

国泰君安君享指数增强集合资产管理计划说明书

二〇一七年二月

特别提示:

本说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券公司客户资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券公司集合资产管理业务实施细则》(以下简称《实施细则》)、《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划管理合同》(以下简称《管理合同》)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,愿意自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实信用、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。

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《管理办法》、《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	国泰君安君享指数增强号集合资产管理计划
	目标规模	推广期规模上限为10亿元,存续期规模上限为50亿份。单个客户首次参与本集合计划金额不低于100万元,户数不超过200户。
	管理期限	本集合计划管理期限为5年,可展期。
	推广期	本集合计划推广期指集合计划开始接受委托人认购参与日至集合计划推广期结束日。本集合计划推广期最长不超过60个工作日。
	封闭期	首个封闭期为集合计划成立之日起6个公历月,之后的非开放期时间均为封闭期,封闭期内不办理参与、退出业务。
	开放期、开放日	本集合计划的首个开放期/开放日为首个封闭期满后每个月的最后一个交易日。计划成立后仅在开放日办理参与和退出,本计划首个封闭期为产品成立之后的6个公历月,本计划首个开放期为封闭期满后第一个月的最后一个交易日,之后每个月最后一个交易日为开放日。开放期内可以办理参与、退出业务。
	份额面值	人民币1.00元
	最低金额	单一投资者首次参与本集合计划的最低金额为人民币100万元,对于已经是本集合计划的持有人,其新增参与资金的最低金额为人民币1万元;将红利再投资本集合计划的份额不受上述限制。
	相关费率	1、参与费率:0%; 2、退出费率:0%; 3、年托管费率:0.15%; 4、年管理费:1.5%; 5、业绩报酬:当年化收益率 $R >$ 中证500指数年化收益率 $R1 > 0\%$ 时,本集合计划对 $(R - R1)$ 的超额收益部分提取20%的业绩报酬。当年化收益率 $R > 0\% >$ 中证500指数年化收益率 $R1$ 时,本集合计划对超过0的收益部分提取20%的业绩报酬。
	投资范围	本集合计划将主要投资于国内依法发行的股票(含新股申购)、证券投资基金、国债逆回购、银行存款等证券期货交易所交易品种以及中国证监会认可的其他投资品种。 在集合计划运作过程中,对于超过《管理合同》约定投资范围和比例的投资,管理人、委托人及托管人应事先签订补充协议。
	风险收益特征	本集合计划属于高风险证券投资产品。
	适合推广对象	本集合计划的适合推广对象为能承受本金损失风险、资产流动性需求不高或是具有资产配置需求的合格投资者。
	当	管理人

事 人	托管人	兴业银行股份有限公司上海分行
	推广机构	国泰君安证券股份有限公司，上海国泰君安证券资产管理有限公司（直销）以及中国证监会认可并与管理人签署相关协议的其他推广机构
集 合 计 划 的 参 与	办理时间	推广期，投资者在推广机构的工作日可以参与本集合计划。 存续期，投资者在集合计划的开放期可以办理参与本集合计划的业务。 本计划首个开放期为首个封闭期满后第一个月的最后一个交易日，之后每个月最后一个交易日为开放日，开放期内可以办理参与业务。
	办理场所	推广机构指定的场所。
	办理方式	<p>1、本集合计划采用电子签名合同的方式签署，委托人在各销售网点，签署电子合同。电子合同在管理人、托管人、委托人三方完成签署，且委托人按合同约定将参与资金划入指定账户并经注册登记机构确认有效后生效。委托人应当如实提供与签署电子签名合同相关的信息和资料，管理人和其他推广机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整，否则应当承担由此造成的一切后果。</p> <p>2、“金额参与”原则，即参与以金额申请。本集合计划的单个委托人首次参与最低金额为100万元人民币，追加参与的最低金额为人民币1万元。</p> <p>3、“未知价”原则，即在开放日，参与集合计划的价格以参与申请日当日（T日）的计划份额净值为基准进行计算。</p> <p>4、委托人的参与资金在集合计划成立之前所产生的利息折成集合计划份额的，该份额归委托人所有，参与资金的利息以注册登记机构的记录结果为准。</p> <p>5、委托人在开放日内可以多次参与本集合计划，已经受理的参与申请只能在当日交易时间结束之前撤销。</p> <p>6、本集合计划在存续期内，若开放日当日的参与申请全部确认后使得本集合计划的总份额超过10亿份或客户数超过200户的，则对该开放日有效参与申请采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则给与部分确认，未确认部分的参与款项退还给委托人。</p>
	参与费	推广期和存续期本集合计划参与费率为0%
	认购资金利息	委托人的参与资金在推广期产生的利息将折算为计划份额归委托人所有。
集 合 计 划 的 退 出	办理时间	本集合计划委托人只能于本集合计划的开放期办理退出申请。 本计划首个开放期为首个封闭期满后第一个月的最后一个交易日，之后每个月最后一个交易日为开放日，开放期内可以办理退出业务。 业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间。
	办理场所	推广机构指定的场所。
	办理方式	<p>1、退出申请的提出：委托人可在原参与网点，在规定的退出开放期内办理退出申请，或登录原参与推广机构指定的网络系统以自主下单的方式申请退出集合计划；</p> <p>2、退出申请的确认：当日（T日）在交易时间内提交的申请，管理人及注册登记机构在收到委托人退出申请的T+2日对该交易的有效性进行确认，委托人通常可在T+3日到网点查询退出的确认情况。巨额退出的情形按《管理合同》对应章节的约定办理；</p> <p>3、退出申请款项的支付：委托人退出申请确认后，管理人将指示托管人把退出款项从集合计划托管专户划往注册登记机构，再由注册登记机构划往各推广机构，并通过推广机构划往申请退出委托人的指定资金账户，退出款项将在T+4日内从托管账户划出。如集合计划出现《管理合同》所述暂停估值的情形时，管理人与托管人协商后，可以将划拨日期相应顺延。</p>

退出费	本集合计划的退出费率为 0%。
单个委托人大额退出	<p>1、单个委托人大额退出的认定 对单个委托人单日退出份额超过集合计划总份额 3%，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处理方式 委托人必须提前 5 个工作日直接或通过推广机构向管理人预约申请；大额退出未预约申请，管理人有权拒绝接受其退出申请。</p>
巨额退出及连续巨额退出	本集合计划不设巨额退出及连续巨额退出。
管理人自有资金参与情况	<p>管理人可以以自有资金参与本集合计划。具体按照《管理办法》、《实施细则》和《管理合同》以及相关法律法规的规定执行。</p> <p>1、自有资金参与的条件：管理人以自有资金参与本集合计划，应当提前 5 个工作日通过管理人网站公告，告知委托人和托管人。</p> <p>2、自有资金的参与方式：管理人以自有资金参与本集合计划，将在本集合计划推广机构参与。</p> <p>3、自有资金参与的份额和比例：参与份额不超过本集合计划总份额 20%。具体参与金额以管理人公告为准。因集合计划规模变动等客观因素导致自有资金参与集合计划被动超限的，管理人依法及时调整。</p> <p>4、自有资金的收益分配：管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他投资者享有同等收益分配的权利和义务。</p> <p>5、自有资金责任承担方式和金额：除《管理合同》另有约定外，管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他投资者享有同等权利和义务。</p> <p>6、自有资金退出的条件：管理人自有资金参与本集合计划的持有期限不得低于 6 个月。管理人以自有资金参与、退出本集合计划时，应当提前 5 个工作日通过管理人网站公告，告知委托人和托管人。募集推广期投入且承担责任的自有资金（如有）在约定责任解除前不得退出。为应对集合计划巨额赎回（如有），解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以自有资金参与或退出集合计划可不受前款规定限制，但需事后及时告知客户和资产托管机构，并按照规定向相关监管机构报备。</p> <p>7、风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本集合计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>8、信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个工作日通过管理人网站公告参与/退出时间和参与/退出金额等信息。</p>
集合计划的分级	本集合计划不分级。
集合计划成立的条件	<p>集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 3000 万元人民币且其委托人的户数为 2 户（含）以上，并经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后，管理人通过管理人网站宣布本集合计划成立。</p> <p>本集合计划成立的时间为计划管理人根据《管理办法》及相关法律法规规定发布集合计划成立公告的日期。</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注册登记机构指定的专门账户，不得动用。</p>
集合计划设立失败	集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币 3000 万元（不含）或者委托人户数低于 2 户（不含）条件下，集合计划设立失败，管理人承担集合计划全部推广费用，并将已认购资金在推广期结束后 30 个工作日内退还集合计划委托人，认购资金产生的利息自推广期结束之日起至下一个结息日后的五个工作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登记机构的记录为



	准。
集合计划份额转让	<p>本计划成立后，管理人可以按照规定申请份额转让事宜。</p> <p>集合计划存续期间，管理人、推广机构的客户之间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，但转让后委托人持有集合计划份额不得少于100万份，委托人合计不超过200户。受让方应符合合格投资者资格，受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。</p>
费用、报酬	<p>费用种类</p> <p>(1) 参与费率：0%。</p> <p>(2) 退出费率：0%。</p> <p>(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。在交易时支付给提供交易单元的券商。</p> <p>(4) 管理费：集合计划管理人每日按前一日集合计划资产净值的1.5%年费率计提管理费，管理费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，管理人向托管人出具划款指令，由托管人于次月首日起5个工作日内复核后依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>(5) 托管费：0.15%，托管人的托管费每日计提，托管费计算逐日累计至每月月底，按月支付，管理人向托管人出具划款指令，由托管人于次月首日起5个工作日内复核后依据管理人划款指令从本集合计划资产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。</p> <p>(6) 证券账户开户费由管理人在开户时先行垫付，产品成立后，由托管人按照管理人出具的指令从集合计划中扣划。托管人不承担垫付开户费用义务。</p> <p>(7) 与本集合计划相关的审计费：在存续期间发生的集合计划审计费用，在合理期间内摊销计入集合计划。本集合计划的年度审计费，按与会计师事务所签定协议所规定的金额，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> <p>(8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用</p>
不由集合计划承担的费用	集合计划推广期间的费用，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，以及处理与本集合计划运作无关的事项发生的费用等不列入本集合计划费用。
业绩报酬	<p>当年化收益率 $R >$ 中证500指数年化收益率 $R1 > 0\%$ 时，本集合计划对 $(R - R1)$ 的超额收益部分提取20%的业绩报酬。</p> <p>当年化收益率 $R > 0\% >$ 中证500指数年化收益率 $R1$ 时，本集合计划对超过0的收益部分提取20%的业绩报酬。</p>
收益构成	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。
收益分配	<p>分配原则</p> <p>(1) 每一集合计划份额享有同等的分配权。</p> <p>(2) 集合计划当期收益应先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配。</p> <p>(3) 本计划收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，红利再投资增加的份额计入集合计划份额总规模，投资人可选择现金红利或将现金红利转为集合计划份额进行再投资；若投资人不选择，本计划默认的收益分配方式是现金分红；</p> <p>(4) 选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除权日的份额净值转成相应的份额。投资人在不同销售机构处可以选择不同的分红方式；</p> <p>(5) 集合计划收益分配除权日的集合计划份额净值减去集合计划份额分红金额后不能低于集合计划份额面值。</p> <p>(6) 收益分配时发生的银行转账或其他手续费用由委托人自行承担；</p>

	<p>(7) 集合计划成立不满3个月可不进行收益分配;</p> <p>(8) 在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下,收益每年至多分配四次,收益分配时间不晚于年度会计报告出具后30个工作日;</p> <p>(9) 红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过15个工作日;</p> <p>(10) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。</p>
分配方式	<p>委托人可以选择收益分配方式为现金或再投资于本集合计划,未做选择的默认是现金分红。委托人可以修改分红方式。选择采取红利再投资方式的,分红资金按除权日的份额净值转成相应的集合计划份额;选择现金方式的,管理人向托管人出具划款指令,由托管人按照指令将分红款划入分红专户,再划入推广机构结算备付金账户,最后由推广机构划入委托人账户。若因红利再投资导致收益分配后的集合计划总份额被动超过合同约定的规模上限时,管理人有权采取必要措施对集合计划的参与和退出进行控制,直至份额符合合同约定。</p>
分配方案	<p>收益分配方案须载明收益范围、净收益、分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。</p> <p>本集合计划收益分配方案由管理人拟定,并报告委托人。管理人至少在R-2工作日之前(R为权益登记日)将收益分配方案向委托人公告。</p>
集合计划展期	<p>本集合计划管理期限为5年,可展期。</p>
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. 集合计划存续期届满但未展期的; 2. 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; 3. 托管人因重大违法、违规行为,被监管机构取消业务资格而管理人未在30个工作日内与新的托管人签订托管协议的; 4. 管理人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责的; 5. 托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责时,管理人未在30个工作日内与新的托管人签订托管协议的; 6. 存续期内,任一开放日集合计划委托人少于2户(不含)时; 7. 存续期内,管理人有权决定提前终止本集合计划,并提前在管理人网站公告或书面告知委托人; 8. 战争、自然灾害等不可抗力的发生导致本集合计划不能存续; 9. 法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。 <p>(二) 集合计划的清算</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、自集合计划终止之日起5个工作日内成立集合计划清算小组,集合计划清算小组按照监管机构的相关规定进行集合计划清算; 2、清算过程中有关重大事项应当及时公布; 3、清算结束后5个工作日内,管理人和托管人应当在扣除清算费用、管理费、托管费及管理人业绩报酬后,将集合计划资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。 4、清算结束后15个工作日内由集合计划清算小组在管理人网站公布清算结果或书面通知委托人清算结果。 5、若本集合计划在终止之日有未能流通变现的证券,管理人可针对该部分未能流通变现证券制定二次清算方案,该方案应经集合计划清算小组认可,并通过管理人网站进行披露。管理人应根据二次清算方案的规定,对前述未能流通变现的证券在可流通变现后进行二次清算,并将变现后的资产扣除相关费用后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。在进行二次清算的变现过程中,变现的资金以现金保存,不得再进行投资。

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。若无特别说明，本说明书中的所有术语与《管理合同》中的相关表述具有相同涵义。如两者不一致的，以《管理合同》的相关内容为准。