

# 太平洋证券本金保障型指数挂钩收益凭证 金鲨1号 产品说明书

特别提示：

本说明书依据《证券公司柜台市场管理办法（试行）》、《证券公司开展收益凭证业务规范（试行）》及其他有关规定制作，发行人承诺本说明书的内容真实、准确、完整，不存在任何虚假内容、误导性陈述和重大遗漏。

投资者承诺以真实身份认购收益凭证，保证认购资金的来源及用途合法，并已阅知本说明书和《收益凭证认购协议》全文，了解相关权利、义务和风险，自行承担投资风险和损失。

发行人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则运用募集资金。

投资者签订《收益凭证认购协议》且合同生效后，其认购收益凭证的行为本身即表明其对《收益凭证认购协议》及本说明书的承认和接受。投资者将按照有关规定、《收益凭证认购协议》、本说明书享有权利、承担义务。



## 一、产品简要：

产品名称	太平洋证券本金保障型指数挂钩 收益凭证金鲨1号
产品简称	简称：金鲨1号
产品代码	代码：S12273
发行人	太平洋证券股份有限公司
登记机构	中证机构间报价系统股份有限公 司
产品风险评级	低风险（此为太平洋证券内部评 级）
目标客户	经太平洋证券客户风险承受能力 评估为积极型、相对积极型、稳 健型、相对保守型、保守型的客 户

## 二、产品要素说明

产品名称	太平洋证券本金保障型指数挂钩收益凭证金鲨1号 简称：金鲨1号 代码：S12273
产品规模上限	5000 万元人民币

产品类型	本金保障型指数挂钩收益凭证
认购人数上限	投资者人数不超过 200 人
产品期限	29 天
认购金额	以投资者在太平洋证券指定的交易系统提交的有效委托认购金额为准。  币种：人民币
挂钩标的	沪深 300 指数  本产品挂钩标的指数价格为观察期内每日中证指数有限公司公布的沪深 300 指数收盘价（按照四舍五入法精确到小数点后 2 位），沪深 300 指数的证券代码为“000300”。
产品募集期 (销售期)	2016 年 8 月 16 日-2016 年 8 月 16 日
存续期起始日	2016 年 8 月 17 日
存续期到期日	2016 年 9 月 15 日  如遇存续期到期日为法定节假日或非交易日，则顺延至存续期到期日后第一个交易日。
投资收益率	本产品投资收益率区间为 2%-12.5%（年化）。

最低参与门槛	5 万元（人民币）
单个投资者最高认购金额	5000 万元（人民币）
金额递增单位	100 元（人民币）
认购金额的划付	投资者须在销售期的可交易时间内，在太平洋证券指定的交易系统提交上述产品的认购委托，太平洋证券柜台系统立即全额冻结认购金额，并于清算后执行认购金额的划付。
收益计算方式	<p>本产品投资收益具体计算方式以及名词释义如下：</p> <p>观察期：从起息日（含）至到期日（不含）之间的每个交易日</p> <p>观察标的：从起息日（含）至到期日（不含）之间的沪深 300 指数的每日收盘价格</p> <p>期初价格：沪深 300 指数起息日当日的收盘价格</p> <p>期末价格：沪深 300 指数到期日前一交易日的收盘价格</p> <p>执行价格：期初价格*100%（按四舍五入法精确到小数点后 2 位）</p> <p>障碍价格：期初价格*115%（按四舍五入法精确到小</p>

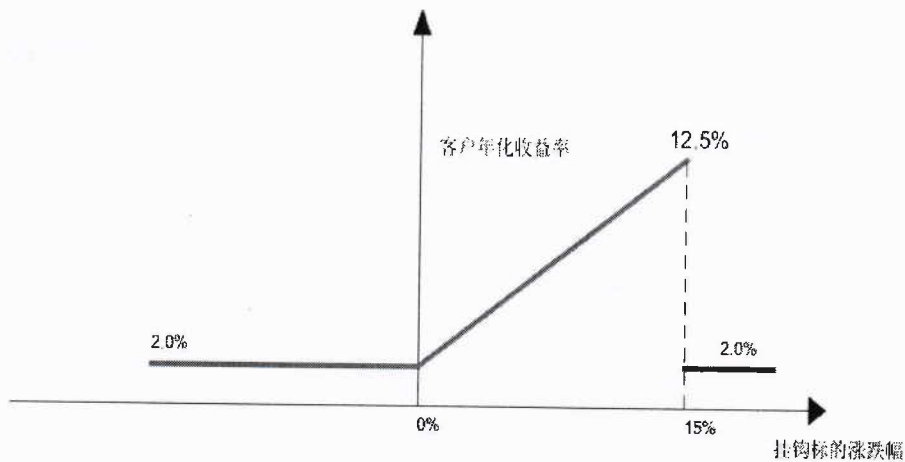
	<p>数点后 2 位)</p> <p>固定收益率 (年化) =2%</p> <p>参与率=0.7</p> <p>一级收益率(年化)= Max[(期末价格-执行价格)/期初价格,0];</p> <p>收益计算方式:</p> <p>1、当标的证券收盘价在观察期内从未高于障碍价格, 则:</p> <p>到期收益=投资本金*(固定收益率+参与率*一级收益率) *实际投资天数/365;</p> <p>2、当标的证券收盘价在观察期内曾经高于障碍价格, 则:</p> <p>投资收益=投资本金*固定收益率*实际投资天数 /365。</p> <p>收益计算精确到小数点后两位, 小数点后第三位四舍五入。</p>
付息安排	存续期到期一次性支付
资金到账日	存续期到期日后 2 个工作日内
提前终止与转	除本协议另有约定外, 太平洋证券、投资者均无权提

让	<p>前终止本产品。</p> <p>目前暂时不支持本产品份额的转让。在技术条件、法律法规、中国证券业协会以及中证机构间报价系统股份有限公司相关规定允许的情况下，产品份额可在太平洋证券股份有限公司柜台市场或机构间私募产品报价和服务系统进行转让，具体转让规则及安排以太平洋证券股份有限公司柜台市场或者中证机构间报价系统股份有限公司相关公告为准。</p>
募集资金用途	募集资金用于补充公司营运资金。
税费	根据国家有关税收法律、法规的规定，投资者投资本期产品所应缴纳的税款由投资者承担。

### 三、收益图示及收益情景分析

#### 1、收益曲线

当沪深 300 的收盘价在观察期内从未高于障碍价格时：



(横坐标为期末价格相对期初价格的涨幅, 纵坐标为年化收益率)

当沪深 300 的收盘价在观察期内曾高于障碍价格时:

无论期末价格为何值, 产品年化收益率为 2%。

## 2、收益情景分析:

假设期初价格(即起息日当日沪深 300 指数的收盘价格)为 3200, 则障碍价格为 3680。

当沪深 300 的收盘价在观察期内从未高于 3680 时:

若期末价格(即到期日前一交易日沪深 300 指数的收盘价格)小于等于 3200, 则产品年化收益率为 2%;

若期末价格大于 3200, 且小于等于 3680, 则:

产品年化收益率=(期末价格-期初价格)/期初价格\*0.7+2%;

当沪深 300 的收盘价在观察期内的任一天内高于 3680, 则产品年化收益率为 2%。

特别提示: 本太平洋证券收益凭证产品是指太平洋证券发行的,

约定到期时太平洋证券按协议约定支付固定收益或挂钩特定标的收益的有价证券。

（印）