

# 关于《太平洋证券太盈1号集合资产管理合同》

## 第一次变更的公告

尊敬的委托人并托管人：

为了更好的为委托人服务，根据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》等法律法规的规定和《太平洋证券太盈1号集合资产管理合同》（二〇一九年三月）（以下简称《原合同》）的有关约定，现拟变更《原合同》、《太平洋证券太盈1号集合资产管理计划说明书》、《太平洋证券太盈1号集合资产管理计划风险揭示书》部分条款。就《原合同》修订事宜，我司向托管人兴业银行股份有限公司发送“关于《太平洋证券太盈1号集合资产管理合同》第一次修订的托管人意见征询函”并取得托管人的同意“回执”。

### (1)、合同变更内容具体如下：

修改前	修改后
1、新增	
管理人和托管人已于2019年3月签署了编号《太平洋证券太盈1号集合资产管理合同》（以下简称：原合同），管理人、托管人在协商一致的基础上，双方同意变更《原合同》并签署编号为JH2019085的《太平洋证券太盈1号集合资产管理合同》（以下简称：本合同），本合同作为原合同第一次修订版。自本合同生效之日起，本合同适用所有本集合计划委托人。在本合同生效之后新参	

与本集合计划的投资者应签署本合同，在本合同生效之前参与本集合计划的委托人无需重新签署本合同。

## 2、修改位置“三、释义”

.....

《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》。

.....

《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》。

《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。

<p>中国：指中华人民共和国。</p> <p>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。</p> <p>元：指中国法定货币人民币，单位“元”。</p> <p>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《太平洋证券太盈1号集合资产管理计划说明书》、《太平洋证券太盈1号集合资产管理合同》所设立的太平洋证券太盈1号集合资产管理计划。</p> <p>集合资产管理计划说明书或说明书：指《太平洋证券太盈1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</p>	<p>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。</p> <p>元：指中国法定货币人民币，单位“元”。</p> <p>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《太平洋证券太盈1号集合资产管理计划说明书》、《太平洋证券太盈1号集合资产管理合同》所设立的太平洋证券太盈1号集合资产管理计划。</p> <p>集合资产管理计划说明书或说明书：指《太平洋证券太盈1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</p>
---	---

<p>出集合资产管理计划参与申请的要约邀请文件。</p> <p>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》。</p> <p>.....</p> <p>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。</p>	<p>出集合资产管理计划参与申请的要约邀请文件。</p> <p>托管协议：指《太平洋证券集合资产管理计划之资产托管协议》（托管人结算模式【统签】）。</p> <p>.....</p> <p>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。</p>
<p>3、修改位置“四、合同当事人”</p>	
<p>托管人：</p> <p>托管人名称：兴业银行股份有限公司</p> <p>法定代表人：高建平</p> <p>通信地址：上海市静安区江宁路168号20层</p>	<p>托管人：</p> <p>托管人名称：兴业银行股份有限公司</p> <p>法定代表人：高建平</p> <p>通信地址：上海市浦东新区银城路167号4层</p>

<p>邮政编码：200041</p> <p>联系电话：021-52629999</p>	<p>邮政编码：200120</p> <p>联系电话：021-52629999</p>
<p>4、修改位置“五、集合资产管理计划的基本情况”之“（四）投资范围和投资比例”</p>	
<p>1、投资范围</p> <p>本计划全部投资于标准化资产，具体如下：</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（3）金融衍生品：在证券期货交易市场的股指期货；</p>	<p>1、投资范围</p> <p>本计划全部投资于标准化资产，具体如下：</p> <p>（1）标准化债权类资产：银行存款、同业存款以及证券交易所或者银行间市场交易的国债、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；</p> <p>（2）标准化股权类资产：交易所上市交易的股票（含新股申购）；</p> <p>（3）公募证券投资基金：货币基金，股票型、混合型、债券型基金；</p> <p>（4）债券正回购。</p> <p>2、投资组合比例</p>

<p>(4) 债券正回购。</p> <p>2、投资组合比例</p> <p>(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%;</p> <p>(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%;</p> <p>(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%;</p> <p>(4) 本计划总资产占净资产比例不得超过 200%;</p> <p>(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> <p>3、预警和平仓线</p> <p>(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, 自触发预警线之日起 5 个交易日内调整, 使得本集合计划股权类资</p>	<p>(1) 投资于以上第 (1) 项标准化债权类资产和货币基金合计比例不得低于本集合计划总资产的 80% (含 80%), 使得本集合计划直接投资于标准化债权类资产以及通过投资货币基金间接持有标准化债权类资产比例合计不得低于本集合计划总资产的 80% (含 80%), 从而符合固定收益类产品比例要求;</p> <p>(2) 投资于以上第 (2) 项的标准化股权类资产占本计划总资产比例低于 20% (不含 20%);</p> <p>(3) 投资于以上第 (4) 项中的公募证券投资基金 (货币基金除外) 比例不高于本集合计划总资产的 20% (不含 20%);</p> <p>(4) 本计划总资产占净资产比例不得超过 200%;</p> <p>(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>
---	---

<p>产占本计划净值的比例不超过 10%;</p> <p>(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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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</p>	<p>3、预警和平仓线</p> <p>(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, 自触发预警线之日起 5 个交易日内调整, 使得本集合计划直接投资的标准化股权类资产占本计划净值的比例不超过 10%。由于因管理人主观原因之外因素 (例如出现资产流动性受限、市场波动) 造成管理人无法在 10 日内调仓的, 管理人应该在流动性受限资产可卖出、可转让或者可交易的情况下的 5 个工作日内卖出, 使得本集合计划直接投资的标准化股权类资产比例符合上述要求。</p> <p>自本集合计划份额净值高于预警线 (0.95 元) 后的下一个交易日起, 本集合计划上述投资限制解除。</p> <p>(2) 平仓线: 本集合计划成立后, 任意一个交易日单位净值</p>
---	--

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。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基金业协

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。

本集合计划平仓线或者预警线的设置，并非构成管理人对投资者投资于本集合计划最大损失的承诺和保证。在平仓卖出过程中，由于大量卖出导致市场价格大幅下跌或因证券跌停、停牌等事件导致证券不能及时卖出等因素，可能给本集合计划带来损失，导致平仓后本集合计划实际份额净值低于平仓线。

预警线、平仓线由管理人负责监控，托管人负责按本合同约定复核份额净值，配合进行账务处理。

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



<p>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。</p>	<p>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基金业协会报告。</p> <p>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。</p>
<p>5、修改位置“五、集合资产管理计划的基本情况”之“（十）本集合计划利益冲突情况”</p>	
<p>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</p>	<p>1、可能存在利益冲突的情形</p> <p>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者从事其他重大关联交</p>

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。

易”时，可能发生利益冲突。

## 2、利益冲突处理方式

投资者在此同意并授权管理人可以将本集合计划的财产投资于管理人、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，但管理人前述投资行为存在为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他相关方提供或者变相提供融资的情形除外。

管理人在实施前述投资行为以及从事其他重大关联交易前事先得到投资者同意，并有充分证据证明未损害投资和利益，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，公平对待本集合计划财产，遵循投资者利益优先原则并防范利益冲突。

## 3、利益冲突披露方式、披露

	<p>内容及披露频率</p> <p>管理人从事关联交易的，应该事后向投资者、托管人及时、全面、客观的在本集合计划年度报告中披露报告期内的关联交易情况，具体内容披露内容包括但不限于交易时间、交易对手方、交易数量，对投资者利益影响情况等。</p> <p>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，并充分证明未损害投资者利益。</p>
<p>6、修改位置“五、集合资产管理计划的基本情况”之“（十三）本集合计划的各项费用”</p>	
<p>.....</p> <p>3、管理费：0.8%/年；</p> <p>4、托管费：0.03%/年；</p> <p>.....</p>	<p>.....</p> <p>3、管理费：0.5%/年；委托人和托管人在此同意，管理人有权以管理人网站公告方式下调本计划管理费率，无须履行合同变</p>

	<p>更程序。新的管理费率及其生效时间具体以管理人公告为准。</p> <p>4、托管费：0.03%/年；委托人和托管人在此同意，管理人有权以管理人网站公告方式下调本计划托管费率，无须履行合同变更程序。新的托管费率及其生效时间具体以管理人公告为准。</p>
<p>7、修改位置“六、集合计划的参与和退出”之“（二）集合计划的退出”之“5、退出份额、次数的约定”</p>	
<p>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。</p>	<p>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30万元，否则管理人有权将其剩余份额进行强制赎回。投资者持有的本集合计划份额净值低于30万元时，需要退出本集合计划的，应当一次性全部退出，不允许部分退出。</p>
<p>8、修改位置“七、管理人自有资金参与集合计划”</p>	

<p>管理人自有资金不参与本计划。</p>	<p>管理人自有资金不参与本计划。但管理人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%。</p>
<p>9、修改位置“十一、集合计划账户与资产”之第（三）条条款</p>	
<p>（三）集合计划资产的管理与处分</p> <p>集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产固有财产及其管理、托管的其他资产。管理人、托管人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。管理人或</p>	<p>（三）集合计划资产的管理与处分</p> <p>集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人及托管人的自有资产固有财产及其管理、托管的其他资产。管理人、托管人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。管</p>

<p>托管人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》、《实施细则运作管理规定》、《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。</p>	<p>理人或托管人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》、《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。</p>
<p>10、修改位置“十二、集合计划资产托管”</p>	
<p>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。</p> <p>.....</p>	<p>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《太平洋证券集合资产管理计划之资产托管协议》（托管人结算模式【统签】）。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。</p> <p>.....</p>
<p>11、修改位置“十三、集合计划的估值”之“（七）估值方法”</p>	
<p>.....</p> <p>4、 银行定期存款或通知</p>	<p>.....</p> <p>4、 银行定期存款或通知</p>

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、股指期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。

6、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；

7、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

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

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；

8、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

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。

.....



<p>管人必须及时完成估值工作。</p> <p>.....</p>	
<p>12、修改位置“十四、集合计划的费用、业绩报酬”之“（一）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间”</p>	
<p>.....</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%的费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.8\% \div 365 (\text{首日按集合计划初始资金金额})$ <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>.....</p> <p>4、与本集合计划相关的审计费</p> <p>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。</p>	<p>.....</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0.5%的费率计提，计算方法如下：</p> $H = E \times 0.5\% \div 365 (\text{首日按集合计划初始资金金额})$ <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>.....</p> <p>4、与本集合计划相关的审计费</p> <p>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，</p>

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。

.....

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

按直线法在每个自然日内平均摊销。

本集合计划的清算审计费，按与会计师事务所签订协议所规定的金额，于本集合计划终止当日一次性计入本集合计划费用。

.....

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，托管人不垫付开户费用。

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；

<p>支出金额支付。</p>	<p>管理人为了维护本集合计划资产安全而采取处置措施所发生的各项费用，包括但不限于诉讼费（仲裁费）、律师费、评估费、保全费、拍卖费等处置费用。托管人根据管理人发送的指令和费用凭证对划款指令进行表面相符性的形式审查。</p> <p>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。</p>
<p>13、修改位置“十四、集合计划的费用、业绩报酬”之“（三）业绩报酬”</p>	
<p>1、业绩报酬计算方法</p> <p><math>R \leq r_i</math>，管理人业绩报酬=0；</p> <p><math>r_i &lt; R</math>，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。</p> <p>其中，R 为委托人每笔份额持有期年化收益率；<math>r_i</math> 具体以管理人公告为准。业绩报酬计提基</p>	<p>业绩报酬计提日为分红日、投资者退出确认日（以下简称“退出日”）或本集合计划终止日（含提前终止）。管理人在符合业绩报酬计提条件时，于业绩报酬计提日提取业绩报酬。</p> <p>1、业绩报酬计提原则</p> <p>a、按照投资者每笔参与份额</p>

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。

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

分别计算持有期收益率，在符合业绩报酬计提的条件下计提业绩报酬。

b、在分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除。在每笔份额退出日和集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除。

c、业绩报酬的提取频率不得超过每6个月一次，但因投资者退出本集合计划的，管理人按本合同提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

d、投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取退出份额对应的业绩报酬。

## 2、业绩报酬的计提方法

在业绩报酬提取日，如果超额收益 $\geq 0$ ，则：每笔份额应提取

<p>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；</p> <p>管理人业绩报酬计提如下：</p> <p>持有期年化收益率（R） 计提比例 业绩报酬（Y）的计提公式</p> $R \leq r_i \quad 0 \quad Y = 0$ $R > r_i \quad 60\% \quad Y = A \times (R - r_i) \times 60\% \times D \div 365$ <p>Y = 业绩报酬；</p> <p>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。</p> <p>2、业绩报酬计提</p> <p>(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。</p> <p>(2) 业绩报酬计提日为本集</p>	<p>的业绩报酬 = 该笔份额超额收益 * 60%</p> <p>每笔份额超额收益 = 该笔份额持有期收益 - 该笔份额基准收益</p> <p>该笔份额持有期收益 = (本次业绩报酬计提日前一工作日的累计单位净值 - 上一次业绩报酬计提日前一个工作日的累计单位净值) * 该笔份额数</p> <p>该笔份额的基准收益 = 业绩报酬计提基准 / 365 * 实际运作天数 * 该笔份额数 * 该笔份额上一个业绩报酬计提日前一个工作日的单位净值；</p> <p>实际运作天数：每笔份额上一业绩报酬计提日前一个工作日（不含当日。如果不存在上一个业绩报酬计提日：对于募集期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从成立日当天开始算；对于存续期参与的</p>
---	---

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

份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔份额申购申请当日开始算）到本次业绩报酬计提日前一个工作日（含当日，无论本次业绩报酬计提日是否提到业绩报酬，均作为下次业绩报酬计提的起始日）的自然天数；

本集合计划的业绩报酬计提基准K具体以管理人公告为准，但管理人应确保业绩报酬计提基准K的变更频率应该与本集合计划开放期相匹配，即业绩报酬计提基准K的调整周期不得短于本集合计划两个开放期的间隔时间。业绩报酬计提基准不是管理人向投资者保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，投资者应自行承担投资风险。

### 3、业绩报酬支付

由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于5个工作日

<p>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。</p>	<p>内从本集合计划资产中一次性支付给管理人，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。</p> <p>因涉及注册登记机构数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，托管人不复核业绩报酬。</p>
<p>14、修改位置“十七、投资决策和风险控制”第（二）、（三）条款</p>	
<p>（二）投资程序</p> <p>1、投资决策程序</p> <p>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。</p> <p>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</p>	<p>（二）投资程序</p> <p>1、投资研究</p> <p>资产管理总部下设研究部，负责资产管理业务证券库的建立、维护与更新。研究工作保持独立、客观，研究员根据资产管理计划的投资目标和策略，对其分工板块、行业和上市公司的相关资料进行综合研究分析，筛选目标证券，经讨论通过后纳入各类证券池。</p>

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；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

## 2、投资决策

资产管理总部建立健全投资决策授权制度,明确界定投资权限。投资决策严格遵守法律法规的规定,符合资产管理合同约定的投资目标、投资范围、投资限制等要求。

管理人资产管理业务投资决策实行投资决策委员会-投资总监-投资经理三级授权管理制度。

投资决策委员会由资产管理业务分管领导及其他委员组成,是资产管理业务投资管理的最高决策机构,主要职责包括制定、完善投资决策制度和流程;审议投资经理提交的阶段性投资计划,并对投资运作情况进行回顾与分析;审定证券池建池规则及执行流程,审定资产管理产品投资重仓标准,负责重仓投资审批,并根据重仓比例高低确定分级授权;审定资产管理产品证券投资



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、

业务止盈止损规则；制定投资授权方案，对投资经理、投资总监做出投资授权，对超出投资经理、投资总监权限的投资作出决定；需要投资决策委员会决议的其他重大事项等。

投资经理对资产管理计划的日常运作和管理承担首要责任。主要工作包括：根据所管理资产管理计划的风险等级要求和资产管理计划合同约定的投资目标和投资策略，制定具体投资组合配置方案；测算拟定组合配置方案的风险敞口、确定组合整体止盈、止损控制机制；在债券库中选择具体标的进行投资；建议重点投资品种或单个投资标的，向研究部提出研究要求；拟定资产管理计划投资组合方案，根据自身的市场经验，结合市场技术指标，在授权范围内，确定投资的具体数额和时机，并向交易部下达交

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、

易指令。

### 3、投资执行

资产管理计划证券投资交易均采用集中交易制度。投资执行与投资决策严格分离，资产管理计划的所有证券买卖活动须通过交易部统一分配，集中交易完成。执行程序包括：

(1) 交易指令的下达：交易指令由投资经理通过投资管理系统账号发出，所有交易指令集中于交易部；

(2) 交易指令的审批：交易指令经系统审批、交易主管辅助通过后成为正常指令，未通过审批的指令将被拒绝执行；

(3) 交易指令的分解：交易指令由交易主管通过系统以事先设定的规则辅助分发到各交易员处；

(4) 交易指令的完成与反馈：交易员根据指令要求，结合

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

(1) 管理人的资产管理总部

自身的操作经验合理地完成交易，及时将完成情况及其他意外情况反馈给交易主管，交易主管日终将汇总的交易执行情况反馈至各投资经理，并将交易日报表交由相应投资经理签字确认；

(5) 交易指令下达的方式：

全部以电脑下单方式完成，在电脑发生故障等意外情况时，可以录音电话或书面方式下达，禁止以口头方式下达指令。

## (三) 风险控制

风险管理是资产管理计划投资管理的重要组成部分，对风险的识别、判断、评估、跟踪和控制贯穿于资产管理计划投资管理的全过程。

### 1、决策过程中的风险控制

(1) 构建债券库。研究部对债券进行研究，根据投资理念和资产管理计划合同规定，剔除不符合资产管理计划要求和存在瑕

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

疵的标的，根据定性和定量相结合的方式，进行内部评级，确定信用风险等级；并做好日常跟踪和维护，及时调整证券库；

(2) 研究部对拟投资的重点投资品种进行信用风险评估，并将风险分析情况反馈给资产管理计划投资经理；

(3) 资产管理计划投资经理确定投资组合，只能从债券证券库中选取债券。

## 2、执行过程中的风险控制

(1) 投资经理不定期对投资组合面临的利率风险、流动性风险等进行全面的评估与分析，并定期在投资决策委员会上提交所管理产品的投资回顾和总结。

(2) 研究部对重点投资品种进行动态风险跟踪和评估；投资经理根据研究部的风险提示报告，对投资组合和重点投资品种进行适当调整；

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

(3) 投资决策委员会认为必要时，可要求资产管理计划投资经理限期对投资组合和重点投资品种进行调整。

### 3、投资授权控制

投资决策委员会根据资产管理业务发展情况，按照投资类别、产品属性确定投资总监、投资经理的投资额度和投资权限。投资授权额度原则上每年核定一次。相关投资经理、投资总监超过其权限范围内的投资，上报投资决策委员会审议。

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：是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。

(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。

15、修改位置“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。

(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。

(3)本计划的总资产占净资产的比例不得超过200%。

(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%，

(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。

(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。

(3)本计划的总资产占净资产的比例不得超过200%。

(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%。

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

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%。

（5）本集合计划参与质押式回购与买断式回购最长期限均不得超过 365 天。

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，由过错方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

<p>括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>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；</li> <li>2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</li> <li>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；</li> <li>4、挪用集合计划资产；</li> <li>5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；</li> <li>6、募集资金超过计划说明书约定的规模；</li> <li>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；</li> <li>8、使用集合计划资产进行不必要的交易；</li> <li>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；</li> <li>10、法律、行政法规和中国</li> </ol>	<p>括：</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、投资于不符合国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外），包括但不限于： <ol style="list-style-type: none"> <li>①投资项目被列入国家发展和改革委员会发布的淘汰类产业目录；</li> <li>②投资项目违反国家环境保护政策要求；</li> <li>③通过穿透核查，资产管理计划最终投向上述投资项目。</li> </ol> </li> <li>2、直接投资于商业银行信贷资产；</li> <li>3、违规为地方政府及其部门提供融资，要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；</li> <li>4、直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止投资的行业和领域；</li> <li>5、直接或者通过投资其他资管产品等形式间接，为管理人、托管人及前述机构的控股股东、</li> </ol>
--	--

证监会禁止的其他行为。

实际控制人或者其他相关方提供或者变相提供融资。

6、违规将本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；

7、将本集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；

8、使用本集合计划资产进行不必要的交易；

9、相关法律法规及中国证监会规定的其他禁止投资事项。

### (三) 托管人对管理人的投资监督

1、托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同有关集合计划财产投资政策的约定，承诺对本集合计划如下投资事项进行监督：

#### ①对投资范围的监督：

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、

### (三) 托管人对管理人的投资监督

1、托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人根据本合同有关集合计划财产投资政策的约定，承诺对本集合计划如下投资事项进行监督：

#### ①对投资范围的监督：

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、

<p>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、债券逆回购以及法律法规允许的固定收益证券；</p> <p>(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；</p> <p>(3) 金融衍生品：在证券期货交易市场的股指期货；</p> <p>(4) 债券正回购。</p> <p>②对资产配置比例的监督：</p> <p>(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%；</p> <p>(2) 投资于以上第（2）项的股权类资产占本计划总资产比例</p>	<p>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、债券逆回购以及法律法规允许的固定收益证券；</p> <p>(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；</p> <p>(3) 债券正回购。</p> <p>②对资产配置比例的监督：</p> <p>(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%；</p> <p>(2) 投资于以上第（2）项的股权类资产占本计划总资产比例</p>
--	---

<p>低于 20%;</p> <p>(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%;</p> <p>(4) 本计划总资产占净资产比例不得超过 200%;</p> <p>(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%的;</p> <p>③对投资限制的监督:</p> <p>(1) 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。(托管人对“同一资产”按照“单只债券、单只基金、单只股票”来监控);</p> <p>(2) 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, 所申报的金额不得超过本计划的总资产,</p>	<p>低于 20%;</p> <p>(3) 本计划总资产占净资产比例不得超过 200%;</p> <p>(4) 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%的;</p> <p>③对投资限制的监督:</p> <p>(1) 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。(托管人对“同一资产”按照“单只债券、单只基金、单只股票”来监控);</p> <p>(2) 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, 所申报的金额不得超过本计划的总资产, 且所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;</p> <p>(3) 本集合计划总资产不得</p>
--	--

<p>且所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>(3) 本集合计划总资产不得超过计划资产净值的 200%；</p>	<p>超过计划资产净值的 200%；</p>
<p>16、修改位置“二十三、当事人的权利和义务”</p>	
<p>(一) 委托人的权利和义务</p> <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>(一) 委托人的权利和义务</p> <p>1、委托人的权利</p> <p>(1) 取得集合计划收益；</p> <p>(2) 按照法律法规和本合同约定的时间和方式获得本集合计划的信息披露资料；</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》的约定，参与、退出和转让集合计划；</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>	<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) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；</p> <p>(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于本集合计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(4) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(5) 按照本合同约定支付本集合计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬</p>
---	--

(如有)、托管费、审计费、税费等合理费用;

(6) 在持有的本集合计划份额范围内, 承担本集合计划亏损或者终止的有限责任;

(7) 向管理人或本集合计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件, 配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作;

(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为;

(9) 不得从事任何有损本集合计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动;

(10) 保守商业秘密, 不得泄露本集合计划的投资计划、投资意向等; 不得利用本集合计划相关信息进行内幕交易或者其他



<p>(二) 管理人的权利和义务</p> <p>1、管理人的权利</p> <p>(1)根据本合同及《说明书》的约定,独立运作集合计划的资产;</p> <p>(2)根据本合同及《说明书》的约定,收取管理费等费用;</p> <p>(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;</p> <p>(4)根据本合同及《说明书》的约定,终止本集合计划的运作;</p> <p>(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;</p> <p>(6)行使集合计划资产投资形成的投资人权利;</p>	<p>不当、违法的证券期货业务活动;</p> <p>(11) 法律法规、中国证监会和基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。</p> <p>(二) 管理人的权利和义务</p> <p>1、管理人的权利</p> <p>(1) 根据本合同的约定,独立管理和运用本集合计划的财产;</p> <p>(2) 根据本合同的约定,及时、足额收取管理费及业绩报酬(如有);</p> <p>(3) 按照有关规定和本合同约定行使因本集合计划财产投资所产生的权利;</p> <p>(4) 根据本合同和其他有关规定,监督托管人,对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对本集合计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的,应当及时采取措施制止,并报告中国证监会相关派出机构及基金业</p>
--	---

<p>(7)集合计划资产受到损害时,向有关责任人追究法律责任;</p> <p>(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。</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(3)依法计算并披露资产管理计划净值,确定参与、退出价格;</p> <p>(4)进行资产估值等会计核算;</p> <p>(5)根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管</p>	<p>协会;</p> <p>(5)自行提供或者委托经中国证监会、基金业协会认定的服务机构为本集合计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务,并对其行为进行必要的监督和检查。</p> <p>(6)以管理人名义,代表本集合计划行事投资过程中产生的权属登记等权利;</p> <p>(7)法律法规、中国证监会和基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。</p> <p>2、管理人的义务</p> <p>(1)依法办理本集合计划的销售、登记、备案事宜;</p> <p>(2)按照基金业协会要求报送本集合计划产品运行信息;</p> <p>(3)按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务,管理和运用本集合计划财产;</p> <p>(4)对投资者的风险识别能</p>
---	--

<p>协议的约定,接受托管人的监督;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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</p>	<p>力和风险承受能力进行评估,向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金;</p> <p>(5) 制作风险揭示书,向投资者充分揭示相关风险;</p> <p>(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作本集合计划财产;</p> <p>(7) 建立健全的内部管理制度,保证本集合计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立,对所管理的不同财产分别管理,分别记账,分别投资;聘请投资顾问的,应制定相应利益冲突防范机制;</p> <p>(8) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外,不得为管理人及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作本集合计划财产;</p>
---	--

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

(9) 保守商业秘密，不得泄露本集合计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；

(10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损本集合计划财产及其他当事人利益的活动；

(11) 除规定情形或符合规定条件、本合同约定外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；

(12) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；

(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

(14) 按照本合同约定计算并向投资者披露本集合计划份额净值；

(15) 确定本集合计划份额参与、退出价格，采取适当、合

中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。

理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和本合同的约定；

(16) 如本集合计划投资于非标资产的，管理人需对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；

(17) 按照本合同约定负责本集合计划会计核算并编制财务会计报告；

(18) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(19) 按照本合同的约定确定收益分配方案，并根据收益分配方案及时向投资者分配收益；

(20) 根据法律法规与本合同的规定，编制向投资者披露的本集合计划季度、年度等定期报告，向基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；

(21) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(22) 建立并保存投资者名单；

(23) 组织并参加本集合计划财产清算小组，参与本集合计划财产的保管、清算、变现和分配；

(24) 按照法律法规和中国证监会的规定，保存本集合计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自本集合计划终止之日起不得少于 20 年；

(25) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、基金业协会并通知托管人和投资者；

(26) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。

<p>(三) 托管人的权利与义务</p> <p>1、托管人的权利</p> <p>(1)依法对集合计划的资产进行托管；</p> <p>(2)按照本合同、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；</p> <p>(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；</p> <p>(4)查询集合计划的经营运作情况；</p> <p>(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。</p> <p>2、托管人的义务</p> <p>(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</p>	<p>(三) 托管人的权利与义务</p> <p>1、托管人的权利</p> <p>(1)按照本合同约定，依法保管本集合计划财产；</p> <p>(2)按照本合同约定，及时、足额获得本集合计划托管费用；</p> <p>(3)法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。</p> <p>2、托管人的义务</p> <p>(1)安全保管本集合计划财产；</p> <p>(2)除依据法律法规规定和本合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管本集合计划财产；</p> <p>(3)对所托管的不同财产分别设置账户，确保本集合计划财产的完整与独立；</p> <p>(4)公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损本集合计划财产及其他当事人利益的活</p>
--	---

<p>财产应当相互独立；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(4) 安全保管所托管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，及时办理清算、交割事宜；</p> <p>(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；</p> <p>(6) 监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或</p>	<p>动；</p> <p>(5) 按规定开立和注销本集合计划的托管账户及其他投资所需账户；</p> <p>(6) 复核本集合计划资产净值和份额净值；</p> <p>(7) 办理与本集合计划托管业务活动有关的信息披露事项；</p> <p>(8) 根据相关法律法规和本合同约定，复核管理人编制的本集合计划财产的定期报告，并出具书面意见；</p> <p>(9) 编制托管年度报告，并向基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>(10) 按照法律法规规定和本合同约定，根据管理人投资指令，及时办理清算，交割事宜；</p> <p>(11) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄漏；</p> <p>(12) 根据法律法规规定和</p>
--	---



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

中国证监会的规定保存本集合计划会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自本集合计划终止之日起不得少于 20 年；

(13) 监督管理人的投资运作，发现管理人投资或清算指令违反法律法规、中国证监会规定或本合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和基金业协会；

(14) 法律法规、监管机构规定的和本合同约定的其他权利。

<p>易记录、会计账册等文件、资料和数据，保存期不少于二十年；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(13) 因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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>	
<p>17、修改位置“二十四、违约责任与争议处理”</p>	
<p>(一) 违约责任</p> <p>1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行</p>	<p>(一) 违约责任</p> <p>1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行</p>

<p>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：</p> <p>.....</p>	<p>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，应按过错原则分别对各自的行为承担连带赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：</p> <p>.....</p>
---	---

18、修改位置“二十五、风险揭示”

<p>.....</p> <p>(三) 股指期货的投资风险</p> <p>1、股指期货的市场风险</p> <p>由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失；股指期货实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被平仓，因</p>	<p>.....</p> <p>(三) 本集合计划份额净值低于止损线的风险</p> <p>本集合计划触及平仓线，本集合计划存在强行平仓和提前终止风险。</p> <p>本集合计划平仓线或者预警线的设置，并非构成管理人对投资者投资于本集合计划最大损失的承诺和保证。当本集合计划份额净值跌破平仓线时，本集合计划将提前进入终止清算并进行平</p>
---	---

此投资者进行股指期货交易会面临较大的市场风险。

## 2、股指期货的结算风险

投资者金融期货投资的结算及投资者金融期货资产账户项下的资产保管由期货经纪公司负责。证券投资者如果选择了不具有合法证券经纪业务资格的证券及期货经纪公司从事证券交易，投资者权益将无法得到法律保护；或者所选择的证券及期货经纪公司在交易过程中存在违法违规经营行为或破产清算，也可能给投资者带来损失。

对从事股指期货的投资者来说，为投资者进行结算的结算会员或同一结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中国金融期货交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，投资者的资产可能因被连带

平仓。平仓时点存在一定的滞后性，具有不可控的风险。在平仓卖出过程中，由于大量卖出导致市场价格大幅下跌或因证券跌停、停牌等事件导致证券不能及时卖出等因素，可能给本集合计划带来损失，导致平仓后本集合计划份额实际份额净值低于平仓线。

.....

<p>强行平仓而遭受损失。</p> <p>3、股指期货的模型风险</p> <p>集合计划的投资依赖各种量化投资模型，因为模型不能有效的、完全的刻画市场运行中的真实状况，模型在测算、评估时存在误差（历史表现不保证未来表现），模型中的参数估计存在误差，或者市场条件突然发生改变等因素，数量模型的可靠性将对本集合的收益产生影响。同时，量化模型对相关数据的准确性和可靠性依赖较高，个别研究报告或其它材料的数据是否准确可靠，对本集合计划的业绩表现有所影响。</p> <p>.....</p>	
<p>19、修改位置“二十七、合同的补充、修改与变更”</p>	
<p>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</p>	<p>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</p>

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

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（但此情形下涉及本合同投向和比例变更的，应当事先取得投资者同意，并按照以下第2条条款约定履行合同变更程序）。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

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；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。

.....

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；约定期限内未反馈意见的，视同委托人同意本合同变更，但本合同投向和比例变更后导致本集合计划产品类型发生变化的，必须事先得到投资者的书面同意，不允许默许同意。自合同变更生效之日起，公告内容即成为本合同组成部分。

.....

(2)、《太平洋证券太盈1号集合资产管理计划说明书》和《太平洋证券太盈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《原合同》“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《太平洋证券太盈1号集合资产管理合同》第一次变更征询函”。

特此公告

