划托管专户划往各推广机构指定账户。退出款项将在 T+2 日内从托管账户划出，在 T+3 日内划拨至委托人账户。</p>
	单个委托	(1) 单个委托人大额退出的认定

<p>人 大额退出 及预约申 请</p>	<p>单个委托人单日退出份额超过计划总份额5%，即视为单个委托人大额退出。</p> <p>(2) 单个委托人大额退出的申请和处理方式</p> <p>委托人必须提前2个工作日直接或通过推广机构向管理人预约申请，否则管理人有权拒绝接受其退出申请。</p>
<p>巨额退出 的认定和 处理方式</p>	<p>巨额退出时，管理人可以根据发生巨额退出的集合计划当时的资产组合状况决定全额退出，或部分顺延退出。</p> <p>当管理人认为支付委托人的全部退出申请有困难时，管理人在当日接受退出申请份额不低于上一日集合计划总份额的10%的前提下，对未接受的退出申请予以延期办理。如管理人认为有必要，可暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但暂停和延缓期限不得超过10个工作日，并应当在T+1日内通过管理人网站和销售机构的各营业网点通告委托人，并说明有关处理方法</p>
<p>集合计划成立 的条件、时间</p>	<p>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200人（不含）以下，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。</p> <p>本集合计划成立的时间为计划管理人根据《管理办法》及相关法规规定发布集合计划成立公告的日期。</p> <p>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。</p>

<p>集合计划设立失败（本金及利息返还方式）</p>	<p>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量低于 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，并将已认购资金及银行活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。</p>
<p>费用、报酬</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 0.05% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div 365$ 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） 本计划的托管费按前一日产品资产净值计算，按日计提，按季支付。由托管人根据与管理人的指令，在每季初的前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若因战争、自然灾害等不可抗力或法定节假日致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后或法定节假日终止后的首个工作日支付。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。 托管费收费账户信息如下： 户 名：单位托管和年金业务收入 账 号：5002060100 开户银行：包商银行总行清算中心</p> <p>2、管理费：</p>

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 0.2% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div 365$$

H 为管理人当日计提的管理费

E 为前一日计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）

按前一日计划资产净值计算，按日计提，按季支付。由托管人根据与管理人的指令，在每季初的前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若因战争、自然灾害等不可抗力或法定节假日致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后或节假日终止后的首个工作日支付。产品终止后，依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。

管理费收款账户

户 名： 太平洋证券股份有限公司

账 号： 2502011009027306844

开户银行： 中国工商银行昆明南屏支行

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，在每月度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

4、 与本集合计划相关的审计费

	<p>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。</p> <p>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，于实际发生时计入集合计划费用；</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>证券账户开户费在产品成立后，经管理人与托管人核对无误，由托管人根据管理人指令从委托资产中支付给管理人指定账户，托管人不承担垫付开户费用义务。</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>
不由集	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

<p>合计划 承担的 费用</p>	<p>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>本集合计划业绩报酬计提日为收益分配日、委托人退出日或本计划终止日（含提前终止）。管理人在符合业绩报酬计提条件时，于业绩报酬计提日提取业绩报酬。</p> <p>(1) 管理人收取业绩报酬的原则</p> <p>a、按照委托人每笔参与份额分别计算持有期收益率，在符合业绩报酬计提的条件下计提业绩报酬。</p> <p>b、集合计划收益分配日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在每笔份额退出日和集合计划终止时提取业绩报酬的，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>业绩报酬的提取条件和提取比例如下：</p> <p>若业绩报酬计提日，委托人获得超额收益，则管理人有权计提其超额收益的 60%作为业绩报酬，其中超额收益为每笔份额持有期收益率高于其基准收益（即按照业绩报酬计提基准计算的收益）的部分。计算方式如下：</p> <p>在业绩报酬提取日，如果超额收益≥ 0，则：每笔份额应提取的业绩报酬=该笔份额超额收益*60%</p> <p>每笔份额超额收益=该笔份额收益-该笔份额基准收益</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</p>

-上一次业绩报酬计提日的累计单位净值) *该笔份额数

该笔份额的基准收益=业绩报酬计提基准/365*实际运作天数
*该笔份额数;

实际运作天数：每笔份额上一业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的自然天数；如果不存在上一业绩报酬提取日，则为每笔份额的参与日。

管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响，密切关注市场资金面松紧变化，把握市场利率走势，合理确定集合计划的规模、投资标的以及业绩报酬计提基准的范围。管理人确定业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券回购、债券、货币市场基金等的收益情况估算，但并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，投资风险为委托人自行承担。本集合计划的业绩报酬计提基准暂定为 5.15%。管理人可根据本计划运作情况及市场情况，在每个开放期前对下一个封闭期的业绩报酬计提基准进行调整，并在管理人网站公告，具体生效时间以管理人公告为准。

本集合计划的业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的标准，并不是管理人向客户保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

3、业绩报酬支付：

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

		<p>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。当集合计划收益分配日、份额退出日或集合计划终止时，托管人根据管理人的指令将退出净值总额（含业绩报酬和退出费用）或分红金额（含业绩报酬）划拨给注册登记机构，由注册登记机构将业绩报酬和退出费用支付给管理人，并将扣除业绩报酬和退出费用的退出款项转入推广机构在注册登记机构的资金账户。托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。</p>
收益分配	收益构成	<p>集合计划收益由债券（含票据）利息收入、买卖证券价差、公允价值变动收益、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>
	分配原则	<ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划份额均享有同等分配权。 2、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。 3、本集合计划的分红方式采用红利再投，分红资金按除权除息日的单位净值转成相应的集合计划单位。 4、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。 5、法律法规另有规定的从其规定。
终止和清算		<p>（一）有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、集合计划存续期届满且未能展期的； 2、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的； 3、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格而管

- 理人未在 30 个工作日内与新的托管人签订托管协议的；
- 4、管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的；
 - 5、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责时，管理人未在 30 个工作日内与新的托管人签订托管协议的；
 - 6、存续期内，任一开放日集合计划委托人少于 2 人时；
 - 7、战争、自然灾害等不可抗力的发生导致本集合计划不能存续；
 - 8、本集合计划在中国基金业协会备案未通过；
 - 9、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。

(二) 集合计划的清算

- 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；
- 2、清算过程中有关重大事项应当及时公布；
- 3、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。
- 4、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、托管费及管理人业绩报酬后，将集合计划资产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。
- 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

	<p>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>
特别说明	<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>