

太平洋证券太盈1号

集合资产管理计划说明书

特别提示:

本说明书依据《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业务运作管理规定》(以下简称《运作管理规定》)、《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》)、《太平洋证券太盈1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,不存在任何虚假记载、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。本说明书中的业绩报酬计提基准仅供委托人参考,不构成管理人、托管人和销售机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

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》、《运作管理规定》、《指导意见》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

集合计划基本信息	名称	太平洋证券太盈1号集合资产管理计划
	类型	固定收益型
	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),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。
	管理期限	本计划存续期限10年,遇到本计划提前终止或者展期的,本计划存续期限相应提前到期或者延长。
	募集期	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。管理人有权根据实际情况提前或者延长募集期并通过管理人网站及时向投资者披露。
	封闭期	除本集合计划约定的开放日和特别开放日以外,均为本集合计划封闭期,不办理参与或者退出业务。
	开放期	本集合计划自成立之日起,每周一为开放申购日(如该周一为非工作日则当周不开放),委托人可以在该日申请申购;自本集合计划成立之日起(含当日),每满180天后的最近一个周一工作日为退出开放日(如该周一为非工作日,则顺延至下一个周一工作日),委托人可在该日申请退出。 例如本计划2019年4月1日成立,则满180天当日为2019年9月27日,其最近一个周一为2019年9月30日且为工作日,则本集合计划第一个开放退出日为2019年9月30日,自第一个开放退出日(不含当天)运作满180天的当天为2020年3月28日,该日最近一个周一为2020年3月30日且为工作日,则第二个开放退出日为2020年3月30日,以此类推;假如本计划2019年4月8日成立,则满180天当日为2019年10月4日,其最近一个周一为2019年10月7日,但该日为非工作日,则顺延至下一个周一工作日2019年10月14日作为本计划第一个开放退出日,自第一个开放退出日(不含当天)运作满180天的当天为2020年4月10日,该日最近一个周一为2020年4月13日且为工作日,则第二个开放退出日为2020年4月13日,以此类推。
	份额面值	人民币1.00元。
	是否聘用投资顾问	否
是否有利益冲突情况	本集合计划发生“管理人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或自其他重大关联交易”时,可能发生利益冲突。管理人在实施前述投资行为前事先得到委托人同意,并	

	<p>在投资行为实施过程中按照市场通行的方式和条件参与交易，公平对待委托财产，遵循委托人利益优先原则并防范利益冲突。</p>
最低金额	<p>单个投资者首次参与份额的最低金额为人民币 30 万元（含）。对于非首次参与的投资者，其新增参与资金的最低金额为人民币 1 万元（含）。</p>
相关费率	<p>1、参与费：0； 2、退出费：0； 3、管理费：0.8%/年； 4、托管费：0.03%/年；</p>
投资范围	<p>1、投资范围 本计划全部投资于标准化资产，具体如下： (1) 债权类资产：银行存款、同业存款、货币型公募基金、债券型公募基金（含分级基金优先级）以及证券交易所或者银行间市场交易的标准化债权类资产：国债、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债、可转债、可交换债券、短期融资券、中央银行票据、政府债券、债券逆回购； (2) 股权类资产：交易所上市交易的股票、股票型公募基金、混合型公募基金； (3) 金融衍生品：在证券期货市场交易的股指期货； (4) 债券正回购。 2、投资组合比例 (1) 投资于以上第（1）项的债权类资产占本计划总资产比例不低于 80%； (2) 投资于以上第（2）项的股权类资产占本计划总资产比例低于 20%； (3) 投资于以上第（3）项的股指期货持仓合约价值占本计划总资产比例低于 20%； (4) 本计划总资产占净资产比例不得超过 200%； (5) 正回购资金余额或逆回购资金余额不超过本计划上一日净资产 100%。</p>
投资限制	<p>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：</p> <p>(1) 本计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>(2) 本计划投资于同一资产的资金，不得超过本计划资产净值的 25%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>(3) 本计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。</p> <p>(4) 管理人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%，银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。管理人管理的全部资产管理计划及公开募集证券投资基金（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%。</p> <p>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。</p>
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>3、可转债投资策略</p>

		<p>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。</p> <p>4、股票投资策略</p> <p>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）。</p>
	风险收益特征	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。
	适合销售对象	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。
当事人	管理人	太平洋证券股份有限公司。太平洋证券股份有限公司是 2004 年 1 月 6 日在云南昆明注册成立的全国性综合类证券公司，主营证券经纪、证券投资咨询、证券自营、证券承销与保荐、证券资产管理、证券投资基金销售、融资融券等业务。
	托管人	兴业银行成立于 1988 年 8 月，总行设在福建省福州市，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一。公司先后成立兴业信托、兴业金融租赁、兴业基金、兴业消费金融、兴业研究、兴业数字金融、兴业资产管理等机构，成为拥有最多金融牌照的商业银行之一，从单一银行已逐步演进为以银行为母体，涵盖信托、租赁、基金、消费金融、期货、资产管理、研究咨询、数字金融等在内的现代金融服务集团。
	销售机构	太平洋证券股份有限公司以及管理人委托的具有基金销售资格的其他销售机构。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。
集合计划的参与	办理时间	<p>1、参与的办理时间</p> <p>(1) 募集期参与</p> <p>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。(2) 存续期参与</p> <p>投资者可在本计划说明书前述“开放期”一栏中约定的开放申购日申请申购本计划。</p>
	办理场所	销售机构指定的场所。
	参与原则	<p>(1) “金额参与”原则，即参与以金额申请。</p> <p>(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；</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) “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，超过募集人数上限和规模上限的其他客户委托将不被确认。</p>
	办理方式、程序	<p>①投资者按销售机构具体安排，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；销售机构对参与申请的受理并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到参与申请。如果委托人资金在规定时间内未全额到账，则仅以其到账金额确定其有效申请份额；若到账金额低于本集合计划的参与下限，则参与申请不成功，其参与款项将被作为无效款项退回委托人账户。</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有效后，构成本合同的有效组成部分，本合同开始生效。</p> <p>④投资者参与申请确认成功后，其参与申请和参与资金不得撤销；</p> <p>⑤投资者募集期参与的，原则上可于计划成立后 2 个工作日到办理参与的销售机构查</p>

		<p>询参与确认情况。投资者存续期的开放申购日（T日）参与的，原则上可于T+2日到办理参与的销售机构查询参与确认情况。前述委托人查询参与确认时间，具体以销售机构的业务规则为准。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。</p>
	参与费及参与份额计算	<p>(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</p> <p>(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</p> <p>以上参与份数均保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p>
	认购资金利息	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。
集 合 计 划 的 退 出	办理时间	本集合计划存续期内，委托人可在投资者可在本计划说明书前述“开放期”一栏中约定的开放退出日或者特别开放日内办理退出业务。
	办理场所	销售机构指定的场所。
	退出原则	<p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(3) 当日的退出申请可以在管理人规定的时间以前撤销；</p> <p>(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；</p> <p>(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则开始实施前3个工作日在指定网站上公告。</p>
	办理方式、程序	<p>(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；</p> <p>(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日到销售机构查询退出的确认情况；</p> <p>(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。前述委托人查询参与确认时间，具体以销售机构的业务规则为准。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。</p>
	退出费及退出份额的计算	<p>(1) 退出费用：0</p> <p>(2) 退出金额的计算方法：退出金额 = 退出份额 × 退出申请日计划单位净值</p>
	退出限制与次数	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30万，否则其剩余份额将一并退出。
	单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式	<p>(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。</p> <p>(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。</p>
	巨额退出	<p>(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。</p>

		<p>(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>(3) 告知客户的方式</p> <p>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。</p>
连续巨额退出		<p>(1) 连续巨额退出的认定</p> <p>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。</p> <p>(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>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。</p>
拒绝或暂停退出的情形及处理		<p>(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:</p> <p>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转;</p> <p>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;</p> <p>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;</p> <p>④法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>(2) 拒绝或暂停受理退出的方式包括:</p> <p>①拒绝、暂停受理某笔或数笔退出申请;</p> <p>②拒绝、暂停受理开放日的全部退出申请;</p> <p>③法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p>
管理人自有资金参与情况		管理人自有资金不参与本计划。
集合计划成立的条件、时间		<p>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。</p>

	<p>本集合计划成立的时间为管理人根据《管理办法》及相关法规规定发布集合计划成立公告中注明的成立日期。</p> <p>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。</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。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。</p>
集合计划设立失败	<p>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。</p>
集合计划份额转让	<p>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。</p> <p>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。</p>
费用、业绩报酬	<p>费用种类（计提标准、方法、支付方式）</p> <p>（一）费用</p> <p>1、托管费：</p> <p>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 0.03% 的年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.03\% \div 365$ <p>（首日按集合计划初始资金金额）</p> <p>H 为每日应计提的托管费</p> <p>E 为前一日计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）。</p> <p>本计划的托管费按本计划前一日资产净值计算，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。</p> <p>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日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。</p> <p>2、管理费：</p> <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 0.8% 的年费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.8\% \div 365$ <p>（首日按集合计划初始资金金额）</p> <p>H 为管理人当日计提的管理费</p> <p>E 为前一日计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）。</p> <p>按本计划前一日资产净值计算，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。</p>

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本计划的其他费用

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，于实际发生时计入本计划费用；

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本计划费用；

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本计划费用；

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）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；

$r_i < R$ ，管理人提取超额部分的 60% 作为管理人业绩报酬，余下 40% 归份额持有委托人享有。

其中， R 为委托人每笔份额持有期年化收益率； r_i 具体以管理人公告为准。业绩报酬计提基准变更频率不得超过每 6 个月一次。业绩报酬计提基准测算依据和测算过程等信息将在管理人网站公告中明确。

业绩报酬计提基准仅供委托人参考，不构成管理人对委托人保本保收益承诺。

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

为本次业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

为上一个业绩报酬计提日（本次业绩报酬计提起始日）的计划单位累计净值；

为上一个业绩报酬计提日的计划单位净值；

表示上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的实际天数，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，若管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬（即业绩报酬为 0），则该日仍然作为管理人下一次业绩报酬计提起始日；

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	$Y = 0$
$R > r_i$	60%	$Y = A \times (R - r_i) \times 60\% \times D \div 365$

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。

(5) 管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次。但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的, 不受前述提取频率的限制。

3、业绩报酬支付

业绩报酬由管理人计算, 支付业绩报酬时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, 托管人对业绩报酬金额不承担复核义务和责任。

不由集合计划承担的费用

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。

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、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、当年收益先弥补上一年度亏损之后, 方可进行当年收益分配;

4、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。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(具体到账时间以销售机构的业务规则为准); 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;

	<p>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；</p> <p>6、法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>(四) 收益分配方案的确定与披露</p> <p>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日之前（R为权益登记日）将收益分配方案向委托人公告。</p>
委托人的权利和义务	<p>1、委托人的权利</p> <p>(1) 取得集合计划收益；</p> <p>(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；</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》的约定，参与和退出集合计划；</p> <p>(4) 按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p> <p>2、委托人的义务</p> <p>(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；</p> <p>(2) 按照本合同及《说明书》约定交付委托资金；</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；</p> <p>(4) 不得违规转让其所拥有的计划份额；</p> <p>(5) 委托人以其出资为限对本计划财产的债务承担责任。</p> <p>(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。</p>
投资风险揭示	<p>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。本计划面临的风险详见本集合资产管理计划风险揭示书。</p>
风险承担安排	<p>投资者参与本计划，应当根据自身能力审慎决策，独立承担投资风险。管理人和托管人不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。</p>
信息披露的内容、方式和频率	<p>(一) 定期报告</p> <p>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。</p> <p>1、集合计划单位净值报告</p> <p>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。</p> <p>2、集合计划的资产管理季度报告</p> <p>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资产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。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公告并向中国证监会相关派出机构和基金业协会备案。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。</p> <p>3、集合计划的资产管理年度报告、年度财务会计报告</p> <p>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资产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</p>

	<p>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。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。</p> <p>4、集合计划的托管季度报告和托管年度报告</p> <p>管理人应当在每季度结束后20日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告（如有）中的财务数据后，于每季度结束之日起一个月内向管理人提供季度托管报告，报告内容包括托管人履职情况以及对当期财务会计报告（如有）、季度报告的复核意见等。</p> <p>管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于每年度结束之日起四个月内向管理人提供年度托管报告，报告内容包括托管人履职情况以及对当期财务会计报告、年度报告的复核意见等。</p> <p>上述托管人报告通过管理人网站向投资者披露。计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，托管人可以编制当期的季度报告和年度报告。</p> <p>（二）临时报告</p> <p>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：</p> <ol style="list-style-type: none"> 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、合同的补充、修改与变更； 6、与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项； 7、负责本集合计划的销售机构发生变更； 8、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或其他重大关联交易； 9、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； 10、管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责； 11、其他管理人认为的重大事项。 <p>（三）信息披露方式</p> <p>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。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人网站信息披露 <p>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。</p> <ol style="list-style-type: none"> 2、太平洋证券客服电话 <p>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。</p>
集合计划展期	本集合计划存续期满后不进行展期。
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、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

	<p>撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接；</p> <p>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；</p> <p>3、存续期内，连续5个工作日除自有资金以外集合计划委托人少于2人时；</p> <p>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；</p> <p>5、存续期届满；</p> <p>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；</p> <p>7、本集合计划在基金业协会备案未通过；</p> <p>8、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。</p> <p>管理人应当自本合同终止之日起五个工作日内报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派驻机构。</p> <p>(二) 集合计划的清算</p> <p>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。</p> <p>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。管理人和托管人一致同意，本计划延期清算期间不收取管理费和托管费。</p> <p>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基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p> <p>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。</p>
<p>特别说明</p>	<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>

