

太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划说明书
(二〇二三年四月)

特别提示:

本说明书依据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(以下简称《指导意见》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理规定》(以下简称《运作管理规定》)、《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)》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(二〇一九年八月第二次修订版)之补充协议一》(前述两项协议以下并称《管理合同》或本合同)及其他有关规定制作,管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

委托人承诺以真实身份参与集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,并已阅知本说明书和《管理合同》全文,了解相关权利、义务和风险,自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产,但不保证集合计划一定盈利,也不保证最低收益。本说明书对集合计划未来的收益预测仅供委托人参考,不构成管理人、托管人和销售机构保证委托资产本金不受损失或取得最低收益的承诺。

投资者签订《管理合同》且合同生效后,投资者即为《管理合同》的委托人,其认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《管理合同》及本说明书的承认和接受。委托人将按照《指导意见》、《管理办法》、《运作管理规定》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

集合计划基本信息	名称	太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划
	类型	固定收益型
	目标规模	本集合募集期规模和存续期规模上限为 5 亿份(不含募集期利息转份额部分)本集合计划,户数均不超过 200 人,但法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。
	管理期限	本集合资产管理计划管理期限 10 年;经委托人、管理人、托管人协商一致同意,本集合计划可提前结束。
	募集期	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。
	封闭期	除本集合计划开放期以外,本集合计划均封闭运作。
	开放期	本集合计划成立满 6 个月后,每月 15 号为开放日(非工作日顺延至最近的下一个工作日),投资者可在该开放日办理参与、退出本集合计划的业务。管理人有权以公告方式调整开放日。 假设,本次合同变更生效日为 2019 年 7 月 1 日,则本次合同变更生效后的第一个开放日为 2019 年 7 月 15 日,第二个开放日为 2019 年 8 月 15 日,第三个开放日为 2019 年 9 月 16 日……,以此类推。开放日内,投资者可以按照本合同约定办理参与或退出业务。但管理人以管理人公告方式调整(变更或增加)本集合计划开放日的除外。 特别开放日:本集合计划发生合同或者管理人/托管人变更,根据本合同约定,管理人可安排特别开放日,保障不同意合同变更的委托人退出的权利。
	份额面值	人民币 1.00 元。
	最低金额	个投资者首次参与的最低金额为人民币 30 万元,非首次参与资金的最低追加金额为人民币 1 万元。
	相关费率	1、参与费:0; 2、退出费:0; 3、管理费:0.7%/年; 4、托管费:0.03%/年;
投资范围和投资比例	1、投资范围 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>(1) 标准化债权类资产，包括银行存款（合同业存款）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，分级基金和平衡基金，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>2、投资组合比例</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>
投资限制	<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>
投资策略	<p>1、精选信用债</p> <p>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</p> <p>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</p> <p>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</p>

		<p>强债性保护时捕捉低风险投资机会。</p> <p>4、股票投资策略</p> <p>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>
	风险收益特征	根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本集合计划属 R3 中风险，仅面向风险承受能力评级为 C3 稳健型、C4 积极型、C5 激进型的合格投资者和专业投资者。委托人承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。
	风险承担安排	本集合资产管理计划的投资风险由投资者自行承担，管理人、资产托管机构不以任何方式对投资者资产本金不受损失或者取得最低收益作出承诺。
	适合销售对象	仅面向风险承受能力评级为 C3 稳健型、C4 积极型、C5 激进型的合格投资者和专业投资者。
当 事 人	管理人	太平洋证券股份有限公司。太平洋证券股份有限公司是 2004 年 1 月 6 日在云南昆明注册成立的全国性综合类证券公司，主营证券经纪、证券投资咨询、证券自营、证券承销与保荐、证券资产管理、证券投资基金销售、融资融券等业务。
	托管人	兴业银行股份有限公司 1988 年 8 月成立于福建省福州市，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，也是中国首家赤道银行。2007 年 2 月在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），目前注册资本 207.74 亿元。目前已在全国设立 44 家一级分行（含香港分行）、2064 家分支机构，与全球 1600 多家银行建立代理行关系，并建立了网上银行、电话银行、手机银行、微信银行和直销银行等线上渠道，形成虚实结合、覆盖全国、衔接境内外的庞大服务网络，拥有约 6 万名员工组成的专业化金融服务团队，形成了以银行为主体，涵盖信托、金融租赁、基金、期货、资产管理、消费金融、研究咨询、数字金融等多个领域的综合金融服务集团，跻身全球银行 30 强，稳居世界 500 强、全球上市公司 100 强。截至 2017 年末，兴业银行总资产达 6.42 万亿元，较年初增长 5.44%；实现净利润 572 亿元，同比增长 6.22%；加权平均净资产收益率 15.35%，总资产收益率 0.92%，继续保持同类型银行前列；不良贷款率 1.59%，较年初下降 0.06 个百分点，拨备覆盖充足，拨贷比达 3.37%，拨备覆盖率达 211.78%，均保持同业较高水平。资产托管规模突破 11 万亿，稳居行业第一梯队。
	销售机构	太平洋证券股份有限公司及具有法律法规规定的代销资格并与管理人签订代销协议的机构。
	是否有投资顾问	未聘请投资顾问
	投资者的重要权利和义务	<p>1、委托人的权利</p> <p>(1) 取得集合计划收益；</p> <p>(2) 按照法律法规和本合同约定的时间和方式获得本集合计划的信息披露资料；</p> <p>(3) 按照本合同及《说明书》的约定，参与、退出和转让集合计划；</p> <p>(4) 按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；</p> <p>(5) 因管理人、托管人过错导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；</p> <p>(6) 法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。</p> <p>2、委托人的义务</p> <p>(1) 委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并承诺委托资金的来源及用途合法，不得非法汇集他人资金参与本集合计划；</p> <p>(2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承担能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；</p> <p>(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于本集</p>

		<p>合计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(4) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(5) 按照本合同约定支付本集合计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；</p> <p>(6) 在持有的本集合计划份额范围内，承担本集合计划亏损或者终止的有限责任；</p> <p>(7) 向管理人或本集合计划销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；</p> <p>(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(9) 不得从事任何有损本集合计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>(10) 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；不得利用本集合计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；</p> <p>(11) 法律法规、中国证监会和基金业协会规定的和本合同约定的其他义务。</p>
集合计划的参与	办理时间	<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>
	办理场所	销售机构指定的场所。
	参与原则	<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>
	办理方式、程序	<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；若交易账户内参与资金不足，销售机构不受理该笔参与申请；</p> <p>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。委托人深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有效后，构成本合同的有效组成部分，本合同开始生效。</p> <p>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；</p> <p>⑤投资者募集期参与的，可于计划成立后 2 个工作日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。</p>

	参与费及参与份额计算	<p>(1) 参与费率：0</p> <p>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 参与份额保留小数点后两位，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 参与份额保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。</p>
	认购资金利息	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。
集合计划的退出	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。
	办理场所	销售机构指定的场所。
	退出原则	<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>(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>
	办理方式、程序	<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>
	退出费及退出份额的计算	<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>
	退出限制与次数	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。
单个委托人大额退出的认定、申请和处理方式	<p>(1) 单个委托人大额退出的认定 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 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</p>	

	巨额退出	<p>接受其退出申请。</p> <p>(1) 巨额退出的认定 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 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>
管理人自有资金参与情况		<p>(一) 管理人自有资金参与的条件和方式 管理人可以以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 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 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>
集合计划成立的条件、时间		<p>集合计划的参与资金总额不低于 1000 万元人民币且其委托人的人数为 2 人（含）以上 200 人（含）以下。本计划募集过程应符合法律、行政法规和中国证监会规定，于募集结束之后十个工作日内，管理人聘请的具有证券相关业务资格的会计师事务所对集合计划进行验资并出具验资报告。本计划在取得验资报告后，管理人公告本集合计划成立并公告。 本集合计划成立的时间为计划管理人根据《管理办法》及相关法规规定发布集合计划成立公告的日期。</p>

		<p>管理人在集合计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或资产缴付证明等材料报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p> <p>集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入集合计划份额登记机构指定的专门账户，不得动用。存入前述专门账户的投资者资金，独立于管理人、销售机构的固有财产，非因投资者本身的债务或者法律规定的其他情形，不得查封、冻结、扣划或者强制执行存入专门账户的投资者参与资金。</p>
集合计划设立失败		<p>集合计划募集期结束，在集合计划规模低于人民币 1000 万元或者委托人人人数低于 2 人条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划全部募集费用，并将已认购资金及银行活期利息（按银行同期活期存款利率计）在募集期结束后 30 日内退还集合计划委托人，各方互不承担其他责任。利息金额以本集合计划注册与过户登记人的记录为准。</p>
集合计划份额转让		<p>在证券交易所以及其他中国证监会认可的交易平台开通后，集合计划存续期间，客户可以通过证券交易所等中国证监会认可的交易平台转让集合计划份额并办理份额变更登记手续。转让后，持有本集合计划份额的合格投资者合计不得超过二百人。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。受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订本合同。</p> <p>管理人、交易所不得通过办理计划的份额转让，公开或者变相公开募集本计划。</p>
费用	费用种类（计提标准、方法、支付方式）	<p>（一）集合计划费用支付标准、计算方法、支付方式和时间</p> <p>1、托管费： 本集合计划自成立之日起计提托管费。本计划的托管费按前一日的计划资产净值 0.03% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.03\% \div 365$（首日按集合计划初始资金金额） H 为每日应计提的托管费 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>本计划的托管费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法定节假日终止后的首个工作日即可支付日支付。本计划终止（包括提前或延期）后，依据清算程序支付托管人尚未支付的托管费。</p> <p>管理人在约定的托管费支付日未向托管人发送托管费划付指令的，托管人有权在托管费支付日当日或后续任一日自行扣收全部或部分应付未付托管费。费用自动划扣后，托管人应向管理人告知托管费支付金额及计算方式，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。</p> <p>2、管理费： （1）管理费 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 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>（2）业绩报酬</p>

①业绩报酬计提原则

- (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。
- (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。
- (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。
- (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。
- (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。
- (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。

②业绩报酬计算方法

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 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。

3、证券交易费用

本集合计划应按规定比例支付经手费、证管费、过户费、印花税、证券结算风险基金、佣金等费用。

本集合计划向所租用交易单元的券商支付佣金（该佣金已扣除风险金），其费率由管理人根据有关政策法规确定，在每月度首日起 10 个工作日内支付给提供交易单元的券商。

4、与本集合计划相关的审计费

本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签订协议所规定的金额，在被审计的会计期间，按直线法在每个自然日内平均摊销。

		<p>本集合计划的清算审计费，按与会计师事务所签订协议所规定的金额，于本集合计划终止当日一次性计入本集合计划费用。</p> <p>5、违约处置费</p> <p>管理人为了维护本集合计划资产安全而采取违约处置措施所发生的各项费用，包括但不限于诉讼费（仲裁费）、律师费、律师差旅费、评估费、保全费、拍卖费等违约处置费用。托管人根据管理人发送的指令和费用凭证对划款指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性和合理性不承担复核责任。</p> <p>6、按照国家有关规定可以列入的其他费用</p> <p>银行结算费用、银行间市场账户维护费、开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费、注册与过户登记人收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用；</p> <p>银行结算费用，于实际发生时计入集合计划费用；</p> <p>银行间市场账户维护费，按银行间市场规定的金额，在相应的会计期间一次性计入费用；</p> <p>开户费、银行账户维护费、银行间交易费、转托管费在发生时一次计入集合计划费用；</p> <p>证券账户开户费在产品成立后，经管理人与托管人核对无误，由托管人根据管理人指令从委托资产中支付给管理人指定账户，托管人不承担垫付开户费用义务。</p> <p>与集合计划运营有关的其他费用，如果金额较小，或者无法对应到相应会计期间，可以一次进入集合计划费用；如果金额较大，并且可以对应到相应会计期间，应在该会计期间内按直线法摊销；</p> <p>上述计划费用中第3至5项费用由管理人根据有关法律法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付。</p> <p>（二）不列入集合计划费用的项目</p> <p>集合计划募集期间的费用，管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失，以及本集合计划成立前发生的费用和存续期间发生的与募集有关的费用等不列入本集合计划费用。</p>
	<p>不由集合计划承担的费用</p>	<p>集合计划募集期间的费用，管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或集合计划资产的损失，以及本集合计划成立前发生的费用和存续期间发生的与募集有关的费用等不列入本集合计划费用。</p>
<p>收益分配</p>		<p>（一）收益的构成</p> <p>本集合计划收益指集合计划利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额，集合计划已实现收益指集合计划收益减去公允价值变动收益后的余额。</p> <p>（二）可供分配收益</p> <p>可供分配收益指截至收益分配基准日（即可供分配收益计算截至日）资产负债表中集合计划未分配收益与未分配收益中已实现收益的孰低数。</p> <p>（三）收益分配原则</p> <p>1、收益采用现金分配或红利再投资方式，每位委托人获得的分红收益金额保留小数点后两位，第三位四舍五入。</p> <p>2、集合计划份额均享有同等分配权。</p> <p>3、计划收益分配基准日的单位净值减去每单位份额收益分配金额后不能低于初始面值。</p> <p>4、本集合计划的默认分红方式为现金分红，委托人可以选择现金分红或者红利再投资分红方式。选择采取现金分配的，管理人向托管人发送划付指令，托管人根据指令将收益分配划入注册登记机构，注册登记机构将收益分配款划入相应销售机构结算备付金账户，由销售机构划入委托人的交易账户，现金红利在R-7日内划转到委托人的交易账户；选择采取红利再投资方式的，分红资金按除权除息日的单位净值转成相应的集合计划单位。</p> <p>5、收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担。</p>

	<p>6、法律法规另有规定的从其规定。</p> <p>(四) 收益分配方案的确定与披露</p> <p>在满足分红条件时,管理人可根据本集合计划的运作情况决定分红事宜,具体分红事宜以管理人公告为准。本集合计划收益分配方案由管理人拟定,由托管人核实后由管理人报告委托人。管理人至少在分红日前将收益分配方案向委托人公告。</p>
<p>集合计划利益冲突情况</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>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>投资风险揭示</p>	<p>投资者投资于本集合计划可能面临以下风险,有可能因下述风险导致投资者本金或收益损失。本集合计划面临的风险包括但不限于以下风险:</p> <p>(一) 特殊风险揭示</p> <p>1、本集合计划为固定收益类,投资于标准化债权类资产比例不低于本集合计划资产总值的80%,除债券类资产面临的一般市场风险、信用风险、流动性风险外(详见本节第(二)条相关约定)。</p> <p>2、债券正回购投资风险</p> <p>本集合计划在投资过程中,可能会通过债券正回购交易等手段,增加投资组合的杠杆,以提升整体投资组合的预期收益,但与此同时也相应放大了投资组合的风险水平。</p> <p>本集合计划参与债券正回购时,用于融资回购的债券将作为托管人相关结算备付金账户偿还融资回购到期购回款的质押券,若管理人债券回购交收违约的,本集合计划存在质押券被中登公司处置的风险,从而可能给本集合计划收益带来不利影响。</p> <p>3、股票投资风险</p> <p>(1) 宏观经济风险、政策风险、上市公司经营风险</p> <p>上市公司的股票价格主要受国内外宏观经济、政策、上市公司经营情况的影响。若宏观经济、政策或者上市公司经营出现不利于股票价格上涨的情况,股票价格将下跌,从而影响本集合计划的收益,本集合计划投资者可能出现亏损。</p> <p>(2) 停牌风险</p> <p>若本集合计划的股票面临停牌,将导致本集合计划的流动性降低,极端情况下将无法及时兑付客户的赎回款。</p> <p>(3) 退市风险</p>

若本集合计划的股票面临退市，将会给本集合计划的投资收益带来极大影响，本集合计划投资者很可能出现亏损。

(4) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，而周期性的经济运行周期表现将对证券市场的收益水平产生影响，从而对收益产生影响。

4、本集合计划委托募集所涉风险

本集合计划委托其他销售机构销售本集合计划，若因该销售机构发生违法违规、销售资格被有关机构取消或者违反委托销售协议的其他事项，管理人将提前终止委托该销售机构销售，本集合计划将有委托销售提前终止的风险。

5、本集合计划份额转让所涉风险

本集合计划份额转让的受让人还应该符合本合同约定的合格投资者要求，若受让人不满足，则投资者面临份额转让失败的风险。

6、本集合计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形所涉风险

本集合计划未在基金业协会完成备案手续或不予备案情形，投资者将面临本集合计划提前终止的风险。

7、电子合同签约风险

本集合计划采用电子签名合同方式签订的，在合同签订过程中可能存在无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障等多种因素，造成数据的损坏、丢失，或造成电子合同无法及时签订，从而影响投资者的投资收益。电子合同签订后，投资者凭密码进行交易，投资者通过密码登陆后所有操作均将视同本人行为，如投资者设置密码过于简单或不慎泄露，可能导致他人在未经授权的情况下操作投资者账户，给投资者造成潜在损失。

8、合同变更风险

(1) 默认处理风险。本合同中约定，投资者未在公告规定时限内回复意见或回复意见不明确，且未在特别开放期内办理退出手续的，视为投资者同意合同变更，在此情况下，投资者对默认情况的忽略或误解、部分投资者因未能提供有效联系方式或者未能将变动后的联系方式及时通知管理人等，可能存在潜在风险。

(2) 强制退出风险。本合同中约定，“对于明确答复不同意合同变更但逾期未退出本集合计划的投资者，管理人有权在合同变更征询公告中说明的回复期限届满后，将其份额强制退出集合计划”，此种情况下投资者面临强制退出风险。

9、合同争议处理方式的风险

当相关当事人出现合同争议时，按照本合同的规定，因本合同引起的或与本合同有关的任何争议，由合同签署各方协商解决，协商不成的，合同签署各方一致同意将争议向中国国际贸易仲裁委员会提起仲裁。

在这种情况下，投资者将不能采用诉讼的方式解决相关争议，提请投资者注意此风险。

10、无法参与及退出的风险

(1) 投资者认购/申购申请需要经过注册登记机构确认，不符合认购/申购规则（比如最低参与金额为 30 万，最低追加参与为 10000 元）或当集合计划委托人达到 200 人上限时，投资者存在认购/申购申请失败的风险。

(2) 本集合计划开放时，若出现本合同第六章约定的拒绝或者暂停投资者退出的情况时，也会导致投资者不能及时退出的风险。

(二) 一般风险揭示

1、本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认（申）购资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本集合计划属于 R3 中风险投资品种，适合风险识别、评估、承受能力为 C3 稳健型、C4 积极型、C5 激进型的合格投资者和专业投资者。

2、市场风险

本集合计划投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险等。

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策和证券市场监管政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响，可能导致证券价格波动，从而影响收益。

(2) 经济周期风险

证券市场受宏观经济运行的影响，而经济运行具有周期性的特点，周期性的经济运行将对证券市场的收益水平产生影响，从而对本集合计划收益产生影响。

(3) 利率风险

利率风险是指由于利率变动而导致的资产价格和资产利息的损益。利率波动会直接影响企业的融资成本和利润水平，导致证券市场的价格和收益率的变动，使本集合计划的收益水平随之发生变化，从而产生风险。

(4) 购买力风险

投资者的利润将主要通过现金形式来分配，而现金可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使投资者的实际收益下降。

(5) 再投资风险

固定收益品种获得的本息收入或者回购到期的资金，可能由于市场利率的下降面临资金再投资的收益率低于原来收益率，从而对本集合计划产生再投资风险。

3、管理风险

本集合计划运作过程中，管理人依据本合同约定管理和运用本集合计划财产所产生的风险，由本集合计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

4、流动性风险

本集合计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，不能迅速转变成现金，或者转变成现金会对资产价格造成重大不利影响的的风险。

5、信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

6、募集失败风险

本集合计划的成立需符合相关法律法规的规定，本集合计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

管理人的责任承担方式：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在本集合计划募集期限届满（确认本集合计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

7、税收风险

本集合计划属契约式基金，其所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

8、关联交易风险

关联交易风险指本集合计划投资于管理人、托管人及与管理人、托管人有关联方关系的公

	<p>司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易，由于不正当的关联交易导致的道德风险、法律风险以及系统风险，而这些风险可能使本集合计划资产遭受损失。</p> <p>9、其他风险</p> <p>(1) 技术风险。在本集合计划的日常交易中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致投资者的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等；</p> <p>(2) 操作风险。管理人、托管人、证券交易所、证券登记结算机构等在业务操作过程中，因操作失误或违反操作规程而引起的风险；</p> <p>(3) 战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，将会严重影响证券市场的运行，可能导致本集合计划财产的损失，从而带来风险；</p> <p>(4) 管理人或托管人，因停业、解散、撤销、破产，或者被监管机构撤销相关业务许可等原因不能履行职责，可能给投资者带来一定的风险。</p>
<p>信息披露的内容、方式和频率</p>	<p>本集合计划信息披露应采用中文文本。如同时采用外文文本的，应保证两种文本的内容一致。两种文本发生歧义的，以中文文本为准。本集合计划信息披露的信息采用阿拉伯数字；除特别说明外，货币单位为人民币元。</p> <p>(一) 向投资者信息披露</p> <p>1、定期信息披露</p> <p>本集合计划定期信息披露内容包括本集合计划单位净值及累计单位净值、本集合计划的资产管理季度（年度）报告、资产托管季度（年度）报告。</p> <p>(1)、本集合计划单位净值及累计单位净值</p> <p>管理人于每个工作日通过管理人网站披露经过托管人复核的前一个工作日的本集合计划单位净值及累计单位净值。管理人披露的单位净值，作为本集合计划投资者参与、退出的价格标准。</p> <p>(2)、季度管理报告和年度管理报告</p> <p>管理人应当向投资者提供本集合计划季度管理报告和年度管理报告，披露报告期内本集合计划运作情况，年度管理报告内容包括但不限于下列信息：</p> <p>①管理人及托管人履职情况报告；</p> <p>②投资表现；</p> <p>③投资组合；</p> <p>④收益分配情况；</p> <p>⑤运用杠杆情况（如有）；</p> <p>⑥财务会计报告；</p> <p>⑦本集合计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；</p> <p>⑧投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项以及中国证监会规定的其他事项。</p> <p>管理人季度管理报告应当披露前述第⑥项之外的其他信息。</p> <p>季度管理报告由管理人在每季度向投资者提供一次。管理人应于每季度结束后1个月内通过管理人网站通告并向中国证监会相关派出机构和基金业协会备案。若本集合计划成立不足3个月或者存续不足3个月时，管理人可以不编制当期的季度报告。</p> <p>年度管理报告由管理人在每年度向投资者提供一次。其中，年度管理人报告中的年度财务会计报告应当经具有证券相关业务资格的会计师事务所审计，审计机构应当对本集合计划会计核算及净值计算出具意见。管理人应于每个会计年度结束后4个月内通过管理人网站通告并向中国证监会相关派出机构和基金业协会备案。若本集合计划成立不足3个月或者</p>

存续期间不足三个月的，管理人可以不编制当期的年度管理报告。

(3) 托管人履职报告

托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。

管理人应当在每季度结束后 20 日内向托管人提供其编制的季度报告、当期财务会计报告（如有）供托管人复核，托管人复核管理人季度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于 10 日内向管理人反馈复核意见。

管理人应当在每年度结束后两个月内向托管人提供其编制的年度报告、当期财务会计报告供托管人复核，托管人复核管理人年度报告、当期财务会计报告中的财务数据后，于一个月内向管理人反馈复核意见。

因本集合计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月，管理人未编制本集合计划当期的季度报告和年度报告的，托管人不编制当期托管人履职报告。

2、临时信息披露

本集合计划存续期间，发生对本集合计划持续运营、投资者利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应以管理人网站公告方式及时向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：

(1) 本集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资经理发生变更，或出现其他可能对本集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

(2) 本集合计划终止和清算；

(3) 本合同的修改与变更；

(4) 与本集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

(5) 集合计划投资于管理人、托管人及其关联方关系的公司发行或者承销期内承销的证券或其他重大关联交易；

(6) 管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

(7) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

(8) 管理人、托管人的法定名称发生变更；

(9) 管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划；

(10) 管理人自有资金参与或退出；

(11) 发生巨额退出或者连续巨额退出并延期支付；

(12) 负责本集合计划的销售机构发生变更；

(13) 份额持有人大会的召开和决议；

(14) 其他管理人认为需要披露的事项。

前述第 (1) 至第 (11) 条约定的情形属于重大事项的临时报告，管理人应当在事项发生之日起五日内向投资者披露，并及时报送中国证监会相关派出机构以及基金业协会。

3、本集合计划合同文本披露

本集合计划合同文本披露内容包括：《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理合同》及其有效修订版或补充、《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划说明书》及其有效修订版、《太平洋证券金元宝 10 号集合资产管理计划风险揭示书》及其有效修订版，管理人需在本集合计划发行前至少 1 个工作日内以及修订版或者补充生效之后，通过管理人网站披露。

	<p>(二) 向监管信息披露</p> <p>管理人、托管人应当根据《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等法律法规及本合同约定的报告种类、内容、时间和途径，向基金业协会备案并向中国证监会相关派出机构报送，报送的情形包括但不限于：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、分管管理人资产管理业务的高级管理人员、资产管理业务部门负责人以及本集合计划投资经理离任；管理人应当立即对其进行离任审查，并自离任之日起三十个工作日内将审查报告报送中国证监会相关派出机构和基金业协会。 2、管理人进行年度审计应同时对资产管理业务内部控制情况进行审计，并在每年度结束之日起四个月内将前述审计结果报送中国证监会及相关派出机构、基金业协会。 3、管理人应当建立对销售机构履职情况的监督评估机制，发现违法违规行为的，应当及时更换并报告中国证监会相关派出机构和基金业协会； 4、管理人应当建立健全应急处理机制，对发生延期兑付、负面舆论、群体性事件等风险事件的处理原则、方案等作出明确规定，并指定高级管理人员负责实施。出现重大风险事件的，应当及时向中国证监会及相关派出机构、基金业协会报告。 5、托管人应当监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者本合同约定的，应当拒绝执行，并向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告； 6、法律法规规定和本合同约定的应向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告的其他事项。
集合计划展期	本集合计划存续期满后不进行展期
终止和清算	<p>(一) 有下列情形之一的，集合计划应当终止：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、管理人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格的或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的管理人承接； 2、托管人因重大违法、违规行为，被监管机构取消业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接； 3、存续期内，连续5个工作日集合计划委托人少于2人时； 4、本集合计划委托人、管理人、托管人一致同意提前终止本计划时； 5、存续期届满； 6、本集合计划跌破平仓线以及其他本合同约定的应当终止的情形； 7、本集合计划在中国基金业协会备案未通过； 8、法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。 <p>管理人应当自本合同终止之日起五个工作日内报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构。</p> <p>(二) 集合计划的清算</p> <p>自本集合计划发生终止情形之日起5个工作日内成立清算小组并对本集合计划财产进行清算。</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、本集合计划财产清算小组 <ol style="list-style-type: none"> (i) 本集合计划财产清算小组组成 <p>本集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师组成，清算小组还可聘用必要的工作人员。本集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行本集合计划清算。</p> <ol style="list-style-type: none"> (2) 本集合计划财产清算小组职责 <p>清算小组负责本集合计划财产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法进行必要的民事活动。</p>

	<p>2、本集合计划财产清算的程序</p> <p>(1) 出现本合同约定的终止情形时，由清算小组统一接管；</p> <p>(2) 对本集合计划财产和债权债务进行清理和确认；</p> <p>(3) 对本集合计划财产进行估值和变现；</p> <p>(4) 制作清算报告，聘请会计师事务所对清算报告进行审计；</p> <p>(5) 将清算报告报送中国证监会相关派出机构和基金业协会并在管理人网站公告；</p> <p>(6) 对剩余财产进行分配。</p> <p>3、清算费用</p> <p>清算费用是指清算小组在进行清算过程中发生的所有合理费用，包括但不限于清算审计费等，清算费用由清算小组从本集合计划财产中支付。</p> <p>4、本集合计划财产清算及剩余资产的分配</p> <p>依据清算分配方案，清算小组将本集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除清算费用、交纳所欠税款并清偿本集合计划债务后，按投资者持有的份额比例以货币资金的形式进行分配。</p> <p>5、延期清算处理方式</p> <p>若本集合计划财产存在流动性受限等情形，管理人可以延迟清算并及时向中国证监会相关派出机构和基金业协会报告。管理人和托管人一致同意，本集合计划延期清算期间不收取管理费和托管费。在进行延迟清算的变现过程中，变现的资金以现金形式保存，不得再进行投资。在支付相关费用（如有）后按本集合计划的投资者持有的份额比例进行再次分配并履行相应的告知义务，直至所有流动性受限资产全部清算完毕。</p> <p>6、本集合计划财产清算报告的告知安排</p> <p>清算过程中的有关重大事项须及时公告；管理人应当在本集合计划清算结束后5个工作日内将清算结果报基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构并及时在管理人网站公告。</p>
特别 说明	本说明书作为《管理合同》的重要组成部分，与《管理合同》具有同等法律效力。