

太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划

产品发行公告

太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）将于 2020 年 3 月 23 日正式发行，初始募集期为 2020 年 3 月 23 日至 2020 年 4 月 3 日。本集合计划基本信息如下：

代码	E61135
类型	混合类
管理人	太平洋证券股份有限公司
注册登记机构	太平洋证券股份有限公司
托管人	南京银行股份有限公司
销售机构	太平洋证券股份有限公司
适合销售对象	本集合计划风险等级为 R4 中高风险，仅面向风险承受能力评级为 C4 积极型、C5 激进型的合格投资者和专业投资者。
存续期	本集合计划存续期限为自成立之日起至运作满 10 年（计划年度）当日止，遇到终止日为非工作日的，管理人有权将该终止日顺延至其最近的工作日。若本集合计划发生提前终止或者展期的，本集合计划存续期限相应提前到期或者延长。
开放日	申购开放日：本集合计划自成立之日起，每周一为申购开放日，如果遇到该日为非工作日则顺延至其最近的工作日。 赎回开放日：自上一个赎回开放日（其中第一个赎回开放日无上一个赎回开放日，因此第一个赎回开放日的上一个赎回开放日为本集合计划成立日）起运作每满 180 天后的最近一个周一为赎回开放日，如果遇到该日为非工作日则顺延至其最近的工作日。 因本集合计划投资于私募资产管理产品，应确保私募资产管理产品的最近开放赎回日或者到期日不得晚于本集合计划最近的开放赎回日或者终止日。 举例说明：假设本集合计划成立日为 2020 年 3 月 2 日成立，则运作满 180 天后的最近一个周一为 2020 年 08 月 31 日，在此假设条件下本集合计划第一个赎回开放日为 2020 年 8 月 31 日，以此类推。
投资方向、比例和限制	1、投资方向 (1) 私募资产管理产品：证券公司及其子公司、基金公司及其子公司和期货公司发行的资产管理计划以及在中国证券投资基金业协会官方网站公示已登记的私募证券投资基金管理人发行的私募基金。 (2) 经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（以下



简称公募基金)：股票型公募基金(包括股票型指数公募基金)、混合型公募基金、债券型公募基金、货币市场基金。

(3) 标准化股权类资产：国内沪深交易所挂牌的股票(含新股申购)。

(4) 标准化金融衍生品：在证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的股指期货。

(5) 标准化债权类资产：包括银行存款(包括活期存款和定期存款)以及沪深交易所或者银行间市场交易的国债、金融债(包括政策性金融债)、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、资产支持证券(仅限沪深交易所挂牌、不得为劣后级且底层不得为其他资管产品及其收/受益权)以及债券逆回购等标准化债权类资产。

(6) 债券正回购。

2、投资比例

(1) 本集合投资于以上第(1)项私募资产管理产品和第(2)项公募基金(以下或并称“资产管理产品”)的比例高于80%(不含80%)。

(2) 按照穿透原则合并计算，本集合计划投资于标准化债权类资产的比例为：0-80%(不含)。

(3) 按照穿透原则合并计算，本集合计划投资于标准化股权类资产的投资比例为：0-80%(不含)。

(4) 按照穿透原则合并计算，本集合计划投资于标准化金融衍生品类资产(按持仓合约价值)的投资比例为：0-80%(不含)。

(5) 本集合计划投资于同一资产的资金，不得超过本集合计划资产净值的25%；管理人全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金(此处同一资产不包括本集合计划“定制”的资管产品，其中“定制”指本集合计划持有该资管产品全部份额)，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。特别的，本集合计划投资于私募资产管理产品，应当按照穿透原则合并计算的投资同一资产的比例以及投资同一资产的金额，符合前述双25%的投资比例要求。

(6) 本集合计划总资产占净资产的比例不得超过200%。

(7) 本集合计划每日债券回购资金余额不得超过本集合计划上一日净资产100%。

(8) 相关法律法规及中国证监会规定的其他投资比例要求。

3、投资限制

(1) 本集合计划不得投向未经金融机构(商业银行、证券公司)托管或保管的基金。

(2) 本集合计划不得投资合伙企业份额。

(3) 本集合计划参与股票、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本集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

(4) 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。

(5) 本集合计划所投资的资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品。



	(6) 本集合计划所投资的资产管理产品的投向全部为标准化资产。 (7) 相关法律法规及中国证监会规定的其他投资限制要求。
最低认购/ 申购金额	本集合计划首次最低认购/申购金额为 40 万元 (不包含认购费), 最低追加认购金额为 1 万元。
认/申购、 退出费率	认/申购费率: 1%/笔。 退出费率: 0%。
托管费率	0.02%/年
管理费率	1.5%/年

投资者在参与本集合计划前请仔细阅读《太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》及相关材料, 并于初始募集期内前往本公告列示的销售机构办理参与手续。

特此公告。



太平洋证券股份有限公司

2020年3月16日



