

编号：TPY-GS-JH-JTL1-201903XD

太平洋证券金添利 1 号集合资产 管理计划集合资产管理合同

(2019 年 3 月修订)

管理人：太平洋证券股份有限公司

托管人：中国工商银行股份有限公司上海市分行



鉴于：

管理人、托管人双方已于 2018 年 4 月签署了《太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》以及 2018 年 5 月签署了《关于太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划管理合同变更的确认函（一）》、2018 年 6 月签署了《关于太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划管理合同变更的确认函（二）》（以下统称《原合同》）。现管理人、托管人在协商一致的基础上，根据业务实际情况对《原合同》进行修订，本次合同变更生效前已经签署《原合同》的客户无需重新签署变更后的合同，本次合同变更生效后新参与的客户应签署变更后的合同。

合同流水号E8位：19349542
本合同为第6份，共6份
可在工行门户网站、手机银行、融e联等渠道进行合同验证

合同流水号E8位：19349542
本合同为第6份，共6份
可在工行门户网站、手机银行、融e联等渠道进行合同验证

合同流水号E8位：19349542
本合同为第6份，共6份
可在工行门户网站、手机银行、融e联等渠道进行合同验证

合同流水号E8位：19349542
本合同为第6份，共6份
可在工行门户网站、手机银行、融e联等渠道进行合同验证



目录

特别约定.....	1
一、前言.....	2
二、释义.....	3
三、合同当事人.....	6
四、集合资产管理计划的基本情况.....	7
五、集合计划的参与和退出.....	12
六、管理人自有资金的参与和退出.....	17
七、集合计划的分级.....	18
八、集合计划客户资产的管理方式和管理权限.....	18
九、集合计划的成立.....	18
十、集合计划账户与资产.....	19
十一、集合计划资产托管.....	21
十二、集合计划的估值.....	21
十三、集合计划的费用、业绩报酬.....	25
十四、集合计划的收益分配.....	29
十五、投资理念与投资策略.....	30
十六、投资决策与风险控制.....	31
十七、投资限制及投资禁止行为.....	34
十八、集合计划的信息披露.....	35
十九、集合计划份额的转让、非交易过户和冻结.....	37
二十、集合计划的展期.....	38
二十一、集合计划终止和清算.....	38
二十二、当事人的权利和义务.....	39
二十三、违约责任与争议处理.....	42
二十四、风险揭示.....	44
二十五、合同的成立与生效.....	46
二十六、合同的补充、修改与变更.....	47
二十七、或有事件.....	48
二十八、其他.....	49



特别约定

本合同以电子签名方式或以纸质合同签章方式签署，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，以电子签名方式或在代销机构营业场所以纸质合同签章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。

委托人以电子合同签名方式签署本合同的，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》、《证券公司集合资产管理电子签名合同试点指引》的有关规定，三方一致同意委托人自签署《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、计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质计划说明书、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、纸质计划说明书、纸质风险揭示书或其他文书。



一、前言

为规范太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划(以下简称“集合计划”或“计划”或“本计划”或“集合资产管理计划”或“本集合资产管理计划”或“本集合计划”)运作,明确《太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》(以下简称“本合同”或“管理合同”或《集合资产管理合同》)当事人的权利与义务,依照《中华人民共和国合同法》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(证监会令第 151 号,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》(证监会公告【2018】31 号,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》(银发【2018】106 号,以下简称《指导意见》)等法律法规、中国证监会、中国证券投资基金业协会和中国证券业协会的有关规定,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《管理办法》、《运作管理规定》、《指导意见》、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,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,承担投资风险和损失。委托人为自然人的保证未筹集他人资金参与集合计划。委托人是法人或依法成立的其他组织,并用合法筹集的资金参与本集合计划的,应当向管理人及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,管理人和销售机构应拒绝其参与本集合计划。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资产管理计划。

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。

二、释义

本合同中除非文另有所指，下列词语具有如下含义：

《集合资产管理合同》、本合同、管理合同：指《太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》及对其的任何有效修订和补充。

《指导意见》：指 2018 年 4 月 27 日由中国人民银行、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《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（银发【2018】106 号）。

《管理办法》：指 2018 年 10 月 22 日经中国证券监督管理委员会公布施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令【第 151 号】）。

《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公布施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告【2018】31 号）。

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”。

本集合计划或集合计划或本计划或计划或集合资产管理计划或本集合资产管理计划：指依据《太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》所设立的太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划。

中国证监会：指中国证券监督管理委员会。

证券投资基金业协会：指中国证券投资基金业协会。

管理人：指太平洋证券股份有限公司。

托管人：指中国工商银行股份有限公司上海市分行。

注册登记机构：指办理本计划注册登记业务的机构。本计划的注册登记机构为太平洋证券股份有限公司。



《集合资产管理合同》当事人：指受《集合资产管理合同》的约束，根据《集合资产管理合同》享受权利并承担义务的法律主体，包括委托人、管理人、托管人。

委托人：指根据《集合资产管理合同》合法取得集合计划份额的投资者。

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：家庭金融净资产不低于 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) 基本养老保险金、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。

集合计划成立日：指管理人公告集合计划成立的日期。

集合计划存续期：指集合计划成立并存续的期间。

工作日、交易日：指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日。

T 日：指日常参与、退出或办理其他集合资产管理计划业务的申请日。

T+n 日：指自 T 日起第 n 个工作日（不包含 T 日）。

募集期：指本集合计划自开始募集到募集完成的期间。管理人应当在募集之日起的 60 日内完成募集活动，具体时间见管理人网站有关公告。

封闭期：指本集合计划封闭运作，不接受委托人的申购和退出业务的阶段。

开放期：集合计划为委托人办理参与、退出等业务申请的日期。

持有期（P）：指自委托人每笔份额成立日（含当日，若该笔份额为募集期



认购的)或者每笔份额申购申请之日(不含当日,若该笔份额为存续期申购的),至该笔份额退出申请之日(含当日),经过的自然日天数。

参与:指委托人申请购买集合计划的行为,存续期间参与的叫申购,募集期参与的叫认购。

退出:指委托人根据集合计划的规定,向管理人申请卖出集合计划的行为。

管理人自有资金:指管理人合法所有的,具有支配及使用权利的资金。

集合资产管理计划利润:集合计划利润是集合计划投资所得债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息、其他收入扣除相关费用后的余额。

集合资产管理计划账户:指注册登记机构给委托人开立的用于记录委托人持有本集合资产管理计划份额情况的登记账户。

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集合资产管理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、相关费用后的净资产值。

集合资产管理计划单位净值/份额净值:指集合资产管理计划资产净值除以计划总份额。

集合资产管理计划单位累计净值:指集合资产管理计划份额净值加上份额累计分红。

集合资产管理计划份额面值: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:不可抗力是指任何不能预见、不能避免、不能克服的客观事件或因素,包括但不限于:相关法律法规的变更;国际、国内金融市场风险事故的发生;战争或动乱、自然灾害、公众通讯设备故障、电力中断、互联网故障、证券交易所非正常暂停或停止交易、非因管理人或托管人自身原因导致的技术系统异常事故等;

关联方、关联关系:指《企业会计准则第 36 号——关联方披露》中的关联



方定义。

管理人网站：指 <https://www.tpyzq.com>，管理人网站变更时以管理人公告为准。

7 个工作日可变现资产：包括可在交易所、银行间市场正常交易的股票、债券、非金融企业债务融资工具、期货及期权合约以及同业存单，7 个工作日内到期或者可支取的逆回购、银行存款，7 个工作日内能够确认收到的各类应收款项等。

流动性受限资产：是指由于法律法规、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。

三、合同当事人

委托人

姓名：_____证件类型：_____证件号码：_____

通信地址：_____邮政编码：_____

电子信箱：_____

其他：_____

机构名称：

法定代表人：

通信地址：

邮政编码：

联系电话：

委托人的详细情况在各委托人签署的电子合同或纸质合同中列示。

管理人

机构名称：太平洋证券股份有限公司



法定代表人：李长伟

通信地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

邮政编码：650021

联系人：沈立峰

联系电话：021-61377635

托管人

机构名称：中国工商银行股份有限公司上海市分行

负责人或授权代表：张晓琪

通信地址：上海市浦东新区浦东大道 9 号

邮政编码：200120

联系人：胡丽君、张哲胤

联系电话：021-58885888

四、集合资产管理计划的基本情况

(一) 名称：太平洋证券金添利 1 号集合资产管理计划

(二) 类型：固定收益型

(三) 目标规模

本集合计划募集期和存续期规模上限为 50 亿份。本集合计划单个委托人首次参与资金不低于 30 万元。本集合计划参与人数上限为 200 人。

(四) 投资范围、比例和投资限制

1、投资范围和投资比例

本集合计划投资于标准化资产，具体如下：

(1) 固定收益类资产占本集合计划资产总值的比例不得低于 80%，包括但不限于银行存款、同业存单、债券型公募基金（含债券型分级公募基金、可转债公募基金）、货币型公募基金以及以及在证券交易所或银行间市场交易的标准化债权类资产：国债、地方政府债券、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开公司债）、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债、混合资本债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中央银行票据、资产支



持证券、非金融企业债务融资工具、债券逆回购等标准化债权类资产。

(2) 债券正回购。

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。

管理人拟实施上述未明确列示投资品及其他本合同签署后市场新增交易品种的投资的，应于开始实施投资前与托管人就此类新增投资品的会计核算、估值、清算、监督、系统支持等达成一致。

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。从事重大关联交易的，管理人还应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。

2、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) 本集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的 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；

(2) 管理人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；

(3) 集合计划参与债券、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；

(4) 应投资于短期融资券债项评级为 a-1 级及以上；

(5) 应投资于长期债券债项评级为 AA-以上（含 AA-），若无债项评级，需主体评级满足 AA-（含）以上，且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考；

(6) 本计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。本集合计划参与债券



正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过本集合计划上一日净资产 100%，否则管理人应向相关金融监管部门报告；

(7) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。

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、可转让或者恢复交易的 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。资产托管人对于上述 1、2 条投资限制不予监控，但是法律法规有规定的除外。

(五) 管理期限

本集合资产管理计划管理期限为 10 年。

(六) 建仓期、封闭期、开放期安排

1、本集合计划建仓期为自成立之日起至满 91 天的当日止。建仓期内的投资活动，应符合本合同约定的投向和风险收益特征，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。

2、封闭期：除本合同约定的开放期以及特别开放日外，本集合计划均封闭运作，封闭期内不办理集合计划的参与和退出业务。

3、开放期：自本集合计划建仓期结束后，每周一（如周一为非工作日则当周不开放申购）开放申购以及自建仓期结束之日起每满 90 天后的最近一个周一开放赎回，如遇该周一为非工作日或者管理人认为有必要调整的情况，则该赎回日顺延，具体以管理人网站公告为准。

4、特别开放日：发生合同变更情形，管理人有权设置特别开放日，保障不同意合同变更的委托人退出权利。

5、流动性安排：管理人应确保本集合计划开放日内，资产组合中 7 个工作日内可变现资产价值，不得低于本集合计划资产净值的 10%。

在开放退出期内，主动投资于流动性受限资产市值合计不超过本集合计划资



产净值 20%。

(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

首次参与的最低金额为人民币 300,000 元,非首次参与的最低金额为人民币 10,000 元。

(九) 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 R2 中低风险投资产品,仅适合向风险承受能力等级为 C2 谨慎型、C3 稳健型、C4 积极型、C5 激进型投资者销售。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) 本集合计划的销售

1、销售机构

太平洋证券股份有限公司以及具有法律法规规定的基金销售资格并与管理人签订相关委托销售协议的销售机构。

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销售本集合计划。但管理人和销售机构通过设置特定对象并确定程序的官网、客户端等互联网媒介向已注册特定对象进行宣传销售的除外。

(十一) 本集合计划的各项费用

1、认购/申购费: 0。

2、退出费:

持有期 (P)	$P < 90$ 天	$P \geq 90$ 天
退出费率	0.5%/笔	0

3、管理费: 0.5%/年,按前一日资产净值计算,逐日计提,按季支付。

4、托管费: 0.03%/年,按前一日资产净值计算,逐日计提,按季支付。



5、管理人业绩报酬： R 为客户份额持有期年化收益率， $R \leq r_i$ ，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% 归委托人所有。业绩报酬计提基准 r_i 以管理人公告为准，委托人和托管人在此同意管理人可以以管理人网站公告方式变更业绩报酬计提基准，但业绩报酬计提基准变更频率不得超过每 6 个月一次。

6、税收：委托资产和本合同各方当事人根据国家法律法规的规定，各自履行纳税义务。管理人因本资产管理计划运作过程中发生而需缴纳增值税费（税金及附加等），由本委托资产承担，增值税的计算、提取及缴纳，由管理人依照《营业税改征增值税试点实施办法》、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》等国家法律、法规及规章的相关规定进行。

（十二）预警线和止损线

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 个交易日内调整持仓，使得本计划债项评级 AA- 类的债券资产持仓比例不得高于本计划资产净值的 20%。

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。

（十三）本集合计划聘请的投资顾问

本集合计划未聘请投资顾问。

（十四）本集合计划利益冲突情况

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，可能与委托人利益存在冲突。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。



五、集合计划的参与和退出

（一）集合计划的参与

委托人参与和退出集合计划的确认、清算由管理人指定的注册登记机构负责，本集合计划的注册登记机构为太平洋证券股份有限公司。

1、参与的办理时间

（1）募集期参与

在募集期内，投资者在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

投资者在建仓期结束后的每周一（如周一为非工作日则当周不开放申购）可以办理本集合计划的参与申请业务。

2、参与的原则

（1）“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；“未知价”原则，即存续期参与价格以参与申请当日收盘后估值计算的单位净值为基准进行计算份额；

（2）采用金额参与的方式，即参与以金额申请；

（3）“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申请予以全部确认，再将超募当日所有有效参与申请先按照参与金额大小排序，金额相同的再按照参与时间先后顺序排序，然后根据排序逐笔确认，超过目标规模上限的其他客户的参与申请将不被确认。如果确认某笔委托将导致规模超限，则该笔参与申请将全额不被确认；

（4）委托人的参与资金在集合计划成立之前所产生的利息折成集合计划份额的，该份额归委托人所有，参与资金的利息及折算的份额以注册登记机构的记录结果为准；

（5）委托人在募集期或者开放期内可以多次参与本集合计划，已经受理的参与申请只能在当日交易时间结束之前撤销。

3、参与的程序和确认

（1）投资者按销售机构的具体安排，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；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。

(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。参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分；

(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，原则上可于计划成立后 2 个工作日内到办理参与的销售机构查询参与确认情况。投资者在本计划存续期的开放日（T 日）参与的，注册登记机构在 T+1 日根据管理人确认结果为委托人办理增加权益的登记手续，原则上投资人可于 T+2 日后在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。

4、参与费及参与份额的计算

(1) 参与费率：0；

(2) 参与份额的计算方法：

1) 募集期参与：参与份额=（每笔参与金额+募集期利息）/1.00

2) 存续期参与：参与份额=参与金额÷参与申请日本集合计划单位净值。

委托人参与份额以四舍五入的方法保留小数点后两位，由此产生的差额部分计入集合计划资产的损益。

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（不含直销和代销账户中产生的利息）折成集合计划份额归委托人所有，利息金额及折算的份额以本集合计划注册登记机构的记录为准。



(二) 集合计划的退出

1、退出的办理时间

投资者可在自建仓期结束之日起每满 90 天后的最近一个周一办理退出申请业务,如遇该周一为非工作日或者管理人认为有必要调整的情况,则该赎回日顺延,具体以管理人网站公告为准。

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(T日)的计划单位净值为基准进行计算,该净值在 T+1 日公告;如涉及到巨额退出条款或本合同约定其他因素导致当日无法退出或无法全部退出的,退出价格按照实际退出日当日份额净值为基准进行计算;

(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,退出本计划的最低份额为 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份额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 个工作日在管理人网站上公告。

3、退出的程序和确认

(1)退出申请的提出

委托人可在本集合计划退出开放日,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。委托人提交退出申请时,其必须在注册登记机构有足够的集合计划余额。

(2)退出申请的确认

管理人及注册登记机构在 T 日对该退出交易的有效性进行确认,委托人通常可在 T+2 日到网点查询退出的确认情况。

(3)退出款项划付

委托人退出申请确认后,管理人将指示托管人 T+2 日内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 内日划往各销售机构，最后通过销售机构划往委托人提出退出申请时应指定参与时的签约银行账户（具体销售机构与委托人之间的划款路径以销售机构业务规则为准）。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。

4、退出费及退出份额的计算

(1) 退出费用

持有期 (P)	P < 90 天	P ≥ 90 天
退出费率	0.5%/笔	0

(2) 退出金额的计算公式

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))

退出金额的计算结果保留到小数点后两位，小数点后第三位四舍五入，由此产生的差额部分计入集合计划资产损益。

退出申请日 (T 日) 的每份额净值在当日收市后计算，并在 T+1 日通告。遇不可抗力，可适当延迟计算或通告。

5、退出份额与次数限制

委托人退出时按份额退出集合计划，每次退出最低份额为 1 万份，委托人可申请将其持有的部分或全部集合计划份额退出，次数不限。

因委托人部分退出，导致委托人持有资产净值小于 30 万元时，该部分份额将被全部强制退出。

6、单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式

本集合计划不设单个委托人大额退出限制条款。但因单个委托人大额退出导致出现巨额退出，则根据巨额退出的认定和办理方式办理。

7、巨额退出的认定和办理方式

(1) 巨额退出的认定

开放退出日，本计划当日累计净退出申请份额超过上一工作日计划总份额数的 10% 时，即为巨额退出。

(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付

发生巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定金额



退出、部分顺延退；

全额退出：当管理人认为有条件支付委托人的退出申请时，按正常退出程序办理。

部分顺延退出：当管理人认为支付委托人的退出申请可能会对计划资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受净退出比例不低于集合计划总份额 10% 的前提下，对其余退出申请予以延期办理。对于当日的退出申请，将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份额；未能受理的退出部分，委托人可选择延期办理或撤销退出申请。对于选择延期办理的退出申请，管理人将在下一个工作日内办理，并以该工作日的计划单位净值为准计算退出金额，依此类推，直至全部办理完毕为止，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，转入下一个工作日的退出申请不享有优先权。

(3) 告知客户的方式

发生巨额退出并延期支付时，管理人应在 3 个工作日内在管理人网站公告，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

如果本集合计划连续 2 个开放日发生巨额退出，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

本集合计划发生连续巨额退出，管理人可按说明书及资产管理合同载明的规定，暂停接受退出申请，但暂停期限不得超过 20 个工作日；已经接受的退出申请可以延缓支付退出款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并在管理人网站上进行公告。

9、拒绝或暂停退出的情形及处理

发生下列情形时，管理人可以拒绝或暂停受理委托人的退出申请：

- (1) 不可抗力的原因导致集合计划无法正常工作；
- (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) 管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有委托人利



益时；

(4) 因市场，剧烈波动等原因而出现连续巨额退出，或者其他客观原因，导致本集合计划的现金出现困难时，管理人可以暂停接受集合计划的退出申请；

(5) 法律、法规或中国证监会认定的其他情形。

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并在管理人网站进行公告。

六、管理人自有资金的参与和退出

(一) 自有资金参与、退出的条件、程序

管理人可以以自有资金参与本集合计划，自有资金参与本集合计划的持有期限不低于 6 个月。自有资金参与、退出的条件和程序同其他委托人（指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 15%（含 15%），管理人及其附属机构以自有资金参与本计划的份额合计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。

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比例被动超标的，管理人应在超标后 3 个工作日内办理超出份额的退出手续。

为应对本计划巨额赎回以解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其附属机构以自有资金参与及后续退出不受上述规定的限制，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。

(三) 收益分配和责任承担方式

管理人自有资金参与份额与其他委托人持有计划份额享有同等参与收益分配的权利。

管理人自有资金参与份额不对其他委托人承担保本保收益责任。

(四) 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，将同其他委托人自行承担因



投资本集合计划带来的投资风险。

管理人每次以自有资金参与、退出时应当提前 5 个工作日通知托管人并以临时公告的形式通过管理人的网站（www.tpyzq.com）方式及时向客户披露。

七、集合计划的分级

本集合资产管理计划不分级。

八、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。

九、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后，管理人宣布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》、《运作管理规定》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。

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注册登记机构指定的专门账户，不得动用。存入前述专门账户的委托人资金，独立于管理人、销售机构、注册登记机构的固有财产，非因投资者本身的债务或者法律法规规定的其他情形，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 万元或委托人的人数少于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划的全部募集费用，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。

（三）集合计划开始运作的条件和日期

1、条件：集合计划公告成立。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：自管理人公告本集合计划成立之日起，管理人可按合同约定开始本集合计划的运作。

十、集合计划账户与资产

（一）集合计划账户的开立

托管人负责以本集合计划的名义开立托管账户，保管集合计划的银行存款。托管账户由托管人负责管理，本计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付费用、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款等，均需通过该账户进行。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。



当托管账户被有权机关查询、冻结或扣划款项时，托管人按照有权机关要求依法予以执行，因此影响托管账户资金划付的，托管人不负任何责任。相关手续办理完毕后，托管人应通知管理人，但法律法规或监管要求另有规定的除外。

托管人为本集合计划开立证券账户。证券账户名称应为“太平洋证券—工商银行—太平洋证券金添利1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]。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。本计划证券账户的开立和证券账户开户确认书的保管由托管人负责，管理和使用由管理人负责。

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。

管理人同时担任本计划的注册登记机构，并承担相应注册登记责任。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。

（二）集合计划资产的构成

集合计划资产是指运用集合计划资金进行投资所形成的各类资产，包括集合计划购买的各类有价证券、银行存款本息及其他资产。主要包括：

- 1、银行存款和应计利息。
- 2、根据有关规定缴纳的保证金。
- 3、应收证券交易清算款。
- 4、债券投资及应计利息。
- 5、其他投资。
- 6、其他资产。

（三）集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人、注册登记机构及托管人的固有财产及其管理、托管的其他资产。管理人、托管人、注册登记机构不得将本计划财产归入其固有财产。管理人、托管人因资管计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入本计划财产。管理人、托管人、注册登记机构因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，本计划财产不属于其清算财产。非因本计划本身债务或者法律法规规定的其他情形，不得查封、



冻结、扣划或者强制执行本计划财产。除依照《管理办法》、《运作管理规定》、《指导意见》、《集合资产管理合同》、《托管协议》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。

十一、集合计划资产托管

本集合计划资产交由托管人负责托管，并签署了托管协议。托管人的托管职责以托管协议的约定为准，如管理合同与托管协议不一致的，相关约定以托管协议为准。

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，并接受本合同以及管理人和托管人签订的托管协议中约定的托管职责和范围。

十二、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、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、费用后的价值。

(三) 份额净值：指计算日集合计划资产净值除以计算日该集合计划总份额的金额。本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：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、计算参与和退出集合计划的基础。

(五) 估值对象：本集合计划资产所购买的一切有价证券、银行存款及其他资产。

(六) 估值日：本集合计划成立后，每个交易日对资产进行估值。

(七) 估值方法：

估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证



券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得，合同另有约定的除外。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

本产品按以下方式进行估值：

- 1、回购交易成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息；
- 2、投资固定收益品种的估值方法

(1) 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。

(2) 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；估值日无交易的，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，可参考监管机构和行业协会估值意见，或者参考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。

(3) 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；估值日无交易的，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，可参考监管机构和行业协会估值意见，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。

(4) 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。

(5) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券，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。

(6) 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值净价为准估值。如有充足证据表明该价格不能真实地反映公允价值的，应主要依据中央国债登记结算有限责任公司公布的收益率曲线及估值价格。



(7) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券，应主要依据中央国债登记结算有限责任公司公布的收益率曲线及估值价格估值。对未在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的，按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券品种，按市价法估值，鉴于其交易不活跃，可采用最近交易日的收盘价。

3、投资证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所上市基金包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，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，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及理财债券基金，按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利；

(4) 持有的基金处于封闭期的，按照最新公布的份额净值估值；没有公布份额净值的，按照成本估值。

4、存款的估值方法

持有的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。

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，在与托管人商议后，按最能反映资产公允价值的方法估值。

(八) 估值程序：

本集合计划份额净值是按照每个工作日闭市后，本计划资产净值除以当日资管计划份额的余额数量计算，精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。国家另有规定的，从其规定。日常估值由管理人进行，托管人复核，管理人和托管人每个工作日（T日）对当日（T日）计划资产进行估值，并于当日（T日）完成核对工作。日常核算对账，管理人、托管人双方通过电子直连、电子邮件或电话



完成。用于公开披露的集合计划单位净值由管理人完成估值后，将估值结果加盖业务章后传真或邮件发送至托管人，托管人进行复核，托管人复核无误后加盖托管业务章返回给管理人，由管理人对外披露。当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给集合计划财产或委托人造成损失的，由管理人承担责任，托管人不承担责任。

由于证券交易所、注册登记机构发送的数据错误或其他不可抗力造成估值错误的，管理人和托管人免于承担责任。

(九) 单位净值错误与遗漏的处理方式：

1、本集合计划单位净值的计算精确到0.0001元，小数点后第五位四舍五入。当资产估值导致本集合计划单位净值小数点后四位以内发生差错时，视为本集合计划单位净值错误。如管理人公告的集合计划份额净值是经托管人复核确认的，当发生净值计算错误时，由管理人负责处理。由此给集合计划委托人和集合计划资产造成损失的，由管理人先行对委托人或者集合计划支付赔偿金，在管理人赔偿后，管理人和托管人应根据实际情况界定双方承担的责任。托管人以其在本合同项下所收取的托管费为限，对因此造成的实际直接经济损失承担赔偿责任。

2、管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保本集合计划资产估值的准确性和及时性，当估值出现错误时，本集合计划管理人应当立即予以纠正，通知托管人并采取合理的措施防止损失进一步扩大。

3、本计划的会计责任方由管理人担任，与本计划有关的会计问题，如经管理人、托管人双方在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按管理人的建议执行；或者管理人和托管人对计划净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时公布计划净值的情形，以管理人的计算结果对外公布；由此给委托人和集合计划财产造成的损失，由管理人负责全部赔付，托管人不承担任何责任。

4、因集合计划估值错误给委托人造成直接经济损失的应先由管理人承担，管理人对不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。

5、由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，或由于管理人或托管人不可控制的其他原因，管理人或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集合计划资产净值计算错误，管理人、托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施减轻或消除由此造成的影响。

6、法律法规或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，双方当事人应本着平等和保护集合计划持有人利益的原则进行协商确定处理原则。

（十）暂停估值的情形：

当出现下列情形致使集合计划管理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，集合计划管理人必须按规定完成估值工作。

1、集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或因其他原因暂停营业时；

2、因不可抗力或其他情形致使集合计划管理人、托管人无法准确评估集合计划资产价值时；

由于不可抗力原因，或由于证券交易所及注册登记机构发送的数据错误，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，但未能发现错误的，由此造成的资产估值错误，管理人和托管人可以免除赔偿责任。但管理人、托管人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

十三、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：

本集合计划托管费按前一日集合计划资产净值的 0.03% 年费率计提，计算方法如下：

$$T = E \times 0.03\% \div 365$$

T 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日集合计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）

托管费每日计提，按季支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在每季初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，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。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。集合计划终止后，依据清算程序向托管人支付尚未支付的托管费。

托管费收费账户信息如下：

户名：证券公司资产管理计划托管收入

账号：1001688911500887116

开户行：中国工商银行上海市分行业务处理中心

上述托管人的收费账户信息如有变更，托管人可单独决定而无须变更本合同，但须在账户信息变更生效前至少三个工作日通知管理人。

2、管理费：

本集合计划管理费按前一日集合计划资产净值的 0.50% 年费率计提，计算方法如下：

$$G = E \times 0.50\% \div 365$$

G 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日集合计划资产净值（首日按本计划初始资金金额）

管理费每日计提，按季度支付。由管理人向托管人发送集合计划管理费划付指令，托管人复核后于 5 个工作日内从集合计划中支付给管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（二）不列入集合计划费用的项目

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；

$r_i < R$ ，管理人提取超额部分的 60% 作为管理人业绩报酬，余下 40% 归委托人所有。

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。

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

P_1 为本次业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

P_0 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；

P_0^* 为上一个业绩报酬计提日的计划单位净值；

D 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 = 每笔份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值 = 每笔份额 * 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。托管人对业绩报酬不承担复核义务。

(四) 其他费用

1、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。在每季度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

2、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。

3、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，在费用实际发生时由托管人直接从托管账户扣除，无需管理人出具划款指令。但根据管理人的需要，托管人应向管理人提供费用支付的凭证；

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；

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 1 至 3 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。

十四、集合计划的收益分配

（一）收益的构成

集合计划收益由债券（含票据）利息收入、买卖证券价差、银行存款利息以及其他合法收入构成。

（二）可供分配利润

可供分配利润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后，方可进行当年收益分配；
- 4、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指定账户，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，原则上现金红利在 R+3 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。
- 5、法律法规另有规定的从其规定。

（三）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网站发布的分红公告为准。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网站发布分红公告报告委托人。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。



十五、投资理念与投资策略

（一）投资目标

本集合计划通过对中、长、短期金融工具的投资，在有效控制投资风险的基础上，力争获取稳健的投资回报。

（二）投资理念

在深入的利率研究和信用研究基础上，优化组合，精选个券，充分挖掘信用债市场、类固定收益资产中的投资机会，实现计划资产的长期稳健增值。

（三）投资策略

1、资产配置策略

本集合计划主要资产投资于固定收益类金融工具，并在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、财政及货币政策、资金供需情况）、证券市场估值水平等的研判，动态调整计划各类资产的投资比例，力争为计划资产获取稳健回报。

2、固定收益类资产投资策略

本计划将在综合分析宏观经济形势、货币政策走向以及债券市场供求关系的基础上，主动判断市场利率的变化趋势，确定并动态调整组合资产的平均剩余期限，根据收益最优化的原则，确定组合中固定收益类资产的合理配置。

（1）利率预期策略

通过分析未来市场利率的走势，对组合的期限和品种进行合理配置，将利率变化对于债券组合的影响控制在一定范围之内。在预期利率进入上升周期时，减小债券组合的剩余期限或增加浮动利率债券配置，反之则增加债券组合的剩余期限或减少浮动利率债券的配置。

（2）收益率曲线策略

收益率曲线的形状随时间而变化，不同到期期限的债券的相关变化造成收益率曲线的变动。运用统计和数量分析技术，预测收益率曲线的变化方式，遵循风险调整后收益率最大化配比原则，建立最优化的债券投资组合，以达到预期投资收益最大化的目的。

（3）债券选择策略



在单个债券选择方面，主要从收益率、流动性、信用风险、剩余期限、税收等方面进行综合分析，选择经信用风险调整后收益率较高的个券、收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势、投资价值较高的债券品种构建投资组合，并定期进行动态调整。

对于国债、央行票据、金融债等品种，主要根据对宏观经济形势和政策环境的分析，预测未来利率走势，综合考虑流动性因素决定投资品种。

对于信用类债券（公司债、企业债、短期融资券、可分离交易债券等），重点分析发行人的行业发展前景、市场地位、财务状况、债务结构、资产质量、盈利状况、现金流状况，判断其财务风险；分析募集资金投向对发行人未来的财务状况、债券风险等方面的影响，以及项目实施可能出现的风险；有担保的债券，对担保人或担保物的风险进行评估。在上述分析基础上，对债券品种的信用风险进行综合评估，选择信用状况良好、市场低估的债券进行投资。

3、现金管理类资产投资策略

本计划以严谨的市场价值分析为基础，采用稳健的投资组合策略，通过对现金管理类金融品种的组合操作，在保持本金的安全性与资产流动性的同时，追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本计划的现金流，保持投资组合的流动性，满足本计划投资运作的要求。

4、新券申购策略

对于新发行的证券品种，管理人将凭借丰富的资产管理经验以及新券定价能力，可在询价与配售过程中把握主动、发挥优势，追求可控风险之下的收益最大化。

5、基金投资策略

本集合计划坚持从研究基金价值入手，采用定性分析与定量分析相结合的方法，选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金构建备选基金池，对基金的投资理念和投资价值进行判断。

十六、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》、《运作管理规定》、《指导意见》、《集合资产管理合同》、《说明书》、《暂行规定》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）集合计划的投资程序

1、投资程序

管理人的投资管理流程主要涉及资产管理总部以下机构及相关责任人：

（1）资产管理投资决策委员会

（2）投资经理

（3）集中交易及交易人员

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：分析判断宏观经济、证券市场走势，对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资计划书；确定证券池入池品种的选择原则及其品种调整；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。

投资经理具体负责资产管理计划的日常投资和管理，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及每月投资策略报告，报资产管理投资决策委员会审批；按照资产管理投资决策委员会批准的投资策略报告，制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；每月对投资组合方案的执行情况以及业绩表现进行总结，向资产管理投资决策委员会提交《投资总结报告》；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；撰写资产管理业务公开报告中关于管理资产的投资运作的部分；积极参与资产管理业务的重要客户的沟通及演示



等。

2、投资交易程序

管理人采用集中交易模式，证券投资类交易均通过集中交易室完成。集中交易室由交易主管负责管理。交易人员对投资经理发出的不符合有关法律法规及管理人内部相关制度规定的交易指令，有权暂停执行，并立即向交易主管报告。交易主管在其授权范围内进行处理，超出其权限的，应立即向资产管理总部总经理报告。

3、投资风险的监控与绩效评估

资产管理投资决策委员会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。

对资产管理产品业绩的衡量主要参照以下标准：

- (1) 资产管理产品的风险收益特征是否符合产品合同规定；
- (2) 评估期内资产管理产品单位资产净值的实际增减值和增减率；
- (3) 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突的业务应在机构、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

管理人设立了由董事会—经理层—公司风险管理部门—各业务部门负责人及风控



岗等多层次组成的风险管理体系，建立了合规部、风险管理部、稽核部等中后台风险管理控制部门与资产管理总部等业务前台部门相互分离、相互制约、各司其职、协调配合的组织架构。

3、投资风险管理程序

管理人在实施客户资产管理业务风险管理时主要以业务类型为主导，按风险识别、风险评估、风险管理措施的实施、风险管理监控等方面进行管理。

(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。风险评估可采取定性分析和定量分析相结合的方法，包括对市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险、合规风险等在内的全面风险评估。

(3) 风险管理措施：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，进行相应的风险缓释、转移、承受等处置措施。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。

(4) 风险管理制度的监控：为保证风险管理的有效性，由稽核部对资产管理总部实施定期或不定期的稽核审计、专项检查。

(5) 风险管理制度的完善：稽核部将根据既定的监控程序对资产管理总部进行监督核查，并对认为风险管理有缺陷的情况进行重点核查。如果发现风险控制制度有不足之处时，应及时提出改进建议和报告，并监督资产管理总部对风险控制制度不足之处进行完善。

十七、投资限制及投资禁止行为

(一) 投资限制

参见“四（四）2 投资限制”相关条款。

(二) 禁止行为



本集合计划的禁止行为包括：

- (1) 违规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。

管理人应对本条的“投资限制及投资禁止行为”进行监控，如管理人未能完全履行义务，则应承担因此给委托人和本计划财产造成的损失。

十八、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、托管季度（年度）报告。

1、集合计划单位净值报告

披露时间：产品存续期间管理人应于每个工作日披露上一工作日集合计划份额净值。

披露方式：管理人网站 www.tpyzq.com。

2、集合计划的季度资产管理报告和季度托管报告

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度托管报告，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个月或者存续期间不足3个月时，管理人、托管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

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，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3个月时，管理人、托管人可以不编制当期的年度报告。

(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，管理人应当以公告或电子邮件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，管理人应当及时将有关情况向住所地中国证监会派出机构及中国证券业协会报告报告，并向委托人披露。

2、集合计划资产的估值错误导致错误偏差达到计划资产净值的 0.5%。

3、暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请。

4、集合计划终止和清算。

5、管理人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、负责本集合计划的销售机构发生变更。

9、集合计划投资于管理人、托管人及与其有关联方关系的公司发行或者承销期内承销的证券或者其他重大关联交易。



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、其他根据法律法规和中国证监会的有关规定应当披露的重大事项。

十九、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、注册登记机构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）集合计划份额的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、退出等交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定的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。

集合计划注册登记机构只受理因继承、捐赠、司法执行、以及其他形式财产分割或转移引起的计划份额非交易过户。对于符合条件的非交易过户申请按注册登记机构的有关规定办理。

（三）集合计划份额的冻结

集合计划份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

集合计划注册登记机构只受理国家有权机关依法要求的集合计划份额冻结与解冻事项。

当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册登记机构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、集合计划的展期

本集合资产管理计划存续期届满终止，无展期安排。

二十一、集合计划终止和清算

(一) 有下列情形之一的，集合计划应当提前终止：

- 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、本集合计划在证券投资基金业协会备案未通过；
- 5、本集合计划存续期届满；
- 6、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；
- 7、本集合计划跌破平仓线；
- 8、战争、自然灾害等不可抗力事故的发生导致本集合计划不能存续；
- 9、法律、法规规定或本合同约定的其他情况。

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 个工作日内由管理人开始组织清算本集合计划财产，管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费及管理人业绩报酬后，将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配给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。
- 2、清算过程中有关重大事项应当及时公布。
- 3、管理人应当在本计划清算结束后 5 个工作日将清算结果报证券投资基金业协会备案，并抄送中国证监会相关派出机构。管理人于清算结束后 15 个工作日内在管理人网站公布清算结果。



4、若本计划终止日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证券投资基金业协会报告。同时，管理人针对该部分流动性受限资产制定延期清算方案。管理人于前述流动性受限资产变现后并扣除相关费用后，将剩余清算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，以货币形式全部分配给委托人，并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行延期清算的变现过程中，变现的资金以现金保存，不得再进行投资。管理人和托管人同意本计划延期清算期间不再收取管理费和托管费。

二十二、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，有权得到直接损失赔偿；
- （6）法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及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，以委托资金承担本合同约定的管理费、托管费和其他费用；
- （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）法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及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) 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；
- (3) 根据本合同及说明书的约定，终止本集合计划的运作；
- (4) 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) 行使集合计划资产投资形成的投资人权利；
- (6) 集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；
- (7) 法律法规、中国证监会的有关规定和本合同及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) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；
- (3) 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；
- (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、销售机构的行为进行监督，如发现托管人、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、委托销售协议的，应当予以制止；
- (7) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项，按规定出具资产管理报告和财务会计报告，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，确定参与、退出价格；
- (8) 按照本合同及说明书约定向委托人分配集合计划的收益，及时向投资者分配收益；
- (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，保存期不少于二十年；

(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) 法律法规、中国证监会有关规定和本合同及说明书约定的其他义务。

(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) 托管人根据其承诺事项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，



保管集合计划的资产，确保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) 安全保管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，及时办理清算、交割事宜；

(5) 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) 托管人根据其承诺事项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，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行，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；

(7) 对本计划投资信息和相关资料承担保密责任，除法律、行政法规、规章制度或者审计要求、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；

(8) 办理与本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；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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；

(12) 因托管人过错导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，对因此造成的实际直接经济损失承担赔偿责任；

(13) 法律法规、监管部门有关规定及本合同、托管协议约定的其他义务。

二十三、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；因双方原因给计划财产或者委托人造成损害的，应当按照各自的过错程度分别承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

(1) 不可抗力

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。任何一方当事人延迟履行合同义务后，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；

(5) 资产管理人、资产托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司、保证金监控中心等）发送或提供的数据错误及合理信赖上述信息而操作给本计划资产造成的损失等；

(6) 管理人或托管人任何一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或委托人造成的直接损失向委托人承担连带责任；

(7) 在本合同、托管协议中约定的管理人、托管人可以免责的其他情形。

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。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、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。

5、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



行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

6、托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他集合计划资产不承担保管责任，由于非托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，托管人不承担赔偿责任。

7、委托人的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

（二）争议的处理

对于因本合同的订立、内容、履行和解释或与本合同有关的争议，合同当事人应尽量通过协商、调解途径解决。不愿或者不能通过协商、调解解决的，任何一方均有权将争议提交上海国际仲裁中心进行仲裁，仲裁地点为上海，仲裁语言为中文。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费用、律师费及其他与仲裁有关费用由败诉方承担。争议处理期间，合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行资产管理合同规定的义务，维护资产委托人及合同各方的合法权益。

争议的解决适用中华人民共和国法律（不包括香港、台湾和澳门地区）。

二十四、风险揭示

本集合计划可能面临的风险包括但不限于以下风险，请委托人仔细详读并充分理解。

（一）固定收益类产品特有风险

1、利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使集合计划资产管理业务收益水平随之发生变化，从而产生风险。

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证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

货币政策、财政政策、产业政策等国家宏观经济政策或与业务相关的法律法规（包括但不限于中国证券监督管理委员会发布的《上市公司股东、董监高



减持股份的若干规定》以及交易所相关实施细则等)的变化对资本市场可能产生一定的影响,可能导致市场价格波动或交易、担保物处置受限等,从而使资产管理计划的委托资产及其收益面临收益下降或本金损失的风险。

4、信用风险

集合计划在交易过程中发生交收违约,或者集合计划所投资固定收益类资产之融资人出现违约、拒绝支付到期本息,或由于融资人信用质量降低导致债券价格下降,造成集合计划资产损失的风险。

5、流动性风险

指本集合计划所投资的证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。

(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、获取信息不全、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,从而产生风险。

(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) 税务风险

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。

二十五、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。托管人加盖公章或合同专用章即视为签署本合同。

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确认。
- 2、本集合计划依法有效成立。

本合同自生效之日起对委托人、管理人、托管人具有同等的法律效力。

(二) 合同的组成

《太平洋证券金添利 1 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



业务受理有关凭证等为本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与合同具有同等法律效力。

二十六、合同的补充、修改与变更

1、本合同生效后，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，可以对本集合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合计划。

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，应在征询意见函中约定的特别开放日提出退出本集合计划的申请；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；逾期未退出且未有意见答复的，视同委托人同意本合同变更（但涉及本集合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。

委托人同意并确认，若经全体委托人、管理人、托管人一致同意达成书面补充协议的，亦可将补充协议视为对本合同的有效变更。

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、委托人同意，管理人经与托管人书面达成一致后依据本合同的规定采取的合同变更行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

5、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，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。



6、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出机构。

二十七、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集合计划的权利，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。为了保障不同意管理人或者托管



人变更的委托人退出的权利，管理人应当在公告生效前 5 个工作日内设置特别开放日。委托人不同意变更的，应在管理人设置的特别开放日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且未在特别开放日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；

(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/托管人变更公告生效后，应当在 15 个工作日内要求委托人重新签订新管理人/托管人的资产管理合同；

(5) 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备案。

3、法律法规、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。

二十八、其他

管理人确认，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。

本合同一式陆份，管理人持有贰份、托管人持有贰份，其余按照有关监管部门的要求备案，每份均具有同等法律效力。

(以下无正文)



(本页无正文，为委托人、太平洋证券股份有限公司与中国工商银行股份有限公司上海市分行签署的《太平洋证券金添利1号集合资产管理计划集合资产管理合同》的签署页。)

资产委托人:

自然人(签字):

签署日期: 年 月 日

(或)法人或其他组织(盖章):

法定代表人或授权代表(签字或盖章):

签署日期: 年 月 日

资产管理人: 太平洋证券股份有限公司

法定代表人或授权代表(签字或盖章):

签署日期: 2019年4月1日

资产托管人: 中国工商银行股份有限公司上海市分行

上海市分行
业务合同专用章
8B37FBB0D036

签署日期: 2019年3月28日



