

## 关于《太平洋证券金添利1号集合资产管理计划集合资产管理合同 (2019年3月修订)》第二次变更的征询函

尊敬的投资者：

管理人、托管人双方已签署了《太平洋证券金添利1号集合资产管理计划集合资产管理合同（2019年3月修订）》《〈太平洋证券金添利1号集合资产管理计划资产管理合同（2019年3月修订）〉之补充协议》（以下并称《原合同》）。为使太平洋证券金添利1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，本次变更内容为产品投资范围、投资比例、投资限制、投资禁止、投资策略、参与及退出安排、预警线和平仓线、利益冲突、自有资金参与、业绩提成、估值方法、合同的变更、展期、终止及清算等，具体条款详见附表或以我司网站挂网的《太平洋证券金添利1号集合资产管理计划资产管理合同（2025年12月）》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投资者意见。本次合同变更征询意见截止日为2026年1月26日。为了保障不同意本次合同变更的投资者退出本集合计划的权利，管理人安排2026年1月26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2026年1月27日强制赎回您持有的所有份额（赎回价格为2026年1月26日本集合计划单位净值）。

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

退出手续的投资者，视为同意本合同变更。

三、本集合计划说明书将同步进行变更。

四、请您在“关于《太平洋证券金添利1号集合资产管理计划集合资产管理合同（2019年3月修订）》第二次变更的征询函回函”中做出意见表示。感谢您的支持与配合。

特此公告。



太平洋证券股份有限公司

2026年1月21日

关于《太平洋证券金添利1号集合资产管理计划集合资产管理合同  
(2019年3月修订)》第二次变更的征询函回函

请投资者根据以上内容作出意见表示：

同意合同变更之投资者，请于“同意合同变更”栏签字或盖章；不同意合同变更之投资者，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      | 投资者签字/盖章 |
| 同意合同变更  |          |
| 不同意合同变更 |          |
| 时间      | 年 月 日    |

投资者姓名：

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<br>对照表 | 变更前                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 变更后                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
|-------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资范围        | <p>本集合计划投资于标准化资产，具体如下：</p> <p>（1）固定收益类资产占本集合计划资产总值的比例不得低于80%，包括但不限于银行存款、同业存单、债券型公募基金（含债券型分级公募基金、可转债公募基金）、货币型公募基金以及以及在证券交易所或银行间市场交易的标准化债权类资产：国债、地方政府债券、金融债（含政策性金融债）、企业债、公司债（含非公开公司债）、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债、混合资本债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具、债券逆回购等标准化债权类资产。</p> <p>（2）债券正回购。</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，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p> <p>管理人拟实施上述未明确列示投资品及其他本合同签署后市场新增交易品种的投资的，应于开始实施投资前与托管人就此类新增投资品的会计核算、估值、清算、监督、系统支持等达成一致。</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（PPN）、资产支持票据（ABN，非次级）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）债券正回购。</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> |
| 投资比例        | 无                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             | <p>（1）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）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>(3) 本集合计划总资产占净资产比例不得超过200%;</p> <p>(4) 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>(5) 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。</p>                                                                                    |
| 投资比例超限的处理方式 | <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合同约定的投资比例的, 管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的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。资产托管人对于上述1、2条投资限制不予监控, 但是法律法规有规定的除外。</p>                                               | <p>因证券市场波动、证券发行人合并、本集合计划规模变动等管理人之外的因素, 造成本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的, 管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十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报告。</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;</p> <p>(2) 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>(3) 集合计划参与债券、可转换公司债券、可交换公司债券等证券</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) 集合计划参与债券、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) 投资于短期融资券、超短期融资券及其他债项评级采用短期债券信用等级评级的信用债, 如有债项评级应为 A-1及以上, 无债项评级的, 如有担保, 担保人的主体评级应为 AA (含) 以上, 若无担保人, 则主体评级应为 AA (含) 以上; 除前述之外的信用债 (不含可转债、可交换债) 信用评级应为 AA (含) 以上, 信用评级</p> |

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |                                                                                                                                                                                            |
|------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | <p>发行申购时,申报的金额不得超过集合计划的总资产,申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量;</p> <p>(4) 应投资于短期融资券债项评级为 a-1 级及以上;</p> <p>(5) 应投资于长期债券债项评级为 AA- 以上 (含 AA-), 若无债项评级, 需主体评级满足 AA- (含) 以上, 且对中债资信评估有限公司评级信息不予参考;</p> <p>(6) 本计划的总资产占净资产的比例不得超过 200%。本集合计划参与债券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%, 否则管理人应向相关金融监管部门报告;</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。</p> <p>(8) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</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合同约定的投资比例的, 管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 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。资产托管人对于上述 1、2 条投资限制不予监控, 但是法律法规有规定的除外。</p> | <p>认定标准: 对于有担保的债券, 以担保人主体评级为准; 对于无担保的债券, 以债项评级为准; 对于无担保且无债项评级债券, 以主体评级为准; 以上所有评级对中债资信评估有限责任公司评级信息不予参考。</p> <p>(3) 本集合计划投资的可转债、可交换债券不得进行转股或换股操作;</p> <p>(4) 证券法规规定和集合计划管理合同约定禁止从事的其他投资。</p> |
| 投资禁止 | <p>本集合计划的禁止行为包括:</p> <p>(1) 违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       | <p>集合计划的禁止行为包括:</p> <p>(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</p>                                                                                                                               |

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | <p>担保等用途；</p> <p>(2) 将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；</p> <p>(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；</p> <p>(4) 挪用集合计划资产；</p> <p>(5) 募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；</p> <p>(6) 募集资金超过计划说明书约定的规模；</p> <p>(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；</p> <p>(8) 使用集合计划资产进行不必要的交易；</p> <p>(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；</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，则应承担因此给委托人和本计划财产造成的损失。</p> | <p>监会、基金业协会另有规定的除外；</p> <p>(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；</p> <p>(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> <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> |
| 投资决策 | <p>资产管理投资决策委员会负责对管理人所管理的资管产品的投资运作进行决策管理，具体职责包括：分析判断宏观经济、证券市场走势，对资产管理业务的投资方向、仓位控制、投资策略等提出总体意见；审核资产管理产品的资产配置方案；审核投资经理拟定的投资策略、月度投资总结和重大项目投资计划书；确定证券池入池品种的选择原则及其品种调整；对投资经理做出投资授权；对资产管理产品的运作及绩效状况进行业绩评估等。</p> <p>投资经理具体负责资产管理计</p>                                                                                                                                                                            | <p>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>划的日常投资和管理，具体职责包括：在投资决策委员会的授权范围内，负责所管理的资产管理产品的日常投资运作、风险管理；制定资产管理产品的整体投资策略报告及每月投资策略报告，报资产管理投资决策委员会审批；按照资产管理投资决策委员会批准的投资策略报告，制定和执行资产管理产品投资组合方案并下达日常交易指令；每月对投资组合方案的执行情况以及业绩表现进行总结，向资产管理投资决策委员会提交《投资总结报告》；根据资产管理产品参与、退出状况及市场情况的变化，调整投资组合、控制流动性风险和市场风险；参与证券池维护；撰写资产管理业务公开报告中关于管理资产的投资运作的部分；积极参与资产管理业务的重要客户的沟通及演示等。</p> |                                                                                                                                                                                                                         |
| 参与时间 | <p>自本集合计划建仓期结束后，每周一（如周一为非工作日则当周不开放申购）开放申购以及自建仓期结束之日起每满90天后的最近一个周一开放赎回，如遇该周一为非工作日或者管理人认为有必要调整的情况，则该赎回日顺延，具体以管理人网站公告为准。</p>                                                                                                                                                                                           | <p>开放参与日：本集合计划在本次合同变更生效日当日开放申购，之后每周一开放申购（如周一为非工作日则当周不开放申购），具体以管理人公告为准。</p> <p>开放退出日：本集合计划每月第一个周一为开放退出日，如果遇到该日为非工作日则顺延至下一个周一。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。</p> |
| 退出时间 | <p>投资者可在自建仓期结束之日起每满90天后的最近一个周一办理退出申请业务，如遇该周一为非工作日或者管理人认为有必要调整的情况，则该赎回日顺延，具体以管理人网站公告为准。</p>                                                                                                                                                                                                                          | <p>对于投资者每笔份额，其持有期须满90天（含90天）才能在开放退出日申请退出。对于持有期不满90天的份额申请退出的，销售机构或管理人有权拒绝该等份额的退出申请。每笔份额持有期为该笔份额申购确认日（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。</p>                                                                 |

|         |                                                                                                                       |                                                                                                                                                                                                                                         |       |                                                                                                                                                                                            |      |        |   |                |  |  |
|---------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------|--------|---|----------------|--|--|
|         |                                                                                                                       | <p>天数。</p> <p>但以下情形下，投资者选择退出可不受份额持有期限限制：</p> <p>（1）投资者在临时开放日申请退出；</p> <p>（2）管理人在某个开放退出日前调低业绩报酬计提基准或者调高业绩报酬计提比例，投资者在该开放退出日申请退出的。</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。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> |       |                                                                                                                                                                                            |      |        |   |                |  |  |
| 参与金额    | <p>首次参与的最低金额为人民币300,000元，非首次参与的最低金额为人民币10,000元。</p>                                                                   |                                                                                                                                                                                                                                         |       | <p>投资者在本集合计划存续期开放参与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参与日追加参与本集合计划的除外。管理人有权以管理人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> |      |        |   |                |  |  |
| 退出费     | <table><tr><td>持有期（P）</td><td>P&lt;90天</td><td>P≥90天</td></tr><tr><td>退出费率</td><td>0.5%/笔</td><td>0</td></tr></table> | 持有期（P）                                                                                                                                                                                                                                  | P<90天 | P≥90天                                                                                                                                                                                      | 退出费率 | 0.5%/笔 | 0 | <p>退出费率：0%</p> |  |  |
| 持有期（P）  | P<90天                                                                                                                 | P≥90天                                                                                                                                                                                                                                   |       |                                                                                                                                                                                            |      |        |   |                |  |  |
| 退出费率    | 0.5%/笔                                                                                                                | 0                                                                                                                                                                                                                                       |       |                                                                                                                                                                                            |      |        |   |                |  |  |
| 退出份额    | <p>委托人退出时按份额退出集合计划，每次退出最低份额为1万份，委托人可申请将其持有的部分或全部集合计划份额退出，次数不限。</p> <p>因委托人部分退出，导致委托人持有资产净值小于30万元时，该部分份额将被全部强制退出。</p>  |                                                                                                                                                                                                                                         |       | <p>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>                                                            |      |        |   |                |  |  |
| 预警线和止损线 | <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个交易日内调整持仓，使得本计划债项评级 AA-类的债券资产持仓比例不得高于本计划资产净值的20%。</p>              |                                                                                                                                                                                                                                         |       | <p>删除</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。</p> <p>预警线、平仓线由管理人负责监控，托管人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，管理人在履行合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 利益冲突 | <p>(一) 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>(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</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）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</p> |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>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>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,具体管理人关联方名单以管理人官网或者证券交易所网站定期公开披露的半年报、年报为准;</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(托管人关联方名单以中国工商银行股份有限公司(股票代码: 601398) 公开披露的最新报告中股东变动、主要股东持股情况、财务报表附注等章节涉及的关联方为准);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。</p> <p>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><b>2、关联交易的区分标准</b></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本集合计划净资产的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</p> |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>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。</p> <p>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</p> |
|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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。

#### (2) 重大关联交易处理方式

管理人以本集合计划的资产从事重大关联交易的，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。

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，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），退出金额需根据本合同约定扣除业绩报酬（如有）；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。

#### 6、关联交易披露方式、披露内容

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。

(1) 临时公告：管理人以本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

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 | <p>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>                                                                                                                                                                                                             |
| 自有资金参与 | <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15%。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，应提前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>1、自有资金参与、退出的条件和方式</p> <p>管理人及其子公司（含孙公司）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、自有资金参与金额和比例</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。

(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(二)款、第(三)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。

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。

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),退出金额需根据本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。

4、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。

5、自有资金收益分配和责任承担方式

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | <p>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。</p> <p>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>                                                                                                                                                      |
| 估值方法 | <p>估值应符合本合同、《证券公司客户资产管理业务规范》中的估值原则、《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》、及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得，合同另有约定的除外。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。</p> <p>本产品按以下方式进行估值：</p> <p>1、回购交易成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计算利息；</p> <p>2、投资固定收益品种的估值方法</p> <p>（1）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。</p> <p>（2）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；估值日无交易的，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</p> | <p>自本次合同变更生效日起，按照本合同约定的估值方法进行估值，不对本次合同变更生效日之前的估值进行追溯调整。</p> <p>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。</p> <p>1、固定收益品种估值方法</p> <p>（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。</p> <p>（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，回售登记日截止日（含当日）后未行使回售权的</p> |

境发生了重大变化的,可参考监管机构和行业协会估值意见,或者参考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。

(3) 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;估值日无交易的,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,可参考监管机构和行业协会估值意见,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。

(4) 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。

(5) 对于只在上交所固定收益平台或者深交所综合协议平台交易的债券,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。

(6) 在对银行间市场的固定收益品种估值时,采用中央国债登记结算有限责任公司中债估值数据查询系统中公布的当日最新中债估值净价为准估值。如有充足证据表明该价格不能真实地反映公允价值的,应主要依据中央国债登记结算有限责任公司公布的收益率曲线及估值价格。

(7) 对在银行间市场上市交易的资产支持证券,应主要依据中央国债登记结算有限责任公司公布的收益率曲线及估值价格估值。对未在银行间市场上市交易且中债登公司未提供价格的,按成本估值。对在交易所上市的资产支持证券品种,按市价法估值,鉴于其交易不活跃,可采用

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、可交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。估值日无交易,且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,按最近交易日的估值全价确定公允价值;估值日无交易,且最近交易日后发生影响公允价值计量的重大事件的,应参考类似投资品种的现行价格及重大变化因素,调整最近交易日的估值全价确定公允价值。

非公开发行的上述债券,使用第三方估值机构(中证估值)提供的当日的估值全价进行估值。

(4) 交易所市场发行未上市或未挂牌转让的固定收益品种,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据或其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

(5) 全国银行间市场上不含权的固定收益品种(含同业存单),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,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据或其他信息支持的估值技术确定其公允价

最近交易日的收盘价。

### 3、投资证券投资基金的估值方法

(1) 持有的交易所上市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)), 按估值日前一交易日的基金份额净值估值; 估值日前一交易日, 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及理财债券基金, 按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益计提红利;

(4) 持有的基金处于封闭期的, 按照最新公布的份额净值估值; 没有公布份额净值的, 按照成本估值。

### 4、存款的估值方法

持有的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。

5、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的, 管理人可根据具体情况, 在与托管人商议后, 按最能反映资产公允价值的方法估值。

值。

### 2、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) 以及上市交易型货币市场基金除外), 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), 以估值日前一交易日的基金份额净值估值, 该日未公布净值的, 以最近公告的基金份额净值计算。

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 (非货币基金), 以估值日前一交易日的基金份额净值估值, 该日未公布净值的, 以最近公告的基金份额净值计算。

(3) 持有的货币市场基金, 按前一估值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, 则按所投资基金前一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, 若所投资基金与本集合计划频率一致但未公布估值日基金份额净值/每万份收益, 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。

3、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。

4、持有的债券回购以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。

5、估值计算中涉及港币等其他货币对人民币汇率的，将依据下列信息提供机构所提供的汇率为基准：当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币对主要货币的中间价或其他能反映公允价值的汇率。

6、在任何情况下，管理人如采用以上规定的方法对受托财产进行估值，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。

7、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。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|  | <p>(三) 业绩报酬</p> <p>本集合资产管理计划业绩报酬计入管理费。</p> <p>1、业绩报酬计算方法</p> <p><math>R \leq r_i</math>, 管理人业绩报酬=0;</p> <p><math>r_i &lt; R</math>, 管理人提取超额部分的60%作为管理人业绩报酬, 余下40%归委托人所有。</p> <p>其中, <math>R</math> 为委托人每笔份额持有期年化收益率; <math>r_i</math> 具体以管理人公告为准。业绩报酬计提基准变更频率不得超过每6个月一次。业绩报酬计提基准测算依据和测算过程等信息将在管理人网站公告中明确。</p> <p>业绩报酬计提基准仅供委托人参考, 不构成管理人对委托人保本保收益承诺。</p> $R = \frac{(P_1 - P_0)}{P_0} \times \frac{365}{D} \times 1$ <p><math>P_1</math> 为本次业绩报酬计提日的计划单位累计净值;</p> <p><math>P_0</math> 为上一个业绩报酬计提日(本次业绩报酬计提起始日)的计划单位累计净值;</p> <p><math>P_0^*</math> 为上一个业绩报酬计提日的计划单位净值;</p> <p><math>D</math> 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, 如果不存在上一业绩报酬提取日, 则募集参与的份额的上一业绩报酬提取日为本计划成立日或者存续期参与的份额的上一业绩报酬提取日为参与申请日, 若管理人于某个业绩报酬计提日未实际计提业绩报酬(即业绩报酬为0), 则该日仍然作为管理人下一次业绩报酬计提起始日;</p> <p>管理人业绩报酬计提如下:</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 <math>X\%</math> (但 <math>X\%</math> 最高不得超过60%) 且有权在本集合计划每个开放退出日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退出频率相匹配, 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退出日的间隔时间。</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)。即以份额持有人单笔份额期间收益为基数, 按比例提取, 具体提取比例如下:</p> <p>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), 管理人不得提取业绩报酬; 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 <math>X\%</math> 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。</p> |

| 持有期<br>年化收<br>益率(R) | 计提<br>比例 | 业绩报酬<br>(Y)的计<br>提公式                               |
|---------------------|----------|----------------------------------------------------|
| $R \leq r_i$        | 0        | $Y=0$                                              |
| $R > r_i$           | 60%      | $Y=A \times (R-r_i) \times 60\% \times D \div 365$ |

$Y$  = 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。

## 2、业绩报酬计提

(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收益分配日（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) 管理人业绩报酬提取频率不得超过每6个月一次。但因投资者退出集合计划提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限制。

## 3、业绩报酬支付

业绩报酬由管理人计算，支付业绩报酬时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。托管人对业绩报酬不承担复核义务。

在分红日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红款中扣除，当分红金额不足以扣除业绩报酬时，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：

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

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

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

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

$$H_i = 0;$$

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

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  $i$  笔集合计划份额期间业绩报酬计提基准， $\sum_{t=1}^n \frac{r_{it}}{365}$  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；

$r_{it}$  为该份额持有人本次赎回/分红

|  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  | <p>对应的第 <math>i</math> 笔集合计划份额对应持有第 <math>t</math> 天的业绩报酬计提基准（年化）；</p> <p><math>n-m</math> 为该份额持有人本次赎回/分红对应的第 <math>i</math> 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><math>n</math> 为该份额持有人本次赎回/分红对应的第 <math>i</math> 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><math>m</math> 为该份额持有人本次赎回/分红对应的第 <math>i</math> 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><math>NAV'_i</math> 为本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值；</p> |
|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|       |                                                                                                                               |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|-------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|       |                                                                                                                               | <p><math>NAV'_{i5}</math>为上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值;</p> <p><math>NAV_{i5}</math>为上一个业绩报酬计提基准日的份额净值;</p> <p><math>N_i</math>为该份额持有人本次赎回/分红对应的第<i>i</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个交易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:<br/>户 名: 太平洋证券股份有限公司<br/>账 号: 2502011009027306844<br/>开户银行: 中国工商银行昆明市南屏支行<br/>大额支付号: 102731002031</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> |
| 合同的变更 | <p>1、本合同生效后, 因法律、法规、规章、中国证监会的规定、证券登记结算机构业务规则以及证券交易所等交易规则修订, 自该修订生效之日起, 本合同相关内容及条款按该修订办理并在管理人网站公告。委托人特此授权管理人经与托管人协商, 可以对本集</p> | <p>1、非因监管规则变化, 需要变更本合同的, 可以按照以下三种方式之一进行变更:</p> <p>(1) 全体投资者、管理人和托管人协商一致后, 可以通过签署补充协议或者修订本合同形式对本合同内容进行变更。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

合计划合同及说明书与新的法律法规或有关政策不一致的内容进行更新或修改，更新或修改的内容不得违反法律法规和中国证监会的有关规定，更新或修改的内容在管理人网站公告满5个工作日后生效。委托人对更新或修改的内容有异议，可在更新或修改内容生效前按照本合同的规定申请退出本集合计划。

2、除上述1所述情形外，为了委托人的利益，管理人和托管人经书面达成一致后可以变更合同，并在管理人网站公告。管理人须在公告后5个工作日内以书面或者管理人网站公告方式（由管理人决定）向委托人发送合同变更征询意见函。委托人不同意变更的，应在征询意见函中约定的特别开放日提出退出本集合计划的申请；意见答复不同意变更且逾期未退出的，管理人有权在期限届满后将相关份额强制退出计划；逾期未退出且未意见答复的，视同委托人同意本合同变更（但涉及本集合计划的投向和比例修改，需取得委托人的书面同意，不允许默许）。自合同变更生效之日起，公告内容即成为本合同组成部分。

委托人同意并确认，若经全体委托人、管理人、托管人一致同意达成书面补充协议的，亦可将补充协议视为对本合同的有效变更。

3、合同变更后，委托人、管理人和托管人的应当按照变更后的合同行使相关权利，履行相应义务。

4、委托人同意，管理人经与托管人书面达成一致后依据本合同的规定采取的合同变更行为均不应被视为或裁定为管理人或托管人的违约行为。

5、委托人、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除委托人自行承担投资风险和损失。

6、管理人应当自资产管理合同变

(2)管理人、托管人双方先就本合同拟变更事项书面达成一致，然后管理人以管理人网站公告或其他约定披露方式向投资者发布变更征询函。如投资者对变更事项有异议，可在管理人设置的临时开放期申请赎回全部份额〔不受本合同有关最低持有期（如有）或退出费（如有）的约束〕，退出本集合计划。对于明确答复不同意本合同变更但逾期未全部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的下一个工作日，将其份额强制退出本集合计划，退出价格为强制赎回日前一工作日的本集合计划的单位净值，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，视为投资者同意本合同变更，但本合同投向和比例变更后导致本集合计划产品类型发生变化的，必须事先得到投资者的书面同意，不允许默示同意。

如未全部赎回的投资者数不少于2人的，则该等变更内容于管理人公告确认的生效日发生法律效力。

同意变更的投资者无需就合同变更与管理人、托管人另行签署变更后的合同或关于合同变更的补充协议，经管理人公告的合同变更内容自变更生效时起自动成为变更后合同的组成部分。合同变更后，投资者、管理人和托管人应当按照变更后的合同内容行使相关权利，履行相应义务。

(3)管理人单方变更。管理人有权单方变更本合同的情形如下：

A、变更投资经理。

B、延长或缩短初始募集期。

C、本集合计划认购、参与、退出、非交易过户的原则、时间、业务规则的变更。

更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。

D、业绩报酬计提基准和比例变更、管理费率降低。

E、调低其他费率等对投资者利益无实质性不利影响的相关事项。

F、本合同的变更对投资者利益无实质性不利影响。

G、本合同当事方约定的管理人有权单独变更本合同的其他情形。

上述情形下变更合同无需取得投资者同意，但管理人应当通过管理人网站公告或其他约定披露方式向投资者披露变更的具体内容，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。

本集合计划改变投资范围和投资比例的，应当按照本条（1）或（2）方式事先取得投资者同意。

若本条款中变更内容涉及托管人履职的（具体包括：业绩报酬计提基准和比例变更、调低管理费率、调低其他费率等对投资者利益无实质性不利影响的相关事项等），管理人应不晚于该等变更生效日以邮件或者双方协商一致的其他形式告知托管人。

2、因监管规则变化，需要变更本合同的，管理人可以与托管人协商后修改本合同（但此情形下涉及本合同投向和比例变更的，应当事先取得投资者同意，并按照以上第1条条款约定履行合同变更程序），并由管理人于与托管人协商一致并达成书面协议后的5个工作日内在管理人网站公告变更的具体内容和合同变更生效时间，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。

管理人须在变更生效日之前设置临时开放期，如投资者对变更事项有异议，可在管理人设置的临时开放期申请赎回全部份额，退出集合计划；未在临时开放期内全部赎回份额的投资者视为同意变更。如未全部赎回的投资者数不少于2人的，则该等

|         |                                |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|---------|--------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         |                                | <p>变更内容于管理人公告确认的生效日发生法律效力，该等生效公告自公告之日起构成本合同组成部分。</p> <p>3、投资者、管理人、托管人不得通过签订补充协议、修改合同等任何方式，约定保证集合计划资产投资收益、承担投资损失，或排除投资者自行承担投资风险和损失。</p> <p>4、本合同发生变更的，管理人应当自本合同变更生效之日起5个工作日内报基金业协会备案。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 集合计划的展期 | <p>本集合资产管理计划存续期届满终止，无展期安排。</p> | <p>1、本集合计划展期应符合以下条件：</p> <p>(1) 本集合计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和本合同的约定；</p> <p>(2) 本集合计划展期没有损害投资者利益；</p> <p>(3) 本集合计划展期应当符合本集合计划的成立条件；</p> <p>(4) 中国证监会规定的其他条件。</p> <p>投资者、管理人和托管人各方应按照本合同约定执行展期程序。</p> <p>2、展期的安排</p> <p>(1) 展期的时间</p> <p>不晚于本集合计划到期前30日。</p> <p>(2) 展期的方式</p> <p>在符合法律法规及本合同约定的展期条件下，管理人可采用如下两种方式之一进行展期：</p> <p>①参考本合同约定的合同变更程序，以修改合同条款的形式直接对本合同期限进行调整展期。</p> <p>②管理人将通过管理人网站通告投资者。</p> <p>投资者应当在收到管理人通告后，在管理人通告的时间内以书面或管理人约定的其他方式明确意见。</p> <p>若投资者不同意展期，投资者有权在存续期届满日前在管理人通告的时间内(含届满日)到销售机构办理退出手续。若投资者书面提出不同</p> |

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|---------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | <p>意展期但未在存续期届满日前管理人通告的时间内(含届满日)到销售机构办理退出手续,则管理人有权将其份额强制退出。若投资者未在管理人约定的时间内明确意见也未申请退出的,则可视为投资者同意管理人的展期安排。</p> <p>3、展期的实现</p> <p>如果同意本集合计划展期的投资者人数不少于2人且满足本节第(三)条第1款约定的条件,则本集合计划存续期将依法展期并由管理人发布相关展期公告,该等展期公告自管理人公告之日起生效并构成本合同组成部分;否则本集合计划展期失败,管理人将按照本合同约定办理终止和清算事宜。</p>                                                                                                                                            |
| 集合计划的终止 | <p>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;</p> <p>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;</p> <p>3、存续期内,连续5个工作日集合计划委托人少于2人时;</p> <p>4、本集合计划在证券投资基金业协会备案未通过;</p> <p>5、本集合计划存续期届满;</p> <p>6、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;</p> <p>7、本集合计划跌破平仓线;</p> <p>8、战争、自然灾害等不可抗力事故的发生导致本集合计划不能存续;</p> <p>9、法律、法规规定或本合同约定的其他情况。</p> <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>1、有下列情形之一的,本集合计划应当终止:</p> <p>(1) 本集合计划存续期届满且不展期的;</p> <p>(2) 经全体投资者、管理人、托管人协商一致决定终止的;</p> <p>(3) 管理人被依法撤销资产管理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;</p> <p>(4) 托管人被依法撤销基金托管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;</p> <p>(5) 持续五个工作日投资者人数少于2人的,但为投资者利益角度出发,管理人有权决定在本集合计划人数少于2人时立即终止本集合计划;</p> <p>(6) 如在本集合计划的开放赎回申请日剩余未申请赎回的客户数少于2人的,则管理人有权从公平角度出发,在下个交易日对剩余未申请赎回的客户做强制赎回以结束本集合计划;</p> <p>(7) 本集合计划未在基金业协</p> |

|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
|---------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | <p>会完成备案；</p> <p>(8) 法律、行政法规、中国证监会规定以及本合同约定的其他情况。</p> <p>管理人应当自本集合计划终止之日起五个工作日内报基金业协会备案前述第(7)项约定情形除外。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 集合计划的清算 | <p>1、自集合计划终止之日起5个工作日内由管理人开始组织清算本集合计划财产,管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费及管理业绩报酬后,将清算后的剩余财产按照委托人拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定,以货币资金的形式全部分配给委托人,并注销集合计划专用证券账户和资金账户。</p> <p>2、清算过程中有关重大事项应当及时公布。</p> <p>3、管理人应当在本计划清算结束后5个工作日将清算结果报证券投资基金业协会备案,并抄送中国证监会相关派出机构。管理人于清算结束后15个工作日内在管理人网站公布清算结果。</p> <p>4、若本计划终止日因委托财产流动性受限等原因延期清算的,管理人应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。同时,管理人针对该部分流动性受限资产制定延期清算方案。管理人于前述流动性受限资产变现后并扣除相关费用后,将剩余清算财产按照委托人拥有份额的比例或者集合资产管理合同的约定,以货币形式全部分配给委托人,并注销集合计划专用证券账户和资金账户。在进行延期清算的变现过程中,变现的资金以现金保存,不得再进行投资。管理人和托管人同意本计划延期清算期间不再收取管理费和托管费。</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> <p>1、本集合计划财产清算小组</p> <p>(1) 本集合计划财产清算小组成员</p> <p>本集合计划财产清算小组成员由管理人、托管人组成,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> <p>(2) 本集合计划财产清算小组职责</p> <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</p> |

#### 资产的分配

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原则上以货币资金的形式进行分配。

#### 5、延期清算处理方式

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。在进行延期清算的变现过程中，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。

#### 6、本集合计划财产清算报告的告知安排

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个工作日内将清算报告报基金业协会备案，并及时在管理人网站公告。

#### 7、账户注销安排

本集合计划财产清算完毕后，应对本集合计划运作中开立的相关账户及时办理销户，管理人、托管人根据法律法规、本合同规定执行。

##### （1）本集合计划托管账户的销户

托管账户的销户需在本集合计划证券账户、债券账户、期货账户等交易类账户销户完成后方可进行，由管理人根据托管人要求提供相应材料后（如需）办理，销户流程需符合《人民币银行结算账户管理办法》以及中国人民银行、国家金融监督管理总局的其他规定。

##### （2）本集合计划证券账户的销

|          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|----------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|          | <p>户</p> <p>由托管人、管理人根据《中国证券登记结算有限责任公司特殊机构及产品证券账户业务指南》规定的流程并向中国证券登记结算有限责任公司提交材料申请销户。</p> <p>(3) 本集合计划债券账户的销户</p> <p>管理人、托管人根据中国人民银行、中央国债登记结算有限责任公司和银行间市场清算所股份有限公司规定的流程进行销户。</p> <p>(4) 基金账户的销户</p> <p>管理人应当根据投资基金的注册登记人要求办理基金账户的销户流程。</p> <p>(5) 其他账户的销户</p> <p>根据相关法律法规和本合同的规定，经管理人与托管人进行协商后办理其他账户（如有）的销户。</p> <p>8、本集合计划财产清算账册及文件的保存</p> <p>本集合计划财产清算账册及有关文件由管理人自本集合计划终止日起保存20年以上。</p> |
| 其他补充说明事项 | 上述各项变更表述以《太平洋证券金添利1号集合资产管理计划资产管理合同（2025年12月）》为准。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |