

关于《太平洋证券聚金2号集合资产管理合同》

第二次变更的公告

尊敬的委托人：

就我司管理的“太平洋证券聚金2号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）合同第二次变更事宜，我司与托管人包商银行股份有限公司书面达成一致并签署了《太平洋证券聚金2号集合资产管理合同之补充协议二》。本计划合同第二次变更具体内容如下：

一、将《太平洋证券聚金2号集合资产管理合同》“二、前言”修改为：

“为规范太平洋证券聚金2号集合资产管理计划（以下简称“集合资产管理计划”、“集合计划”或“计划”）运作，明确《太平洋证券聚金2号集合资产管理合同》（以下简称“本合同”）当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司客户资产管理业务规范》（以下简称《规范》）、《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》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（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》（以下简称《运作规定》）等法律、行政法规、中国证监会和中国证券业协会、基金业协会的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》、《太平洋证券聚金2号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关规定享有权利、承担义务。

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，所披露或提供的信息和资料真实、准确、完整。并已阅知本合同和集合计划说明书全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。



委托人为自然人的，承诺不得用筹集的他人资金参与集合计划。法人或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、代理推广机构提供合法筹集资金的证明文件；未提供证明文件的，管理人、代理推广机构不得接受其参与集合计划。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。”

二、将《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“三、释义”之《管理办法》修改为：

“指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会发布施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》。”

三、将《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“三、释义”增加《运作规定》：

“指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会发布施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》。”

四、将《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“五、集合资产管理计划的基本情况”之“（四）投资范围和投资比例”之“2、投资组合比例”修改为：

“（1）本集合计划投资的固定收益类资产比例不得低于本集合计划资产总值的 80%。

（2）本集合计划总资产占净资产比例不得超过 200%。

（3）本集合计划所投资的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 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 20%；

（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 20%；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资产净值的 20%；本集合计划仅投资于外部信用评级为 AA 及以上的债券或资产支持证券；

(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；

(8) 本集合计划投资的预警线为 0.98 元、平仓线为 0.97 元”

五、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“五、集合资产管理计划的基本情况”之“（八）封闭期、开放期及临时赎回期”变更为：

“（八）封闭期、开放期

1、封闭期：本集合计划除定期开放日以及特别开放日外，均为封闭期，封闭期内不办理参与、退出业务。

2、定期开放日：本集合计划定期开放，定期开放日原则上为每个运作周期到期日的当日，客户可在该日进行申购和赎回。其中，每个运作周期为本次运作周期起始日至本次运作周期到期日（算头算尾，其中首个运作周期起始日为成立日，之后的每个运作周期起始日为上一个运作周期到期日后的首个工作日），原则上每个运作周期为起始日运作满 182 天的当日到期，如遇运作周期到期日为节假日或者其他管理人认为有必要调整的情形，管理人有权调整该运作周期到期日并提前一个工作日在管理人网站公告，但调整后的该运作周期天数不得低于 182 天。

3、特别开放日：本集合计划发生合同变更，根据本合同约定，管理人可安排特别开放日，保障不同意合同变更的委托人退出的权利。”

六、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“五、集合资产管理计划的基本情况”之“（十一）参与本集合计划的各项费用”之第 1 条至第 3 条条款变更为：

“1、认/申购费率：不收取认/申购费；

2、退出费：在管理人公布的定期开放日申请退出的，退出费率为 0；除此之外，委托人在非定期开放日（特别开放日除外）退出的，需承担违约退出费，费率为 2%/笔；”

3、管理费： 0.7%/年，详见本合同第十章节；

七、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“六、集合计划的参与和退出”之“（一）集合计划的参与”之“1、参与的办理时间”之第（2）条款变更为：

“投资者在集合计划定期开放日可以办理本集合计划的参与业务，具体以管理人网站公告为准。”

八、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“六、集合计划的参与和退出”之“（一）集合计划的参与”之“4、参与费及参与份额的计算”变更为：

“（1）参与费率

认/申购费率：不收取认/申购费；

（2）参与份额的计算方法：

①推广期参与份额的计算

每笔参与份额 = （每笔参与金额 + 推广期利息） / 集合计划份额面值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

②存续期参与份额的计算

每笔参与份额 = 每笔参与金额 / 参与申请日集合计划单位净值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。”

九、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“六、集合计划的参与和退出”之“（二）集合计划的退出”之“1、计划退出的开放日及开放时间”变更为：

“开放退出日：投资者在集合计划定期开放日、特别开放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。

未到定期开放日（特别开放日除外），委托人如果申请退出的，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，且该委托人需支付违约退出费。管理人同意该委托人的退出申请之后，由管理人发起强制赎回。”

十、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“六、集合计划的参与和

退出”之“（二）集合计划的退出”之“4、退出费及退出份额的计算”变更为：

“（1）退出费率：管理人公布的定期开放日申请退出，退出费率为 0，否则委托人在非定期开放日退出的，则需支付违约退出费，费率为 2%；

（2）退出金额的计算方法：

退出金额=[申请退出份额×申请退出日集合计划单位净值-业绩报酬(如有)]
× (1-退出费率 (如有)) ”

十一、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“十四、集合计划的费用、业绩报酬”之“（一）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”之“2、管理费 ”变更为：

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 0.7%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div 365$$

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）

十二、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“十四、集合计划的费用、业绩报酬”之“（三）业绩报酬”之“（2）业绩报酬的计提方法 ”变更为：

“业绩报酬的提取条件和提取比例如下：

若业绩报酬计提日，委托人获得超额收益，则管理人有权以该超额收益为基准按照业绩报酬提取比例 X 计提业绩报酬，其中超额收益为每笔分红/退出/到期份额（以下简称每笔份额）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：

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*X

每笔份额超额收益=该笔份额持有期收益-该笔份额基准收益

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

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，则募集参与的份额的上一业绩报酬提取日为本计划成立日或者存续期参与的份额的上一业绩报酬提取日为参与申请日。

第一个运作周期的业绩报酬提取比例为 10%以及第一个运作周期的业绩报酬计提基准 K 为 5.55%/年，此后管理人将于每个开放期前通过管理人网站公告方式公告下一个运作周期的具体业绩报酬提取比例 $X(X \leq 60\%)$ 、业绩报酬计提基准 K。

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。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。”

十三、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“二十五、风险揭示”增加“固定收益类产品特有风险”

“1、利率风险

指市场利率变动导致本集合计划投资的债券价格及收益发生变动的风险。当市场利率上升，通常带来本集合计划所投债券价格下降，从而给本集合计划的投资者收益带来减少的风险。

2、通货膨胀风险

通货膨胀风险又指购买力风险，指由于通货膨胀而使债券到期或者出售时所获得的现金购买力减少，从而造成投资者从本集合计划投资所获得现金收益购买力下降。

3、政策风险

指由于国家的经济政策变化导致债券价格发生波动而产生的风险，从而本集合计划的投资者收益出现风险。

4、信用风险

信用风险是指债券发行人是否能够实现发行时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

(1)、交易品种的信用风险：投资于公司债券、可转换债券等固定收益类产品，存在着发行人不能按时足额还本付息的风险；此外，当发行人信用评级降低时，集合资产管理计划所投资的债券可能面临价格下跌风险；

(2)、交易对手的信用风险：交易对手未能履行合约，或在交易期间未如约支付已借出证券产生的所有利息，将使集合资产管理计划面临交易对手的信用风险。

5、流动性风险

指本集合计划所投资的债券不能按目前合理的市场价格在短期内出售而形成的风险，从而给投资本集合计划的投资者的收益带来风险。”

十四、《太平洋证券聚金2号集合资产管理合同》“二十五、风险揭示”之“（一）市场风险”变更为：

“（二）市场风险

市场风险是指投资品种的价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化，产生风险。市场风险主要包括：

1、经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

2、上市公司经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务因素等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

3、衍生品风险

金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。”

十五、《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》“二十五、风险揭示”之“（三）流动性风险”以及“（四）信用风险”删除。

十六、原合同条款中如有与《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》不符之处，均以《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》相关规定为准。

《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理计划说明书》和《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理计划风险揭示书》同步进行变更。

根据本计划合同“第二十七、合同的补充、修改与变更”约定，管理人将以管理人网站方式向委托人发送合同变更意见征询函。请委托人后续留意管理人网站公告的“关于《太平洋证券聚金 2 号集合资产管理合同》第二次变更的征询函”。

特此公告

太平洋证券股份有限公司

二〇一八年十月二十五日

