

太平洋证券股份有限公司

关于旗下私募资产管理计划适用中国证监会《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其配套规范性文件的公告

尊敬的投资者：

为贯彻落实中国证监会《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令第203号修订）及其配套规范性文件，太平洋证券股份有限公司旗下私募资产管理计划自2023年3月1日起在以下方面执行相关要求：

一、管理人保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户。

二、管理人及相关从业人员不得利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；不得为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利。

三、资产管理计划以最终投向资产类别确定的资产管理计划所属类别中，取消商品及金融衍生品类别，增加期货和衍生品类别，即投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不低于资产管理计划总资产80%，且期货和衍生品账户权益超过资产管理计划总资产20%。

四、管理人以资产管理计划从事关联交易的，按照法律、行政法规、中国证监会的规定和合同约定，事先取得投资者的同意，事后及时告知投资者和托管人，并向中国证监会相关派出机构报告。

五、封闭式资产管理计划的投资者可以分期缴付参与资金，在资产管理合同中事先约定分期缴付资金的有关安排，并明确相应的违约责任。单个投资者首期缴付金额不得低于合格投资者参与单个资产管理计划的最低投资金额，所有投资者首期缴付金额合计不得少于1000万元。

六、管理人自有资金参与、退出资产管理计划的，提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意。因资产管理计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人依照中国证监会规定及资产管理计划合同的约定及时调整达标。为应对资产管理计划巨额赎回以解决流动性风险，或者中国证监会认可

的其他情形，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出资产管理计划可不受本条款规定的限制，但须及时告知投资者和托管人并向中国证监会相关派出机构报告。

七、单只资产管理计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过其净资产 50%的，该资产管理计划的总资产不得超过其净资产的 120%。资产管理计划投资于国债、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不受前述规定限制。

八、资产管理计划业绩报酬计入管理费。

特此公告。

