

关于《太平洋证券研究精选 1 号集合资产管理合同》

第一次变更的公告

尊敬的委托人：

我司管理的“太平洋证券研究精选 1 号集合资产管理计划”（以下简称“本计划”）于 2019 年 3 月 13 日开始募集。为了更好的为委托人服务，经与托管人兴业银行股份有限公司达成一致，双方签署了《太平洋证券精选 1 号集合资产管理合同》（二〇一九年四月第一次修订）。

一、本计划合同变更内容具体如下：

修改前	修改后
一、计划名称	
太平洋证券研究精选 1 号集合资产管理计划	太平洋证券精选 1 号集合资产管理计划
二、“三、释义”	
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。	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。
三、“五、集合资产管理计划的基本情况”（四）中条款 2、投资组合比例	
(2) 投资于以上第 (2) 项的债券类资产占本集合计划总资产比例低于 20%；	(2) 投资于以上第 (2) 项的债权类资产占本集合计划总资产比例低于 20%；
四、“五、集合资产管理计划的基本情况”	
新增	(十四) 预警线和平仓线

	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 0.85 元，即触发预警线，亏损超过 10%的股票合计持仓比例不得超过总资产的 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 0.8 元，即触发平仓线，本集合计划将强行平仓并提前终止清算。 本计划的预警和止损由资产管理人负责监控和操作，资产托管人不负责监控，仅配合进行账务处理，若由于预警止损监控或操作不符合合同约定而造成的一切损失托管人不承担任何责任。
五、“六、集合计划的参与和退出”（一）中条款 1、参与的办理时间	
(2) 存续期参与 投资者可在本合同第五章第（六）条约定的开放申购日申请申购本集合计划。	(2) 存续期参与 投资者可在本合同第五章第（六）条约定的开放期申请申购本集合计划。
六、“六、集合计划的参与和退出”（二）中条款 1、退出的办理时间	
1、退出的办理时间 本集合计划存续期内，委托人可在本合同第五章第（六）条约定的开放日或者特别开放日内办理退出业务。	1、退出的办理时间 本集合计划存续期内，委托人可在本合同第五章第（六）条约定的开放期或者特别开放日内办理退出业务。
七、“七、管理人自有资金参与集合计划”（二）中条款	
管理人以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 15%。管理人及其下设附属机构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 50%。	管理人以自有资金参与本集合计划的份额不超过本集合计划总份额的 15%。管理人及其附属机构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 50%。
八、“十四、集合计划的费用、业绩报酬”（三）中1、管理人收取业绩报酬的原则	
1、管理人收取业绩报酬的原则：	1、管理人收取业绩报酬的原则：

(1) 同一委托人不同时间多次参与的，对委托人每笔参与份额分别计算持有期年化收益率、计提业绩报酬； (2) 在业绩报酬计提日（含分红日、委托人退出日和本集合计划终止日）对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬； (3) 在分红日（指权益登记日）提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除；	(1) 同一委托人不同时间多次参与的，对委托人每笔参与份额分别计算持有期年化收益率并计提业绩报酬； (2) 在业绩报酬计提日（含分红日、委托人退出日和本集合计划终止日）对符合业绩报酬提取条件的份额计提业绩报酬； (3) 在分红日（具体以分红公告为准）提取业绩报酬的，业绩报酬从分红中扣除；
九、“十八、投资限制及禁止行为”（三）中②对资产配置比例的监督	
②对资产配置比例的监督： (1) 投资于以上第（1）项的债权股权类资产占本集合计划总资产比例不低于80%； (2) 投资于以上第（2）项的股权债券类资产占本集合计划总资产比例低于20%；	②对资产配置比例的监督： (1) 投资于以上第（1）项的股权类资产占本集合计划总资产比例不低于80%； (2) 投资于以上第（2）项的债权类资产占本集合计划总资产比例低于20%；

二、《太平洋证券研究精选1号集合资产管理计划说明书》及《太平洋证券研究精选1号集合资产管理计划风险揭示书》内容进行相应修改。

根据本计划合同“第二十七、合同的补充、修改与变更”约定，管理人将以管理人网站方式向委托人发送合同变更意见征询函。请委托人后续留意管理人网站公告的《关于〈太平洋证券研究精选1号集合资产管理合同〉第一次变更的征询函》。

特此公告

太平洋证券股份有限公司
二〇一九年四月十八日