

太平洋证券金添利1号集合资产管理计划

业绩报酬计提基准调整公告

根据《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》（以下简称“《资管合同》”）中有关开放期条款的约定，我司管理并中国工商银行股份有限公司上海市分行托管的太平洋证券金添利1号集合资产管理计划（产品代码E61059，以下简称“本集合计划”）将于2019年11月25日开放申购和赎回，委托人可在该开放日当日提起申购或赎回申请。自本次开放之日起至下一个赎回开放日期间，本集合计划仅每周一开放申购，不开放赎回。其中，本集合计划下一个赎回开放日为2020年2月24日，如果遇到管理人认为有必要调整情况，管理人可公告该赎回开放日顺延，具体以届时的管理人相关公告为准。

根据目前市场情况，我司现公告本集合计划业绩报酬计提基准调整为4.70%/年，自2019年11月27日起生效。

业绩报酬计提基准测算依据及过程如下：

组合券种	收益率水平（年化）	投资比例	收益率贡献（年化）
AAA	4.00%	25%	1.0000%
AAA 私募债	4.50%	40%	1.8000%
AA+	4.10%	25%	1.0250%
AA+ 私募债	4.90%	30%	1.4700%
AA	5.00%	30%	1.5000%
回购	2.80%	-50%	-1.40%
合计		100%	5.40%

按《资管合同》约定，本集合计划管理费率为0.50%/年，托管费率为0.03%/年。故前述大致测算的组合费后收益率为4.87%/年。考虑到建仓时点不同、市场变化导致的收益率偏差，故将业绩报酬计提基准定为4.70%/年。

本业绩报酬计提基准仅为管理人计提业绩报酬的依据，并不构成对
委托人保本保收益的承诺，委托人应自行承担投资风险。

特此公告

太平洋证券股份有限公司

2019年11月19日

