

《太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》

第二次变更的征询函

尊敬的投资者：

就《太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》（以下简称“合同”）第二次变更事宜，我司已与托管人国泰君安证券股份有限公司达成书面一致。现就本次合同变更事宜，征求全体投资者意见。

合同变更意见征询截止日为 2020 年 7 月 16 日。为了保障不同意本次合同变更的投资者退出的权利，管理人拟将 2020 年 7 月 16 日设置为太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”)的特别开放日。如您不同意本次合同变更，请您于上述特别开放日申请退出本集合计划；如您在截止日前意见答复不同意合同变更且未在上述特别开放日申请退出的，管理人将会对您持有的本集合计划份额采取强制赎回；如您在截止日前未回复意见且未退出的，则视为您同意本集合计划合同变更。

具体变更后的条款如下：

一、修改内容

原合同“五、集合资产管理计划的基本情况（六）本集合计划的投资目标、主要投资范围、投资比例及限制、产品风险等级：3、投资比例及限制”，新增第（13）、（14）项

新增条款为：“（13）在开放期内，主动投资于流动性受限资产市值合计不得超过本集合计划资产净值 20%；

（14）如本计划投资于私募资产管理产品，则私募资产管理产品不



得再投资于非标准化资产。”

二、修改内容

原合同“五、集合资产管理计划的基本情况（十二）开放期与封闭期：2、开放期”

原条款为：“开放期：在开放期可以办理参与、退出业务。本集合计划第一个开放期为自集合计划成立之日起，运作至第13个月中的其中连续几个工作日，具体以管理人公告为准，管理人应当至少提前3个工作日在管理人网站公布开放日；之后开放期如下：自前一次开放期的首个开放日起，每满6个月开放一次，开放时间为每满6个月后的第一个月的第11个工作日至第15个工作日，例如本集合计划首次开放为2019年10月14日-10月18日，则管理人可在2020年5月18日-2020年5月22日进行开放，下一个开放期为2020年12月15日至12月21日，依此类推，具体时间以管理人网站公告为准。”

拟修改为：“开放参与期：本集合计划自本次变更生效之日起，每个月可开放一次申购，开放时间为每月的18日，如遇节假日往后顺延，具体以管理人公告为准；

开放赎回期：自本次变更生效之日起最近一次开放赎回日为2020年12月15-12月21日（如遇节假日，按节假日天数往后顺延）。之后每年开放赎回期为：当年的3月18日，6月18日，9月18日，12月18日开放赎回，如遇节假日往后顺延，例如本集合计划自本次变更生效之日为2020年7月17日，则管理人可在2020年12月15日-12月21日开放赎回，之后开放日为2021年3月18日、6月18日、9月18日、12月18日。依此类推，具体时间以管理人网站公告为准。

同时，单个投资者持有份额自其申购申请之日起满六个月的对日（如遇节假日顺延，含该对日）起方可申请赎回，如；例如投资者于2020年7月18日申购本集合计划份额，则该投资者持有的对应份额可在2021年3月18日管理人公告的开放退出日申请退出对应份额，如本次未申请赎回，则投资者下次可申请赎回日为2021年6月18日，以此类推。”

三、修改内容

原合同“十八、投资限制及禁止行为（一）投资比例及限制及投资禁止：1、投资比例及限制”，新增第（13）、（14）项

新增条款为：“（13）在开放期内，主动投资于流动性受限资产市值合计不得超过本集合计划资产净值20%；

（14）如本计划投资于私募资产管理产品，则私募资产管理产品不得再投资于非标准化资产。”

四、修改内容

原合同“二十四、集合计划终止和清算（一）集合计划的终止情形：第（5）项”

原条款为：“（5）持续五个工作日除自有资金以外投资者人数少于2人的；”

拟修改为：“（5）存续期内，连续5个工作日集合计划投资者人数少于2人的；但为投资者利益角度出发，管理人有权决定在本集合计划人数少于2人时立即终止本集合计划，如在本集合计划的开放赎回申请日剩余未申请赎回的投资者人数少于2人的，则管理人有权从公平角度出发，在赎回确认日对剩余未申请赎回的投资者做强制赎回以结束本集合计划；”

五、修改内容

原合同“二十六、风险揭示(二)一般风险揭示:5、投资标的风险”

新增条款:“(3)本计划投资的资产管理产品可能穿透投资于融资融券交易,可能存在包括但不限于如下投资融资融券业务的特有风险:1、可能放大投资损失的风险融资融券业务具有杠杆效应,它在放大投资收益的同时也必然放大投资风险。将股票作为担保品进行融资融券交易时,既需要承担原有的股票价格下跌带来的风险,又得承担融资买入或融券卖出股票带来的风险,同时还须支付相应的利息和费用,由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。2、特有的卖空风险融资融券交易中的融券交易存在着与普通证券截然不同的风险——卖空风险。普通证券投资发生的损失是有限的,最多不会超过本计划投入的全部本金,但是融券交易的负债在理论上可以无限扩大,因为证券上涨的幅度是没有上限的,而证券涨得越多,融券负债的规模就越大。3、利率变动带来的成本加大风险如果在从事融资融券交易期间,中国人民银行规定的同期贷款基准利率调高,证券公司将相应调高融资利率或融券费率,投资成本也因为利率的上调而增加,将面临融资融券成本增加的风险。4、通知送达风险在融资融券交易过程中,相关信息的通知送达至关重要。《融资融券合同》中通常会约定通知送达的具体方式、内容和要求。当证券公司按照《融资融券合同》要求履行了通知义务后即视为送达,则若未能关注到通知内容并采取相应措施,就可能因此承担不利后果。5、强制平仓风险融资融券交易中,本计划与证券公司间除了普通交易的委托买卖关系外,还存在着较为复杂的债权债务关系,以及由于债权债务产生的信托关系和担保关系。证券公司为保护自身债权,对本计划信用账户的资产负债情

况实时监控，在一定条件下可以对本计划担保资产执行强制平仓。6、提前了结债务的风险在融资融券交易中，证券公司可能在融资融券合同中与本计划约定提前了结融资融券债务的条款，本计划在从事融资融券交易期间，如果发生融资融券标的证券范围调整、标的证券暂停交易或终止上市等情况，根据本计划与证券公司签订的合同条款，本计划将可能面临被证券公司提前了结融资融券交易的风险，并可能由此给本计划造成损失。7、监管风险在融资融券交易出现异常或市场出现系统性风险时，监管部门、证券交易所和证券公司都将可能对融资融券交易采取相应措施，例如提高可充抵保证金证券的折算率、融资或融券保证金比例、维持担保比例和强制平仓的条件等，以维护市场平稳运行。这些措施将可能给本金带来杠杆效应降低、甚至提前进入追加担保物或强制平仓状态等潜在损失。”

六、修改内容

原合同“附件 1：投资监督事项表：2、投资限制”，新增第（4）项新增条款为：“（4）在开放期内，主动投资于流动性受限资产市值合计不得超过本集合计划资产净值 20%。”

请投资者在本公告附件《〈太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划集合资产管理合同〉第二次变更的征询函的回函》中做出意见表示并邮寄至相应代销机构。

感谢您的支持与配合！



太平洋证券股份有限公司

二〇二〇年七月十五日

附件:《太平洋证券均盈优选 FOF1 号集合资产管理计划集合资产管理合同》

第二次变更的征询函的回函

请投资者根据以上内容作出意见表示:

同意本次合同变更之投资者,请您于“同意”栏签章;不同意合同变更之投资者,请您于“不同意”栏签章。

意见	<u>投资者</u> 签章
同意	
不同意	
时间	2020 年 月 日

投资者姓名/名称

身份证号码/营业执照号

联系电话

投资者所在销售机构

