

太平洋证券
金元宝 10 号集合资产管理合同

(集合资产管理计划)



二〇一八年十一月第二次修订版

目 录

一、特别约定.....	1
二、前言.....	1
三、释义.....	2
四、合同当事人.....	6
五、集合资产管理计划的基本情况.....	7
六、集合计划的参与和退出.....	10
七、管理人自有资金参与集合计划.....	15
八、集合计划的分级.....	16
九、集合计划客户资产的管理方式和管理权限.....	16
十、集合计划的成立.....	17
十一、集合计划账户与资产.....	17
十二、集合计划资产托管.....	19
十三、集合计划的估值.....	19
十四、集合计划的费用、业绩报酬.....	25
十五、集合计划的收益分配.....	28
十六、投资理念与投资策略.....	29
十七、投资决策与风险控制.....	30
十八、投资限制及禁止行为.....	33
十九、集合计划的信息披露.....	34
二十、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结.....	36
二十一、集合计划的展期.....	36
二十二、集合计划终止和清算.....	36
二十三、当事人的权利和义务.....	38
二十四、违约责任与争议处理.....	41
二十五、风险揭示.....	42
二十六、合同的成立与生效.....	44
二十七、合同的补充、修改与变更.....	45
二十八、或有事件.....	45

一、特别约定

本合同以纸质或电子合同签名方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人作为本合同一方，以纸质或电子合同签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

以电子签名方式签订本合同的，管理人、托管人双方签署的书面合同与委托人签署的电子合同内容保持一致。委托人、管理人、托管人同意遵守《中华人民共和国电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意自委托人签署《电子签名约定书》之日起，委托人以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同、集合计划说明书、风险揭示书）或其他文书的，视为签署本合同、集合计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他纸质文书。

二、前言

为规范太平洋证券金元宝 10 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《太平洋证券金元宝 10 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》（以下简称《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《运作管理规定》）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》、《运作管理规定》、《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划说明书》（以下简称《说明书》）、本合同及其他有关法律、法规的规定享有权利、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、代理销售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、代理销售机构不得接受其参与集合计划。委托人承诺不使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资本集合计划。

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。

集合资产管理计划合同是约定集合资产当事人之间权利义务的法律文件。集合资产管理计划说明书主要向投资者披露与集合资产相关事项的信息，是投资者据以选择及决定是否投资于集合资产的文件。投资者成功认购集合资产单位后即成为集合资产管理计划的委托人，受资产管理计划文件的约束。投资者按照其持有的集合资产单位类别和份数比例，在集合资产管理计划项下享有权利、承担义务。投资者欲了解集合资产管理计划当事人的权利和义务详情，应查阅集合资产管理计划合同。

三、释义

本《集合资产管理合同》中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

本合同、管理合同、《集合资产管理合同》：指《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理合同》及对该合同的有效修订和补充。

《管理办法》：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》。

《运作管理规定》：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》。

《指导意见》：指 2018 年 4 月 27 日中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布并实施的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》。

《业务规范》：指中国证券业协会于 2012 年 10 月 19 日正式发布并施行的《证券公司

客户资产管理业务规范》（中证协发[2012]206号）。

《暂行规定》：指2016年7月14日经中国证券监督管理委员会发布并于2016年7月18日实施的《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》。

中国：指中华人民共和国。

法律法规：指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件。

元：指中国法定货币人民币，单位“元”。

集合计划、计划、本计划、集合资产管理计划、本集合资产管理计划或本集合计划：指依据《太平洋证券基金元宝10号集合资产管理计划说明书》、《太平洋证券基金元宝10号集合资产管理合同》所设立的太平洋证券基金元宝10号集合资产管理计划。

集合资产管理计划说明书或说明书：指《太平洋证券基金元宝10号集合资产管理计划说明书》，管理人根据《运作管理规定》的要求制作计划说明书，供集合资产管理计划委托人选择并决定是否提出集合资产管理计划参与申请的要约邀请文件。

托管协议：指《太平洋证券-兴业银行关于集合资产管理计划之资产托管协议》。

中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

证券业协会：指中国证券业协会。

基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

集合资产管理计划管理人或管理人：指太平洋证券股份有限公司（简称“太平洋证券”）。

集合资产管理计划托管人或托管人：指兴业银行股份有限公司。

销售机构：太平洋证券股份有限公司以及管理人认可的其他销售机构。管理人新增或变更本集合计划的销售机构时，将提前在管理人网站上披露。

注册与过户登记人：指太平洋证券股份有限公司（简称“太平洋证券”）。

集合资产管理合同当事人：指受《集合资产管理合同》约束，根据《集合资产管理合同》享受权利并承担义务的法律主体。

投资者或合格投资者是指具备相应风险识别能力和风险承受能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人、法人或者其他组织：

（一）具有2年以上投资经历，且满足以下条件之一的自然人：家庭金融资产不低于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于40万元。

（二）最近1年末净资产不低于1000万元的法人单位。

（三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、

基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在中国证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构：

(四) 接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；

(五) 基本养老保险、社会保障基金、企业年金等养老基金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；

(六) 中国证监会视为合格投资者的其他情形。

合格投资者投资于单只固定收益类资产管理计划的金额不低于30万元，投资于单只混合类资产管理计划的金额不低于40万元，投资于单只权益类、商品及金融衍生品类资产管理计划的金额不低于100万元。资产管理计划投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定的非标准化资产的，接受单个合格投资者委托资金的金额不低于100万元。

委托人：投资者签署《集合资产管理合同》且合同生效后，投资者即为本集合资产管理计划的委托人。

集合资产管理计划成立日：指集合计划经过募集达到集合计划说明书和集合计划管理合同规定的成立条件后，管理人通告集合计划成立的日期。

募集期：指本集合计划自开始募集到募集完成之间的时间段，管理人应当在募集之日起的60日内完成募集、设立活动，具体时间见管理人有关公告。

集合计划存续期：指自集合计划成立并存续的期间。

开放期：指委托人可以在管理人公布的开放日办理集合计划参与或退出等业务的时间期间。

开放日：指开放期内的每个工作日。

封闭期：指除开放日及特别开放日外的期间，在此期间委托人不得参与、退出本集合计划。

工作日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

T日：本集合计划约定的特定日。

T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）。

规模上限日：在募集期，集合计划认购申请累计份额达到或超过规模上限的第一个交易日。

会计年度：指公历每年1月1日起至当年12月31日为止的期间。

计划年度：指本计划成立之日起每满一年为止的期间。例如，本计划于2018年04月

01日成立，则2018年04月01日至2019年03月31日为一个计划年度，依此类推。若31日为非工作日，则取其之前的最近一个工作日。

募集期/存续期参与：在募集期/开放申购日内本集合资产管理计划投资者参与本集合资产管理计划的行为。

自有资金：指管理人参与本集合计划的本金。

集合资产管理计划资产或委托投资资产：指依据有关法律、法规和委托人的意愿，委托人参与的本集合资产管理计划净额。

集合资产管理计划收益：指集合资产管理计划利息收入、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。

集合资产管理计划资产总值：指集合资产管理计划通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行有价证券交易等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和。

集合资产管理计划资产净值：指集合资产管理计划资产总值扣除负债后的净资产值。

集合资产管理计划份额净值或单位净值：指集合资产管理计划资产净值和集合资产单位总份额之比。其结果以元为单位，采取四舍五入精确到小数点后4位（即到0.0001元），由此产生的损益归入集合资产财产。

集合资产管理计划份额面值：指人民币1.00元。

集合资产管理计划资产估值：指计算评估集合资产管理计划资产和负债的价值，以确定集合资产管理计划资产净值的过程。

不可抗力：指遭受不可抗力事件一方无法预见、无法避免、无法克服的客观情况，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、注册与过户登记人非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易等。管理人或托管人因不可抗力不能履行《集合资产管理合同》时，应及时通知其他各方并采取适当措施防止委托人损失的扩大。

关联方：指根据财政部《企业会计准则第36号-关联方披露》的规定，具有下列情形之一的企业或自然人：一方控制，共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制，共同控制或重大影响的，构成关联方。

管理人网站：指 www.tpyzq.com，管理人指定网站变更时以管理人公告为准。

五、集合资产管理计划的基本情况

(一) 名称：太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划

(二) 类型：固定收益型

(三) 目标规模

本集合募集期规模和存续期规模上限为5亿份（不含募集期利息转份额部分）本集合计划，户数均不超过200人，但法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

(四) 投资范围和投资比例

1、投资范围

集合资产管理计划的投资范围为中国证监会允许集合计划投资的金融产品。具体为：

(1) 固定收益类金融产品，包括国债、金融债、企业债、公司债、可转债、可交换债券、短期融资券、央行票据、债券基金、分级基金优先份额、债券逆回购、银行存款（含协议存款）、央行票据和政府债券、货币市场基金和现金以及法律法规允许的其他固定收益证券；

(2) 权益类金融产品，包括国内上市的股票、股票型基金、混合型基金；

(3) 金融衍生品：股指期货。

(4) 债券正回购。

2、投资组合比例

(1) 固定收益类资产占本集合计划总值的比例为80%及以上。

(2) 权益类资产占本集合计划总值的比例为0-20%。

(3) 股指期货，合约价值不超过本集合计划总值的20%。

(4) 本集合计划总资产占净资产比例不得超过200%。

3、预警和平仓线

(1) 预警线：本集合计划成立后，任意一个交易日单位净值跌破0.95元，即触发预警线，自触发预警线5个交易日内调整，使得本集合计划权益类资产占资产净值的比例不超过10%；

(2) 平仓线：本集合计划成立后，任意一个交易日单位净值跌破0.9元，即触发平仓线，本集合计划将强行平仓并提前终止清算。

预警线、平仓线由管理人负责监控，托管人仅配合进行账务处理。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

如因证券市场波动、证券发行人合并、集合资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定投资比例或者合同约定的投资比例的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者回复交易的15个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

委托人在此同意并授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其上述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券。管理人应当建立健全内部审批机制和评估机制，并应当遵循投资者利益优先原则，事后告知投资者和托管人，并采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益，并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易同时向证券交易所报告。

(五) 管理期限

本集合资产管理计划管理期限10年；经委托人、管理人、托管人协商一致同意，本集合计划可提前结束。

(六) 建仓期、封闭期、开放期和流动性安排

建仓期：本集合计划建仓期为自成立之日起120天。建仓期内的投资活动，应符合本合同约定的投向和比例，但以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

建仓期结束后，本集合计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

封闭期、开放期：本集合计划自成立之日起6个月内封闭运作，期间不办理参与退出业务；本集合计划成立满6个月后，每周第一个工作日为开放日，可以办理参与、退出本集合计划的业务。

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。

流动性安排：在本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的20%。本集合计划开放退出期内，资产组合中7个工作日可变现资产的价值不低于本集合计划资产净值的10%。

流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条

件提前支取的银行存款)、资产支持证券(票据)、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

7个工作日可变现资产,包括交易所、银行间市场正常交易的债券、非金融企业债务融资工具、期货合约以及同业存单,7个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款。

(七) 集合计划份额面值

人民币1.00元。

(八) 参与本集合计划的最低金额

募集期,单个委托人首次参与份额的最低金额为人民币50万元。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。

(九) 本集合计划聘请的投资顾问

本集合计划未聘请投资顾问。

(十) 本集合计划利益冲突情况

管理人管理本集合计划不存在利益冲突情况以及可能影响委托人合法权益的其他重要事项。

(十一) 本集合计划的风险收益特征及适合销售对象

根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引(试行)》,经由管理人审慎评估,本集合计划属R3中风险,仅面向风险承受能力评级为C3稳健型、C4积极型、C5激进型的合格投资者。委托人承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求,自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

(十二) 本集合计划的销售

1、销售机构:太平洋证券股份有限公司及具有法律法规规定的代销资格并与管理人签订代销协议的机构。

2、销售方式

本集合计划应当以非公开方式向合格投资者募集。管理人、销售机构不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金,不得通过报刊、电台、电视台、互联网等传播媒体或者讲座、报告会、传单、布告、自媒体、分析会等方式向不特定对象宣传推介本计划。但管理人和销售机构通过设置特定对象确定程序的官网、客户端等互联网媒介向已注册特定对象进行宣传推介的除外。

(十三) 本集合计划的各项费用

1、参与费:0.8%/笔;

2、退出费：0；

3、管理费：0.7%/年；

4、托管费：0.05%/年；

5、业绩报酬：详见本合同第十四章节。

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；

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。

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。

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。

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。

六、集合计划的参与和退出

（一）集合计划的参与

1、参与的办理时间

（1）募集期参与

本集合计划募集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，本集合计划募集期最长不超过60日。

在募集期内，投资者在销售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募集期并通过管理人网站及时向投资者披露。

（2）存续期参与

投资者在本集合计划开放日内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。

2、参与的原则

(1) “金额参与”原则，即参与以金额申请。

(2) “已知价”原则，即募集期参与价格以人民币1.00元为基准进行计算份额；

(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；

(4) “金额优先+时间优先”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，超过募集人数上限和规模上限的其他客户委托将不被确认。

3、参与的程序和确认

委托人在募集期或者开放期内可在销售机构指定的场所参与本计划。

(1) 参与程序和确认

①投资者按销售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；

②投资者应开设销售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，销售机构不受理该笔参与申请；

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，管理人和其他销售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投资者募集期参与的，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。投资者存续期的开放日(T日)参与的，可于T+2日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

本集合计划存续期内，投资者T日申请参与成功后，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销售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。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。

4、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：

每笔参与费=每笔参与金额×参与费率÷(1+参与费率)；

每笔净参与金额=每笔参与金额-每笔参与费。

(2) 参与份额的计算方法：

①募集期参与份额的计算

每笔参与份额=(每笔参与金额+募集期利息)/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。

5、参与资金利息的处理方式

委托人的参与资金在募集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。

(二) 集合计划的退出

1、退出的办理时间

本集合计划存续期内，委托人可在开放日或者特别开放日内办理退出业务。

2、退出的原则

(1) “未知价”原则，即本计划的退出价格以受理申请当日的计划单位净值为基准进行计算，该净值在 T+1 日公告；

(2) 本计划采用“份额退出”的方式，委托人以计划份额申请退出。选择部分退出的，退出集合资产单位份额最低为1万份；

(3) 当日的退出申请可以在管理人规定的时间以前撤消；

(4) “先进先出”原则。委托人申请部分退出集合计划份额时，按先进先出的原则，即对该委托人在该销售机构参与的集合计划份额进行退出确认时，参与确认日期在前的集合计划份额先确认退出，参与确认日期在后的集合计划份额后确认退出；

(5) 管理人在不损害计划持有人权益的情况下可更改上述原则。管理人最迟须于新规例开始实施前3个工作日在指定网站上公告。

3、退出的程序和确认

(1) 申请方式：委托人可在本集合计划开放日，按照销售机构的退出业务办理规则，前往原参与的销售机构提出退出申请；

(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，管理人将指示托管人T+2日把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构T+2日划往各销售机构，最后通过销售机构划往申请退出委托人的资金账户。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。

4、退出份额的约定

每次退出的最低份额为1万份计划单位，委托人可将其部分或全部计划单位退出。

5、退出费及退出份额的计算

(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

5、退出份额、次数的约定

本计划对委托人退出次数不做限制。委托人可将其部分或全部计划单位退出。委托人选择部分退出的，其剩余的资产不得低于50万，否则其剩余份额将一并退出。

6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

(1) 单个委托人大额退出的认定

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。

(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个工作日直接或通过销售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。

7、巨额退出的认定和处理方式

(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，按单个账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。

8、连续巨额退出的认定和处理方式

(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。

9、拒绝或暂停退出的情形及处理

(1) 发生下列情形时，管理人可以在开放期拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

- 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行；
- ② 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；
- ③ 因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额退出，导致本集合计划的现金支付出现困

难：

④法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

(2) 拒绝或暂停受理退出的方式包括：

①拒绝、暂停受理某笔或数笔退出申请；

②拒绝、暂停受理开放日的全部退出申请；

③法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。

已接受的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付的，可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日（或工作日）予以支付，但最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并向委托人报告。

发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。

七、管理人自有资金参与集合计划

(一) 自有资金参与、退出的条件、程序

本集合计划的存续期内，管理人可以以自有资金参与本集合计划，自有资金参与条件和程序同其他委托人（指参与本集合计划的管理人以外的委托人）。

(二) 募集期和存续期参与集合计划的金额和比例

管理人以自有资金参与本集合计划的份额不得超过本集合计划总份额的 10%（含 10%），管理人及其下设附属机构以自有资金参与本计划的份额不得超过本计划总份额的 50%，具体参与金额以管理人网站公告为准。

(三) 自有资金退出的条件、程序

自有资金退出程序同其他委托人。自有资金参与本集合计划的持有期限不低于 6 个月。

因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人应在 10 个工作日内办理超出份额的退出手续。

为解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人参与的自有资金参与、退出不受上述比例、持有期等限制，但应及时告知委托人和托管人，并向相关派出机构及证券投资基金业协会报告。

(四) 收益分配和责任承担方式

管理人自有资金参与本集合计划,与管理人以外的委托人享有同等参与收益分配以及清算资金返还的权利。

管理人自有资金参与份额不对管理人以外的委托人承担责任。

(五) 风险揭示和信息披露

本集合计划管理人以自有资金参与本集合计划,不对管理人以外委托人承担投资风险,也不构成管理人对本集合委托人投资本金不受损失或者取得最低收益的暗示。

管理人自有资金参与、退出时应当提前5个工作日以临时报告的形式通过管理人的网站(www.tpyzq.com)方式及时向客户披露。

八、集合计划的分级

本集合计划不根据风险收益特征进行分级。

九、集合计划客户资产的管理方式和管理权限

本集合计划由太平洋证券股份有限公司担任管理人,按照本合同约定,行使管理人权利并负责本集合计划的投资运作和管理。

(一) 管理方式

本集合计划由管理人进行主动管理,在本合同约定的投资范围及比例限制内,独立运作集合计划的资产。

(二) 管理权限

管理人对本集合计划的管理权限包括:

- 1、根据本合同的约定,独立运作集合计划的资产;
- 2、根据本合同的约定,收取集合计划的管理费等相关费用;
- 3、根据本合同的约定,终止本集合计划的运作;
- 4、在本合同的有效期内,在不违反公平、合理原则以及不妨碍托管人遵守相关法律法规及其行业监管要求的基础上,监督托管人,并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益;
- 5、集合计划资产受到损害时,向有关责任人追究法律责任;发生差错时,向当事主体追偿不当利得;
- 6、法律法规及本合同约定的其他权利。

十、集合计划的成立

(一) 集合计划成立的条件和日期

集合计划的参与资金总额不低于1000万元人民币且其委托人的人数为2人(含)以上200人(含)以下。本计划募集过程应符合法律、行政法规和中国证监会规定,于募集结束之后十个工作日内,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。本计划在取得验资报告后,管理人公告本集合计划成立并公告。

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。

管理人在集合计划成立之日起五个工作日内,将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或资产缴付证明等材料报基金业协会备案,并抄报中国证监会相关派出机构。

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。存入前述专门账户的投资者资金,独立于管理人、销售机构的固有财产,非因投资者本身的债务或者法律规定的其他情形,不得查封、冻结、扣划或者强制执行存入专门账户的投资者参与资金。

(二) 集合计划设立失败

集合计划募集期结束,在集合计划规模低于人民币1000万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募集费用,并将已认购资金及银行活期利息(按银行同期活期存款利率计)在募集期结束后30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。

(三) 集合计划开始运作的条件和日期

1、条件

自集合计划公告成立即符合开始运作的条件。集合计划在完成备案前不得开展投资活动,但以现金管理为目的,投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

2、日期

本集合计划自成立之日起开始运作。

十一、集合计划账户与资产

(一) 集合计划账户的开立

托管人负责以资产托管人的名义开立托管专户，保管委托资产的银行存款。该托管专户同时也是托管人在法人集中清算模式下，代表所托管的包括本项委托资产在内的所有托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。

托管专户由托管人负责管理。委托资产托管期间的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、资产划拨、追加资产和提取资产等，均需通过该账户进行。资产托管人可根据实际情况需要，为委托财产开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。

托管人为本集合计划开立证券账户、资金账户及其他相关账户。证券账户名称为“太平洋证券—兴业银行—太平洋证券金元宝10号集合资产管理计划”[备注：账户名称以实际开立账户名称为准]。

销售机构为集合计划的每一位投资者建立集合计划交易账户，记录投资者通过该销售机构买卖本集合计划份额的变动及结余情况。

太平洋证券股份有限公司担任本计划的注册与过户登记人，并承担相应注册与过户登记人责任。

集合计划证券账户的开立和使用，仅限于满足开展本集合计划的需要。

管理人同时担任本计划的注册登记机构，并承担相应委托责任。注册登记机构为投资者开立集合计划账户，用于记录投资者持有的本集合资产管理计划份额。

本计划证券账户的开立和证券账户卡的保管由托管人负责，管理和使用由管理人负责。

(二) 集合计划资产的构成

本集合计划资产的构成主要有：

本集合计划的资产包括用集合计划资金购买的各种有价证券、银行存款本息及其他投资，其主要构成包括银行存款及其应计利息，清算备付金及其应计利息，根据有关规定缴纳的保证金，应收参与款，票据投资及其应计利息，债券投资及其应计利息，基金投资及其分红，其他资产等。

(三) 集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人按照托管协议约定予以托管，并独立于管理人及托管人及注册登记机构的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人、托管人或及注册登记机构的债权人无权对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《运作管理规定》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。

十二、集合计划资产托管

本集合计划资产由计划管理人委托兴业银行股份有限公司托管，管理人已经与托管银行签订了《太平洋证券-兴业银行关于集合资产管理计划之资产托管协议》。托管人将严格遵照有关法律、法规及双方达成的托管协议对集合资产进行托管。

委托人签署本合同的行为本身即表明对现行证券交易、登记结算制度下托管人托管职能有充分的了解，并接受本合同约定的托管职责和范围。

托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同、说明书与托管协议冲突，相关约定以管理合同为准。

十三、集合计划的估值

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

(一) 资产总值

集合计划的资产总值是指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行基金、股票、债券等资本市场投资所形成的各类资产的价值总和。

(二) 资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

(三) 份额净值

集合计划份额净值是指集合计划资产净值除以计划总份额，即单位净值。集合计划份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。

(四) 估值目的

集合计划资产估值的目的是客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出及委托到期清算集合计划的基础。

(五) 估值对象

运用集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

(六) 估值日

本集合计划成立后，对资产进行估值之每个交易日。

(七) 估值方法

除管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外，本计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管

理人与托管人另行协商确定估值方法，并以签署托管协议补充协议的方法确定有关内容。

1、股票估值方法

(1) 上市流通股票按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 未上市股票的估值

①首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的一股票的收盘价进行估值；

(3)首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的一股票的收盘价进行估值；

(4)非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按以下方法估值：

①、估值日在证券交易所上市的一股票的收盘价格低于获得非公开发行股票的成本时，采用市价法；

②、估值日在证券交易所上市的一股票的收盘价格高于获得非公开发行股票的成本时，可按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D-D1) \div D$$

其中：FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为取得该非公开发行股票的成本；P为估值日在证券交易所上市的一股票的收盘价；D为该非公开发行股票的锁定期所含的交易天数；D1为估值日至锁定期结束所包含的交易天数（不包含估值日当天）。

(5) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1) — (4) 小项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1) — (4) 小项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

2、债券估值方法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值

日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素或参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素或参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(4) 交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(5) 在对银行间市场的固定收益品种估值时采用中央国债登记结算有限责任公司中债估值数据查询系统中公布的当日最新中债估价净价为准估值。如有充足证据表明该价格不能真实地反映公允价值的，应主要依据第三方估值机构处理标准或意见并综合考虑市场成交价、市场报价、收益率曲线及估值价格；

(6) 包括中小企业私募债在内的只在上交所固定收益平台和深交所综合协议平台挂牌交易的债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；

(7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1) - (7)小项规定的方法对计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1) - (7)小项规定的方法对计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，资产管理人可根据具体情况与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

3、证券投资基金估值方法

(1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估

值；

(2) 持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日前一交易日的基金份额净值估值；估值日前一交易日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

(3) 持有的货币市场基金，按估值日前一交易日基金管理公司公布的每万份收益计算；

在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1)-(3)项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1)-(3)项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

4、银行定期存款或通知存款估值方法，银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。对利率变化后的账务进行调整，不追溯之前已计提的金额和账务。

5、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的，管理人可根据具体情况，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值；

6、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值；如管理人或托管人发现集合资产管理计划估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。根据有关法律法规，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布；

7、暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其它原因暂停营业时，或因其它任何不可抗力致使管理人或托管人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人或托管人必须及时完成估值工作。

(八) 估值程序

日常估值由管理人进行。用于披露的资产净值由管理人完成估值后，将估值结果报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；托管人复核后以双方认可方式反馈给管理人；报告期末估值复核与集合资产管理计划会计账目的核对同时进行。

集合计划份额净值的计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。

(九) 估值错误与遗漏的处理

管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当份额计价出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

因份额净值错误给委托人造成直接经济损失的，管理人应当承担赔偿责任，赔偿范围以投资人实际损失为限。管理人在赔偿委托人后，有权向有关责任方追偿。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

(十) 差错处理

1、差错类型

本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册与过户登记人、或代理销售机构、或委托人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿并承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料备案差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成委托人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则有协助义务的当事人应当承担相应的责任，但不限于赔偿、责任声明等。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求返还不当得利的权利及要求获得不当得利的当事人承担因不返还

或不全部返还不当得利造成的损失；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成集合资产管理计划资产损失时，托管人应为集合资产管理计划的利益向管理人追偿，如果因托管人过错造成集合资产管理计划资产损失时，管理人应为集合资产管理计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成集合资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、《集合资产管理合同》或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失；

(7) 按法律法规规定的其他方式处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改注册与过户登记人的交易数据的，由注册与过户登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行说明。

(十一) 暂停披露净值的情形

1、与本计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；

2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合资产管理计划资产价值时。

(十二) 特殊情形的处理

由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的集合资产管理计划资产计价错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理

人和托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

由于注册与过户登记人发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误而造成的份额净值计算错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十四、集合计划的费用、业绩报酬

(一) 集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间

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：

$$H = E \times 0.05\% \div 365 \text{ (首日按集合计划初始资金金额)}$$

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)。

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即可支付日支付。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。

管理人在约定的托管费支付日未向托管人发送托管费划付指令的，托管人有权在托管费支付日当日或后续任一自行扣收全部或部分应付未付托管费。费用自动划扣后，托管人应向管理人告知托管费支付金额及计算方式，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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0.7%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.7\% \div 365 \text{ (首日按集合计划初始资金金额)}$$

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。

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

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。

5、按照国家有关规定可以列入的其他费用

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:

银行结算费用,于实际发生时计入集合计划费用;

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;

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;

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。

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;

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。

(二) 不列入集合计划费用的项目

集合计划募集期间的费用,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,以及本集合计划成立前发生的费用和存续期间发生的与募集有关的

费用等不列入本集合计划费用。

(三) 业绩报酬

1、业绩报酬计算方法

$R \leq r_i$, 管理人业绩报酬=0, R 为客户份额持有期年化收益率, r_i 为每个封闭期的业绩报酬计提基准:

$r_i < R$, 管理人提取超额部分的50%作为管理人业绩报酬, 余下50%归份额持有委托人享有。提取频率不得超过每6个月一次。但因委托人退出集合计划提取业绩报酬的, 不受前述提取频率的限制。

其中, r_i 为业绩报酬计提基准, 业绩报酬计提基准设置为6.0%, 该产品主要80%以上仓位投资于债券, 并结合股票市场情况进行部分可转换债券及权益类资产配置。债券投资主要是通过通过对上市公司发行的债券经过甄别后选取收益比较高、风险相对可控的短期债券进行投资, 并对个券进行风险识别与划分, 对利率走势、期限利差走势、信用利差走势进行研究分析。权益类资产投资主要是结合市场情况进行指数型基金及要约收购等事件类股票的配置。具体测算过程如下:

本集合计划计划110%主要投资于AA-及以上的上市公司信用债, 预期收益5.5%, 10%主要投资于可转换债, 预期收益5%-10%, 10%投资指数基金及股票, 预期收益5%-15%, 融资利率-3.5%, 产品预期收益测算为6.0%-7.5%; 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6.0%/年。

投资品种	市场中性		
	预期仓位	预期收益	组合收益
信用债	110%	5.50%	6.05%
可转换债	10%	5%-10%	0.5%-1%
权益类资产	10%	5%-15%	0.5%-1.5%
融资成本	30%	-3.50%	-1.05%
总资产预期收益	-	-	6%-7.5%

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。

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

P_1 为业绩报酬计提日的计划单位累计净值;

P_0 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位累计净值;

P_0^* 为上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值;

D 表示上一个发生业绩报酬计提日(含)到本次业绩报酬计提日(不含)的实际天数;

管理人业绩报酬计提如下:

持有期年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
$R \leq r_i$	0	$Y=0$
$R > r_i$	50%	$Y=A \times (R-r_i) \times 50\% \times D \div 365$

Y =业绩报酬;

A =每笔退出份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值=每笔退出份额*上一个业绩报酬计提日的计划单位净值。

2、业绩报酬计提

(1) 按委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

(2) 业绩报酬计提日为本集合计划收益分配日(以管理人的分红公告为准)、委托人退出日或计划终止日。

(3) 在委托人退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的,业绩报酬从退出资金或清算资金中扣除。在本集合计划收益分配日提取业绩报酬的,业绩报酬从分红款中扣除。

(4) 在委托人退出或计划终止时,业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分,则将该退出份额单独核算业绩报酬,而该笔参与的剩余部分不受影响。

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个工作日内将业绩报酬划拨给管理人。因涉及注册登记数据,托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

十五、集合计划的收益分配

(一) 收益的构成

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。

(二) 可供分配收益

可供分配收益指截至收益分配基准日（即可供分配收益计算截至日）资产负债表中集合计划未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数。

（三）收益分配原则

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。

2、集合计划份额均享有同等分配权。

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。

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销售机构结算备付金账户，由销售机构划入委托人的交易账户，现金红利在R+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，分红资金按除权除息日的单位净值转成相应的集合计划单位。

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。

6、法律法规另有规定的从其规定。

（四）收益分配方案的确定与披露

在满足分红条件时，管理人可根据本集合计划的运作情况决定分红事宜，具体分红事宜以管理人公告为准。本集合计划收益分配方案由管理人拟定，由托管人核实后由管理人报告委托人。管理人至少在R-2工作日之前（R为权益登记日）将收益分配方案向委托人公告。

十六、投资理念与投资策略

（一）投资目标

本集合计划主要通过投资于债券、股票及其它多种资产类别，积极寻求各类具备确定性收益特征的投资机会，争取为委托人创造持续稳定回报。

（二）投资理念

精选信用债券，积极捕捉市场中较为确定性的投资机会，通过多产品、多市场、多策略分散风险，为投资者提供稳定而持续的投资收益。

（三）投资策略

1、精选信用债

管理人从行业、公司经营风险、公司财务风险以及增信情况研判信用债券的内部信用评

级，在此基础上，结合信用与收益率的关系来精选信用债券。

2、股票型、混合型开放式基金投资策略

对于预期利好的停牌股票通过持有该股票的基金进行套利；考察折价率、剩余期限、到期年化收益率、分红回报率及投资能力，把握阶段性投资机会和套利机会。

3、可转债投资策略

综合考虑票息收益、转股溢价率、纯债溢价率、隐含波动率、绝对价格等指标，在具有较强债性保护时捕捉低风险投资机会。

4、股票投资策略

当股票市场出现收益率较为确定的投资机会时，捕捉低风险投资机会。（包括但不限于要约收购套利，确定性事件驱动，新股申购等）。

十七、投资决策与风险控制

（一）集合计划的决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

1、《管理办法》、《管理规定》、《指导意见》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律文件。

2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本集合计划投资决策的基础。

3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。力争保护投资者的本金安全，在此基础上为投资者争取较高的收益。

（二）投资程序

1、投资决策程序

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、投资经理两级体系组成。

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；审核投资经理拟定的投资策略；月度投资总结和重大项目投

券计划书：确定证券池入池品种的选择原则及其品种调整；确定投资经理以及对投资经理做出投资授权；对资产管理产品的运作及绩效状况进行业绩评估等。

投资经理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，投资经理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。交易室接到投资经理的投资指令后，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经理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、投行业务等涉及利益冲

实的业务应在机构、人员、信息、账户等方面严格隔离。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：

(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：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。

十八、投资限制及禁止行为

(一) 投资限制

为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：

(1) 本计划申购新股，申报的全额不得超过集合计划的现金总额，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

(2) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过资产净值的 25%；(托管人对“同一资产”按照“同一债券，同一股票，单只基金”来监控)

(3) 本计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。本产品参与银行间债券正回购资金余额或逆回购资金余额超过上一日净资产 100%的，管理人和托管人应向相关金融监管部门报告。

(4) 同一证券期货经营机构管理的全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%。同一证券期货经营机构管理的全部资产管理计划及公募基金证券投资基金(以下简称公募基金)合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%。(托管人对此不予以监控)。

如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行适当程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。

管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责，托管人不承担由此造成的损失。

(二) 禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- 3、向客户做出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；
- 4、挪用集合计划资产；

- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- 6、募集资金超过计划说明书约定的规模；
- 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额；
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易；
- 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为；
- 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

十九、集合计划的信息披露

(一) 定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、资产托管年度报告。

1、集合计划单位净值报告

管理人在每个工作日通过管理人网站披露经过托管人复核的前一个工作日的份额单位净值。

2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告

管理人在每季度向委托人提供一次准确、完整的季度资产管理报告，对报告期内集合计划的运作情况进行说明，包括但不限于履职情况报告、投资表现、投资组合、收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项以及中国证监会规定的其他事项进行说明。托管人在每季度向委托人提供一次准确、完整的季度资产托管报告。上述报告应于每季度结束之日起1个月内通过管理人网站通告并向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会备案。集合计划成立不足3个月或者存续不足3个月时，管理人可以不编制当期的季度报告。

3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告、年度财务会计报告

管理人在每年度向委托人提供一次准确、完整的年度资产管理报告，对报告期内集合计划的运作情况进行说明，包括但不限于履职情况报告、投资表现、投资组合、会计报告、收益分配情况、投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项以及中国证监会规定的其他事项进行说明。年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对本计划会计核算及净值计算出具意见。托管人在每年度向委托人提供

一次准确、完整的年度资产托管报告。上述报告应于每个会计年度截止日后4个月内通过管理人网站通告。集合计划成立不足3个月或者存续期间不足三个月的，管理人、托管人可以编制当期的年度报告。托管人对年度报告（内含财务会计报告内容）复核后出具年度托管报告即为托管人对财务会计报告和年度报告出具意见

（二）临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人网站公告方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

1、集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

2、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

3、发生巨额退出并延期支付；

4、集合计划终止和清算；

5、管理人以自有资金参与和退出；

6、合同的补充、修改与变更；

7、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

8、负责本集合计划的代理销售机构发生变更；

9、集合计划投资于管理人、托管人及其有关关联方关系的公司发行或者承销期内承销的证券；

10、管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

11、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

12、其他管理人认为的重大事项。

（三）信息披露方式

本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《运作管理规定》、集合资产管理合同及其他有关规定进行。集合计划的信息披露事项将以下列方式进行披露。

1、管理人网站信息披露

本说明书、资产管理合同、其他备查文件、相关报告等有关集合计划的信息，将在集合计划管理人网站（www.tpyzq.com）上披露，委托人可随时查阅。

2、太平洋证券客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，委托人可以通过太平洋证券客服电话（95397）查询。

二十、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

(一) 集合计划份额的转让

在证券交易所以及其他中国证监会认可的交易平台开通后,集合计划存续期间,客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额并办理份额变更登记手续。转让后,持有资管计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。管理人应当在份额转让前,对受让人的合格投资者身份和资管计划的投资者人数进行合规性审查。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。

管理人、交易所不得通过办理计划的份额转让,公开或者变相公开募集本计划。

(二) 集合计划的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等集合计划交易方式,将一定数量的集合计划份额按照一定规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。

注册与过户登记人只受理继承、捐赠、以及其他形式财产分割或转移等情况下的非交易过户。具体业务规则以注册与过户登记人业务规则为准。

委托人办理因上述原因引起的非交易过户须提供注册与过户登记人要求的相关证明文件等材料到注册与过户登记人处办理。对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起2个月内办理,并按注册与过户登记人规定的标准收费。

(三) 其他情形

集合计划份额冻结、解冻的业务,由注册与过户登记人办理。

集合计划注册与过户登记人只受理国家有关机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻以及注册与过户登记人认可的其他情况的集合计划份额的冻结与解冻。

当集合计划份额处于冻结状态时,集合计划注册与过户登记人或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

二十一、集合计划的展期

本集合计划存续期满后不进行展期。

二十二、集合计划终止和清算

(一) 有下列情形之一的,集合计划应当终止:

1、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或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；

2、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接；

3、存续期内，连续5个工作日集合计划委托人少于2人时；

4、本集合计划委托人、管理人、托管人一致同意提前终止本计划时；

5、存续期届满；

6、本集合计划跌破平仓线以及其他本合同约定的应当终止的情形；

7、本集合计划在中国基金业协会备案未通过；

8、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。

管理人应当自本合同终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

(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，清算后的剩余财产，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。若本计划发生委托财产流动性受限等情形，管理人可以延迟清算并及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

受限资产指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、资产支持证券发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券，以及中国证监会认定的其他和非金融企业债务融资工具等资产。

3、管理人应当在本集合计划清算结束后5个工作日内将清算结果报中国基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

资产管理计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。

二十三、当事人的权利和义务

(一) 委托人的权利和义务

1、委托人的权利

(1) 取得集合计划收益；

(2) 通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划运作的信息，包括资产配置、投资比例、损益状况等；

(3) 按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；

(4) 按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；

(5) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

(6) 法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。

2、委托人的义务

(1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；

(2) 按照本合同及《说明书》约定交付委托资金；

(3) 按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；

(4) 不得违规转让其所拥有的计划份额；

(5) 委托人以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。

(6) 法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他义务。

(二) 管理人的权利和义务

1、管理人的权利

(1) 根据本合同及《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；

(2) 根据本合同及《说明书》的约定，收取管理费等相关费用；

(3) 按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划份额的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；

(4) 根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；

(5) 监督托管人，并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益；

(6) 行使集合计划资产投资形成的投资人权利；

(7) 集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；

(8) 法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。

2、管理人的义务

(1) 在集合计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，以专业技能管理集合计划的资产，为委托人的最大利益服务，依法保护委托人的财产权益；

(2) 对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理、分别记账，进行投资；

(3) 依法计算并披露资产管理计划净值，确定参与、退出价格；

(4) 进行资产估值等会计核算；

(5) 根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；

(6) 依法对托管人、代理销售机构的行为进行监督，如发现托管人、代理销售机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、代理销售协议的，应当予以制止；

(7) 按规定出具资产管理报告，保证委托人能够了解有关集合计划资产投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

(8) 按照本合同及《说明书》约定及时向委托人分配集合计划的收益；

(9) 按照法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向申请退出集合计划的委托人支付退出款项；

(10) 妥善保存与集合计划有关的合同、协议、销售文件、客户资料、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；

(11) 在集合计划到期或其他原因解散时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资金的返还事宜；

(12) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向委托人和托管人报告；

(13) 因管理人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(14) 因托管人违反本合同导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

(15) 以管理人名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为。

(16) 法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。

(三) 托管人的权利与义务

1、托管人的权利

(1) 依法对集合计划的资产进行托管；

(2) 按照本合同、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；

(3) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、《说明书》和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的其他权利。

2、托管人的义务

(1) 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户，不同托管账户中的财产应当相互独立；

(2) 非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；

(3) 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，按照托管协议保管集合计划的资产，确保所保管集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

(4) 安全保管所托管集合计划资产，执行管理人的投资或清算指令，及时办理清算、交割事宜；

(5) 定期核对资产管理业务资产情况，建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的资产管理计划资产净值和资产管理计划参与、退出价格；

(6) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的，应当拒绝执行，并向中国证监会派出机构和证券投资基金业协会报告；

(7) 建立与管理人的对账机制，复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值和本计划参与、退出价格；

(8) 对资产管理计划投资信息和相关资料承担保密责任，除法律、行政法规、规章规定或者审计要求、合同约定外，不得向任何机构或者个人提供相关信息和资料；

(9) 办理与资产管理计划托管业务活动有关的信息披露事项，对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见；

(10) 妥善保存与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于二十年；

(11) 在集合计划终止时，与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

(12) 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告委托人和管理人；

(13) 因违反本合同导致集合计划财产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

(14) 因管理人过错造成集合计划资产损失的，代委托人向管理人追偿；

(15) 法律法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》、《托管协议》约定的其他义务。

二十四、违约责任与争议处理

(一) 违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给计划财产或者委托人造成损害的，应当承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

(1) 不可抗力

不可抗力是指本合同当事人无法预见、无法克服、无法避免，且在本合同生效之后发生的，使本合同当事人无法全部或部分履行本合同的任何事件，包括但不限于战争、自然灾害等。

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划财产损失扩大。任何一方当事人迟延履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

(4) 在计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。违约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误的，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接损失。

6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职务的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

(二) 争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交中国国际经济贸易仲裁委员会，按照该会现时有效的仲裁规则在北京仲裁。仲裁裁决是终局性的，对各方均有约束力。争议处理期间，相关各方当事人应恪守职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行本合同规定的义务，维护委托人的合法权益。

二十五、风险揭示

委托人投资于本计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致委托人本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产，管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度，以降低风险发生的概率。但这些制度和办法不能完全防止风险出现的可能，管理人也不保证本计划一定盈利，也不保证最低收益。本计划面临的风险包括但不限于以下风险：

(一) 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股息、利息和分红，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。

(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。”

(三) 管理风险

在集合资产管理计划运作过程中，管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的获取和对经济形势、金融市场价格走势的判断，如管理人判断有误、获取信息不

会、或对投资工具使用不当等影响集合资产管理计划的收益水平。

(四) 关联交易的风险

关联交易风险指集合计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，由于不正当的关联交易导致的相应道德风险、法律风险以及系统风险，而这些风险可能使本计划资产遭受损失。

(五) 税收风险

集合计划资产和相关当事人应按有关法律法规规定承担相应税费并履行纳税义务（包括但不限于可能需要承担财税[2016]140号文项下的增值税等），且随着国家财税政策的变化，应当由集合计划资产和相关当事人承担的税费可能发生变化，从而导致委托人实际获得的收益（如有）可能降低的风险。

(六) 其他风险

1、技术风险。在集合资产管理计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等；

2、操作风险。管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险；

3、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致委托资产的损失，从而带来风险；

4、担任集合资产管理计划管理人的资产管理公司，因停业、解散、撤销、破产，或者被中国证监会撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给委托人带来一定的风险。

二十六、合同的成立与生效

(一) 合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- 1、委托人参与资金实际交付并经管理人确认；
- 2、其他合同约定的生效条件。

(二) 合同的组成

《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料和各销售机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证、委

托人通过纸质合同签名方式产生的本合同的附件，是本合同不可分割的一部分。

(三) 本合同正本一式陆份，管理人持有两份，托管人持有贰份，上报协会和监管部门贰份。

二十七、合同的补充、修改与变更

1、本合同签署后，因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商，可以对本集计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集计划。

2、除上述1所述情形外，为了委托人的利益，管理人和托管人经书面达成一致后可以变更合同，并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以书面或者管理人网站公告方式（由管理人决定）向委托人发送合同变更征询意见函。委托人不同意变更的，应在征询意见函发出后的特别开放日（特别开放日的设置为管理人对不同意变更的委托人采取的保障其退出的措施）提出退出本集计划的申请；意见答复不同意变更且逾期未退出的，管理人有权在期限届满后将相关份额强制退出计划；约定期限内未反馈意见的，视同委托人同意本合同变更（但涉及本集计划的投向和比例修改，需取得委托人的书面同意，不允许默许）。自合同变更生效之日起，公告内容即成为本合同组成部分。

3、合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

4、委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

5、管理人应当自资产管理合同变更之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派驻机构。

二十八、或有事件

本合同所称的或有事件是指，根据相关法律法规的规定，管理人可能以独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司，发生管理人变更或者托管人变更。

(一)当管理人独资或者控股方式成立具有独立法人资格的从事资产管理业务的公司时,委托人在此同意,如果或有事件发生,在管理人与托管人协商一致的基础上,管理人有权将本合同中由管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让给上一条所述的从事资产管理业务的公司或者新的管理人,并无须就此项变更和委托人另行签订专项协议。但在转让前管理人应以信息披露的形式通告委托人。管理人保障委托人退出本专项计划的权利,并在届时的通告中对相关事项作出合理安排。

管理人应当保证受让人具备开展此项业务的相关资格,并向托管人提供监管机构相关批复文件复印件。

管理人应按照监管机构的要求办理转让手续。

(二)管理人和托管人变更

1、管理人或托管人变更的情形

管理人变更的情形:管理人被依法撤销资产管理业务资格;管理人被依法解散,或被依法撤销或被依法宣告破产;法律法规及中国证监会认定的其他情形。

托管人变更的情形:托管人被依法撤销基金托管资格;托管人被依法解散,或被依法撤销或被依法宣告破产;法律法规及中国证监会认定的其他情形;

2、管理人或托管人变更程序

(1)发生管理人、托管人变更的情形的,需在发生之日起6个月内完成变更程序,否则本集合计划终止;

(2)管理人或托管人变更需经过委托人同意。管理人应当通过管理人网站公告或邮件通知等方式向委托人通知变更征询意见,委托人需在征询意见发出之日起5个工作日内向管理人做出是否同意回复。委托人不同意变更的,应在征询意见发出之日起5个工作日内向管理人提出退出本集合计划的申请;委托人未在前述时间回复意见或意思表示不明确或未在征询意见发出之日起5个工作日内提出退出计划申请的,视为委托人同意管理人或托管人变更,不再接受委托人退出申请;

(3)管理人变更公告,应当在管理人享有的权利和由管理人承担的义务转让生效后由新管理人通过指定的网站或邮件通知等方式向委托人公告;托管人变更公告,应当在托管人变更后,由新托管人通过网站公告方式告知委托人;

(4)管理人变更公告生效后,应当在15个工作日内要求委托人重新签订新管理人的资产管理合同;托管人变更公告生效后,无需重新签订合同,公告视为合同的一部分内容;

(5)因委托人未同意管理人或托管人变更导致集合计划份额退出,管理人应当在公告

生效前5个工作日内设置特别开放期，若在特别开放期内委托人未退出的，则视为同意变更管理人或托管人；

(6) 完成管理人或托管人变更工作后，管理人、托管人及变更后管理人、变更后托管人应当根据相关规定进行报备或报告（如需）。

3、法律、行政法规、中国证监会规定对管理人或托管人的变更另有规定的，按其规定执行。

管理人、托管人确认，已向委托人明确说明集合计划的风险，不保证委托人资产本金不受损失或取得最低收益；委托人确认，已充分理解本合同的内容，自行承担投资风险和损失。

本合同应由委托人本人签署，当委托人为机构时，应由法定代表人或其授权代表签署并加盖公章或者经有效授权的合作专用章。

(以下无正文)

(本页无正文，为《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理合同》签署页)

委托人签字/盖章：

管理人



法定代表人或授权代表 (盖章)

托管人



法定代表人或授权代表 (盖章)

签订日期：2018年 11 月 ____ 日

注意：账户如有变更，请及时通知相关各方。

托管专户

户 名：

账 号：

开户银行：

大额支付号：

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

托管费收款账户

账户名：证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账号：216200191675000146

开户行：兴业银行上海分行营业部