

太平洋证券金添利 2 号集合资产管理计划

2019 年 4 月 25 日开放及下一期业绩比较基准的公告

尊敬的投资者：

太平洋证券金添利 2 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，本集合计划代码为：E61075。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市分行。

现管理人根据《太平洋证券金添利 2 号集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“《资管合同》”）的约定，对本集合计划第一个开放日公告如下：

1、第一个开放日安排

本集合计划第一个开放日为：2019 年 4 月 25 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、第二个封闭期业绩比较基准测算依据及过程

第二个封闭期为：2019 年 4 月 26 日至 2019 年 10 月 22 日（如期限内如发生合同变更，请以合同约定为准），本期业绩比较基准为 5.0%/年。

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 30%，AA 公募债占比 50%，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4.55%/年；AA+公募债（1年），占比10%，收益率水平4.35%/年；AA公募债（3年），占比30%，收益率水平5.15%/年；AA公募债（1年），占比20%，收益率水平4.50%/年；AA非公开公司债、PPN，占比30%，收益率水平5.6%/年；正回购比例为30%，融资成本按3.3%/年计算，测算出的组合收益率为5.60%/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5.07%。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5.0%/年的水平。

特此公告

太平洋证券股份有限公司

2019年4月25日

