

关于《太平洋证券金元宝15号集合资产管理计划资产管理合同》

第二次变更的份额持有人征询函

尊敬的份额持有人：

管理人、托管人双方已签署了《太平洋证券金元宝15号集合资产管理计划资产管理合同》和《太平洋证券金元宝15号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议一》，以下统称“《原合同》”。为使太平洋证券金元宝15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《原合同》进行第二次变更。

一、就本集合计划本次变更事宜，我司已与托管人达成书面一致，本次变更涉及管理人的义务、投资比例、管理人自有资金参与、业绩报酬、利益冲突及关联交易、越权交易的界定等，具体条款详见附表或以我司网站挂网的《太平洋证券金元宝15号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议二》为准。

二、现管理人就本集合计划本次合同变更相关事宜征询全体份额持有人意见。本次合同变更征询意见截止日为2023年3月27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2023年3月27日为临时开放日，您可于当日申请退出本集合计划。

如您/贵机构不同意本次合同变更，请于征询截止日前以书面签署征询函回函的方式做出不同意变更的意思表示或/并在前述临时开放日申请退出本集合计划。您/贵机构同意本次合同变更，请于征询截止日前以书面签署征询函回函的方式做出同意变更的意思表示。

对于书面意见答复不同意变更且逾期未退出的投资者，管理人将于2023年3月28日强制赎回您持有的所有份额（赎回价格为2023年3月27日本集合计划单位净值）。

份额持有人未在征询期内回复意见或回复意见不明确，且未在上述临时开放期内办理退出手续的，视为份额持有人同意本合同变更。

三、本集合计划说明书将同步进行变更，风险揭示书具体内容不变。

四、请您在“关于《太平洋证券金元宝15号集合资产管理计划资产管理合同》变更的份额持有人征询函的回函”中做出意见表示。感谢您的支持与配合。

特此公告。



关于《太平洋证券金元宝15号集合资产管理计划资产管理合同》

第二次变更的份额持有人征询函的回函

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。请您于征询截止日前书面反馈意见。

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

份额持有人姓名（名称）：

证件号码：

联系电话：

客户所在销售机构：

附：合同变更要素对照表

变更事项	变更前	变更后
<p>管理人的义务</p>	<p>(1) 依法办理本集合计划的销售、登记、备案事宜；</p> <p>(2) 按照基金业协会要求报送本集合计划产品运行信息；</p> <p>(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本集合计划财产；</p> <p>(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；</p> <p>(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；</p> <p>(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作本集合计划财产；</p> <p>(7) 建立健全的内部管理制度，保证本集合计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；</p> <p>(8) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作本集合计划财产；</p> <p>(9) 保守商业秘密，不得泄露本集合计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；</p> <p>(10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损本集合计划财产及其他当事人利益的活动；</p> <p>(11) 除规定情形或符合规定条件、本合同约定外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；</p> <p>(12) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；</p> <p>(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p> <p>(14) 根据本合同约定召集本集合计划份额持有人大会，本集合计划不设置份额持有人大会或者份额持有人大会设立日常机构的除外；</p>	<p>(1) 依法办理本集合计划的销售、登记、备案事宜；</p> <p>(2) 按照基金业协会要求报送本集合计划产品运行信息；</p> <p>(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用本集合计划财产；</p> <p>(4) 对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；</p> <p>(5) 制作风险揭示书，向投资者充分揭示相关风险；</p> <p>(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作本集合计划财产；</p> <p>(7) 建立健全的内部管理制度，保证本集合计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；</p> <p>(8) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作本集合计划财产；</p> <p>(9) 保守商业秘密，不得泄露本集合计划的投资计划、投资意向等，依法依规提供信息的除外；</p> <p>(10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损本集合计划财产及其他当事人利益的活动；</p> <p>(11) 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；</p> <p>(12) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；</p> <p>(13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；</p> <p>(14) 根据本合同约定召集本集合计划份额持有人大会，本集合计划不设置份额持有人大会或者份额持有人大会设立日常机构的除外；</p>

	<p>(15) 按照本合同约定计算并向投资者披露本集合计划份额净值；</p> <p>(16) 确定本集合计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和本合同的约定；</p> <p>(17) 如本集合计划投资于非标资产的，管理人需对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；</p> <p>(18) 按照本合同约定负责本集合计划会计核算并编制财务会计报告；</p> <p>(19) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(20) 按照本合同的约定确定收益分配方案，并根据收益分配方案及时向投资者分配收益；</p> <p>(21) 根据法律法规与本合同的规定，编制向投资者披露的本集合计划季度、年度等定期报告，向基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>(22) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；</p> <p>(23) 建立并保存投资者名单；</p> <p>(24) 组织并参加本集合计划财产清算小组，参与本集合计划财产的保管、清算、变现和分配；</p> <p>(25) 按照法律法规和中国证监会的规定，保存本集合计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自本集合计划终止之日起不得少于20年；</p> <p>(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、基金业协会并通知托管人和投资者；</p> <p>(27) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。</p>	<p>(15) 按照本合同约定计算并向投资者披露本集合计划份额净值；</p> <p>(16) 确定本集合计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和本合同的约定；</p> <p>(17) 如本集合计划投资于非标资产的，管理人需对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；</p> <p>(18) 按照本合同约定负责本集合计划会计核算并编制财务会计报告；</p> <p>(19) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；</p> <p>(20) 按照本合同的约定确定收益分配方案，并根据收益分配方案及时向投资者分配收益；</p> <p>(21) 根据法律法规与本合同的规定，编制向投资者披露的本集合计划季度、年度等定期报告，向基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构；</p> <p>(22) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；</p> <p>(23) 建立并保存投资者名单；</p> <p>(24) 组织并参加本集合计划财产清算小组，参与本集合计划财产的保管、清算、变现和分配；</p> <p>(25) 按照法律法规和中国证监会的规定，保存本集合计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自本集合计划终止之日起不得少于20年；</p> <p>(26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关派出机构、基金业协会并通知托管人和投资者；</p> <p>(27) 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。</p> <p>(28) 管理人及相关从业人员不得为本人或他人违规持有金融机构股权提供便利。</p> <p>(29) 法律法规、中国证监会及基金业协会规定的和资产管理合同约定的其他义务。</p>
<p>投资比例</p>	<p>(1) 按照穿透原则合并计算，本集合计划投资于标准化债权类资产的比例不得低于本集合计划总资产的80%（含80%）；</p>	<p>(1) 按照穿透原则合并计算，本集合计划投资于标准化债权类资产的比例不得低于本集合计划总资产的80%（含80%）；</p>

	<p>(2) 按照穿透原则合并计算, 本集合计划投资于标准化股权类资产的投资比例不得高于本集合计划总资产的20% (不含20%);</p> <p>(3) 按照穿透原则合并计算, 本集合计划投资于金融衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的20% (不含20%);</p> <p>(4) 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;</p> <p>(5) 本集合计划总资产占净资产比例不得超过200%;</p> <p>(6) 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%;</p> <p>(7) 管理人管理的全部资产管理计划及公开募集证券投资基金 (以下简称公募基金) 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%。 如法律法规或监管机构以后允许本集合计划投资其他品种, 管理人履行合同变更程序并取得投资者和托管人同意后, 可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p>	<p>(2) 按照穿透原则合并计算, 本集合计划投资于标准化股权类资产的投资比例不得高于本集合计划总资产的20% (不含20%);</p> <p>(3) 按照穿透原则合并计算, 本集合计划投资于金融衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的20% (不含20%);</p> <p>(4) 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;</p> <p>(5) 本集合计划总资产占净资产比例不得超过200%;</p> <p>(6) 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%;</p> <p>(7) 管理人管理的全部资产管理计划及公开募集证券投资基金 (以下简称公募基金) 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%。 如法律法规或监管机构以后允许本集合计划投资其他品种, 管理人履行合同变更程序并取得投资者和托管人同意后, 可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>(8) 本集合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, 本集合计划的总资产不得超过净资产的 120%。本集合计划投资于国债、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。 如法律法规或监管机构以后允许本集合计划投资其他品种, 管理人履行合同变更程序并取得投资者和托管人同意后, 可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p>
<p>管理人自有资金参与</p>	<p>管理人自有资金不参与本集合计划。但管理人附属机构以自有资金参与本集合计划的份额不得超过本集合计划总份额的 50%。</p>	<p>管理人自有资金不参与本集合计划。管理人子公司以自有资金参与本集合计划的份额不得超过本集合计划总份额的 50%。</p>
<p>利益冲突及关联交易</p>	<p>(一) 可能存在利益冲突的情形 本集合计划发生“管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其上述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券或者从事其他重</p>	<p>(一) 可能存在利益冲突的情形 本集合计划发生“管理人将集合计划的资产投资于管理人、托管人及其上述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券或者从事其他关联交</p>

	<p>大关联交易”时，可能发生利益冲突。</p> <p>(二) 利益冲突处理方式</p> <p>投资者在此同意并授权管理人可以将本集合计划的财产投资于管理人、托管人及其上述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，但管理人前述投资行为存在为管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他相关方提供或者变相提供融资的情形除外。</p> <p>管理人在实施前述投资行为以及从事其他重大关联交易前事先得到投资者同意，并有充分证据证明未损害投资和利益，并在投资行为实施过程中按照市场通行的方式和条件参与交易，公平对待本集合计划财产，遵循投资者利益优先原则并防范利益冲突。</p> <p>(三) 利益冲突披露方式、披露内容及披露频率</p> <p>管理人从事关联交易的，应该事后向投资者、托管人及时、全面、客观的在本集合计划年度报告中披露报告期内的关联交易情况，具体内容披露内容包括但不限于交易时间、交易对手方、交易数量，对投资者利益影响情况等。</p> <p>从事重大关联交易的，管理人还应向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易同时向证券交易所报告，并充分证明未损害投资者利益。</p>	<p>易”时，可能发生利益冲突。</p> <p>(二) 利益冲突处理方式</p> <p>管理人以本集合计划的资产从事关联交易的，根据法律法规、中国证监会的规定和合同约定，事先取得投资者的同意，并在投资行为实施过程中按照市场通行的方式和条件参与交易，公平对待本集合计划财产，遵循投资者利益优先原则并防范利益冲突。</p> <p>本集合计划资产除投资于管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券外，管理人不得将其直接或者通过投资其他资产管理计划等间接形式，为本机构、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方提供或者变相提供融资。</p> <p>(三) 利益冲突披露方式、披露内容</p> <p>管理人以集合计划的资产从事关联交易的，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。</p> <p>此外，管理人从事重大关联交易的，应当按照合同约定在本集合计划季度报告和年度报告中进行披露，具体披露内容包括但不限于交易时间、交易对手方、交易数量，对投资者利益影响情况等。</p>
<p>越权交易的界定”之“(三) 托管人对管理人投资运作的监督”中“投资比例”</p>	<p>(1) 本集合计划投资于标准化债权类资产的比例不得低于本集合计划总资产的80% (含80%)；</p> <p>(2) 本集合计划投资于标准化股权类资产的投资比例不得高于本集合计划总资产的20% (不含20%)；</p> <p>(3) 本集合计划投资于金融衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的20% (不含20%)；</p> <p>(4) 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%；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；</p> <p>(5) 本集合计划总资产占净资产比例不得超过200%；</p>	<p>(1) 本集合计划投资于标准化债权类资产的比例不得低于本集合计划总资产的80% (含80%)；</p> <p>(2) 本集合计划投资于标准化股权类资产的投资比例不得高于本集合计划总资产的20% (不含20%)；</p> <p>(3) 本集合计划投资于金融衍生品账户权益不超过本集合计划总资产的20% (不含20%)；</p> <p>(4) 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%；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；</p> <p>(5) 本集合计划总资产占净资产比例不得超过200%；</p>

	<p>(6) 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%;</p>	<p>(6) 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%;</p> <p>(7) 本集合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, 本集合计划的总资产不得超过净资产的120%。本集合计划投资于国债、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。托管人对此项不进行监控。</p>
<p>业绩报酬</p>	<p>业绩报酬计提日为分红日、投资者退出日或本集合计划终止日(含提前或者延期终止)。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。</p> <p>①业绩报酬计提原则</p> <p>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。</p> <p>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。在本集合计划分红日提取业绩报酬的, 业绩报酬从分红款中扣除。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>②业绩报酬计算方法</p> <p>每笔参与份额以上次业绩报酬计提日(如该笔参与份额不存在上次业绩报酬计提日, 则对于募集期参与的份额而言, 其上次业绩报酬计提日为成立日; 对于存续期参与的份额而言, 其上次业绩报酬计提日为其参与申请日。不论上次业绩报酬计提日是否实际提取到业绩报酬, 均作为下次业绩报酬计提的起始日)至本次业绩报酬计提日的持有期年化收益率与业绩报酬计提基准K进行比较, 将超额收益部分的20%作为管理人业绩报酬。其中, 业绩报酬计提基准K=6%/年, 管理人有权以管理人公告方式变更业绩报酬基准K, 但管理人应确保业绩报酬计提基准K的变更频率应该与本集合计划开放期相匹配, 即业绩报</p>	<p>业绩报酬计提日为分红日、投资者退出日或本集合计划终止日(含提前或者延期终止)。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。</p> <p>①业绩报酬计提原则</p> <p>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。</p> <p>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。在本集合计划分红日提取业绩报酬的, 业绩报酬从分红款中扣除。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>②业绩报酬计算方法</p> <p>每笔参与份额以上次业绩报酬计提日(如该笔参与份额不存在上次业绩报酬计提日, 则对于募集期参与的份额而言, 其上次业绩报酬计提日为成立日; 对于存续期参与的份额而言, 其上次业绩报酬计提日为其参与申请日。不论上次业绩报酬计提日是否实际提取到业绩报酬, 均作为下次业绩报酬计提的起始日)至本次业绩报酬计提日的持有期年化收益率与业绩报酬计提基准K进行比较, 将超额收益部分的20%作为管理人业绩报酬。其中, 业绩报酬计提基准K=6%/年, 管理人有权以管理人公告方式变更业绩报酬基准K, 但管理人应确保业绩报酬计提基准K的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K的调</p>

酬计提基准K的调整周期不得短于本集合计划两个开放期的间隔时间。

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

P_1 为本次业绩报酬计提日的本集合计划累计单位净值；

P_0 为上一个业绩报酬计提日的（下一个业绩报酬计提日的起始日）本集合计划累计单位净值；

持有期年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
R<=6%	0	Y=0
R>6%	20%	Y=A×(R-K)×20%×D÷365

P_0^* 为上一个业绩报酬计提日的本集合计划单位净值；

D 表示上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的实际天数；

管理人业绩报酬计提如下：

Y=每笔份额应计提的业绩报酬；

A=每笔份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值=每笔份额*上一个业绩报酬计提日的本集合计划单位净值。

3、业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个工作日内将业绩报酬划拨给管理人。因涉及注册登记数据，托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

管理费收入账户：

户名：太平洋证券股份有限公司

账号：2502011009027306844

开户银行：中国工商银行昆明市南屏支行

整周期不得短于本集合计划两个开放期的间隔时间。

$$R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \times \frac{365}{D} \times 100\%$$

P_1 为本次业绩报酬计提日的本集合计划累计单位净值；

P_0 为上一个业绩报酬计提日的（下一个业绩报酬计提日的起始日）本集合计划累计单位净值；

持有期年化收益率 (R)	计提比例	业绩报酬 (Y) 的计提公式
R<=6%	0	Y=0
R>6%	20%	Y=A×(R-K)×20%×D÷365

P_0^* 为上一个业绩报酬计提日的本集合计划单位净值；

D 表示上一个业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的实际天数；

管理人业绩报酬计提如下：

Y=每笔份额应计提的业绩报酬；

A=每笔份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值=每笔份额*上一个业绩报酬计提日的本集合计划单位净值。

③业绩报酬支付

由管理人向托管人发送业绩报酬划付指令，托管人于5个工作日内将业绩报酬划拨给管理人。因涉及注册登记数据，托管人对业绩报酬的计算不承担复核义务和责任。

管理费收入账户：

户名：太平洋证券股份有限公司

账号：2502011009027306844

开户银行：中国工商银行昆明市南屏支行

④本集合计划业绩报酬计入管理费。

其他

以上仅为本次合同变更要素列示，其他变更内容详见《太平洋证券金元宝15号集合资产管理计划资产管理合同之补充协议二》