

关于《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理合同》

第二次变更征询函

尊敬的委托人：

管理人、托管人双方已于2018年12月签署了《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理计划集合资产管理合同》、2019年6月签署了《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理合同之补充协议一》（以下称《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，并已签署《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理合同之补充协议二》。

现管理人就《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理合同之补充协议二》事宜，向太平洋证券稳健增强1号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）全体委托人征询意见。本次合同变更意见征询截止日为2019年12月24日。为了保障不同意本次合同变更的委托人退出本集合计划的权利，管理人安排本集合计划2019年12月24日特别开放。如不同意本次合同变更，请您于2019年12月24日申请退出本集合计划。如您在截止日前意见答复不同意变更且未在2019年12月24日申请退出的，管理人会将您所持有的本集合计划全部份额做强制退出处理。如您在截止日前未回复意见且未退出的，视为同意本集合计划合同变更。

由于2019年12月24日也为本集合计划开放申购赎回日，于该日申购本集合计划的委托人视作同意本次合同变更。

本次合同变更内容具体如下：

一、“五、集合资产管理计划的基本情况（四）投资范围和投资比例”

原条款为：“3、关联交易

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、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方与管理人有关联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。管理人应遵循投资者利益优先原则，采取切实有效措施，防范利益冲突，保护投资者合法权益；并在事后2个工作日内以管理人网站公告方式告知资产托管机构和委托人，涉及重大关联交易的，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。”



拟修改为：“3、关联交易

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、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方与管理人有关联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。委托人签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事该等关联交易，管理人无需就该等具体关联交易分别取得投资者的个别授权，但管理人应有充分证据证明未损害委托人利益，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，遵循委托人利益优先原则并防范利益冲突。并在事后及时以管理人网站公告方式告知资产托管机构和委托人，涉及重大关联交易的，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。”

二、“五、集合资产管理计划的基本情况(八)封闭期、开放期”

原条款为：“(二)开放期：

(1) 开放申购期：委托人在开放申购期可以办理参与业务。本集合计划原则上定期开放申购，开放申购时间为：本次变更生效之日起每月的第 11-15 个工作日（例如，本计划第一次变更生效之日为 2019 年 6 月 25 日，则变更生效后开放申购期为：2019 年 7 月 15 日-2019 年 7 月 19 日，2019 年 8 月 15 日-2019 年 8 月 21 日，2019 年 9 月 16 日-2019 年 9 月 20 日，以此类推）以及自运作起始日起每满 182 天的当日（第一个运作起始日指本计划成立日，之后运作起始日指每满 182 天的次日）。

(2) 开放赎回期：自运作起始日起每满 182 天的当日（第一个运作起始日指本计划成立日，之后运作起始日指每满 182 天的次日）。委托人在开放赎回期可以办理退出业务。若遇到节假日或者其他特殊情况，管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应调整并公告。

此情况下，管理人主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的 20%。

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。”

拟修改为：“2、开放期：

（1）申购期：委托人在本集合计划的开放申购期可以办理参与业务。本集合计划原则上定期开放申购业务，开放申购时间为：本次合同变更生效之日的次月起每月的10日，如遇节假日则顺延至后一个工作日，管理人也可根据实际情况进行调整，具体以管理人公告为准（例如，本计划第二次变更生效之日为2019年12月10日，则变更生效后开放申购期为：2020年1月10日，2020年2月10日，2020年3月10日，以此类推）。

（2）赎回期：委托人在本集合计划的开放赎回期可以办理退出业务。本集合计划原则上定期开放赎回业务，开放申购时间为：本次合同变更生效之日起运作满30日后的次月起每月的10日，如遇节假日则顺延至后一个工作日，管理人也可根据实际情况进行调整，具体以管理人公告为准（例如，本计划第二次变更生效之日为2019年12月10日，则变更生效后开放申购期为：2020年2月10日，2020年3月10日，2020年4月10日，以此类推）。

此情况下，管理人主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的20%。

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、“五、集合资产管理计划的基本情况（十二）本集合计划的各项费用”

原条款为：“1、认购费与申购费：0%。

2、退出费：0%；

3、管理费：0.5%/年，详见本合同第十四章节；

4、托管费：0.05%/年，详见本合同第十四章节；

5、业绩报酬：详见本合同第十四章节。

6、证券交易费用：本集合计划应按规定比例在发生投资交易时计提并支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、基金申购赎回费等税费，作为交易成本从本集合计划资产中直接扣除；

7、其它相关服务机构费用：律师费、审计费等其他相关服务机构的费用由管理人根据行业收费标准及业务实际情况，向托管人出具划款指令，从集合计划专用银行账户中扣划。

委托人、管理人、托管人作为各纳税主体，应根据取得的收益按照有关法律、法规的规定，自行纳税，管理人不代扣代缴。

管理人、托管人在履行管理、托管职责时获得的收入产生的相关税费，由管理人、托管人自行承担。

按照法律法规及国家有关部门规定管理人作为纳税人应缴纳的委托资产管理运用过程中的增值税（如有），由委托资产承担。如法律、行政法规和国家有关部门的规定调整的，则按新的规定执行。”

拟修改为：“1、认购费与申购费：0%。

2、退出费： 委托人连续持有本集合计划份额的时间不超过 50 天（不含当日）的，退出费率为 0.1%/笔；

3、管理费： 0.5%/年，详见本合同第十四章节；

4、托管费：0.03%/年，详见本合同第十四章节；

5、业绩报酬：详见本合同第十四章节。

6、证券交易费用：本集合计划应按规定比例在发生投资交易时计提并支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金、基金申购赎回费等税费，作为交易成本从本集合计划资产中直接扣除；

7、其它相关服务机构费用：律师费、审计费等其他相关服务机构的费用由管理人根据行业收费标准及业务实际情况，向托管人出具划款指令，从集合计划专用银行账户中扣划。

委托人、管理人、托管人作为各纳税主体，应根据取得的收益按照有关法律、法规的规定，自行纳税，管理人不代扣代缴。

管理人、托管人在履行管理、托管职责时获得的收入产生的相关税费，由管

理人、托管人自行承担。

按照法律法规及国家有关部门规定管理人作为纳税人应缴纳的委托资产管理运用过程中的增值税（如有），由委托资产承担。如法律、行政法规和国家有关部门的规定调整的，则按新的规定执行。”

四、“十四、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”

原条款为：“1、托管费：

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 0.05% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日计划资产净值。（首日按本计划初始资金金额）

本计划的托管费按前一日产品资产净值计算，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。

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。

托管费收费账户信息如下：

户 名：证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账 号：216200191675000146

开户银行：兴业银行上海分行营业部

.....

（三）业绩报酬

业绩报酬计提日为收益分配日、委托人退出日或本计划终止日（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。

(1) 管理人收取业绩报酬的原则

a、按照委托人每笔参与份额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、集合计划收益分配日提取业绩报酬的，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，但因委托人退出本计划的，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。

(2) 业绩报酬的计提方法

业绩报酬的提取条件和提取比例如下：

若业绩报酬计提日，委托人获得超额收益，则管理人有权以该笔超额收益为基准提取一定比例（60%）作为业绩报酬，其中超额收益为每笔份额持有期收益率高于其基准收益（即按照业绩报酬计提基准计算的收益）的部分。计算方式如下：

在业绩报酬提取日，如果超额收益 ≥ 0 ，则：每笔份额应提取的业绩报酬=该笔份额超额收益*60%

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

该笔份额持有期收益=(本次业绩报酬计提日的累计单位净值-上一次业绩报酬计提日的累计单位净值)*该笔份额数

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；

实际运作天数：每笔份额上一业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的自然天数；如果不存在上一业绩报酬计提日，对于募集期参与的份额而言其上一个业绩报酬计提日为本集合计划成立日，对于存续期参与的份额而言其上一个业绩报酬计提日为其参与申请日。

管理人有权在本集合计划封闭期结束后、下一个开放日前，公布本集合计划的业绩报酬计提基准（K），具体标准及生效时间以管理人网站公布为准。

管理人通过深入分析国内外宏观经济走势、社会资金运动及各项宏观经济政策对金融市场特别是货币市场的影响，密切关注市场资金面松紧变化，把握市场利率走势，合理确定集合计划的规模、投资标的以及业绩报酬计提基准的范围。

管理人确定业绩报酬计提基准主要基于集合计划投资的债券回购、债券、货币市场基金等的收益情况估算,但并不是管理人向委托人保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺,投资风险为委托人自行承担。

3、业绩报酬支付:

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。若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。当集合计划收益分配日、份额退出日或集合计划终止时,托管人根据管理人的指令将退出净值总额(含业绩报酬和退出费用(如有))或分红金额(含业绩报酬)划拨给注册登记机构,由注册登记机构将业绩报酬和退出费用(如有)支付给管理人,并将扣除业绩报酬和退出费用(如有)的退出款项转入推广机构在注册登记机构的资金账户。因涉及注册登记数据,业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成,托管人不承担复核业绩报酬的责任。”

拟修改为“1、托管费:

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:

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

H 为每日应计提的托管费

E 为前一日计划资产净值。(首日按本计划初始资金金额)

本计划的托管费按前一日产品资产净值计算,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。

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。

托管费收费账户信息如下:

户 名: 证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账 号：216200191675000146

开户银行：兴业银行上海分行营业部

.....

(三) 业绩报酬

1. 管理人根据当时市场情况,在本集合计划发行前确定业绩报酬计提基准且有权在本集合计划每个开放期前变更业绩报酬计提基准(年化,变更周期不短于两次开放期的间隔时间),并通过管理人网站、销售机构指定网络系统或其他途径和方式进行公告,本集合计划业绩报酬计提基准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调整周期不得短于本集合计划两个开放期的间隔时间。

2. 业绩报酬的计提基准日:【本集合计划分红日、投资者赎回日和本集合计划终止日】如在某个分红日本集合计划未提取到业绩报酬的。该分红日仍被作为“业绩报酬计提基准日”。

3. 业绩报酬的计算:业绩报酬的计算采用单个投资者单笔份额赎回时对应的持有期收益率和对应期间业绩报酬计提基准的差额来计提(赎回份额按照“先进先出”原则和本合同所约定的相关条款计算;清算时,所有投资者视同全部赎回)。即以份额持有人单笔认/申购对应份额持有期间收益为基准,按比例提取,具体提取比例如下:

当份额持有人本次赎回对应份额持有期间的收益率低于业绩报酬计提基准(含),管理人不提取业绩报酬;当份额持有人本次赎回对应份额持有期间的收益率高于业绩报酬计提基准(不含),管理人提取超额收益的60%作为业绩报酬。业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次,但因份额持有人退出本集合计划,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。

计算公式如下:

$$\text{当 } \frac{NAV_{e'} - NAV_{is'}}{NAV_{is}} > B_i \text{ 时,}$$

$$H_i = \left(\frac{NAV_{e'} - NAV_{is'}}{NAV_{is}} - B_i \right) \times N_i \times NAV_{is} \times 60\%,$$

$$\text{其中, } B_i = \sum_{t=1}^n \frac{r_{it} \times T_{it}}{365};$$

$$\text{当 } \frac{NAV_{e'} - NAV_{is'}}{NAV_{is}} \leq B_i \text{ 时,}$$

$$H_i = 0; H = \sum_{i=1}^n H_i$$

其中：

H 为该份额持有人本次赎回/分红时管理人提取的全部业绩报酬；

H_i 为该份额持有人本次赎回/分红时对应的第 i 笔集合计划份额应计提的业绩报酬；

B_i 为该份额持有人本次赎回/分红时对应的第 i 笔集合计划份额对应当期的业绩报酬计提基准；

r_{it} 为该份额持有人本次赎回/分红对应的第 i 笔集合计划份额对应持有第 t 期的业绩报酬计提基准（年化）；

T_{it} 为该份额持有人本次赎回/分红对应的第 i 笔集合计划份额对应持有第 t 期的实际天数。即在第 t 期期间上一个业绩报酬计提期的最后一天的下一个工作日（含当日。若本期为第一次计提业绩报酬，对于募集期认购的份额而言为成立日；对于存续期申购的份额而言为申购确认日）/若不存在上一个业绩报酬计提期且非第 1 期的，则为本期业绩报酬计提基准变更生效日至本次业绩报酬计提期的最后一日（含当日。若本次为第 i 笔份额赎回提取业绩报酬的，则为该笔份额的赎回申请日；若本次为第 i 笔份额分红提取业绩报酬的，则为本次分红日的前一工作日）/如本次未提取业绩报酬，则为下一期业绩报酬计提基准变更生效日（不含）实际经过的自然日天数；

NAV_e' 为该份额持有人本次赎回申请日的份额累计净值/本次分红日的前一个工作日的累计份额净值；

NAV_{is}' 为该份额持有人本次赎回所对应的第 i 笔集合计划份额申购申请日的份额累计净值（如认购则为本集合计划份额面值）/上一次分红日的前一个工作日的累计份额净值。

NAV_{is} 为该份额持有人本次赎回所对应的第 i 笔集合计划份额申购申请日的份额净值（如认购则为本集合计划份额面值）/上一次分红日的前一个工作日的份额净值。

N_i 为该份额持有人本次赎回对应的第 i 笔集合计划份额数。

业绩报酬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。

4. 业绩报酬的支付：业绩报酬在份额持有人赎回时或本产品清算时由管理人

负责计算和复核。业绩报酬从份额持有人的赎回资金总额或清算资金总额中扣除后支付，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人以管理人的指令数额为准于【5】个交易日内从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，顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。”

五、“十六、投资理念与投资策略（三）投资策略”

原条款为：“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。本集合计划投资于权益、商品及衍生品，采用量化对冲策略，以追求最低回撤为目标，力求稳定收益。

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）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、量化投资策略

本集合计划的股票量化投资主要采用指数增强策略，在控制一定指数跟踪偏离度的前提下，尽量获取最大的相对指数的超额收益，同时，通过做空相应的股指期货合约，将股票组合中的 beta 风险进行对冲，以获取稳定的 alpha 收益。”

拟修改为：“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。本集合计划投资于权益、商品及衍生品，采用量化对冲策略，以追求最低回撤为目标，力求稳定收益。

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) 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、量化投资策略

本集合计划的股票量化投资主要采用指数增强策略,在控制一定指数跟踪误差的前提下,尽量获取较大的相对指数的超额收益,同时,根据市场情况适时做空股指期货合约,将股票组合中的beta风险进行部分或全部对冲。”

六、“集合计划的参与和退出(二)集合计划的退出”

原条款为：“4、退出费及退出份额的计算

(1) 退出费率： 0；

(2) 退出金额的计算方法：

退出金额=申请退出份额×申请退出日集合计划单位净值×(1-退出费率(如有))-业绩报酬(如有)”

拟修改为：“4、退出费及退出份额的计算

(1) 退出费用

持有期 (P)	P<50 天	P≥50 天
退出费率	0.1%/笔	0

(2) 退出金额的计算方法：

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。”

七、“二十七、合同的补充、修改与变更”

原条款为：

“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,委托人特此授权:如管理人调低管理费、托管费、申购费的,可在与托管人协商一致后,直接在管理人网站公告,变更自公告之日起生效。此外,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投资比例修改,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。”

拟修改为:

“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(但如涉及本合同投向和比例变更的,应当事先取得投资者同意,并参照以下第2条条款约定履行合同变更程序)。

除上述1所述情形外,委托人特此授权:如管理人调低管理费、托管费、申购费或退出费等费用的,可在与托管人协商一致后,直接在管理人网站公告,变更自公告之日起生效。此外,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，应在特别开放日(具体以管理人公告为准)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(但本合同投向和比例变更后导致本集合计划产品类别发生变更的，必须事先取得投资者的书面同意，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。”

管理人将对《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理计划说明书》进行同步变更。

请委托人在“关于《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理合同》第二次变更征询函的回函”中做出意见表示意见答复。

感谢您的支持与配合。

特此公告



太平洋证券股份有限公司
2019年12月11日

关于《太平洋证券稳健增强1号集合资产管理合同》第

二次变更征询函的回函

请委托人根据以上内容作出意见表示：

同意合同变更之委托人，请于“同意合同变更”栏签字或盖章；不同

意合同变更之委托人，请于“拒绝合同变更”栏签字或盖章。

意见	委托人签字/盖章
同意合同变更	
拒绝合同变更	
时间	2019年 月 日

产品持有人姓名：

证件号码：

联系电话：

客户所在销售机构：