

中国太平洋人寿保险股份有限公司关于投资太平洋卓越 全时量化多策略产品关联交易的信息披露公告 (2020-85)

根据《保险公司资金运用信息披露准则第1号：关联交易》（保监发〔2014〕44号）的相关规定，现将中国太平洋人寿保险股份有限公司（以下简称“本公司”）申购太平洋资产管理有限责任公司（以下简称“太保资产”）发行的太平洋卓越全时量化多策略产品（以下简称“该产品”）关联交易的有关信息披露如下：

一、交易概述及交易标的基本情况

(一) 交易概述

2020年6月2日，本公司申购太保资产发行的太平洋卓越全时量化多策略产品，申购金额人民币0.10亿元。根据中国银保监会相关规定，该交易属于资金运用类关联交易。

(二) 交易标的基本情况

该产品为一款混合类保险资管产品，采取封闭期和开放期交替运作。该产品秉承“价值投资、长期投资、稳健投资”之理念，通过量化手段配置不同策略与资产，持续优化投资风险与收益的动态匹配，争取在各种市场环境下，控制产品波动率与回撤，获取长期稳定增值。该产品采取风险平价模型进行多策略均衡配置，以获得长期稳健的风险收益。多策略主要包括以下四大类低相关性风险收益来源不同的量化策略：多因子阿尔法，事件驱动，管理波动率和趋势跟踪。该产品主要投资于股票、可转债和分级基金优先级，通过股指期货套保工具控制股票资产波动率，同时在法律法规许可的范围内挖掘其他可能的投资机会。该产品以股票、基金、可转债为主，辅以股指期货作为套保工具控制股票资产波动。该



投资组合的投资限制为：投资于股票（不含新三板股票）、股票型基金、混合型基金以及股指期货多头合约价值的比例不超过产品总资产的 60%；固定收益类资产投资比例不超过产品总资产的 80%；投资于股指期货空头合约价值（按绝对值计算）的比例不高于投资组合中股票资产的 100%；其余资产投资于本产品投资范围中的其他品种。

二、交易各方的关联关系和关联方基本情况

（一）交易各方的关联关系

太保资产为本公司控股股东中国太平洋保险（集团）股份有限公司的控股子公司，为本公司关联方。

（二）关联方基本情况

关联方名称：太平洋资产管理有限责任公司

企业类型：有限责任公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 39 楼

法定代表人：于业明

经营范围：管理运用自有资金及保险资金；委托资金管理业务；与资金管理业务相关的咨询业务；国家法律法规允许的其它资产管理业务；依法须经批准的项目，经相关部门批准后可开展经营活动。

注册资本：人民币 21 亿元

统一社会信用代码：91310115789549569U

三、交易的定价政策及定价依据

（一）定价政策

该产品按照一般商业条款以及市场化原则进行，符合相关法律法规要求，不存在损害任何一方及其股东或相关方利益的情形。

（二）定价依据

本公司与太保资产根据资产规模、投资目标、投资策略、投资绩效等因素，按照“固定+浮动”的原则协商确定资产管理费率的定价机制。

四、交易协议的主要内容

（一）交易价格

本公司申购该产品人民币 0.10 亿元，太保资产依据《委托资产管理合同》向本公司收取委托管理费。该产品的管理费按本公司所投份额的前一日资产净值的 0.30%的年费率计提。

（二）交易结算方式

该产品管理费每日计提、逐日累计至每自然季季末，按自然季支付，由产品托管人按照管理人的划款指令从资产中一次性支付给管理人。

（三）协议生效条件、生效时间、履行期限

本公司与太保资产于 2020 年 6 月 1 日申请申购，于 2020 年 6 月 2 日确认生效并完成交易，本次申购人民币 0.10 亿元。该产品为开放式，履行期限不定。

五、交易决策及审议情况

（一）决策的机构、时间、结论

本公司委托太保资产进行保险资金的管理运用。按照相关法律法规及监管规定，本公司与太保资产签订了《委托资产管理合同》，约定由太保资产负责本公司的资金运用事宜。太保资产根据《委托资产管理合同》、投资指引和本公司的资产管理投资需求，自主进行委托资产管理项下的资产配置、投资决策和资金运用操作，制定具体投资策略和风险控制策略，发出投资交易和其他相关指令。依据自身成熟完善的决策机制，本次投资决策于 2020 年 6 月 1 日经相关投资决策流程审批通过。

（二）审议的方式和过程



本次投资由太保资产投资管理部门以投资操作申请的形式发起，按照太保资产相关投资交易权限，经相关投资决策流程审批通过。

六、其他需要披露的信息

无。

本公司承诺：已充分知晓开展此项交易的责任和风险，并对本公告所披露信息的真实性、准确性、完整性和合规性负责，愿意接受有关方面监督。对本公告所披露信息如有异议，可以于本公告发布之日起 10 个工作日内，向中国银保监会保险资金运用监管部反映。