

# 关于《太平洋证券金元宝 19 号集合资产管理计划资产管理合同》

## 第一次变更的份额持有人征询函

尊敬的份额持有人：

为了太平洋证券金元宝 19 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）更好地运作，我司拟对本集合计划合同进行第一次变更。

就本集合计划合同第一次变更事宜，我司作为管理人已与托管人兴业银行股份有限公司达成书面一致并双方签署了《〈太平洋证券金元宝 19 号集合资产管理计划资产管理合同〉之补充协议一》。

一、本次涉及开放日、决策程序、业绩报酬、风险揭示、信息披露等条款变更，变更后条款详见我司网站挂网的《〈太平洋证券金元宝 19 号集合资产管理计划资产管理合同〉之补充协议一》，主要变更条款如下：

（一）《原合同》“第九节、本集合计划的参与、退出与转让”之“（二）本集合计划参与和退出的开放日和时间”中条款

原条款为：“申购开放日：本集合计划自成立之日起，每周二为申购开放日，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 天的当日为赎回开放日，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 2019 年 9 月 3 日成立，则运作满 180 天的当日为 2020 年 2 月 29 日，因该日为非工作日，则顺延至该日最近的工作日 2020 年 3 月 2 日，在此假设条件下本集合计划第一个赎回开放日为 2020 年 3 月 2 日，以此类推。

本集合计划参与、退出时间为开放日的上海、深圳证券交易所交易时间，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。”

变更后条款为：“申购开放日：本集合计划自成立之日起，每周二为申购开



放日，如果遇到该日为非工作日则顺延至其最近的工作日。如果某次申购开放日前后一周内遇到国家法定节假日，管理人有权调整该次申购开放日，具体以管理人公告为准。如非工作日超过 5 天，则管理人有权调整开放参与日，具体以管理人公告为准。

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 天后最近的周二为赎回开放日，如果遇到该日为非工作日则顺延至其最近的工作日。如遇到管理人认为有必要调整赎回开放日情形（比如开放影响现有投资者利益、本集合计划出现流动性风险以及本合同约定的其他情形），管理人有权调整开放退出日，具体日期以管理人公告为准。

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：本集合计划成立日为 2020 年 5 月 12 日成立，假设本次合同变更生效日为 2020 年 11 月 5 日，则运作满 180 天后最近的周二为 2020 年 11 月 10 日，在此假设条件下本集合计划第一个赎回开放日为 2020 年 11 月 10 日，以此类推。

本集合计划参与、退出时间为开放日的上海、深圳证券交易所交易时间，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。”

（二）《原合同》“第二十二节、本集合计划的费用和税收”之“（三）管理费、托管费的计提标准、计提方法及支付方式”之“2、管理费”之“（2）业绩报酬”中条款第 2 条管理费第（2）款”

原条款为：“（2）业绩报酬

业绩报酬计提日为分红确认日、投资者退出确认日或本集合计划终止确认日（即注册登记机构处理清盘或者终止强赎之日）。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业绩报酬计提原则

i 按投资者每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

ii 在投资者退出或本集合计划终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资

金或清算资金中扣除。在本集合计划分红时提取业绩报酬的，业绩报酬从分红款中扣除。

iii 业绩报酬计提频率不得超过每 6 个月一次，但因投资者退出提取业绩报酬的，不受该提取频率限制。

iv 投资者申请退出时，管理人按“先进先出”的原则，即按照投资者份额参与的先后次序进行顺序退出的方式确定退出份额，计算、提取该退出份额对应的业绩报酬。

## ②业绩报酬计算方法

在业绩报酬提取日，如果超额收益 $\geq 0$ ，则：每笔份额应提取的业绩报酬=该笔份额超额收益\*30%

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

对于退出和分红时提取业绩报酬的，该笔份额持有期收益=（本次业绩报酬计提日前一工作日的累计单位净值-上一次业绩报酬计提日前一个工作日的累计单位净值）\*该笔份额数；对于终止时提取业绩报酬的，该笔份额持有期收益=（终止日的累计单位净值-上一次业绩报酬计提日前一个工作日的累计单位净值）\*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\*该笔份额上一个业绩报酬计提日前一个工作日的单位净值；

实际运作天数：每笔份额上一业绩报酬计提日（含当日。如果不存在上一个业绩报酬计提日：对于募集期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从成立日当日开始算；对于存续期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔份额申购确认当日开始算；对于红利转投的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔份额的转投日开始算）到本次业绩报酬计提日（不含当日，无论本次业绩报酬计提日是否提到业绩报酬，均作为下次业绩报酬计提的起始日，但终止时提取业绩报酬的，本次业绩报酬计提日为终止日）间隔的自然日天数；

管理人于本集合计划发行前公告具体的业绩报酬计提基准 K，并且管理人有权以管理人公告方式变更业绩报酬基准 K，但业绩报酬计提基准 K 的调整周期不得短于本集合计划两个开放退出日的间隔时间。业绩报酬计提基准不是管理人向



投资者保证其资产本金不受损失或者保证取得最低收益的承诺，投资者应自行承担投资风险。

### 3、业绩报酬支付

因涉及注册登记数据，业绩报酬由管理人负责计算并复核，由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人依据业绩报酬划付指令于5个工作日内将业绩报酬划拨给管理人。

具体管理费收入账户以管理人书面通知为准。”

**变更后条款为：**“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），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业绩报酬的计提日：分红确认日、投资者退出确认日和本集合计划终止确认日（即注册登记机构办理清盘或者终止强赎之日）。

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对应的业绩报酬计提期间（以下简称“期间”）年化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；终止清算时，所有投资者视同全部赎回）。即以份额持有人单笔份额期间收益为基准，按比例提取，具体提取比例如下：

当份额持有人单笔份额期间年化收益率低于对应期间业绩报酬计提基准（含），管理人不提取业绩报酬；当份额持有人单笔份额期间年化收益率高于对应期间业绩报酬计提基准（不含），管理人提取超额收益的30%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。

对于单个份额持有人，提取业绩报酬的计算公式如下：

$$\text{当 } \frac{\text{NAV}_{e'} - \text{NAV}_{is'}}{\text{NAV}_{is}} > B_i \text{ 时, } H_i = \left( \frac{\text{NAV}_{e'} - \text{NAV}_{is'}}{\text{NAV}_{is}} - B_i \right) \times N_i \times \text{NAV}_{is} \times 30\%;$$

$$\text{其中, } B_i = \sum_{t=1}^n \frac{r_{it}}{365} - \sum_{t=1}^m \frac{r_{it}}{365}, n \geq m;$$

当  $\frac{NAV_e^s - NAV_{is}^s}{NAV_{is}} \leq B_i$  时,  $H_i = 0$ ;

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

其中:

$H$  为该份额持有人本次赎回/分红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/分红对应的第  $i$  笔集合计划份额期间业绩报酬计提基准,  $\sum_{t=1}^n \frac{r_{it}}{365}$  为截至本次业绩报酬计提日的期间业绩报酬计提基准,

$\sum_{t=1}^m \frac{r_{it}}{365}$  为截至上次业绩报酬计提日的期间业绩报酬计提基准;

$r_{it}$  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  $t$  天的业绩报酬计提基准 (年化);

$n-m$  为该份额持有人本次赎回/分红对应的第  $i$  笔集合计划份额本次业绩报酬计提期间运作天数, 即上一个业绩报酬计提日 (含当日, 如果不存在上一个业绩报酬计提日: 对于募集期参与的份额而言, 其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从成立日当日开始算; 对于存续期参与的份额而言, 其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔份额申购确认当日开始算; 对于红利转投的份额而言, 其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔转投份额登记日开始算) 到本次业绩报酬计提日 (不含当日, 无论本次业绩报酬计提日是否提到业绩报酬, 均作为下次业绩报酬计提的起始日) 间隔的自然日天数;

$n$  为该份额持有人本次赎回/分红对应的第  $i$  笔集合计划份额自申购确认日 (对于存续期参与的份额而言) 或者自成立日 (对募集期参与的份额而言) 或者转投份额登记日 (对于红利转投的份额而言) 至本次业绩报酬计提日 (不含当日) 间隔的自然日天数;

$m$  为该份额持有人本次赎回/分红对应的第  $i$  笔集合计划份额自申购确认日 (对于存续期参与的份额而言) 或者自成立日 (对募集期参与的份额而言) 或者转投份额登记日 (对于红利转投的份额而言) 至上次业绩报酬计提日 (不

含当日，如果不存在上一个业绩报酬计提日：对于募集期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从成立日当日开始算；对于存续期参与的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔份额申购确认当日开始算；对于红利转投的份额而言，其第一次业绩报酬计提的实际运作天数从该笔转投份额登记当日开始算）间隔的自然日天数；

$NAV_e^t$ 为本次业绩报酬计提日前一个工作日的份额累计净值；

$NAV_{is}^t$ 为上一个业绩报酬计提日前一个工作日的份额累计净值；

$NAV_{is}$ 为上一个业绩报酬计提日前一个工作日的份额净值；

$N_i$ 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：因涉及注册登记数据，业绩报酬在份额持有人赎回时或本集合计划清算时由管理人负责计算和复核，托管人根据管理人的划款指令进行划款。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，托管人仅根据划付指令于【5】个工作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。

管理人特别声明：业绩报酬计提基准不是预期收益和保证收益率。投资者承认，本合同所提及的业绩报酬计提基准仅是管理人计提业绩报酬的标准，不构成管理人、托管人对本集合计划资产收益状况的任何承诺或担保。在某些情况下，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。”

二、本集合计划说明书及风险揭示书将进行相应变更。

三、现就本集合计划合同第一次变更事宜，管理人征询本集合计划全体份额持有人意见。本次合同变更意见征询截止日为 2020 年 11 月 5 日。为了保障不同意本次合同变更的份额持有人退出本集合计划的权利，管理人安排本集合计划 2020 年 11 月 5 日为临时开放日。如不同意本次合同变更，请您于临时开放日申请全部份额退出本集合计划。如您在截止日前意见答复不同意变更且未在临时开放日申请全部份额退出的，管理人将于临时开放日的下一工作日对您所



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申请全部份额退出的，视为同意本集合计划合同变更。

请您在《关于〈太平洋证券金元宝 19 号集合资产管理计划资产管理合同〉第一次变更的份额持有人征询函之回函》中做出意见表示。

感谢您的支持与配合。

特此公告。



太平洋证券股份有限公司  
二〇二〇年十一月四日



**《关于〈太平洋证券金元宝 19 号集合资产管理计划资产管理合同〉第  
一次变更的份额持有人征询函之回函》**

请份额持有人根据以上内容作出意见表示：

同意合同变更之份额持有人，请于“同意合同变更”栏签字或盖章；不同意合同变更之份额持有人，请于“不同意合同变更”栏签字或盖章；如未反馈且未在临时开放日申请退出的则默认同意。

意见	份额持有人签名/盖章
同意合同变更	
不同意合同变更	
时间	2020 年      月      日

份额持有人姓名/名称：

证件号码：

联系电话：