

关于《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理合同》

第六次合同变更份额持有人征询函

尊敬的投资者：

为使太平洋证券金元宝 10 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《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理合同》（二〇一九年八月第三次修订版）、《〈太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划资产管理合同（二〇一九年八月第三次修订版）〉之补充协议一》和《〈太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划资产管理合同（二〇一九年八月第三次修订版）〉之补充协议二》（以下并称“《原合同》”）（以下并称“《原合同》”）进行变更。

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，本次主要变更事项涉及投资目标、投资范围、投资比例、投资限制、投资禁止、投资策略、开放规则、自有资金参与、管理费、业绩报酬、利益冲突及关联交易、估值条款、风险揭示等，关键条款变更见本函件附表或全部条款以我司网站挂网的合同编号为 jh2024010《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划资产管理合同》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【2024 年 5 月 6 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【2024 年 5 月 6 日】为特别开放日，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/并在前述特别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【2024 年 5 月 7 日】强制赎回您持有的所有份额（赎回价格为【2024 年 5 月 6 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，且未在上述特别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、本集合计划说明书和风险揭示书将同步进行变更。



四、请您在“关于《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理合同》第六次合同变更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 10 号集合资产管理合同》

第六次合同变更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。如您同意本次合同变更，请您于征询截止日前书面回复同意。份额持有人未在征询期内回复意见或回复意见不明确，且未在特别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。

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：

证件号码：

联系电话：

客户所在销售机构：

附表：关键条款变更前后对照表

变更事项	变更前	变更后
<p>投资目标、投资范围、投资比例、投资限制、投资禁止</p>	<p>(一) 投资目标</p> <p>本集合计划主要通过投资于债券、股票及其它多种资产类别，积极寻求各类具备确定性收益特征的投资机会，争取为委托人创造持续稳定回报。</p> <p>(二) 集合资产管理计划的投资范围为中国证监会允许集合计划投资的金融产品。具体为：</p> <p>(1) 标准化债权类资产，包括银行存款（含同业存款）以及沪深交易所或者银行间市场交易的国债、金融债（包括政策性金融债）、企业债、公司债、可转债、可交换债券、短期融资券、债券逆回购、中央银行票据、政府债券以及法律法规允许的其他标准化债权类资产；</p> <p>(2) 标准化权益类资产，包括沪深交易所交易的股票（包括新股申购）；</p> <p>(3) 公募证券投资基金（包括交易所场内交易的基金以及场外交易的基金，分级基金和平层基金，货币型、债券型、股票型以及混合型等各类型基金）；</p> <p>(4) 债券正回购。</p> <p>(三) 投资比例</p> <p>(1) 标准化债权类资产比例不得低于本集合计划总资产 80%（含 80%）；</p> <p>(2) 标准化权益类资产比例低于本集合计划总资产 20%（不含 20%）；</p> <p>(3) 公募证券投资基金的比例不得超过本集合计划总资产的 20%（不含 20%）；</p> <p>(4) 本集合计划总资产占净资产比例不得超过 200%。</p> <p>(四) 预警和平仓线</p> <p>(1) 预警线：本集合计划成立后，任意一个交易日单位净值跌破 0.95 元，即触发预警线，自触发预警线 5 个工作日内调整，使得本集合计划权益类资产占资产净值的比例不超过 10%；</p> <p>(2) 平仓线：本集合计划成立后，任意一个交易日单位净值跌破 0.9 元，即触发平仓线，本集合计划将强行平仓并提前终止清算。预警线、平仓线由管理人负责监控，托管人</p>	<p>(一) 投资目标</p> <p>本集合计划在控制投资风险的基础上，通过多元化投资各类资产和策略，以及动态管理方法平滑业绩波动，力争实现投资资产的稳健增值。</p> <p>(二) 投资范围</p> <p>本集合计划投资于标准化资产，具体如下：</p> <p>(1) 标准化债权类资产：在证券交易所或银行间市场交易的标准化债权类资产，包括但不限于国债、地方政府债券、央行票据、金融债（含次级债、二级资本债、混合资本债、政策性金融债、资本补充债、TLAC 非资本债券）、企业债、公司债（含非公开发行的公司债）、项目收益债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、永续债、可转换债券、可交换债券（含非公开发行的可交换债券）、可分离交易可转债、资产支持证券（仅限于沪深交易所挂牌且不得为劣后级，底层不得为资管产品及其收/受益权）、非公开定向债务融资工具、资产支持票据（ABN）等非金融企业债务融资工具、债券逆回购、银行存款（包括但不限于定期存款、活期存款等）、同业存单、公开募集债券型投资基金（含 QDII 基金）、货币型基金及法律法规或中国证监会允许本集合计划投资的其他固定收益类金融工具；</p> <p>(2) 标准化股权类资产：国内依法发行或上市的股票（包括但不限于上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、全国中小企业股份转让系统以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、港股通标的股票、优先股等中国证监会认可的其他股权类资产；</p> <p>(3) 公开募集证券投资基金（以下简称公募基金）以及中国证监会认可的比照公募基金管理的资产管理产品（前述金融产品以下并称公募资管产品）：股票型基金、混合型基金、指数型基金、商品型基金、QDII 基金（除债券型）、公募 REITS 及其他由中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，其他受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的公募资产管理产品；</p> <p>(4) 公募资管产品以外的其他受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品（即私募资管产品）：银行及其理财子公司发行的私</p>

<p>仅配合进行账务处理。</p> <p>法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，管理人在履行本合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p> <p>如因证券市场波动、证券发行人合并、集合资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定投资比例或者本合同约定的投资比例（包括投资限制中有关约定比例）的，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者回复交易的15个交易日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，管理人应当及时向证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。</p> <p>（五）投资限制</p> <p>为维护集合计划委托人的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>（1）本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，申报的金额不得超过本集合计划的总资产，申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。</p> <p>（2）本集合计划参与质押式回购与买断式回购最长期限均不得超过365天。</p> <p>（3）本集合资产管理计划投资于同一资产的资金，不得超过该计划资产净值的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；（托管人对“同一资产”按照“同一债券，同一股票，单只基金”来监控）</p> <p>（4）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；（托管人对此不予以监控）</p> <p>（5）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100%；</p> <p>（6）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%。（托管人对此不予以监控）</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</p>	<p>募理财产品，信托公司发行的信托计划，证券公司及其子公司、基金公司及其子公司、期货公司及其子公司发行的私募资产管理计划，保险公司及其子公司发行的私募资产管理产品，在中国证券投资基金业协会官方网站公示已登记的私募证券投资基金管理人发行的私募基金以及其他国务院金融监督管理机构依法核准或注册的私募资产管理产品；</p> <p>（5）期货和衍生品类资产：证券期货交易所等国务院同意设立的交易场所集中交易清算的股指期货、股指期权、国债期货等场内标准化期货合约和标准化期权合约；</p> <p>（6）债券正回购。</p> <p>管理人在进行港股通、优先股、期权交易等投资前，需提前与托管人进行沟通，确认投资清算流程及核算规则，并待双方确认各方面条件成熟后，方可投资。</p> <p>投资于本合同约定投向外的其他法律法规或中国证监会允许本集合计划投资的品种，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本集合计划的投资范围。</p> <p>（三）投资比例</p> <p>（1）大类资产配置比例</p> <p>穿透合并计算原则下，本集合计划投资于标准化债权类资产的比例，合计不得低于本集合计划总资产的80%；</p> <p>（2）总资产占净资产比例</p> <p>穿透合并计算原则下，本集合计划总资产占净资产比例不得超过200%；</p> <p>（3）组合投资比例</p> <p>（a）穿透合并计算原则下，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>（b）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>（c）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、</p>
--	---

<p>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督。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制，履行合同变更程序后，本集合计划可相应调整投资组合限制的规定。</p> <p>管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责，托管人不承担由此造成的损失。</p> <p>（六）禁止行为</p> <p>本集合计划的禁止行为包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途； 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资； 3、向客户做出保证其资产本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺； 4、挪用集合计划资产； 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营； 6、募集资金超过计划说明书约定的规模； 7、接受单一客户参与资金低于中国证监会规定的最低限额； 8、使用集合计划资产进行不必要的交易； 9、内幕交易、利益输送、操纵证券价格、不正当关联交易及其他违反公平交易规定的行为； 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。 	<p>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；</p> <p>（d）管理人管理的全部资产管理计划及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%。</p> <p>（四）投资限制</p> <p>为维护集合计划投资者的合法权益，本集合计划的投资限制为：</p> <p>（1）本集合计划参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券发行申购时，原则上申报的金额不得超过本集合计划的总资产，原则上申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量；</p> <p>（2）本集合计划投资的资产支持证券，其底层资产不得为资产管理产品及其收（受）益权，或者其不得存在规避监管要求的情形；</p> <p>（3）本集合计划投资的资产管理产品应满足如下限制：</p> <ol style="list-style-type: none"> ①不得投向未经金融机构（商业银行、证券公司）托管或保管的资产管理产品； ②不得投资合伙企业份额； ③所投资的资产管理产品投向全部为标准化资产； ④所投资的资产管理产品不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品； ⑤如投资信托计划，该信托计划资金主要投向证券类投资标的，且不得用于借贷活动以及不符合“投资”本质的经营活动，不得设计委托贷款和信托贷款； ⑥不得投资于管理人发行的资产管理产品； <p>（4）本集合计划参与质押式回购与买断式回购最长期限均不得超过 365 天；</p> <p>（5）法律、行政法规规定和本合同约定限制从事的其他投资。</p> <p>（五）投资禁止</p> <p>本集合计划的禁止行为包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> （1）从事或者变相从事信贷业务，或者直接投向信贷资产，中国证监会、基金业协会另有规定的除外； （2）通过委托贷款、信托贷款等方式从事经营性民间借贷活动； （3）通过设置无条件刚性回购安排变相从事借贷活动，产品投资收益不与投资标的的经营业绩或者收益挂钩；
---	---

		<p>(4) 投向保理资产、融资租赁资产、典当资产等与资产管理相冲突的资产及其收（受）益权，以及投向从事前述业务的公司的股权；</p> <p>(5) 投向国家禁止或者限制投资的项目，不符合国家产业政策、环境保护政策、土地管理政策的项目；</p> <p>(6) 通过地方金融资产交易所等平台，投资不符合要求的非标准化债权资产；</p> <p>(7) 开展借贷、担保、明股实债等投资活动，中国证监会、基金业协会另有规定的除外；</p> <p>(8) 通过投资公司、合伙企业、资产管理产品等方式间接从事或者变相从事本款第（1）项至第（7）项规定的活动；</p> <p>(9) 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>(10) 法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。</p> <p>管理人应对本条的“投资限制及投资禁止行为”进行监控，如管理人未能完全履行义务，则应承担因此给投资者和本集合计划财产造成的损失。</p>
<p>投资策略</p>	<p>1、精选信用债 管理人从行业、公司经营风险、公司财务风险以及增信情况研判信用债券的内部信用评级，在此基础上，结合信用与收益率的关系来精选信用债券。</p> <p>2、公募基金投资策略 通过历史分红回报率及净值波动增长精选优质公募基金；考察折价率、剩余期限、到期年化收益率、分红回报率及投资能力，把握阶段性投资机会和套利机会。</p> <p>3、可转债投资策略 综合考虑票息收益、转股溢价率、纯债溢价率、隐含波动率、绝对价格等指标，在具有较强债性保护时捕捉低风险投资机会。</p> <p>4、股票投资策略 当股票市场出现收益率较为确定的投资机会时，捕捉低风险投资机会。（包括但不限于要约收购套利，确定性事件驱动、新股申购等）。</p>	<p>1、决策依据</p> <p>(1) 本集合计划投资将严格遵守《管理办法》《运作规定》等法律法规规定以及本合同和计划说明书的约定；</p> <p>(2) 本集合计划投资决策以宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势为基础；</p> <p>(3) 在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是维护本集合计划投资者利益的重要保障。</p> <p>2、决策程序 管理人资产管理业务实行投资决策委员会领导下的投资经理负责制。管理人资产管理总部下设的研究部为资产管理业务提供投资基础研究。本集合计划投资经理对本集合计划的日常运作和管理承担首要责任。投资决策委员会是资产管理业务投资管理的决策机构，负责在管理人经营管理层的授权范围内对资产管理业务重大事项集体审议决策，投资决策委员会成员须经管理人总经理办公会审议。</p> <p>3、投资管理的标准和方法</p> <p>(1) 资产配置策略 本集合计划主要资产投资于固定收益类金融工具，并在严格控制风险的基础上，通过对全球经济形势、中国经济发展（包括宏观经济运行周期、</p>

		<p>财政及货币政策、资金供需情况)、证券市场估值水平等的研判,动态调整本集合计划各类资产的投资比例,力争获取稳健回报。</p> <p>(2) 标准化债权类资产投资策略</p> <p>本集合计划将在综合分析宏观经济形势、货币政策走向以及债券市场供求关系的基础上,主动判断市场利率的变化趋势,确定并动态调整组合资产的平均剩余期限,确定组合中标准化债权类资产的合理配置。</p> <p>①利率预期策略</p> <p>通过分析未来市场利率的走势,对组合的期限和品种进行合理配置,将利率变化对于债券组合的影响控制在一定范围之内。在预期利率进入上升周期时,减小债券组合的剩余期限或增加浮动利率债券配置,反之则增加债券组合的剩余期限或减少浮动利率债券的配置。</p> <p>②收益率曲线策略</p> <p>收益率曲线的形状随时间而变化,不同到期期限的债券的相关变化造成收益率曲线的变动。运用统计和数量分析技术,预测收益率曲线的变化方式,优化债券投资组合,力争实现较高投资收益。</p> <p>③债券选择策略</p> <p>在单个债券选择方面,主要从收益率、流动性、信用风险、剩余期限、税收等方面进行综合分析,选择经信用风险调整后收益率较高的个券、收益率相同情况下流动性较高的个券以及具有税收优势、投资价值较高的债券品种构建投资组合,并定期进行动态调整。</p> <p>对于国债、央行票据、金融债等品种,主要根据对宏观经济形势和政策环境的分析,预测未来利率走势,综合考虑流动性因素决定投资品种。</p> <p>对于信用类债券(公司债、企业债、短期融资券、可分离交易可转债等),重点分析发行人的行业发展前景、市场地位、财务状况、债务结构、资产质量、盈利状况、现金流状况,判断其财务风险;分析募集资金投向对发行人未来的财务状况、债券风险等方面的影响,以及项目实施可能出现的风险;有担保的债券,对担保人或担保物的风险进行评估。在上述分析基础上,对债券品种的信用风险进行综合评估,选择信用状况良好、市场低估的债券进行投资。</p> <p>(3) 现金管理类资产投资策略</p> <p>本集合计划以严谨的市场价值分析为基础,采用稳健的投资组合策略,通过对现金管理类金融品</p>
--	--	---

		<p>种的组合操作,在保持资产流动性的同时,追求稳定的当期收益。通过合理有效分配本集合计划的现金流,保持投资组合的流动性,满足本集合计划投资运作的要求。</p> <p>(4) 新券申购策略 对于新发行的证券品种,管理人将凭借其资产管理经验以及新券定价能力,可在询价与配售过程中把握主动、发挥优势。</p> <p>(5) 公募基金投资策略 本集合计划坚持从研究基金价值入手,采用定性分析的方法,选择管理规范、业绩优良的基金管理公司管理的基金构建备选基金池,对基金的投资理念和投资价值进行判断。</p> <p>(6) 私募资产管理产品投资策略 ①本集合计划的管理人本着专业、科学、严谨的态度做好集合计划的“研、投、管、退”四个环节。严格遵循力争为投资者提供稳健收益为目标的原则,通过详细、谨慎的考察研究,投资于优秀的金融产品。 ②管理人将对金融产品进行综合测评,筛选出投资业绩稳定、团队投研功底深厚、内部管理条例完善的金融产品管理公司(包括证券投资私募基金、基金公司及基金子公司、券商、期货公司等)设立的金融产品。管理人将综合考虑投资回报与风险,合理配置不同风格的金融产品。</p> <p>(7) 股票投资策略 自上而下考察行业在产业链上的位置、行业发展趋势、行业景气程度、行业内竞争格局等因素,规避周期在高位或者行业景气度向下的行业;筛选出行业中财务健康、获利能力强、核心竞争优势明显、成长性高、公司治理完善的公司,结合估值情况选择性价比较高的个股,结合行业配置计划精选个股构建股票投资组合。</p> <p>(8) 投资股指期货、国债期货特别约定 ①股指期货、国债期货的投资目的 本集合计划配置股指期货、国债期货的目的是 a、投机: 预判宏观经济形势和市场情绪,择时增加指数类仓位,增加组合弹性; b、套期保值: 对于现有组合仓位进行部分对冲,降低组合风险暴露。 ②股指期货、国债期货投资策略 a、投机策略 投机交易以趋势交易为主,通过预判宏观经济走势和市场情绪确定股指期货、国债期货的趋势方</p>
--	--	---

		<p>向和买卖时机,在上升趋势中适当持有净多头合约,在下降趋势中适当持有净空头合约,在对以投机为目的参与股指期货、国债期货交易的风险敞口、保证金比例以及止损标准进行严格控制的前提下,进行趋势交易。</p> <p>b、套期保值策略</p> <p>套期保值对象是持有股票等权益类现货组合,套期保值工具为中国金融期货交易所上市交易的股指期货合约。通过对现有组合仓位进行部分对冲,降低组合风险暴露。</p> <p>③股指期货、国债期货的风险控制以及责任承担</p> <p>a、流动性风险控制及应急处理机制</p> <p>期货投资的流动性风险主要包括持仓组合变现的流动性风险以及资金流动性风险。</p> <p>持仓的流动性风险通过如下措施进行管理:参与交易时主要选择成交活跃、流动性好的合约作为标的;突发情况导致市场流动性严重不足,制定应急措施和处理方案。</p> <p>资金流动性风险通过如下风险指标与措施进行管理:日常保证金头寸管理与资金调度、划款由专人负责,并设置风险监控指标;建立特殊事件应急处理机制。其中,期货保证金的流动性应急处理机制为:按照与托管行、期货公司签署的期货投资备忘录中保证金风控要求,如果触发风控,则由投资经理将本集合计划中的现金或者其他资产变现后,划至期货保证金账户,补充保证金,以满足该风险度要求。补充保证金操作导致的损失由本集合计划资产承担。</p> <p>b、强制平仓或者爆仓风险控制</p> <p>实时监控风险指标,确保预留保证金能应对市场大部分情况下的波动。当市场持续出现极端不利行情时,投资经理根据市场情况提前平掉部分或全部仓位,或者通过调整其他持仓增加预留保证金,避免出现期货爆仓等不利情形。</p> <p>当期货价格波动导致爆仓或者强行平仓,属于正常的市场风险,由本集合计划资产承担净值损失;系统故障导致期货爆仓或者被强行平仓,由系统供应商承担责任。</p> <p>c、信用风险控制</p> <p>在出现重大突发事件可能导致期货交易信用风险时,投资经理适当调整投资策略,采取及时平仓或者其他必要措施尽力规避信用风险。</p> <p>期货交易过程中如出现信用风险时,由过错方承担相应责任。</p>
--	--	--

		<p>d、结算风险控制</p> <p>本集合计划将选择具有期货经纪业务资格且风险管控能力强的期货公司进行证券交易,并定期了解所选机构的信用和合规状况,尽可能降低本集合计划承担的结算风险。</p> <p>当期货公司由于违规经营或者风险管控不力导致期货交易出现结算风险并造成损失时,由相关期货公司承担责任。</p>
<p>参与、退出与转让(含自有资金参与条款)</p>	<p>(一) 集合计划的参与</p> <p>1、参与的办理时间</p> <p>(1) 募集期参与</p> <p>本集合计划募集期指集合计划接受委托人认购参与至集合计划认购截止日,本集合计划募集期最长不超过60日。</p> <p>在募集期内,投资者在销售机构的工作日内可以参与本集合计划。管理人有权根据实际情况提前结束募集期并通过管理人网站及时向投资者披露。</p> <p>(2) 存续期参与</p> <p>投资者在本集合计划开放日内可以办理本集合计划的参与业务,具体以管理人网站公告为准。</p> <p>2、参与的原则</p> <p>(1) “金额参与”原则,即参与以金额申请。</p> <p>(2) “已知价”原则,即募集期参与价格以人民币1.00元为基准进行计算份额;</p> <p>(3) “未知价”原则,即存续期开放申购日内集合计划参与价格以委托人申请当日的单位净值为基准进行计算;</p> <p>(4) “金额优先+时间优先”原则,管理人应将超募当日以前的有效参与委托予以全部确认,再将超募当日所有有效参与委托先按照参与时间先后排序,时间相同的再按照参与金额大小排序,然后根据排序逐笔确认,超过募集人数上限和规模上限的其他客户委托将不被确认。</p> <p>3、参与的程序和确认</p> <p>委托人在募集期或者开放期内可在销售机构指定的场所参与本计划。</p> <p>(1) 参与程序和确认</p> <p>①投资者按销售机构指定营业网点的具体安排,在规定的交易时间段内办理;</p> <p>②投资者应开设销售机构认可的交易账户,并在交易账户备足认购/申购的货币资金;若</p>	<p>(一) 本集合计划参与和退出的场所</p> <p>投资者应在销售机构的销售网点或者其指定的网络销售平台申请本集合计划参与、退出业务。</p> <p>(二) 本集合计划参与和退出的开放日和开放时间</p> <p>开放日:本集合计划每个自然月的15号为开放日,若该日为非工作日则开放日顺延至最近的一个工作日。投资者可在该开放日办理参与、退出本集合计划的业务。</p> <p>如遇到管理人认为有必要调整开放日情形(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日,具体日期以管理人公告为准,该等公告自管理人公告之日起生效并构成本合同组成部分。</p> <p>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、行政法规、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。</p> <p>(三) 临时开放期的触发条件、程序及披露等相关安排</p> <p>发生本合同变更、本集合计划展期或者管理人/托管人更换、管理人及其子公司(孙公司)自有资金参与和退出本集合计划、本集合计划发生重大关联交易的,为了保障不同意前述情形的投资者退出的权利,本集合计划可临时开放退出。本集合计划触发上述临时开放的,由管理人以管理人网站公告方式通知投资者和托管人,该等公告自管理人公告之日起生效并构成本合同组成部分。</p> <p>(四) 参与和退出的方式、价格、程序及确认</p> <p>1、参与和退出的申请方式</p> <p>投资者必须根据销售机构的业务规则,在存续期的开放日的业务办理时间向销售机构提出申购申请或者在存续期的开放日/临时开放日的业务办理时间向销售机构提出退出申请。</p> <p>2、参与和退出的价格以及原则</p>

交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请；

③投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。委托人应当如实提供与签署合同相关的信息和资料，管理人和其他销售机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。投资者参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分，本合同开始生效。

④投资者参与申请确认后，其参与申请和参与资金不得撤销；

⑤投资者募集期参与的，可于计划成立后2个工作日内到办理参与的营业网点查询参与确认情况。投资者存续期的开放日（T日）参与的，可于T+2日到办理参与的营业网点查询参与确认情况。委托人认可管理人对其认购参与有效性的确认，除经管理人同意外，不再要求管理人提供任何有效性确认的资料。

（2）参与的注册登记

本集合计划存续期内，投资者T日申请参与成功后，注册与过户登记人在T+1日为委托人登记权益并办理注册登记手续。

（3）暂停参与的情形

如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请：

①战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；

②本集合计划出现或可能出现超额募集情况；

③证券交易场所交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；

④集合计划管理人、集合计划托管人或注册与过户登记人的技术保障或人员支持等不充分；

⑤销售机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；

⑥集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；

⑦法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

发生上述①到④项暂停参与情形时，集合计划管理人应当通过管理人网站报告委托人。

（1）本集合计划参与和退出均采用“未知价”原则，即参与/退出价格分别以投资者申请参与/申请退出当日收市后计算的本集合计划份额净值为基准进行计算。

（2）本集合计划采用金额参与和份额退出的方式，即参与以金额申请，退出以份额申请。

（3）在存续期内，管理人使用“时间优先，金额优先”原则对本集合计划募集的规模和人数进行控制，即首先按照参与时间顺序，先参与先确认，对于同样参与时间的，金额高者先确认，超过上限后的所有参与无效。

（4）在存续期内，如有退出本集合计划，管理人采用“先进先出”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。

（5）管理人有权仅接受管理人指定投资者的参与申请。

（6）单个投资者参与金额不低于本合同约定的最低金额。

3、参与和退出的程序以及确认

（1）投资者于本合同约定的存续期的开放日的交易时间内，在本集合计划销售机构处申请参与本集合计划；投资者于本合同约定的存续期的开放日或者临时开放日的交易时间内，在本集合计划销售机构处申请退出本集合计划。

（2）投资者申请参与或退出本集合计划，应按照销售机构的业务规则办理。其中，投资者在开放日申请参与本集合计划的，投资者应先签署本合同、计划说明书和风险揭示书。然后，投资者应确保其开设在销售机构认可的交易账户内备足参与的货币资金，并向销售机构交付参与款项，投资者的参与申请即被受理；投资者在开放日申请退出本集合计划的，其集合计划账户内有足额的退出份额，投资者的退出申请即被受理。销售机构对于投资者参与或者退出申请的受理，仅代表销售机构确实收到该申请，并不代表该申请一定确认成功。参与或者退出申请的确认以注册登记机构的确认结果为准。

（3）对开放日当日（T日）交易时间结束前受理的有效参与申请，注册登记机构将于T+1日对该参与申请是否成功进行确认，投资者可于T+2日后到销售机构网点或销售机构规定的其他方式查询参与申请确认情况；对开放日或者临时开放日当日（T日）交易时间结束前受理的有效退

<p>如果委托人的参与被拒绝，被拒绝的参与款项将与该期间活期存款利息一并退还给委托人，该投资者签署的本合同自始无效。</p> <p>4、参与费及参与份额的计算</p> <p>(1) 参与费率：0； 每笔参与费=每笔参与金额×参与费率÷(1+参与费率)； 每笔净参与金额=每笔参与金额-每笔参与费。 本集合计划参与费归管理人所有。</p> <p>(2) 参与份额的计算方法：</p> <p>①募集期参与份额的计算 每笔参与份额=(每笔净参与金额+募集期利息)/集合计划份额面值 参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p> <p>②存续期参与份额的计算 每笔参与份额=每笔净参与金额/参与申请日集合计划单位净值 参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p> <p>5、参与资金利息的处理方式 委托人的参与资金在募集期产生的利息折成集合计划份额归委托人所有，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。</p> <p>(二) 集合计划的退出</p> <p>1、退出的办理时间 本集合计划存续期内，委托人可在开放日或者特别开放日内办理退出业务。</p> <p>2、退出的原则</p> <p>(1) “未知价”原则，即本计划的退出价格以受理申请当日的计划单位净值为基准进行计算，该净值在 T+1 日公告；</p> <p>(2) 本计划采用“份额退出”的方式，委托人以计划份额申请退出。选择部分退出的，退出集合资产单位份额最低为 1 万份；</p> <p>(3) 当日的退出申请可以在管理人规定的时间以前撤消；</p> <p>(4) “先进先出”原则，委托人申请部分退出集合计划份额时，按先进先出的原则，即对该委托人在该销售机构参与的集合计划份额进行退出确认时，参与确认日期在前的集合计划份额先确认退出，参与确认日期在后的集合计划份额后确认退出；</p>	<p>出申请，注册登记机构将于 T+1 日对该退出申请是否成功进行确认，投资者可于 T+2 日后到销售机构网点或销售机构规定的其他方式查询退出申请确认情况。</p> <p>(4) 退出申请款项的支付：投资者 T 日退出申请确认后，管理人 T+2 日指示托管人将退出款项从本集合计划托管账户划往注册登记机构指定账户，再由注册登记机构划往各销售机构，并通过销售机构划往申请退出投资者的指定资金账户。具体到账时间以销售机构的规则为准。本集合计划向投资者支付的受托资金及收益（如有）的，将返回其参与本集合计划时使用的结算账户或者同名账户。</p> <p>(五) 参与和退出的次数及金额限制</p> <p>1、本集合计划对投资者参与、退出的次数不做限制。</p> <p>2、投资者在本集合计划存续期开放日参与本集合计划的，投资者应当符合合格投资者标准，首次参与金额不得低于 30 万元（不含参与费用），已持有本集合计划份额的投资者在本集合计划存续期开放日追加参与本集合计划的除外。管理人有权以官网公告方式调整本集合计划最低参与金额，但最低不得低于 30 万元（不含参与费用），该等公告自管理人公告之日起生效并为本合同组成部分。</p> <p>3、投资者部分退出本集合计划的，其退出后持有的本集合计划资产净值不得低于 30 万元，否则管理人有权对该投资者部分退出后剩余的份额进行强制退出。投资者持有的本集合计划份额净值低于 30 万元时，需要退出本集合计划的，应当一次性全部退出，不允许部分退出。</p> <p>(六) 参与和退出的费用</p> <p>1、参与费率：0%</p> <p>2、退出费率：0%</p> <p>(七) 参与份额的计算、退出金额的计算方式</p> <p>1、参与份额的计算 投资者每笔参与份额=投资者每笔参与金额/投资者申请参与当日收市后计算的本集合计划份额净值</p> <p>2、退出金额的计算 退出金额=申请退出份额×申请退出日集合计划单位净值-业绩报酬（如有） 退出金额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，由此产生的差额部分计入</p>
--	--

<p>(5)管理人在不损害计划持有人权益的情况下可更改上述原则。管理人最迟须于新规则开始实施前3个工作日在指定网站上公告。</p> <p>3、退出的程序和确认</p> <p>(1)申请方式：委托人可在本集合计划开放日，按照销售机构的退出业务办理规则，前往原参与的销售机构提出退出申请；</p> <p>(2)确认与通知：当日(T日)在交易时间内提交的申请，投资者通常可在T+2日到网点查询退出的确认情况；</p> <p>(3)款项支付：委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人T+2日把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构T+2日划往各销售机构，最后通过销售机构划往申请退出委托人的资金账户。在发生延期退出的情形时，款项的支付办法参照相关条款处理。</p> <p>4、退出费及退出份额的计算</p> <p>(1)退出费用：0</p> <p>(2)退出金额的计算方法：退出金额=退出份额×退出日计划单位净值-业绩报酬(如有)</p> <p>5、退出份额、次数的约定</p> <p>本计划对委托人退出次数不做限制。每次退出的最低份额为1万份计划单位，委托人可将其部分或全部计划单位退出。委托人选择部分退出的，其剩余的资产不得低于30万，否则管理人有权对其剩余份额进行强制赎回。投资者持有的本集合计划资产净值低于30万元时，需要退出本集合计划的，应当一次性全部退出，不允许部分退出。</p> <p>单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式</p> <p>(1)单个委托人大额退出的认定</p> <p>单个委托人单日退出份额超过计划总份额5%，即视为单个委托人大额退出。</p> <p>(2)单个委托人大额退出的申请和处理方式</p> <p>委托人必须提前2个工作日直接或通过销售机构向管理人预约申请，否则管理人有权拒绝接受其退出申请。</p> <p>7、巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1)巨额退出的认定</p> <p>单个开放日，本计划净退出申请份额(退出申请总份额扣除参与申请总份额之余额)超</p>	<p>集合计划资产损益。</p> <p>(八)参与资金的利息处理方式</p> <p>投资者存续期开放日参与本集合计划的，无参与资金利息。</p> <p>(九)巨额退出和连续巨额退出</p> <p>1、巨额退出和连续巨额退出认定标准</p> <p>(1)巨额退出的认定：单个开放日，本集合计划净退出申请份额(退出申请总份额扣除参与申请总份额的净额)超过本集合计划上一日总份额的10%，即认为是发生了巨额退出。</p> <p>(2)连续巨额退出的认定：本集合计划连续两个开放日(含两日)以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。</p> <p>2、巨额退出和连续巨额退出顺序</p> <p>当出现巨额退出或者连续巨额退出时，管理人可以根据本集合计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分退出。</p> <p>(1)全额退出：当管理人认为有能力支付投资者的退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>(2)部分延期退出：当管理人认为支付投资者的退出申请有困难或认为兑付投资者的退出申请可能对本集合计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出本集合计划份额不低于本集合计划上一日总份额的10%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于单个投资者的退出申请，按其退出申请量占退出申请总量的比例，确定该单个投资者当日受理的退出申请；未受理部分可延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的退出申请不享有优先权并以该开放日的本集合计划单位净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。</p> <p>3、巨额退出和连续巨额退出价格确定</p> <p>发生巨额退出或者连续巨额退出时，管理人对其能接受的投资者退出申请部分按照该投资者退出申请日当日收市后计算的本集合计划份额净值为基准作为退出价格；对于其余延期至下一个开放日办理的投资者退出份额，管理人按照下一个开放日当日收市后计算的本集合计划份额净值为基准作为退出价格。</p> <p>4、巨额退出和连续巨额退出款项支付</p> <p>发生巨额退出或者连续巨额退出时，对于管理人接受的(T日)的退出申请部分对应的退出款项将最晚于T+7日划出本集合计划托管户。</p> <p>5、巨额退出和连续巨额退出告知投资者方式</p>
---	---

<p>过上一日计划份额总份数的 10%，即认为是发生了巨额退出。</p> <p>(2) 巨额退出的顺序、价格确定和款项支付当出现巨额退出时，管理人可以根据本计划当时的资产组合状况决定全额退出或部分退出。</p> <p>①全额退出：当管理人认为有能力支付委托人的退出申请时，按正常退出程序执行。</p> <p>②部分延期退出：当管理人认为支付委托人的退出申请有困难或认为兑付委托人的退出申请可能对本计划的资产净值造成较大波动时，管理人在当日接受退出计划份额不低于上一日计划总份额的 10%的前提下，对其余退出申请延期办理。对于当日的退出申请，按单个账户退出申请量占退出申请总量的比例，确定当日受理的退出申请；未受理部分可延迟至下一开放日办理。转入下一开放日的退出申请不享有优先权并以该开放日的计划净值为依据计算退出金额，以此类推，直到全部退出为止。</p> <p>(3) 告知客户的方式</p> <p>当发生巨额退出并顺延退出时，管理人应立即通过在管理人的公司网站刊登公告等途径向委托人公布信息，并说明有关处理方法。</p> <p>8、连续巨额退出的认定和处理方式</p> <p>(1) 连续巨额退出的认定</p> <p>本集合计划连续两个开放日（含两日）以上发生巨额退出，即认为发生了连续巨额退出。</p> <p>(2) 连续巨额退出的顺序、价格确定和款项支付</p> <p>出现连续巨额退出时，管理人可采用全额退出或部分顺延退出（具体含义见前款巨额退出的处理方式）方式处理，当管理人认为有必要时，也可拒绝或暂停接受退出申请，并对已经接受的退出申请，采用全额退出或部分顺延退出方式处理。</p> <p>9、拒绝或暂停退出的情形及处理</p> <p>(1) 发生下列情形时，管理人可以在开放期拒绝或暂停受理委托人的退出申请：</p> <p>①战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；</p> <p>②证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；</p> <p>③因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨</p>	<p>当发生巨额退出或者连续巨额退出时并且管理人选择延期支付的，管理人应提前以管理人网站公告方式告知投资者和托管人，并明确有关处理方法，该等公告自管理人公告之日起生效并构成本合同组成部分。</p> <p>6、单个投资者大额退出的预约申请</p> <p>(1) 单个投资者大额退出的认定</p> <p>单个投资者单日退出份额超过本集合计划总份额 5%，即视为单个投资者大额退出。</p> <p>(2) 单个投资者大额退出的申请和处理方式</p> <p>投资者必须提前 2 个工作日直接或通过其他销售机构向管理人预约申请，否则管理人有权拒绝接受其退出申请。</p> <p>(十) 延期支付及延期退出的情形和处理方式</p> <p>1、延期支付及延期退出的情形：</p> <p>(1) 本集合计划发生巨额退出和连续巨额退出；</p> <p>(2) 法律法规规定和本合同约定的其他延期支付和延期退出情形。</p> <p>2、延期支付及延期退出的处理方式：</p> <p>(1) 发生巨额退出和连续巨额退出，比照本章节第（九）条约定进行处理；</p> <p>(2) 发生法律法规规定和本合同约定的其他延期支付和延期退出情形，由管理人及时在其网站进行公告并告知投资者具体处理方式，该等公告自管理人公告之日起生效并构成本合同组成部分。</p> <p>(十一) 拒绝或者暂停参与、退出的情形以及处理方式</p> <p>1、如出现如下情形，本集合计划管理人可以拒绝或暂停投资者的参与申请：</p> <p>①战争、自然灾害等不可抗力的原因导致本集合计划无法正常运转；</p> <p>②本集合计划出现或可能出现超额募集情况；</p> <p>③证券交易场所所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的本集合计划资产净值；</p> <p>④本集合计划管理人、本集合计划托管人或注册与过户登记人的技术保障或人员支持等不充分；</p> <p>⑤销售机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者不能提供充分证明的；</p> <p>⑥本集合计划管理人认为会有损于现有本集合计划投资者利益；</p> <p>⑦法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。</p> <p>发生上述①到④项暂停参与情形时，本集合计划</p>
---	--

<p>额退出，导致本集合计划的现金支付出现困难；</p> <p>④法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>(2) 拒绝或暂停受理退出的方式包括：</p> <p>①拒绝、暂停受理某笔或数笔退出申请；</p> <p>②拒绝、暂停受理开放日的全部退出申请；</p> <p>③法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>已接受的退出申请，管理人应足额支付；如暂时不能足额支付的，可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分由管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日（或工作日）予以支付，但最长不超过正常支付时间20个工作日，并向委托人报告。</p> <p>发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。</p> <p>2.管理人自有资金参与集合计划</p> <p>(一) 管理人自有资金参与的条件和方式</p> <p>管理人可以以其自有资金参与本集合计划。管理人以自有资金参与本集合计划，应当符合法律法规和中国证监会规定，并按照《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得相关授权程序的批准。管理人以自有资金参与本集合计划方式同其他投资者（指管理人以外的投资者）。</p> <p>(二) 管理人自有资金参与金额和比例</p> <p>管理人自有资金所持有的本集合计划份额不超过本集合计划总份额的10%（含10%）。管理人及其子公司以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的50%。因本集合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本集合计划合同的约定及时调整达标。</p> <p>(三) 管理人自有资金参与退出条件</p> <p>管理人自有资金参与、退出本集合计划的，提前5个工作日告知全体投资者和托管人，并取得其同意；管理人自有资金参与本集合</p>	<p>管理人应当通过管理人网站通知投资者，该等公告自管理人公告之日起生效并构成本合同组成部分。如果投资者的参与被拒绝，被拒绝的参与款项将退还给投资者，期间不计利息，该投资者签署的合同自始无效。</p> <p>2、发生下列情形时，管理人可以在开放期拒绝或暂停受理投资者的退出申请：</p> <p>①战争、自然灾害等不可抗力的原因导致本集合计划无法正常工作；</p> <p>②证券交易场所交易时间非正常停市，导致本集合计划当日资产净值无法计算；</p> <p>③管理人认为接受某笔或某些退出申请可能会影响或损害现有份额持有人利益时；</p> <p>④因市场剧烈波动或其他原因而出现连续巨额退出，导致本集合计划的现金支付出现困难；</p> <p>⑤法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</p> <p>发生上述情形之一且管理人拒绝或暂停受理份额持有人的退出申请的，已接受的退出申请，若管理人有足额支付能力，则管理人将足额支付；如暂时不能足额支付的，应将可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，其余部分可延期支付。发生拒绝或暂停受理退出的情形时，管理人应将拒绝或暂停受理退出的原因和处理办法在管理人网站进行信息披露，该等公告自管理人公告之日起生效并构成本合同组成部分。在暂停退出的情况消除时，管理人应及时恢复退出业务的办理。</p> <p>(十二) 份额转让和非交易过户</p> <p>1、份额转让</p> <p>本集合计划存续期间，在条件允许的前提下，投资者可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式，向合格投资者转让其持有的本集合计划份额。份额转让应遵守交易所相关规定及要求，并按照规定办理份额变更登记手续。</p> <p>转让后，持有本集合计划份额的合格投资者人数合计不得超过200人。管理人应当在份额转让前，对受让人的合格投资者身份和本集合计划的投资者人数进行合规性审查。受让人首次参与本集合计划，应先与管理人、托管人签订本合同。管理人不得通过办理本集合计划的份额转让业务，公开或者变相公开募集本集合计划。</p> <p>2、非交易过户</p> <p>非交易过户是指不采用参与、退出、转让等本集</p>
---	---

	<p>计划的，持有期限不少于 6 个月。</p> <p>（四）收益分配和责任承担方式 管理人自有资金所持有的本集合计划份额与其他投资者持有的本集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。 管理人自有资金参与份额不对其他投资者承担保本保收益责任。</p> <p>（五）为应对本集合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本集合计划合同约定的前提下，管理人及其子公司以自有资金参与及其后续退出本集合计划可不受本条第 2 款、第 3 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。</p>	<p>合计划交易方式，将一定数量的本集合计划份额按照一定规则从某一投资者的集合计划账户转移到另一投资者集合计划账户的行为。</p> <p>本集合计划只受理因继承、捐赠、司法强制执行以及其他符合规定的情况，需办理的非交易过户业务。</p> <p>投资者办理因上述原因引起的非交易过户，须提供注册登记机构要求的受理材料并前往注册登记机构处办理。具体受理材料以注册登记机构业务规则为准。</p> <p>（十三）管理人及其子公司自有资金参与</p> <p>1、管理人及其子公司自有资金参与、退出的条件和方式 管理人以自有资金参与本集合计划，应当符合法律法规和中国证监会规定，并按照《中华人民共和国公司法》和公司章程的规定，获得相关授权程序的批准。</p> <p>投资者和托管人签署本合同即视为同意在本集合计划初始募集期内，管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与本集合计划，无需再事先取得投资者和托管人的同意。</p> <p>除初始募集期外，管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与、退出本集合计划的，管理人应提前 5 个工作日告知全体投资者，以邮件或者其他书面形式告知托管人，并取得其同意，同时自有资金参与本集合计划的，持有期限不少于 6 个月，因本集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与比例被动超标，自有资金选择退出的情形除外。</p> <p>管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与、退出本集合计划方式按照本章节“（四）参与和退出的方式、价格、程序及确认”执行。</p> <p>2、管理人自有资金参与金额和比例 管理人自有资金所持有的本集合计划份额不超过本集合计划总份额的 15%。管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的 50%。因本集合计划规模变动等客观因素导致前述比例被动超标的，管理人应在被动超标后的 5 个工作日内强制赎回超标部分，使得管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与本集合计划的比例达标。</p> <p>3、取得投资者和托管人同意方式 就管理人参与、退出本集合计划事项，管理人将通过管理人官网公告方式征询投资者的意见，以</p>
--	--	---

		<p>邮件或者其他书面形式征询托管人的意见。如投资者对管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与、退出本集合计划有异议，可以在管理人设置的临时开放期申请退出集合计划份额，但不因此影响自有资金参与或退出的效力。投资者未在临时开放期退出本集合计划的，即视为其同意该等事项。此类情况下投资者的退出，不受份额锁定期限制（如有）且不收取退出费（如有），退出金额需根据集合计划合同约定扣除业绩报酬（如有）。托管人如不同意管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与、退出本集合计划，可以邮件或其他书面形式中告知的方式向管理人提出异议。如管理人邮件或者其他书面形式中告知的临时开放期届满，托管机构未提出异议，即视为其同意该等事项。</p> <p>4、管理人及其子公司自有资金参与退出的披露 管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与、退出份额发生变动的，管理人还应事后 10 个工作日内以管理人网站公告方式披露自有资金的参与、退出情况及持有期限等信息。</p> <p>5、管理人及其子公司（孙公司）自有资金收益分配和责任承担方式 管理人及其子公司（孙公司）自有资金所持有的本集合计划份额与其他投资者持有的本集合计划份额享有同等权益、承担同等风险。 管理人及其子公司（孙公司）自有资金参与份额不对其他投资者承担保本保收益责任。</p> <p>6、为应对本集合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本集合计划合同约定的前提下，管理人及其子公司（孙公司）以自有资金参与及其后续退出本集合计划可不受本条第 1 款、第 2 款和第 3 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。</p> <p>（十四）投资者变更情况报送 管理人根据法律法规、中国证监会和基金业协会的规定，定期将本集合计划投资者变更情况报送基金业协会。</p>
<p>管理费</p>	<p>本集合计划自成立之日起计提管理费。本计划的管理费按前一日的计划资产净值 0.7% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.7\% \div 365$ （首日按集合计划初始资金金额） H 为管理人当日计提的管理费</p>	<p>本集合计划自成立之日起计提固定管理费。每日应计提的固定管理费以本集合计划前一日的资产净值为基数并按【0.8%】的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times F \div 365$ H 为管理人当日计提的固定管理费；</p>

	<p>E 为前一日计划资产净值(首日按本计划初始资金金额)。</p> <p>按前一日计划资产净值计算,按日计提,按季支付。由托管人根据与管理人的指令,在每季初的前 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付。若因战争、自然灾害等不可抗力或法定节假日致使无法按时支付的,则在不可抗力情形消除后或节假日终止后的首个工作日支付。本计划终止后,依据清算程序支付管理人尚未支付的管理费。</p>	<p>E 为前一日计划资产净值(首日按本集合计划初始资金金额);</p> <p>F 为本集合计划固定管理费年费率。</p> <p>按本集合计划前一日资产净值计算,按日计提,按季支付。由托管人根据与管理人的指令,在每季初的前 5 个工作日内从本集合计划财产中一次性支付。若因战争、自然灾害等不可抗力或法定节假日致使无法按时支付的,则在不可抗力情形消除后或节假日终止后的首个工作日支付。本合同终止后,依据清算程序支付管理人尚未支付的固定管理费。</p> <p>各方一致同意,管理人有权以管理人网站公告方式下调本集合计划管理费率,无需履行合同变更程序,管理人应在管理费率下调前 1 个工作日在管理人网站进行公告,该等公告自管理人公告之日起生效并构成本合同组成部分。</p> <p>本合同约定的管理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计提的管理费进行追溯调整。</p>
<p>业绩报酬</p>	<p>①业绩报酬计提原则</p> <p>(1) 按委托人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>(2) 业绩报酬计提日为本集合计划分红日(以管理人的分红公告为准)、委托人退出日或计划终止日。</p> <p>(3) 在委托人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。在本集合计划收益分配日提取业绩报酬的,业绩报酬从分红款中扣除。</p> <p>(4) 在委托人退出或计划终止时,业绩报酬按委托人退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额为一笔参与份额的一部分,则将该退出份额单独核算业绩报酬,而该笔参与的剩余部分不受影响。</p> <p>(5) 业绩报酬计提频率不得超过每 6 个月一次,但因委托人退出提取业绩报酬的,不受该提取频率限制。</p> <p>(6) 委托人申请退出时,管理人按“先进先出”的原则,即按照委托人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</p>	<p>本集合计划管理费由固定管理费和业绩报酬组成。</p> <p>①管理人根据市场情况,确定业绩报酬计提基准和业绩报酬计提比例 X%(但 X%最高不得超过 60%)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)和业绩报酬计提比例,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,该等公告自公告之日起生效并构成本合同组成部分。本集合计划业绩报酬计提基准和业绩报酬计提比例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和业绩报酬计提比例调整周期不得短于本集合计划两个开放期的间隔时间。</p> <p>②本集合计划的业绩报酬计提基准日为:本集合计划分红日、投资者赎回申请日和本集合计划终止日;</p> <p>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)。</p> <p>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</p>

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6%进行比较，将超额收益部分的50%作为管理人业绩报酬。

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

P_1 为本次业绩报酬计提日的计划单位累计净值；

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）计划单位累计净值；

P_0^* 为上一个业绩报酬计提日的计划单位净值；

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：

持有期 年化收 益率(R)	计提 比例	业绩报酬(Y)的 计提公式
$R \leq 6\%$	0	$Y = 0$
$R > 6\%$	50%	$Y = A \times (R - 6\%) \times 50\% \times D \div 365$

Y = 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。

④本集合计划业绩报酬计入管理费。

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X%作为业绩报酬。从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。

在分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红款中扣除，当分红金额不足于扣除业绩报酬时，以分红金额为限进行扣除；在投资者赎回申请日或计划终止日提取业绩报酬的，业绩报酬从退出资金中扣除；

同一投资者不同时间多次参与的，对投资者每笔参与份额分别计算年化收益率、计提业绩报酬；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、提取退出份额对应的业绩报酬。业绩报酬的具体计算及支付如下：

$$\text{当 } \frac{NAV_e' - NAV_{is}'}{NAV_{is}} > B_i \text{ 时,}$$

$$H_i = \left(\frac{NAV_e' - NAV_{is}'}{NAV_{is}} - B_i \right) \times N_i \times NAV_{is} \times X\% ;$$

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

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

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

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

		<p>集合计划份额期间业绩报酬计提基准，$\sum_{t=1}^n \frac{r_{it}}{365}$</p> <p>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；</p> <p>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）；</p> <p>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当日开始算）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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>NAV'_e为本次业绩报酬计提基准日的份额累计净</p>
--	--	---

		<p>值；</p> <p>NAV'_{is}为上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值；</p> <p>NAV_{is}为上一个业绩报酬计提基准日的份额净值；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>④业绩报酬的支付：因业绩报酬的计算与份额的注册登记有关，业绩报酬在份额持有人赎回时或本产品清算时由管理人负责计算和复核。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，托管人以管理人的指令数额为准于【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。</p> <p>管理费（含业绩报酬）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 大额支付号：102731002031</p> <p>本合同约定的业绩报酬条款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计提的业绩报酬进行追溯调整。</p> <p>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。</p>
<p>利益冲突及关联交易</p>	<p>1、可能存在利益冲突的情形</p> <p>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易”时，可能发生利益冲突。</p> <p>2、利益冲突处理方式</p>	<p>（一）可能存在利益冲突的情形</p> <p>本集合计划可能存在利益冲突的情形包括：</p> <p>1、关联交易；</p> <p>2、管理人及其子公司自有资金参与本集合计划。</p> <p>（二）利益冲突处理方式、披露方式、披露内容以及披露频率</p> <p>1、发生关联交易的，相关利益冲突方式、披露</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>3、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>方式、披露内容以及披露频率见本章节中“（三）关联交易”中“5、关联交易的处理方式”以及“6、关联交易披露方式、披露内容”；</p> <p>2、发生管理人及其子公司自有资金参与本集合计划，相关利益冲突方式、披露方式、披露内容以及披露频率见本合同“第九节、本集合计划的参与、退出与转让”中“（十三）管理人及其子公司自有资金参与”。</p> <p>（三）关联交易</p> <p>1、关联方范围和依据</p> <p>本集合计划关联交易的关联方范围包括：</p> <p>（1）《企业会计准则第36号--关联方披露》规定的“一方控制、共同控制另一方或对另一方施加重大影响，以及两方或两方以上同受一方控制、共同控制或重大影响的”，包括管理人的母公司；管理人的子公司；与管理人受同一母公司控制的其他企业；对管理人实施共同控制的投资方；对管理人施加重大影响的投资方；管理人的合营企业；管理人的联营企业；管理人主要投资方个人、关键管理人员或与其关系密切的家庭成员控制、共同控制或施加重大影响的其他企业，具体关联方名单以管理人定期公开披露为准；</p> <p>（2）视为关联方进行管理的法人及管理人管理的其他资产管理产品，包括：管理人；本集合计划托管人及其关联方（托管人关联方包括托管人本身，持有托管人5%以上的股东，托管人持有的50%以上股份的控股子公司，及托管人提供的关联方名单（如有）中其他关联方）；管理人管理的其他资产管理产品以及由管理人提供投资顾问服务的金融产品；</p> <p>（3）根据实质重于形式的原则认定的其他与管理人有特殊关系，可能造成管理人对其利益倾斜或导致利益转移的法人或其他组织；</p> <p>（4）其他相关法律法规认定为关联方的情形。关联方不包括国家行政机关、政府部门，中央汇金投资有限责任公司，全国社会保障基金理事会，梧桐树投资平台有限责任公司，以及依据法律、行政法规等豁免认定的关联方。</p> <p>2、关联交易的区分标准</p> <p>根据关联交易对本集合计划的影响程度，关联交易分为一般关联交易和重大关联交易。</p> <p>重大关联交易包括：</p> <p>（1）本集合计划投资管理人、托管人及其关联方发行或承销期内承销的证券；</p>
---	---

		<p>(2) 本集合计划与关联方在二级市场进行对手方交易单笔达到或超过产品净资产的 10%且不低于人民币 3000 万元的;</p> <p>(3) 本集合计划投资于管理人及其关联方管理的其他资产管理产品;</p> <p>(4) 管理人资产管理总部投资决策委员会经审慎评估的具有特殊交易性质的其他关联交易。重大关联交易以外的关联交易为一般关联交易。</p> <p>3、关联交易的交易决策及对价机制</p> <p>(1) 交易决策</p> <p>本集合计划的关联交易需符合本合同约定的投资策略和目标,由管理人资产管理总部投资决策委员会批准后实施。</p> <p>(2) 对价机制</p> <p>本集合计划关联交易定价原则上应当通过询价、投标、竞价等市场化方式进行。因交易标的性质或交易场所限制等原因须协商或以其他非公开方式确定交易价格的,投资经理、交易员应当采取必要措施,获取充分适当的证据表明关联交易定价的独立、合理、公允。</p> <p>4、关联交易的内部管控机制</p> <p>管理人依照法律、法规及内部制度对本集合计划开展的关联交易进行管理和控制。</p> <p>本集合计划拟进行的全部关联交易均需由管理人资产管理总部投资决策委员会批准。此外,重大关联交易需由管理人经营管理层另行批准。</p> <p>5、关联交易的处理方式</p> <p>管理人从业人员应当避免个人利益、相关方利益与投资者利益相冲突,可能发生冲突或者发生冲突时,应当及时向管理人报告。管理人应当及时向投资者充分披露发生冲突的可能性、冲突有关情况;当无法避免时,应当确保投资者利益得到公平的对待。</p> <p>(1) 一般关联交易处理方式</p> <p>投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事本合同约定的一般关联交易情形,管理人无需就一般关联交易再行分别取得投资者的授权。但该等一般关联交易投资行为实施过程中应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,不得损害投资者利益,遵循投资者利益优先、平等自愿、等价有偿原则并防范利益冲突。</p> <p>(2) 重大关联交易处理方式</p> <p>管理人以本集合计划的资产从事重大关联交易</p>
--	--	---

		<p>的,根据法律法规、中国证监会的规定和合同约定,提前5个工作日通过管理人网站公告的形式事先取得投资者的同意,并提供充分证据证明未损害投资者利益。</p> <p>为了保障不同意重大关联交易的投资者的退出权利,管理人应当设置临时开放日。不同意重大关联交易的投资者,可以在临时开放日申请退出本集合计划;对于明确答复不同意重大关联交易但逾期未退出本集合计划的投资者,管理人有权在征询公告中说明的回复期限届满后,将其份额强制退出本集合计划,退出价格为申请退出当日本集合计划单位净值(具体以产品相关公告为准),由此发生的相关税费或或有损失由投资者自行承担;投资者未在公告规定时限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,视为投资者同意重大关联交易。</p> <p>6、关联交易披露方式、披露内容</p> <p>发生利益冲突情形的,管理人将在临时公告以及定期报告中披露,具体披露内容包括利益冲突情形、处置方式、对投资者利益影响等。</p> <p>(1) 临时公告:管理人以集合计划的资产从事关联交易的,事后将通过管理人网站公告的形式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>(2) 定期报告:管理人将在本集合计划季度报告和年度报告中披露报告期内的利益冲突情况。</p> <p>(四) 其他提示</p> <p>本章节所列的关联方范围、重大关联交易与一般关联交易的划分标准,除法律法规强制规定为关联方、重大关联交易外,系管理人公司制度的规定。如该等制度发生修改或者变更导致以上范围和标准调整的,管理人将以公告方式向投资者披露,该等公告自公告之日起生效并构成本合同组成部分。</p>
其他补充说明事项		<p>根据2024年3月1日起实施《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》的要求订立,估值条款、风险揭示等更多修订细节,具体以我司官网公布的合同编号为jh2024010《太平洋证券金元宝10集合资产管理计划资产管理合同》为准。</p>