

合同编号：jh2023084

《太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》

之补充协议三

投资者：

自然人投资者填写处

姓名：

证件类型：

证件号码：

通讯地址：

联系电话：

非自然人投资者填写处

名称：

住所：

通讯地址：

联系人：

联系电话：

投资者的详细情况在各投资者分别与管理人、托管人签署的电子合同或者纸质合同中列示。

管理人：

名称：太平洋证券股份有限公司

法定代表人或授权代表人：李长伟

注册地址：云南省昆明市北京路 926 号同德广场写字楼 31 楼

联系电话：010-88321593

托管人：

名称：南京银行股份有限公司

法定代表人或授权代表人：胡升荣

注册地址：南京市建邺区江山大街 88 号

联系电话：02124198821



管理人、托管人、投资者就三方签署合同编号 jh2020009 的《太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同》、合同编号 jh2020042 的《〈太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同〉之补充协议一》及合同编号 jh20230061 《〈太平洋证券藏金阁 FOF1 号集合资产管理计划资产管理合同〉之补充协议二》（以下统称为“《原合同》”）相关条款进行修改，各方本着诚实、守信的原则，特签订本补充协议。对《原合同》条款作如下修改：

一、修改内容：《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”

原条款：（二）本集合计划参与和退出的开放日和时间

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。

赎回开放日：本集合计划第一个赎回开放日为成立之日起运作满180天后的最近一个周一，之后自上一个赎回开放日起运作每满90天后的最近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。

举例说明：本集合计划成立日为2020年4月10日成立，则运作满180天后的最近一个周一为2020年10月12日，因此本集合计划第一个赎回开放日为2020年10月12日。自该第一个赎回开放日运作满90天后的最近周一为2021年1月11日，因此本集合计划第二个赎回开放日为2021年1月11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。

修改为：（二）本集合计划参与和退出的开放日和时间

开放参与日：本集合计划在本次合同变更生效日起每周一、周二、周三开放申购，如果遇到非工作日则顺延至当周最近的工作日。

开放退出日：本集合计划自本次合同变更生效之日起每自然月第二个周二为开放退出日，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开放退出日情形（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。

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。

二、 修改内容：《原合同》“第九节、本集合计划的参与、退出与转让”之“（六）参与和退出的费用”中“2、退出费率”

原条款：2、退出费率：

对于投资者持有期少于180天（不含180天）的份额，按1.5%/笔的退出费率收取退出费；对于投资者持有期超过180天（含180天）的份额，不收取退出费。

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。

对于持有期少于180天的每笔份额，其退出费=投资者该笔退出份额数×投资者该笔份额对应的退出申请日的本集合计划份额净值×退出费率

对于持有期超过180天（含180天）的每笔份额，其退出费=0

退出费归管理人所有或者管理人有权根据与销售机构签署的代销协议将退出费归属销售机构。

管理人在不违反法律法规规定和本合同约定的情形下根据市场情况制定本集合计划促销计划，定期或者不定期地开展本集合计划促销活动。在本集合计划促销活动期间，管理人可以适当调低本集合计划退出费率，具体以管理人网站公告为准。

修改为：2、退出费率：

对于投资者持有期少于90天（不含90天）的份额（在业绩报酬计提基准变更所对应的开放赎回日，申请赎回的份额除外），按1%/笔的退出费率收取退出费；对于投资者持有期超过90天（含90天）的份额，不收取退出费。

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。

对于持有期少于90天的每笔份额，其退出费=【投资者该笔退出份额数×投资者该笔份额对应的退出申请日的本集合计划份额净值-业绩报酬（如有）】×退出费率

对于持有期超过90天（含90天）的每笔份额，其退出费=0

退出费归管理人所有。

管理人在不违反法律法规规定和本合同约定的情形下根据市场情况制定本集合计划促销计划，定期或者不定期地开展本集合计划促销活动。在本集合计划促销活动期间，管理人可以适当调低本集合计划退出费率，具体以管理人网站公告为准。

本合同约定的参与费率和退出费率自本次合同变更生效之日起执行，不对本次合同变更生效之前已收取的参与费和退出费追溯调整。

### 三、 修改内容：《原合同》“第二十一节、本集合计划财产的估值和会计核算”之“（四）估值方法”

#### 原条款：（四）估值方法

除管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外，本集合计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法，并以签署托管协议补充协议的方法确定有关内容。

#### 1、股票估值方法

（1）上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

#### （2）未上市股票的估值

①首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；

②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；

（3）首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；

（4）非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按以下方法估值：

①、估值日在证券交易所上市的同一只股票的收盘价格低于获得非公开发行股票的成本时，采用市价法；

②、估值日在证券交易所上市的同一只股票的收盘价格高于获得非公开发行股票的成本时，可按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D-D1) \div D$$

其中：FV为估值日该非公开发行股票的价值；C为取得该非公开发行股票的成本；P为估值日在证券交易所上市的同一只股票的收盘价；D为该非公开发行股票的锁定期所含的交易天数；D1为估值日至锁定期结束所包含的交易天数（不包含估值日当天）。

(5) 在任何情况下，管理人如采用本项第（1）—（4）小项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果管理人认为按本项第（1）—（4）小项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况，并与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

## 2、固定收益品种估值方法

(1) 在证券交易所市场挂牌交易实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素或参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(2) 在证券交易所市场挂牌交易未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘价减去所含的债券应收利息得到的净价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素或参考监管机构或行业协会的估值意见，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(3) 首次发行未上市债券采用估值技术确定的公允价值进行估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值；

(4) 交易所的资产支持证券，采用第三方提供的估值数据确定公允价值。第三方未提供估值价格的情况下，按成本进行后续计量；

(5) 在对银行间市场的固定收益品种按照第三方提供的估值数据确定公允价值。在第三方未提供估值价格的情况下，按成本估值；

(6) 只在上交所固定收益平台和深交所综合协议平台挂牌交易的债券按第三方提供的估值数据确定公允价值。在第三方未提供估值价格的情况下，按成本估值；

(7) 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

以上条款约定的“第三方”指中央国债登记结算有限责任公司。但管理人可以根据具体情况并在与托管人商定后，在符合监管规定且不损害委托人利益的前提下，选择其他监管认可的第三方机构。

在任何情况下，管理人如采用本项第(1) — (7)小项规定的方法对本集合计划资产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果管理人认为按本项第(1) — (7)小项规定的方法对本集合计划资产进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上形成的债券估值，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

### 3、私募资产管理产品估值方法

(1) 按份额净值计价的投资标的，按照投资标的的管理人、管理人委托的服务机构或托管人提供的估值日份额净值估值，如投资标的的管理人、管理人委托的服务机构或托管人未提供份额净值依据，则按成本估值；

(2) 投资标的的管理人、管理人委托的服务机构或托管人能够提供固定收益率的投资标的，按成本列示，并每日加计应收利息（或应计收益）进行估值；

(3) 按面值及每万份收益计价的投资标的，以成本列示，按投资标的的管理人、管理人委托的服务机构或托管人每日公布的最新每万份收益计提收益。

### 4、公募证券投资基金估值方法

(1) 持有的交易所基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)等)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；

(2) 持有的场外基金（包括托管在场外的上市开放式基金（LOF）），按估值日的基金份额净值估值；估值日基金份额净值无公布的，按此前最近交易日的基金份额净值估值；

(3) 持有的货币市场基金，按估值日基金管理公司公布的每万份收益计算；

5、银行定期存款或通知存款估值方法，银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。对利率变化后的账务进行调整，不追溯之前已计提的金额和账务。

#### 6、股指期货

股指期货以估值日金融期货交易所的结算价估值，该日无交易的，以最近一日的当日结算价计算。

7、以上估值技术和第三方估值机构原则上为中债估值。在任何情况下，管理人如采用以上规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。如果有确凿证据表明按上述估值方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可以根据具体情况与托管人商定后，按最能反应公允价值的价格估值。

8、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值；如管理人或托管人发现本集合计划估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。根据有关法律法规，本集合计划估值和会计核算的责任方由管理人承担，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对本集合计划计算的估值结果对外予以公布。

#### 修改为：（四）估值方法

除管理人在资产购入时特别标注并给托管人正式书面通知及另有规定外，本集合计划购入的资产均默认按《企业会计准则》等法律、法规进行核算与估值。如相关法律、法规发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法，并以双方认可的方式确定有关内容。

#### 1、固定收益品种估值方法

(1) 交易所上市交易或挂牌转让的不含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的估值全价进行估值。

(2) 交易所上市交易或挂牌转让的含权固定收益品种，选取估值日第三方估值机构提供的相应品种当日的唯一估值全价或推荐估值全价进行估值；行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(3) 交易所市场上市交易的公开发行的可转换债券等有活跃市场的含转股权的债券，实行全价交易的债券选取估值日收盘价作为估值全价；实行净价交易的债券选取估值日收盘价并加计每百元税前应计利息作为估值全价。

(4) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的数据估值。

(5) 全国银行间市场上不含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种估值日当日的估值全价估值；银行间市场上含权的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的相应品种估值日当日的唯一估值全价或推荐估值全价估值。含投资人回售权的固定收益品种，行使回售权的，在回售登记日至实际收款日期间选取第三方估值机构提供的相应品种的唯一估值全价或推荐估值全价，回售登记期截止日（含当日）后未行使回售权的按照长待偿期所对应的价格进行估值。

(6) 全国银行间市场未上市的固定收益品种，按照第三方估值机构提供的数据估值。

## 2、股票估值方法

(1) 上市流通股按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的或者证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

### (2) 未上市股票的估值

①首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；



②送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值；

(3) 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一股票的收盘价进行估值；

(4) 流通受限股票采用第三方估值机构依据《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发[2017]6号）确定的模型进行估值；

(5) 在任何情况下，管理人如采用本项第（1）—（4）小项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果管理人认为按本项第（1）—（4）小项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况，并与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

### 3、公募证券投资基金估值方法

(1) 持有的交易所基金(上市开放式基金(LOF)除外)，按估值日其所在证券交易所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值；如果估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，将参考监管机构或行业协会有关规定或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值；持有的交易所上市开放式基金(LOF)，按能取得的最新份额净值估值。

投资于交易所交易型开放式指数基金(ETF)、上市开放式基金(LOF)、上市的其他开放式基金等提供二级市场交易方式和一级市场份额申购赎回方式的标的基金时，应考虑投资份额的计划退出方式对估值价选取的影响。

(2) 持有的场外基金，按能取得的最新份额净值估值。

(3) 持有的货币市场基金，按前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份收益计提估值日基金收益。但持有的上市交易型货币市场基金，如所投资基金披露份额净值，则按所投资基金估值日的份额净值估值；如所投资基金披露万份(百份)收益，则按所投资基金前一估值日后至估值日期间(含节假日)的万份(百份)收益计提估值日基金收益。

(4) 以所投资基金的基金份额净值估值的，若所投资基金与本计划频率一致但未公布估值日基金份额净值；按其最近公布的基金份额净值/每万份收益为基础估值/计提收益。

#### 4、私募资产管理产品（含私募基金）的估值方法

(1) 私募资管产品管理人提供虚拟份额净值的（指按照产品业绩报酬计算方法预提业绩报酬后的份额净值），优先使用管理人提供的估值日虚拟份额净值进行估值，估值日管理人未提供虚拟份额净值的，按照最新的虚拟份额净值进行估值。

(2) 管理人不能提供虚拟份额净值的，按照管理人提供的估值日份额净值估值；估值日管理人未提供份额净值的，按照最新的份额净值进行估值。

#### 5、期货合约估值方法

期货合约以估值基准日金融期货交易所的结算价估值，该日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，以最近交易日的当日结算价估值。

#### 6、期权估值方法

交易所上市交易的期权，估值基准日有结算价的，按照估值基准日结算价估值，估值基准日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按照最近交易日的结算价估值。如果最近交易日后经济环境发生重大变化的，采用估值技术（期权定价公式）确定公允价值。

7、银行定期存款或通知存款估值方法，银行定期存款或通知存款以本金列示，按协议或合同利率逐日确认利息收入。如提前支取或利率发生变化，将及时进行账务调整。对利率变化后的账务进行调整，不追溯之前已计提的金额和账务。

8、持有的回购以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

9、在任何情况下，管理人如采用以上规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。如果有确凿证据表明按上述估值方法进行估值不能客观反映其公允价值的，管理人可以根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。管理人应在不迟于新的估值方法实施日在管理人网站或指定销售网点通告投资者。

10、相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

如管理人或托管人发现本集合计划估值违反本合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护份额持有人利益时，应立即通知对方，共同查明原因，双方协商解决。

根据有关法律法规，本集合计划资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合计划的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合计划有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照管理人对本集合计划资产净值的计算结果对外予以公布。

#### 四、 本补充协议效力

自本补充协议生效之日起，本补充协议是《原合同》的有效组成部分，与《原合同》具有同等法律效力，并与《原合同》一起构成变更后的新合同文本。《原合同》与本补充协议不一致的，以本补充协议为准；本补充协议未予变更的条款，仍按《原合同》约定执行。

#### 五、 本补充协议的签署和成立

本补充协议应先加盖管理人、托管人公章或合同专用章及双方法定代表人/负责人或授权代表/授权代理人名章（或签字）。如加盖授权代表/授权代理人名章（或签字），需要提供双方法定代表人/负责人的授权书。对于采用纸质合同形式的，投资者应在管理人和托管人已盖章的纸质合同书上手写签名/盖章（如投资者是自然人的，则应由本人签字；如投资者是非自然人则应加盖公章或经有效授权的合同专用章及法定代表人签字/盖章）；对于采用电子合同形式的，投资者应以电子签名方式签署与管理人、托管人已盖章的纸质合同书保持一致的电子合同。本补充协议经管理人、托管人及投资者三方签署后即告成立。

但对于截至本次合同变更生效日继续存续的本集合计划的投资者，无需就本次合同变更签署变更后的新合同文本；本次合同变更生效日（含当日）之后，对本次合同变更生效日（含）起参与本集合计划的投资者而言，应签署包含《原合同》和本补充协议在内的合同文本。

#### 六、 本补充协议的生效

1、对截至本次合同变更生效日继续存续的投资者（以下简称“存续投资者”）而言，本补充协议自管理人完成本次合同变更程序后生效，具体生效时间以管理

人网站挂网的合同变更生效公告载明的生效日为准,但本次合同变更生效日前发生的行为应适用《原合同》。管理人应及时将本次合同变更生效时间通知托管人并将变更公告发送给托管人。本补充协议自本次合同变更生效日起,对存续投资者具有法律效力。

2、对本次合同变更生效日(含)起参与本集合计划的投资者而言,其签署本补充协议生效条件为:

(1) 该投资者、管理人、托管人三方签署本补充协议并成立;

(2) 该投资者认购或者参与申请经注册登记机构确认成功之日起生效;

本补充协议自生效之日起对投资者、管理人、托管人具有同等的法律约束力。

## 七、 其他

本补充协议纸质正本一式肆份,管理人、托管人各执贰份,每份具有同等法律效力。

(以下无正文)

(本页无正文，为《〈太平洋证券藏金阁FOF1号集合资产管理计划资产管理合同〉之补充协议三》签署页)

投资者签字/盖章：

管理人：太平洋证券股份有限公司



法定代表人或授权代表（签字或盖章）：



托管人：南京银行股份有限公司



法定代表人或授权代表（签字或盖章）：



2021.12.

日期：2021年12月31日