

## 关于太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划 增加侧袋机制并修改资产管理合同及托管协议的公告

为了更好地满足投资者的理财需求，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的规定和《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“《资产管理合同》”）的约定，管理人太平洋证券股份有限公司（以下简称“本公司”）经与托管人兴业银行股份有限公司协商一致，并向中国证监会备案，本公司决定自2021年2月6日起对太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）增加侧袋机制相关内容，并修改《资产管理合同》，具体包括：在释义、集合计划份额的申购与赎回、集合计划份额持有人大会、集合计划的投资、集合计划资产估值、集合计划费用与税收、集合计划的收益与分配及集合计划的信息披露等章节增加了侧袋条款相关内容。同时管理人根据《中华人民共和国民法典》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法（2020年修订）》对《资产管理合同》涉及《中华人民共和国合同法》、会计师事务所资质要求进行了修订。管理人对《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划托管协议》（以下简称“《托管协议》”）涉及的上述相关内容也进行了相应的修订。根据相关法律法规及《资产管理合同》，本次修改无需召开集合计划份额持有人大会。《资产管理合同》的具体修订内容详见附件。

《资产管理合同》和《托管协议》的修订自公告之日起生效，投资者可访问本公司网站（[www.tpyzq.com](http://www.tpyzq.com)）查阅修订后的《资产管理合同》、《托管协议》。《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划招募说明书》将根据《资产管理合同》、《托管协议》

的内容进行相应修改，并按规定更新。

风险提示：

1、侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向集合计划份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但集合计划启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露集合计划份额净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回并可以办理申购，因此启用侧袋机制时持有集合计划份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，集合计划份额持有人可能因此面临损失。

2、实施侧袋机制期间，因本集合计划不披露侧袋账户份额的净值，即便管理人在集合计划定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，管理人不承担任何保证和承诺的责任。

管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

3、启用侧袋机制后，管理人计算各项投资运作指标和集合计划业绩指标时仅考虑主袋账户资产，并根据相关规定对分割侧袋账户资产导致的集合计划资产减少按投资损失处理，因此本集合计划披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

4、集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，集合计划管理人不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。集合计划的过往业绩及其净值高低并不预示其未来

业绩表现。投资有风险，敬请投资者在投资前认真阅读资产管理合同、招募说明书和产品资料概要等法律文件，全面认识集合计划产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对集合计划投资作出独立决策，选择合适的集合计划产品。敬请投资者在购买集合计划前认真考虑、谨慎决策。

特此公告。

附件：《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》条款修改对照表

太平洋证券股份有限公司

2021年2月6日

**附件：《太平洋证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》条款修改对照表**

修改章节	修改前	修改后
第二部分 前言	<p>2、订立本合同的依据是《中华人民共和国合同法》（以下简称“《合同法》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》和其他有关法律法规。</p>	<p>2、订立本合同的依据是《中华人民共和国民法典》（以下简称“《民法典》”）、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）、《证券投资基金销售管理办法》（以下简称“《销售办法》”）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（以下简称“《流动性风险管理规定》”）、《证券公司大集合资产管理业务适用&lt;关于规范金融机构资产管理业务的指导意见&gt;操作指引》和其他有关法律法规。</p>
第三部分 释义	无	<p>新增两条作为第56条、第57条。相应调整后续条款序号。具体如下：</p> <p>56、侧袋机制：指将集合计划投资组合中的特定资产从原有账户分离至一个专门账户进行处置清算，目的</p>

		<p>在于有效隔离并化解风险，确保投资者得到公平对待，属于流动性风险管理工具。侧袋机制实施期间，原有账户称为主袋账户，专门账户称为侧袋账户</p> <p>57、特定资产：包括：（一）无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性的资产；（二）按摊余成本计量且计提资产减值准备仍导致资产价值存在重大不确定性的资产；（三）其他资产价值存在重大不确定性的资产</p>
第六部分 集合计划份额的申购与赎回	无	<p>新增一条为“第十七条”：十七、实施侧袋机制期间本集合计划的申购与赎回</p> <p>本集合计划实施侧袋机制的，申购和赎回安排详见招募说明书或届时管理人发布的相关公告。</p>
第七部分 资产管理合同当事人及权利义务	二、托管人（一）托管人简况 法定代表人：高建平	<p>二、托管人（一）托管人简况 法定代表人：<u>陶以平（代为履行法定代表人职权）</u></p>
第八部分 集合计划份额持有人大会	无	<p>新增一条为第九条，相应调整后 续序号</p> <p>九、实施侧袋机制期间集合计划份额持有人大会的特殊约定</p> <p>若本集合计划实施侧袋机制，则相关集合计划份额或表决权的比例指主袋份额持有人和侧袋份额持有人分别持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例，但若相关集合计划份额持有人大会召集和审议事项不涉</p>

		<p>及侧袋账户的，则仅指主袋份额持有人持有或代表的集合计划份额或表决权符合该等比例：</p> <p>1、集合计划份额持有人行使提议权、召集权、提名权所需单独或合计代表相关集合计划份额10%以上（含10%）；</p> <p>2、现场开会的到会者在权益登记日代表的集合计划份额不少于本集合计划在权益登记日相关集合计划份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>3、通讯开会的直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额不小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一（含二分之一）；</p> <p>4、在参与集合计划份额持有人大会投票的集合计划份额持有人所持有的集合计划份额小于在权益登记日相关集合计划份额的二分之一、召集人在原公告的集合计划份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内就原定审议事项重新召集的集合计划份额持有人大会应当有代表三分之一以上（含三分之一）相关集合计划份额的持有人参与或授权他人参与集合计划份额持有人大会投票；</p> <p>5、现场开会由出席大会的集合计划份额持有人和代理人所持表决权的50%以上（含50%）选举产生一名集</p>
--	--	--

		<p>合计划份额持有人作为该次集合计划份额持有人大会的主持人；</p> <p>6、一般决议须经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上（含二分之一）通过；</p> <p>7、特别决议应当经参加大会的集合计划份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上（含三分之二）通过。</p> <p>同一主侧袋账户内的每份集合计划份额具有平等的表决权。</p>
第十二部分集合计划的投资	无	<p>新增一条为第八：</p> <p>八、侧袋机制的实施和投资运作安排</p> <p>当本集合计划持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时，根据最大限度保护本集合计划份额持有人利益的原则，管理人经与托管人协商一致，并咨询会计师事务所意见后，可以依照法律法规及本合同的约定启用侧袋机制。</p> <p>侧袋机制实施期间，本部分约定的投资组合比例、投资策略、组合限制、业绩比较基准、风险收益特征等约定仅适用于主袋账户。</p> <p>侧袋账户的实施条件、实施程序、运作安排、投资安排、特定资产的处置变现和支付等对投资者权益有重大影响的事项详见招募说明书的规</p>

		定。
第十四部分 集合计划资产估值	七、暂停估值的情形 3、当前一估值日集合计划资产净值50%以上的资产出现无可参考的活跃市场价格且采用估值技术仍导致公允价值存在重大不确定性时， <del>一经与托管人协商确认后</del> ，管理人应当暂停估值；	七、暂停估值的情形 3、当 <u>特定资产</u> 占前一估值日集合计划资产净值50%以上的，经与托管人协商确认后，管理人应当暂停估值；
	无	新增一条为第十： 十、实施侧袋机制期间的资产估值 本集合计划实施侧袋机制的，应根据本部分的约定对主袋账户资产进行估值并披露主袋账户的集合计划净值信息，暂停披露侧袋账户份额净值。
第十五部分 集合计划费用与税收	无	新增一条为第四，相应调整后续序号： 四、实施侧袋机制期间的集合计划费用 本集合计划实施侧袋机制的，与侧袋账户有关的费用可以从侧袋账户中列支，但应待侧袋账户资产变现后方可列支，有关费用可酌情收取或减免，但不得收取管理费和托管费，详见招募说明书的规定。
第十六部分 集合计划的收益与分配	无	新增一条为第七： 七、实施侧袋机制期间的收益分配 本集合计划实施侧袋机制的，侧



		袋账户不进行收益分配，详见招募说明书的规定。
第十七部分集合计划的会计与审计	<p>二、集合计划的年度审计</p> <p>1、管理人聘请与管理人、托管人相互独立的具有<del>证券、期货</del>相关业务资格的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。</p>	<p>二、集合计划的年度审计</p> <p>1、管理人聘请与管理人、托管人相互独立的符合《中华人民共和国<u>证券法</u>》规定的会计师事务所及其注册会计师对本集合计划的年度财务报表进行审计。</p>
第十八部分集合计划的信息披露	<p>五、公开披露的集合计划信息</p> <p>(五) 集合计划定期报告，包括集合计划年度报告、集合计划中期报告和集合计划季度报告</p> <p>管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成集合计划年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过具有<del>证券、期货</del>相关业务资格的会计师事务所审计。</p>	<p>五、公开披露的集合计划信息</p> <p>(五) 集合计划定期报告，包括集合计划年度报告、集合计划中期报告和集合计划季度报告</p> <p>管理人应当在每年结束之日起三个月内，编制完成集合计划年度报告，将年度报告登载在指定网站上，并将年度报告提示性公告登载在指定报刊上。集合计划年度报告中的财务会计报告应当经过符合《中华人民共和国<u>证券法</u>》规定的会计师事务所审计。</p>
	无	<p>第五、公开披露的集合计划信息</p> <p>新增一条为第（十）实施侧袋机制期间的信息披露</p> <p>本集合计划实施侧袋机制的，相关信息披露义务人应当根据法律法规、本合同和招募说明书的规定进行信息披露，详见招募说明书的规定。</p>
第十九部分合同的变更、终止与集	<p>三、集合计划财产的清算</p> <p>2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、具有<del>证券、期货</del>相关业务资格的注册会计</p>	<p>三、集合计划财产的清算</p> <p>2、集合计划财产清算小组组成：集合计划财产清算小组成员由管</p>

<p>合计划财产的清算</p>	<p>师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p>	<p>理人、托管人、符合《中华人民共和国证券法》规定的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。集合计划财产清算小组可以聘用必要的工作人员。</p>
	<p>六、集合计划财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经托管人进行书面或电子确认复核无误，并经具有证券、期货相关业务资格的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。</p>	<p>六、集合计划财产清算的公告 清算过程中的有关重大事项须及时公告；集合计划财产清算报告经托管人进行书面或电子确认复核无误，并经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。集合计划财产清算公告于集合计划财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由集合计划财产清算小组进行公告，集合计划财产清算小组应当将清算报告登载在指定网站上，并将清算报告提示性公告登载在指定报刊上。</p>
	<p>无</p>	<p>新增一条为第八：  八、实施侧袋机制期间的集合计划清算  本集合计划实施侧袋机制的，若《资产管理合同》终止，主袋账户资产的清算适用本部分的约定，侧袋账户特定资产的处置变现和支付详见招募说明书的规定。</p>
<p>《资产管理合同》内容摘要相应进行调整</p>		