

太平洋证券掘金纯债 1 号集合资产管理计划

产品发行及业绩报酬计提基准公告

太平洋证券掘金纯债 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）将于 2020 年 5 月 8 日起正式发行，初始募集期为 2020 年 5 月 8 日至 2020 年 5 月 20 日。本集合计划基本信息如下：

代码	E61151
类型	固定收益类
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	中国光大银行股份有限公司北京分行
销售机构	太平洋证券股份有限公司
适合销售对象	根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本集合计划风险等级为 R3 中风险，仅面向风险承受能力评级为 C3、C4、C5 的合格投资者销售。
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，为投资者办理参与业务。 赎回开放日：本集合计划自成立之日起，每年的一月、四月、七月、十月的最后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，为满足以下持有期条件的投资者办理退出业务。对于投资者每笔份额，其持有期须满 90 天（含 90 天）才能在赎回开放日申请退出。对于持有期不满 90 天的份额申请退出的，销售机构或管理人有权拒绝该等份额的退出申请。每笔份额持有期为该笔份额认/申购确认日（对于初始募集期认购的份额从成立日开始算，含当日）至该笔份额退出确认日（不含当日）经过的自然日天数。 本集合计划参与、退出时间为开放日的交易所交易时间，但管理人根据法律法规、中国证监会的规定或本合同约定公告暂停参与、退出时除外。



投资方向、
比例和限制

1、投资方向

(1) 标准化债权类资产：银行存款（包括活期存款和定期存款）、同业存单以及沪深交易所或者银行间市场交易的国债、地方政府债、央行票据、金融债、政策性金融债、企业债、公司债（含非公开发行公司债）、可转换公司债（含可分离交易可转债）、可交换债券、各类债务融资工具（如短期融资券和超短期融资券、中期票据、集合票据、集合债券、非公开定向债务融资工具（PPN）、资产支持票据（ABN）等）、资产支持证券、债券回购以及法律、行政法规或政策许可投资的其他标准化债权类资产。

(2) 公募证券投资基金：公募债券基金、货币市场基金。

(3) 标准化股权类资产：因可转换公司债券转股或可交换债券换股形成的股票。

(4) 标准化衍生品：因分离交易的可转换公司债券产生的权证。

2、投资比例

(1) 投资于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。

(2) 投资于公募证券投资基金（货币基金除外）的比例不高于本集合计划总资产的 20%（不含 20%）。

(3) 因可转换公司债券转股或可交换债券换股形成的股票投资比例不高于本集合计划总资产的 20%。

(4) 因分离交易的可转换公司债券产生的权证投资比例不高于本集合计划总资产的 20%。

(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，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。

(6) 本集合计划总资产占净资产比例不得超过 200%。

(7) 本集合计划每日正回购资金余额或逆回购资金余额不得超过本集合计划上一日净资产的 100%。

(8) 管理人管理的全部资产管理计划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%。

(9) 相关法律法规及中国证监会规定的本集合计划应符合的其他投资比例要求。

3、投资限制

(1) 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。

	(3) 本集合计划不得再投资公募基金以外的其他资管产品。 (4) 本集合计划不直接从二级市场买入股票和权证, 仅投资于因可转换公司债券转股或可交换债券换股形成的股票以及因分离交易的可转换公司债券产生的权证。 (5) 本集合计划仅投资于在上海/深圳证券交易所挂牌和在中国银行间市场交易商协会注册的资产支持证券优先级且该资产支持证券底层资产不得为资产管理产品或其收/受益权。 (6) 相关法律法规及中国证监会规定的本集合计划应符合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 30 万元, 最低追加认购金额为 1 万元。
认/申购、退出费率	认/申购费率: 0%/笔。 退出费率: 0%。
业绩报酬计提基准	6.50%/年 (该业绩报酬计提基准仅为管理人提取业绩报酬的依据, 并不构成管理人向投资者保证其资产本金不受损失或者取得最低收益的承诺)
托管费率	0.02%/年
管理费率	0.60%/年

投资者在认购本集合计划前请仔细阅读《太平洋证券掘金纯债 1 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认购手续。

特此公告。


 太平洋证券股份有限公司
 2020 年 4 月 29 日



