

太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划

2018 年 11 月 27 日开放及第三个封闭期业绩基准的公告

尊敬的投资者：

太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）是固定收益类集合资产管理计划，将于 2018 年 11 月 27 日开放。本集合计划代码为：E61059。本集合计划管理人为太平洋证券股份有限公司，托管人为中国工商银行股份有限公司上海分行。

现管理人根据《太平洋证券金添利 1 号集合资产管理合同》（以下简称“《资管合同》”）的约定，对本集合计划第三个开放期公告如下：

1、第三个开放期安排

本集合计划第三个开放期为：2018 年 11 月 27 日。委托人可根据《资管合同》的约定在开放日当日提起申购或赎回申请。

2、第三个封闭期业绩比较基准测算依据及过程

本集合计划第三个封闭期为 2018 年 11 月 28 日至 2019 年 2 月 26 日，本集合计划第三个封闭期的业绩比较基准为 5.3%/年，业绩比较基准比较对象为三个月银行理财指数及加上流动性和信用风险溢价。

业绩比较基准测算依据及过程如下：本集合计划拟主要配置中短久期的信用债（3 年以内、AA 以上的信用债）。模拟建仓情况为：AA+ 公募债占比 40%，AA 公募债占比 40%，非公开公司债、PPN 占比 50%，

正回购比例为 30%。在进行业绩比较基准测算时，采用中债估值均值数据。具体测算为：AA+公募债（3 年），占比 20%，收益率水平 4.63%/年；AA+公募债（1 年），占比 20%，收益率水平 4.15%/年；AA 公募债（3 年），占比 20%，收益率水平 5.42%/年；AA 公募债（1 年），占比 20%，收益率水平 4.56%/年；AA 非公开公司债、PPN，占比 30%，收益率水平 6.0%/年；正回购比例为 30%，融资成本按 3%/年计算，测算出的组合收益率为 5.85%/年。按合同内约定，本产品管理费率为 0.5%/年，托管费率为 0.03%/年，组合费后收益率为 5.83%。考虑到建仓时点不同、市场变化导致的收益率偏差，故将业绩比较基准定为 5.3%/年的水平。

特此公告

太平洋证券股份有限公司

2018年11月22日

