

国泰君安君享指数增强 集合资产管理计划管理合同

集合计划管理人：上海国泰君安证券资产管理有限公司

集合计划托管人：兴业银行股份有限公司上海分行

二〇一七年二月

目 录

| | |
|----------------------------------|------|
| 第 1 部分 前言 | 1-1 |
| 第 2 部分 释义 | 2-1 |
| 第 3 部分 合同当事人 | 3-1 |
| 第 4 部分 集合计划的基本情况 | 4-1 |
| 第 5 部分 集合计划的参与和退出 | 5-1 |
| 第 6 部分 管理人自有资金参与集合计划 | 6-1 |
| 第 7 部分 集合计划的分级 | 7-1 |
| 第 8 部分 集合计划客户资产的管理方式和管理权限 | 8-1 |
| 第 9 部分 集合计划的成立 | 9-1 |
| 第 10 部分 集合计划账户与资产 | 10-1 |
| 第 11 部分 集合计划资产的托管 | 11-1 |
| 第 12 部分 集合计划估值 | 12-1 |
| 第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬 | 13-1 |
| 第 14 部分 投资收益与分配 | 14-1 |
| 第 15 部分 投资理念与投资策略 | 15-1 |
| 第 16 部分 投资决策与风险控制 | 16-4 |
| 第 17 部分 投资限制及禁止行为 | 17-1 |
| 第 18 部分 集合计划的信息披露 | 18-1 |
| 第 19 部分 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结 | 19-1 |
| 第 20 部分 集合计划的展期 | 20-1 |
| 第 21 部分 集合计划终止与清算 | 21-1 |
| 第 22 部分 当事人的权利与义务 | 22-1 |
| 第 23 部分 违约责任与争议处理 | 23-1 |
| 第 24 部分 风险揭示 | 24-1 |
| 第 25 部分 合同的成立与生效 | 25-1 |
| 第 26 部分 合同的补充、修改与变更 | 26-1 |

重要提示

本合同以电子签名方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

第 1 部分 前言

为规范国泰君安君享指数增强集合资产管理计划的运作，明确《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国合同法》、《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》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券公司客户资产管理业务规范》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》等法律法规、中国证监会和中国证券业协会的有关规定，委托人、管理人、托管人在平等自愿、诚实信用原则的基础上订立本合同。本合同是规定当事人之间基本权利义务的法律文件，当事人按照《证券公司客户资产管理业务管理办法》、《证券公司集合资产管理业务实施细则》、《证券期货经营机构私募资产管理业务运作管理暂行规定》、《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划说明书》、《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划管理合同》及其他有关规定享有权利、承担义务。

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，所披露或提供的信息和资料真实、准确、完整，委托人将积极配合管理人履行反洗钱职责，不借助本集合计划进行洗钱等违法犯罪活动，并已阅知本合同和集合计划说明书全文，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本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

托管人承诺以诚实守信、审慎尽责的原则履行托管职责，安全保管客户集合计划资产、办理资金收付事项、监督管理人投资行为，但不保证本集合计划资产投资不受损失，不保证最低收益。

第 2 部分 释义

本合同中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

| | |
|----------------------------|---|
| 集合计划、本集合计划或本计划 | 指国泰君安君享指数增强集合资产管理计划 |
| 《集合计划说明书》或《说明书》 | 指《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划说明书》以及对其所有的有效修订和补充 |
| 《集合资产管理合同》、本合同、电子合同或电子签名合同 | 指《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划管理合同》及其的任何有效修订和补充 |
| 《证券投资基金法》 | 指 2013 年 6 月 1 日起正式实施的《中华人民共和国证券投资基金法》 |
| 《管理办法》 | 指 2013 年 6 月 26 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券公司客户资产管理业务管理办法》 |
| 《实施细则》 | 指 2013 年 6 月 26 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券公司集合资产管理业务实施细则》（证监会公告[2013]28 号） |
| 《规范》 | 指 2012 年 10 月 19 日中国证券业协会发布并施行的《证券公司客户资产管理业务规范》（中证协发[2012]206 号） |
| 《交易指引》 | 指 2013 年 8 月 21 日经中国证监会发布并施行的《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》 |
| 中国 | 指中华人民共和国，为本合同目的，在此不包括台湾省，香港特别行政区和澳门特别行政区。 |
| 法律法规 | 指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件 |
| 中国证监会 | 指中国证券监督管理委员会 |

| | |
|-----------|--|
| 管理人 | 指上海国泰君安证券资产管理有限公司，在本合同中有时也简称国泰君安证券资产管理 |
| 托管人 | 指兴业银行股份有限公司上海分行，在本合同中有时也简称兴业银行 |
| 委托人或持有人 | 指依据《集合资产管理合同》合法取得本集合计划份额的投资者 |
| 投资者/合格投资者 | 指具备相应风险识别能力和承担所投资集合资产管理计划风险能力且符合下列条件之一的单位和个人：（一）个人或者家庭金融资产合计不低于100万元人民币；（二）公司、企业等机构净资产不低于1000万元人民币。依法设立并受监管的各类集合投资产品视为单一合格投资者。 |
| 推广机构 | 指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 |
| 注册登记业务 | 指本集合计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括委托人集合计划账户管理、集合计划份额注册登记、清算及集合计划交易确认、建立并保管集合计划持有人名册等 |
| 注册登记机构 | 指办理本集合计划注册登记业务的机构，即中国证券登记结算有限责任公司，在本合同中有时也简称中登公司 |
| 集合计划推广期间 | 指本集合计划开始接受委托人认购参与日至推广期结束日 |
| 集合计划运作期间 | 在本合同中又称投资运作期或存续期，指本集合计划成立后转入的投资运作期 |
| 成立日 | 指本集合计划达到《集合资产管理合同》约定的成立条件后，管理人确定的本集合计划成立的日期 |
| 开放期 | 指本集合计划存续期内委托人可以申请办理退出或申购参与的期间 |

| | |
|---------------|--|
| 工作日、交易日 | 指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日 |
| 开放日 | 指为委托人办理本集合计划参与、退出等业务的工作日 |
| 持有期、持有时间 | 指委托人参与本集合计划确认日到申请退出本集合计划确认日之间的自然天数 |
| 分红权益登记日 | 指确认在注册登记机构登记在册的委托人享有某次分红收益分配的日期 |
| 元 | 指人民币元 |
| 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 |
| 集合计划资产总值 | 指本集合计划购买的各类证券、银行存款本息、本集合计划应收申购款以及其他资产的价值总和 |
| 集合计划资产净值 | 指集合计划资产总值减去负债后的价值 |
| 单位净值、份额净值 | 指集合计划资产净值除以总份额所得的每份集合计划资产的价值 |
| 单位累计净值、份额累计净值 | 指每份额净值与集合计划成立以来每份额累计分红派息之和 |
| 股指期货风险敞口 | 指集合计划所持有的权益类证券市值，减去空仓股指期货合约价值，加上多仓股指期货合约价值 |
| 集合计划资产估值 | 指计算评估集合计划资产和负债的价值，以确定集合计划资产净值和每份额净值的方法和过程 |
| 托管费 | 指托管人为集合计划提供托管服务而向集合计划收取的费用 |
| 管理费 | 指管理人为集合计划提供投资管理服务而向集合计划收取的费用 |

| | |
|------|--|
| 不可抗力 | 指遭受不可抗力事件一方不能预见、不能避免、不能克服的客观情况，包括但不限于自然灾害、战争、骚乱、火灾、突发性公共卫生事件、政府征用、没收、注册登记机构非正常的暂停或终止业务、证券交易所非正常暂停或停止交易、非因管理人或托管人自身原因导致的技术系统异常事故、法律法规变化或其他突发事件等 |
| 关联关系 | 指《企业会计准则第 36 号——关联方披露》中的关联关系 |

第 3 部分 合同当事人

一、委托人

委托人的详细情况在各委托人分别与管理人、托管人签署的电子合同中列示。

二、管理人

管理人名称：上海国泰君安证券资产管理有限公司（以下简称“国泰君安证券资产管理”）

法定代表人：龚德雄

住所：上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室

联系地址：上海市银城中路 168 号 24 层（邮政编码：200120）

联系电话：021-38676666

传真：021-68872521

联系人：严晓璐

三、托管人

托管人名称：兴业银行股份有限公司上海分行

负责人：于晓青

住所：上海市江宁路 168 号

联系电话：021-62677777

传真：021-62557608

联系人：鲍一沛

第 4 部分 集合计划的基本情况

一、名称：国泰君安君享指数增强集合资产管理计划。

二、类型：集合资产管理计划。

三、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。单个客户首次参与金额不低于 100 万元，户数不超过 200 户。

四、投资范围和投资组合设计

1、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，对于超过本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。

2、投资组合比例

本集合计划在各类资产的投资组合占集合计划总资产的投资比例，将严格遵守相关法律法规的规定：

(1) 权益类证券(股票、股票型或混合型基金(含 ETF 和 LOF 基金))投资：0%~100%；

(2) 现金类产品（现金、银行活期存款、货币市场基金、同业存单、国债逆回购等）投资：0%~100%；

委托人在此同意授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人及与管理人有关联关系的公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。交易完成后，管理人应当书面通知托管人，并向证券交易所报告。管理人将通过资产管理季度报告向委托人披露上述重大关联交易信息。

如因一级市场申购发生投资比例超标，应自申购证券可交易之日起 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内；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，造成集合计划投资比例超标，管理人应在超标发生之日起在具备交易条件的 10 个交易日内将投资比例降至许可范围内。若因限售期、

相应证券停牌等原因不具备交易条件，上述期限自动顺延，具体顺延时间由管理人协商确定。

法律法规或中国证监会允许集合计划投资其他品种的，资产管理人在履行本合同变更程序后，可以将其纳入本计划的投资范围。

五、管理期限

本集合计划管理期限为5年，可展期。

六、封闭期、开放期及流动性安排

1、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。

2、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的每个月最后一个交易日。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。

3、流动性安排：除巨额退出外，退出份额一般不受限制。

七、集合计划的运作方式

本集合计划采用定期开放的运作方式。

八、集合计划份额面值

各方同意本集合计划份额的面值为人民币1元。

九、参与本集合计划的最低金额

单个委托人首次参与的最低金额为人民币1,000,000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10,000元；将红利再投资本集合计划的份额不受上述限制。

十、本集合计划的风险收益特征及适合推广对象

本集合计划属于高风险证券投资产品。

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。

十一、本集合计划的推广

1、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。

2、推广方式

本集合计划将通过推广机构进行销售。

管理人应将集合资产管理合同、集合资产管理计划说明书等正式推广文件，置备于推广机构。本集合计划应当面向合格投资者推广，合格投资者累计不得超过 200 户。推广机构应当了解客户的投资需求和风险偏好，详细介绍产品特点并充分揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划，引导客户审慎作出投资决定。禁止通过签订保本保底补充协议等方式，或者采用虚假宣传、夸大收益和商业贿赂等不正当手段推广集合计划。

管理人及推广机构应当采取有效措施，并通过管理人、中国证券业协会、中国证监会电子化信息披露平台或者中国证监会认可的其他信息披露平台，客观准确披露集合计划批准或者备案信息、风险收益特征、投诉电话等，使客户详尽了解本集合计划的特性、风险等情况及客户的权利、义务，但不得向合格投资者之外的单位和个人募集资金，不得通过广播、电视、报刊、互联网及其他公共传播媒体或讲座、报告会、分析会和布告、传单、手机短信、微信、博客和电子邮件等方式向不特定对象推广本集合计划。

十一、本集合计划的各项费用

1、参与费率：0%。

2、退出费率：0%。

3、管理费率

本集合计划的年管理费率为1.5%。

4、托管费率

本集合计划的年托管费率为0.15%。

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。

具体计算方法详见本合同第 13 部分集合计划的费用、业绩报酬。

6、其他费用

其他费用及具体计算方法详见本合同第 13 部分集合计划的费用、业绩报酬。

第 5 部分 集合计划的参与和退出

一、集合计划的参与

(一) 参与的办理时间

1、推广期参与

本集合计划推广期指集合计划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。

在推广期内，投资者在推广机构的工作日内可以参与本集合计划。

如本集合计划在推广期内参与金额达到 10 亿元，或者客户数达到 200 户，可提前终止推广期。管理人在推广期内使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。具体方式请参看本部分第一条第（四）款“参与费及参与份额的计算”。

若管理人决定提前结束推广期，应提前一个工作日通知推广机构和注册登记机构。

2、存续期参与

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。

如本集合计划在存续期的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。具体方式请参看本部分第一条第（四）款“参与费及参与份额的计算”。

(二) 参与的原则

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。

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。

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。

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。

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。

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。

本合同以电子签名方式签署，管理人、托管人作为本合同签署方，已接受本合同项下的全部条款；委托人作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明委托人完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

（三）参与的程序和确认

1、参与程序和确认

（1）投资者按推广机构指定营业网点的具体安排，在推广期/开放期的交易时间段内办理；

（2）投资者应开设推广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，推广机构不受理该笔参与申请；

（3）投资者签署本合同后，方可申请参与集合计划。参与申请经管理人确认后，构成本合同的有效组成部分；

（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；

（5）投资者于 T 日提交参与申请后，可以 T+3 日后在办理参与的营业网点查询参与确认情况。投资者推广期参与的，可于计划推广期结束后 2 个工作日内到办理参与的营业网点查询参与确认情况。

2、参与的注册登记

推广期投资者参与成功后，注册登记机构在 N+2 日内（N 日为认购截止日）为委托人登记权益并办理注册登记手续。

存续期投资者参与成功后，注册登记机构在 T+2 日（T 日为参与日）为委托人

登记权益并办理注册登记手续，投资者自 T+3 日后的开放日起有权退出该部分集合计划份额。

3、 暂停参与的情形

如出现如下情形，集合计划管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的参与申请：

- (1) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转；
- (2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况；
- (3) 证券交易场所在交易时间非正常停市，导致无法计算当日的集合计划资产净值；

(4) 管理人认为集合计划资产规模过大，可能对集合计划业绩产生负面影响，从而损害现有集合计划委托人的利益；

(5) 集合计划管理人、集合计划托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；

(6) 推广机构对委托人资金来源表示疑虑，委托人不能提供充分证明的；

(7) 集合计划管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；

(8) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

发生上述(1)到(5)项、(7)、(8)项暂停参与情形时，集合计划管理人应当在管理人网站公告委托人。

(四) 参与费及参与份额的计算

1、参与费率：0%。

2、参与份额的计算方法：

(1) 推广期参与份额的计算

参与费用=0

参与份额 = (参与金额 + 推广期利息) / 集合计划份额面值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

如本集合计划在推广期内参与金额达到 10 亿元或者客户数达到 200 户的，可提前终止推广期。

本集合计划管理人在推广期内使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。

①推广期内参与申请金额不超过 10 亿元且客户数不足 200 户（含 10 亿元或 200 户）

的情形：若推广期内参与申请全部确认后本集合计划参与的总金额不超过 10 亿元或客户数不足 200 户，则所有的有效参与申请全部予以确认。

②推广期内参与申请金额高于 10 亿元或客户数超过 200 户的情形：若推广期内参与申请全部确认后本集合计划参与的总份额超过 10 亿元或客户数超过 200 户，管理人将提前终止推广期。推广期规模上限日是指，在推广期集合计划认购申请累计确认份额超过规模上限的第一个交易日。在该交易日之前的有效认购申请全部予以确认；在该交易日的有效认购申请采用“金额优先+金额同等情况下时间优先”的原则给予部分确认，未确认部分的认购款项全额退还给委托人；在该交易日之下一日，管理人通知各销售网点结束产品认购，同时公告推广期提前结束；在该交易日之后的申请全部予以拒绝。

推广期末日管理人根据委托人申请单申请参与金额进行从大到小排序，在申请金额同等的情况下则按时间优先原则排序，再对排序后的申请单进行逐笔金额确认，直到累计确认金额达到本集合计划的规模上限。若加上某一笔参与金额后，该推广机构的参与总份额超出了分配限额，则对该参与申请及大于该申请单号的参与申请予以全部拒绝。超出目标规模的部分由推广机构将参与资金退回委托人指定资金账户，并停止该集合计划接受参与申请。

管理人在 T+1 个工作日（设认购申请日为 T 日）对投资者认购参与的有效性进行确认。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。

举例如下：

例 1：某委托人投资 2,000,000 元参与本集合计划。假设推广期内有效参与金额不足 10 亿元，且总户数不足 200 户，该笔参与将按照 100%比例全部确认，在推广期间产生利息 60.00 元，集合计划参与价格每份 1.000 元。则其可得到的参与份额为：

参与总金额=2,000,000 元 参与费用=0 元

参与份额=(2,000,000+60.00)/1.000 = 2,000,060 份

即：委托人投资 2,000,000 元参与本集合计划，可得到 2,000,060 份集合计划份额（含利息折份额部分）。

例 2：某委托人投资 2,000,000 元参与本集合计划，假设该笔参与申请发生在参与末日，本次参与末日之前有效参与申请金额达到 8 亿元，共 190 户，参与末日的有效参与申请金额为 3 亿元。

首先，对所有委托人按照申请单申请金额由大到小进行排序，在申请金额同等的情况下根据申请时间优先原则进行排序，并计算申请单累计参与金额，当累计参与金额超过2亿元或户数超过200户时，对该临界序号(不含)之前的申请序号代表的参与金额全部确认，对该临界序号(含)之后的申请序号代表的参与金额全部作为未确认金额，未确认金额将于本集合计划参与结束后退回委托人账户。

假定前述委托人的申请单序号为7，临界序号为8，则其2,000,000元参与申请全部确认。确认参与份额的计算方法同例1；

假定前述委托人的申请单序号为9，临界序号为8，则其参与申请作为未确认金额处理，将于本集合计划参与结束后全部退回委托人账户。

假定前述委托人的申请单序号正好为临界序号，则其参与申请作为未确认金额处理，将于本集合计划参与结束后全部退回委托人账户。

(2) 存续期参与份额的计算

参与费用=0

参与份额 = 参与金额 / 参与日集合计划份额单位净值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

本集合计划管理人在存续期内使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划参与总规模实行限量控制。

(五) 参与资金利息的处理方式

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。

委托人认可上述关于参与的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规及本合同的约定所作出的暂停参与决定与相关参与份额及资金利息的计算及确认。

二、集合计划的退出

(一) 退出的办理时间

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。

若出现新的证券交易市场或其他特殊情况，管理人有权视情况对前述退出办理的日期及时间进行相应的调整并公告。

(二) 退出的原则

1. “未知价”原则，即退出集合计划的价格以退出申请日当日（T日）的集合计划份额净值为基准进行计算；

2. “份额退出”原则，即退出以份额申请，单笔退出申请份额不低于1万份；

3. “先进先出”原则，即对委托人在该推广机构参与的集合计划份额进行退出处理时，参与确认日期在先的集合计划份额先退出，参与确认日期在后的集合计划份额后退出；

4. 当日的退出申请可以且只能在当日交易时间结束之前撤销；

5. 除非巨额退出，退出份额一般不受限制。若某笔退出导致该委托人在某推广机构持有的份额少于1万份，则余额部分必须一起退出。

（三）退出的程序和确认

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；

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。巨额退出的情形按本部分第二条第（七）款巨额退出及连续巨额退出的认定及办理方式办理；

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《集合资产管理合同》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。

（四）退出费及退出份额的计算

1、退出费率：0%。

2、退出金额的计算方法及退出方式

委托人退出金额为退出总额扣减管理人业绩报酬后的余额，计量单位为人民币元，退出金额保留到小数点后两位，小数点后两位以后的部分四舍五入，舍去部分所代表的资产归属集合计划资产。

退出总额=退出份额×集合计划份额净值

退出金额=退出总额-管理人业绩报酬

业绩报酬的计算，详见本合同“集合计划的费用”章节中的“业绩报酬的计提与支

付”部分。

3、收取方式

本集合计划不收取退出费。

(五) 退出的限制与次数

参照本部分第二条第(二)款退出的原则”处理。

(六) 单个委托人大额退出的认定和处理方式

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。

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。

(七) 巨额退出及连续巨额退出的认定和处理方式

本集合计划不设置巨额退出及连续巨额退出。

(八) 拒绝或暂停退出的情形及处理

如出现下列情形，集合计划管理人可以拒绝接受或暂停集合计划委托人的退出申请：

1. 因不可抗力的原因导致集合计划无法正常运作；
2. 集合计划发生提前终止情形；
3. 证券交易场所交易时间非正常停市，导致当日集合计划资产净值无法计算；
4. 法律法规规定或中国证监会等有权机关认定的其它情形。

发生上述情形之一的，已接受的退出申请，集合计划管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分按每个退出申请人已被接受的退出申请量占已接受退出申请总量的比例分配给退出申请人，未支付部分由集合计划管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续工作日予以支付，但最长不超过正常支付时间20个工作日，并报告给委托人。

发生《集合资产管理合同》、集合计划说明书中未予载明的事项，但集合计划管理人有正当理由认为需要暂停接受集合计划参与、退出申请的，可以暂停接受委托人的参与、退出申请，并按照规定向相关监管机构报备。

暂停集合计划退出，集合计划管理人应及时通过管理人网站报告委托人，并制定相应的补救措施。

委托人认可上述关于退出的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规及本合同的约定所作出的延期退出或暂停退出的决定。

第6部分 管理人自有资金参与集合计划

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《集合资产管理合同》以及相关法律法规的规定执行。

1、自有资金投入的条件：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。

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。

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。

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。

5、自有资金责任承担方式和金额：除本合同另有约定外，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。

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。

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。

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。

第 7 部分 集合计划的分级

本集合计划不分级。

第 8 部分 集合计划客户资产的管理方式和管理权限

(一)管理方式:本集合计划由上海国泰君安证券资产管理有限公司担任管理人,负责本集合计划的运作管理。

(二)管理权限:管理人根据本合同约定的方式、条件、要求及限制,为客户提供投资管理服务。

第9部分 集合计划的成立

一、集合计划成立的条件和日期

集合计划的参与资金总额（含参与费）不低于 3000 万元人民币（含）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。

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。

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。

二、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。

三、集合计划开始运作的条件和日期

（一）条件：

自集合计划宣布成立即符合开始运作的条件。

（二）日期

本集合计划自成立之日起开始运作。

第 10 部分 集合计划账户与资产

一、集合计划账户的开立

以管理人作为开户主体，开立户名包含“国泰君安君享指数增强集合资产管理计划”的托管账户，具体以实际开立名称为准，账户预留印鉴为“兴业银行股份有限公司上海分行托管账户专用章 1-1”以及开户机构托管业务负责人名章。本委托财产的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付赎回金额、支付基金收益、收取申购款，均需通过该托管专户进行。

为确保托管账户资金安全，资产托管人、资产管理人应至少每季度一次就托管账户余额进行账务核对，资产托管人通过托管网银的“托管账户银企对账”模块按月向资产管理人提供银行托管账户余额对账服务。资产管理人应在每季度初 15 天内就上个季度的托管账户余额进行对账反馈。资产管理人逾期未反馈的，资产托管人视同资产管理人默认账务核对无误，其后果由资产管理人自行承担。资产管理人应做好托管网银系统用户密码安全管理工作。资产管理人原因导致对账用户被非法使用、密码保管不当被泄露等情况，由此引起的损失由资产管理人自行承担。资产管理人应对账务核对结果的真实性、准确性负责。账务核对不符的，资产管理人可向资产托管人查询。

托管人为本集合计划开立证券账户，证券账户名称为“国泰君安证券资产管理—兴业银行—君享指数增强集合资产管理计划”[备注：账户名称以实际开立账户名称为准]

推广机构为集合计划的每一位委托人建立集合计划交易账户，记录委托人通过该推广机构买卖本集合计划份额的变动及结余情况。

管理人委托中国证券登记结算有限责任公司（简称“中登公司”）或其它符合条件的机构担任本计划的注册登记机构，并承担相应委托责任。注册登记机构为委托人开立集合计划账户，用于记录委托人持有的本集合资产管理计划份额。

二、集合计划资产的构成

本集合计划的资产包括用集合计划资金购买的各种有价证券、银行存款本息及其他投资，其主要构成包括银行存款及其应计利息，券商保证金及其应计利息，应收参与款，票据投资及其应计利息，债券投资及其应计利息，股票、基金投资及其分红，其他资产等。

三、集合计划资产的管理与处分

集合计划资产由托管人托管，并独立于管理人、托管人及注册登记机构的自有资产及其管理、托管的其他资产。管理人、托管人或注册登记机构的债权人不得对集合计划资产行使冻结、扣押及其他权利。除依照《管理办法》、《实施细则》、《集合资产管理合同》、《说明书》及其他有关规定处分外，集合计划资产不得被处分。

第 11 部分 集合计划资产的托管

集合计划资产由计划管理人委托兴业银行上海分行托管，管理人已经与托管人总行签订了托管协议。托管人将严格遵照有关法律法规及托管协议的约定对集合资产进行托管。

对实际存管在交易对手、中介机构等其他机构的证券和存放在托管人以外银行账户内的资金，对该等证券或资金的任何损失，托管人不承担任何责任。

委托人签署本合同的行为本身即表明对现行证券交易、登记结算制度下托管人托管职能有充分的了解，并接受本合同约定、托管协议的托管职责和范围。

第 12 部分 集合计划估值

管理人应当制订健全、有效的估值政策和程序，并定期对其执行效果进行评估，保证集合资产管理计划估值的公平、合理。

一、资产总值

集合计划的资产总值是指通过发行计划份额方式募集资金，并依法进行基金、股票、债券、股指期货交易、银行存款等投资所形成的各类资产的价值总和。

二、资产净值

集合计划资产净值是指集合计划资产总值减去负债后的价值。

三、份额净值

集合计划份额净值是指集合计划资产净值除以计划总份额。

四、估值目的

集合计划资产估值的目的是客观、准确地反映集合计划资产的价值。经集合计划资产估值后确定的集合计划单位净值，是进行信息披露、计算参与和退出及委托到期清算集合计划的基础。

五、估值对象

运用集合计划资产所持有的一切金融资产和金融负债。

六、估值日

本集合计划成立后，对资产进行估值之每个交易日，T+1 日完成 T 日估值。

七、估值方法

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，本计划购入的资产均默认按交易性金融资产核算与估值。如国内证券投资会计原则及方法发生变化，由管理人与托管人另行协商确定估值方法。

1. 股票估值方法

- (1) 上市流通股股票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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件，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或者证券发行机构发生影响证券价格的重大事件，将参考监管机构或行业协会有关规定，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

(2) 未上市股票的估值

- ① 首次发行未上市的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本价估值；
- ② 送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市的股票，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；
- ③ 首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按估值日在证券交易所上市的同一种股票的收盘价进行估值；
- ④ 非公开发行的且在发行时明确一定期限锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(3) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1) - (2)小项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1) - (2)小项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

2. 证券投资基金估值方法

- (1) 持有的交易所基金(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，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，按估值日前一交易日基金管理公司的每万份收益计算；
- (4) 在任何情况下，资产管理人如采用本项第(1) - (3)项规定的方法对委托财产进行估值，均应被认为采用了适当的估值方法。但是，如果资产管理人认为按本项第(1) - (4)项规定的方法对委托财产进行估值不能客观反映其公

允价值的，资产管理人可根据具体情况，并与资产托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

3. 银行定期存款或协议存款估值方法 银行定期存款或协议存款以本金列示，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。
4. 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，在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上，在与托管人商议后，按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值；
5. 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集合估值违反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，资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合有关的会计问题，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，按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。

6. 暂停估值的情形：集合计划投资所涉及的证券交易所遇法定节假日或其它原因暂停营业时，或因其它任何不可抗力致使管理人或托管人无法准确评估集合计划资产价值时，可暂停估值。但估值条件恢复时，管理人或托管人必须及时完成估值工作。

八、估值程序

日常估值由管理人进行，托管人每日进行复核。用于披露的资产净值由管理人完成估值后，将估值结果报送托管人，托管人按照规定的估值方法、时间与程序进行复核；日常估值对账由管理人与托管人通过电子对账形式进行。每周最后一个工作日托管人对估值结果复核无误签章后返回给管理人；托管人复核无误签章后返回给管理人；报告期末估值复核与集合资产管理计划会计账目的核对同时进行。当管理人与托管人的估值结果不一致时，各方应本着勤勉尽责的态度重新计算核对。如果仍无法达成一致，应以管理人的估值结果为准。如因管理人估值错误，由此给集合计划财产或委托人造成损失的，托管人不承担责任。

集合计划份额净值的计算，精确到0.001元，小数点后第四位四舍五入。

九、估值错误与遗漏的处理

管理人和托管人应采取必要、适当、合理的措施确保资产估值的准确性和及时性。当份额计价出现错误时，管理人应当立即予以纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大，托管人应给予必要的配合。

因份额净值错误给投资人造成损失的，合同各方应当按照各自过错承担赔偿责任，赔偿范围以投资人实际经济损失为限。

前述内容如法律法规或监管机关另有规定的，按其规定处理。

十、差错处理

1、差错类型

本计划运作过程中，如果由于管理人、托管人、注册登记机构、或代理销售机构、或委托人自身的过错造成差错，导致其他当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿并承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料备案差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成委托人的交易资料灭失或被错误处理或造成其他差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其他当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

2、差错处理原则

(1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则差错方和有协助义务的当事人应当分别承担相应的责任，但不限于赔偿、责任声明等。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正；

(2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接经济损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；

(3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其他当事人的利益损失，则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求返还不当得利的权利及要求获得不当得利的当事人承担因不返还或不全部返还不当得利造成的损失；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方；

(4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式；

(5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因管理人过错造成集合资产管理计划资产损失时，托管人应为集合资产管理计划的利益向管理人追偿，如果因托管人过错造成集合资产管理计划资产损失时，管理人应为集合资产管理计划的利益向托管人追偿。除管理人和托管人之外的第三方造成集合资产管理计划资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由管理人负责向差错方追偿，托管人应当给予必要的配合和协助；

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律法规、《集合资产管理合同》或其他规定，管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失，托管人应当给予必要的配合和协助；

(7) 按法律法规规定的其他原则处理差错。

3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

(1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；

(2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；

(3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；

(4) 根据差错处理的方法，需要修改注册登记机构的交易数据的，由注册登记机构进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行说明。

十一、暂停披露净值的情形

1、与本计划投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其他原因停市时；

2、因不可抗力或其他情形致使管理人、托管人无法准确评估集合资产管理计划资产价值时。

十二、特殊情形的处理

由于本计划所投资的各个市场及其登记结算机构发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误或即使发现但因上述原因无法修正的，由此造成的集合资产管理计划资产计价错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除或减少由此造成的影响。

由于注册登记机构发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

由于证券交易所及登记结算公司发送的数据错误，有关会计制度变化、管理人或托管人托管业务系统出现重大故障或由于其他不可抗力原因，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误或即使发现但因上述原因无法修正而造成的份额净值计算错误，管理人、托管人免除赔偿责任。但管理人、托管人应积极采取必要的措施消除或减少由此造成的影响。

第 13 部分 集合计划的费用、业绩报酬

一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

1、托管人的托管费

本集合计划应给付托管人托管费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为0.15%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。

托管人的托管费每日计提，托管费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。

2、管理人的管理费

本集合计划应给付管理人管理费，按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为1.5%。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div 365$$

H 为每日应计提的管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

管理人的管理费每日计提，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。

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。

4、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。

5、按照国家有关规定可以列入的其他费用

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、注册登记机构收取的相关费用等集合计划运营过程中发生的相关费用。

银行结算费用，一次计入集合计划费用；

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；

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；

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。

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。

二、不列入集合计划费用的项目

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。

三、管理人提取业绩报酬

1、业绩报酬计提原则

在委托人申请退出或本集合计划终止清算或结算时，管理人将根据年化收益率（R）提取业绩报酬，称为退出提取。

2、业绩报酬计提办法

当委托人申请退出或本集合计划终止清算或结算时，管理人根据年化收益率

(R) 提取业绩报酬，业绩报酬按累进方式计算，从委托人退出计划资金清算款中以现金支付。

A 为业绩报酬计提日的单位累计净值；

C 为上一个业绩报酬计提日的单位累计净值；

C' 为上一个业绩报酬计提日的单位净值；

T 表示上一业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的间隔天数；

E=业绩报酬；

K=退出份额×上一个业绩报酬计提日的单位净值；

年化收益率 $R=(A - C)/C' \times 365 / T \times 100\%$ ；

A1 为业绩报酬计提日的中证 500 指数收盘价；

C1 为上一个业绩报酬计提日的中证 500 指数收盘价；

中证 500 指数年化收益率 $R1=(A1 - C1)/C1 \times 365 / T \times 100\%$ ；

业绩报酬计提日为计划分红日、委托人退出确认日或集合计划清算确认日。

以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日(如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与确认日)至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。

业绩报酬计提标准为：

(1) 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，即 $E=K \times (R - R1) \times 20\% \times (T \div 365)$ 。

例 1：某委托人退出申请日持有份额 1,000,000 份，全部申请退出，退出申请日单位资产累计净值为 1.13 元、中证 500 指数收盘价为 6,552.62，上一个业绩报酬计提日单位资产累计净值为 1.05 元，上一个业绩报酬计提日的单位净值为 1.03 元、中证 500 指数收盘价为 6,123.49，退出申请日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 280 天，则

$$R=(1.13-1.05) \div 1.03 \times (365 \div 280) \times 100\% = 10.12\%$$

$$R1=(6,552.62-6,123.49) \div 6,123.49 \times (365 \div 280) \times 100\% = 9.14\%$$

$$\text{业绩报酬} = (1,000,000 \times 1.03) \times (10.12\% - 9.14\%) \times 20\% \times (280 \div 365) =$$

1,548.67 元。

(2) 当年化收益率 $R > 0\% >$ 中证 500 指数年化收益率 R_1 时, 本集合计划对超过 0 的收益部分提取 20% 的业绩报酬, 即 $E = K \times (R - 0\%) \times 20\% \times (T \div 365)$ 。

例 2: 某委托人退出申请日持有份额 1,000,000 份, 全部申请退出, 退出申请日单位资产累计净值为 1.13 元、中证 500 指数收盘价为 5,947.32, 上一个业绩报酬计提日单位资产累计净值为 1.05 元, 上一个业绩报酬计提日的单位净值为 1.03 元、中证 500 指数收盘价为 6,123.49, 退出申请日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 280 天, 则

$$R = (1.13 - 1.05) \div 1.03 \times (365 \div 280) \times 100\% = 10.12\%$$

$$R_1 = (5,947.32 - 6,123.49) \div 6,123.49 \times (365 \div 280) \times 100\% = -2.88\%$$

业绩报酬 = $(1,000,000 \times 1.03) \times (10.12\% - 0\%) \times 20\% \times (280 \div 365) = 15,992.37$ 元。

业绩报酬计提日(T日)的单位资产累计净值在当天证券交易所收市后计算, 并在 T+2 日网站揭示。遇特殊情况, 经管理人和托管人一致同意, 可以适当延迟计算和揭示。委托人退出时, 托管人根据管理人的指令将退出金额(扣除业绩报酬)划拨给注册登记机构, 由注册登记机构将扣除业绩报酬的退出款项转入委托人的交易账户。

注: 因取值精度原因, 实际业绩报酬计提结果以注册登记机构计提结果为准。

(3) 如管理人已经提取业绩报酬, 即使委托人退出本集合计划时净值有所下跌, 则该部分已提取业绩报酬亦不退还委托人。

3、业绩报酬支付

业绩报酬在业绩报酬计提日计提, 由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额, 托管人据此计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日, 支付日期顺延, 管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成, 相关信息在注册登记机构记录, 托管人不承担复核责任。

四、其他税费

在本集合计划运作期间产生的税费由委托人承担。管理人有权按照法律法规规定履行进行扣缴。

第 14 部分 投资收益与分配

一、收益的构成

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。

二、可供分配收益

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。

三、收益分配原则

- 1、 每一集合计划份额享有同等的分配权。
- 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。
- 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；
- 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；
- 5、 集合计划收益分配基准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。
- 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；
- 7、 集合计划成立不满 3 个月可不进行收益分配；
- 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；
- 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；
- 10、 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

四、收益分配对象

分红权益登记日所有参与本集合计划的委托人。

五、收益分配时间

在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，由管理人决定具体收益分配时间，分红后剩余收益保留于本集合计划。

六、收益分配方式

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。委托人可以修改收益分配方式。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。

七、收益分配比例

在符合收益分配条件和收益分配原则的前提下，每次收益分配比例不得低于可分配收益的 20%。集合计划可分配收益指截至收益分配基准日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。

八、收益分配方案的内容

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。

九、收益分配方案的确定与披露

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。

十、收益分配中发生的费用

收益分配时发生的银行转账等手续费用由委托人自行承担。

十一、收益分配的程序

- 1、管理人计算集合计划的可分配收益；
- 2、托管人对集合计划的可分配收益数据进行复核；
- 3、管理人确定收益分配的金额、时间；
- 4、管理人制定收益分配方案；
- 5、管理人通知委托人；
- 6、注册登记人实施分配方案。

第 15 部分 投资理念与投资策略

一、投资目标

本集合计划以追求指数的相对收益为目标,在博取相对于基准指数的超额收益的基础上同时保留指数涨跌带来的损益,追求资产的稳健增值。

二、投资理念

中证 500 指数编制方式保障了各成分股正是其市值成长最快的时期。相较于其他指数,中证 500 指数总体的占比最形成了传统行业(工业、公用事业、金融地产、能源和原材料)与新兴行业(可选消费、日常消费、医药保健、信息技术和电信服务)权重各占一半,成长与价值风格均衡的格局。在经历过一轮下跌的调整之后,中证 500 指数的估值已经大幅降低,投资价值凸显。

本集合计划以中证 500 指数为基准参考指数,并用量化选股模型选取一揽子股票来增强基准指数的收益。与此同时,量化选股模型在当前市场广度和深度均有大幅提升的情况下逐渐成为股票投资的有力武器,量化股票主动管理及指数增强已成为资管发展趋势。

三、投资策略

本集合计划将以中证 500 指数为基准指数,并根据量化选股模型来投资一揽子股票并尽量博取相对于基准指数的超额收益。

1. 资产配置策略

在具体的资产配置过程中,本集合计划以股票资产为主,以现金类金融资产和 ETF 基金等金融资产为辅,最大限度地保证资金的使用效率。

2. 股票投资策略

1) 行业配置

本集合计划在行业配置方面将尽量遵循基准指数的行业市值占比,尽量控制投资组合相对于基准指数的行业暴露带来的风险损失。

2) 个股选择

本集合计划根据股票库中可选投资标的期望收益率、流动性和市场风险偏好

等要素选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价主要驱动因素的变化动态调整投资组合构成。

A、股票库的建立

本集合计划通过具有前瞻性、差异性和时效性的研究，致力于挖掘拥有可持续竞争力的、被市场低估的、具备确定成长性的优势上市公司。具体研究中，通过对公司可持续竞争力、治理结构、管理层素质、业绩成长性及确定性、估值等要素定性与定量结合综合评定，筛选出具备中长期投资价值的公司股票库。

B、选股策略

本集合计划通过对股票库中可选投资标的公司中短期期望收益率、股票有效流动性、市场风险偏好等核心要素的综合比较，选择风险收益比最具吸引力的个股，并根据投资标的公司股价驱动主要因素的变化动态调整投资组合构成。本集合计划的选股策略从理念上来看主要分为以下两类：

1). Alpha 量化选股模型

通过全方位挖掘市场有效因子，Alpha 选股策略分别覆盖估值、成长、盈利质量等个股基本面因素，也覆盖了卖方分析师多维度指标的市场情绪因素，同时也深入挖掘了基于量价关系和统计套利原理的个股交易型因子。在因子和子模型统筹的层面采用了先进的机器学习技术，根据市场风格的变化来智能选取当前有效因子并对未来个股收益率做出预测。在投资组合管理层面，对每一个 Alpha 策略均在行业和风险因子的暴露上做了严格控制，并基于风险模型和优化器对投资组合进行精细化配置。历史业绩表明 Alpha 选股模型得到的股票组合具有稳定的超额收益。

2). 事件驱动选股模型

事件驱动型交易策略是在提前挖掘和深入分析可能造成股价异常波动的事件基础上，通过充分把握交易时机获取超额投资回报的交易策略。事件驱动型交易策略的“事件”是指具有较为明确的时间和内容，能够对部分投资者的投资行为产生一定的影响，从而决定股价短期波动的因素。目前 A 股市场中的事件驱动的因素有很多，包括财报超预期、大股东增减持、指数成分股调仓、分析师报告覆盖、股权激励以及上市公司调研等多种事件，其分布时间或者有确定的公布时间，

或者为不确定的随机发生。通过回溯 A 股过往的历史数据及事件发生的时间，发现 A 股市场中某些事件的发生会给股票带来相对确定性的超额收益。与此同时，不同事件的发生也有着很强的时间分布。因此本集合计划将在投资过程中对各类事件进行合成，最终可能得到相对稳定的事件驱动策略。

事件驱动和 Alpha 选股策略的收益相关性较低，提供信息的互补性可以更全方位地抓取个股上涨的驱动因素。

第 16 部分 投资决策与风险控制

一、 集合计划的决策依据

集合计划以国家有关法律、法规和本合同的有关规定为决策依据，并以维护集合计划委托人利益作为最高准则。具体决策依据包括：

- 1、《管理办法》、《细则》、《规范》、《集合资产管理合同》、《说明书》等有关法律文件；
- 2、宏观经济发展态势、微观经济运行环境和证券市场走势。这是本集合计划投资决策的基础；
- 3、投资对象收益和风险的配比关系。在充分权衡投资对象的收益和风险的前提下作出投资决策，是本集合计划维护投资者利益的重要保障。针对本产品的特点，在衡量投资收益与风险之间的配比关系时，力争保护投资者的本金安全，在此基础上为投资者争取较高的收益。

二、 投资程序

1、 投资决策程序

管理人资产管理业务投资决策体系由管理人投资决策委员会、投资主办人二级体系组成。

管理人投资决策委员会负责确定以下事项：

- 1) 研究决定各投资主办人/基金经理的任免、授权与授权的更改；
- 2) 研究决定各项资产管理产品的资产配置策略或者投资交易策略；
- 3) 审议投资主办人/基金经理提交的定期报告；
- 4) 审批股票池（含基金）、债券库和策略库的建立方法和程序；
- 5) 审议股票池（含基金）、债券库和策略库的建立和调整方案；
- 6) 审议主动管理产品的投资逻辑和投资实现路径；
- 7) 其他经公司产品发行审核委员会授权的事项。

投资主办人是资产管理业务具体项目的直接管理人，在公司授权范围内进行投资管理。

2、投资交易程序

管理人设置独立的交易部，投资主办人下达的投资指令通过交易部实施。交易部接到投资主办人的投资指令后，根据有关规定对投资指令的合规性、合理性和有效性进行检查，确保投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

3、投资风险的监控与绩效评估

由专人定期对集合计划资产进行定性和定量相结合的风险、绩效评估，并向公司投资决策委员会和风险控制部门提供报告，供投资决策委员会、风险控制部门和投资主办人随时了解投资组合承担的风险水平，检验既定的投资策略。绩效评估能够确认投资组合是否实现了投资预期、组合收益的来源及投资策略成功与否，投资主办人可据以检讨投资策略，进而调整投资组合。主要评估内容如下：

(1) 投资组合的资产配置：分类统计投资组合中各类资产的配置情况，并检查是否符合资源配置策略和集合计划本身的要求。

(2) 投资收益贡献分析：分类统计投资组合中各类资产的收益构成及收益贡献并将实际投资品种与基准进行横向比较。

(3) 动态评估投资组合中各证券的风险和收益水平，并给出调整建议。

三、风险控制

1、风险控制的原则

在建立风险管理体系时应严格遵循以下原则：

- (1) 全面性原则：风险管理制度应覆盖公司业务的所有工作和各级人员，并渗透到决策、执行、监督、反馈等各个环节；
- (2) 审慎性原则：风险管理的核心是有效防范各种风险，公司组织体系的构成、内部管理制度的建立都要以防范风险、审慎经营为出发点；
- (3) 独立性原则：风险管理工作应保持高度的独立性和权威性，并贯彻到业务的各具体环节；
- (4) 有效性原则：风险管理制度应当符合国家法律法规和监管部门的规章，具有高度的权威性，成为所有员工严格遵守的行动指南；执行风险管理制度不能存在任何例外，任何员工不得拥有超越制度或违反规章的权力；

- (5) 适时性原则：风险管理制度应随着国家法律、法规、政策制度的改变以及业务的发展变化及时进行相应修改和完善；
- (6) 防火墙原则：公司内部对投资管理、研究策划、市场开发、风险管理、综合支持等职能通过组织与岗位分设，且相互制衡，以达到风险防范的目的。因业务需要知悉内幕信息的人员，应严格遵守公司的保密协议；
- (7) 定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和可操作性。

2、风险控制组织架构

(1) 管理人董事会是风险管理的最高决策机构，对管理人全面风险管理承担最终责任，董事会下设的内部控制委员会审议管理人风险管理战略目标和政策等，对风险管理有效性进行评估。

(2) 管理人经营管理层对风险管理的有效性承担管理责任，首席风险官负责全面风险管理工作，经营管理层下设的风险管理委员会公司经营风险实行统筹管理，对风险管理重大事项进行审议。

(3) 管理人设立风险管理部履行具体风险管理职责，组织实施风险管理的具体工作内容与任务，对公司经营管理和业务开展过程中的各项风险进行事前、事中、事后的控制、管理与防范。在管理人授权范围内开展工作，对风险管理委员会负责。

(4) 管理人各业务部门根据经营计划、业务规则及本部门具体情况制定本部门的工作流程及风险控制措施，实现一级风险防范。各部门负责人对风险管理的有效性承担直接责任。

3、投资风险程序

(1) 研究业务的风险控制

研究工作应保持独立、客观，不受任何部门及个人的不正当影响；建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；建立投资产品备选库制度，研究部门根据投资产品的特征，在充分研究的基础上建立和维护备选库。建立研究与投资的业务交流制度，保持畅通的交流渠道；建立研究报告质量评价体系，

不断提高研究水平。

(2) 投资业务的风险控制

集合计划的投资应确立科学的投资理念,根据决策的风险防范原则和效率性原则制定合理的决策程序;在进行投资时应有明确的投资授权制度,并应建立与所授权限相应的约束制度和考核制度。建立严格的投资禁止和投资限制制度,保证集合计划投资的合法合规性。建立投资风险评估与管理制度,将重点投资限制在规定的风险权限额度内;对于投资结果建立科学的投资管理业绩评价体系。

(3) 交易业务的风险控制

建立专门的交易部和集中交易制度,投资指令通过交易部完成;应建立交易监测系统、预警系统和交易反馈系统,完善相关的安全设施;交易部应对交易指令进行审核,建立公平的交易分配制度;交易记录应完善,并及时进行反馈、核对并存档保管;同时应建立科学的投资交易绩效评价体系。

(4) 会计核算的风险控制

管理人根据法律法规及业务的要求建立会计制度,并根据风险控制点建立严密的会计系统,对于不同集合计划独立建账,独立核算;管理人通过复核制度、凭证制度、合理的估值方法和估值程序等会计措施真实、完整、及时地记载每一笔业务并正确进行会计核算和业务核算。同时还建立会计档案保管制度,确保档案真实完整。

(5) 信息披露

管理人建立了完善的信息披露制度,保证公开披露的信息真实、准确、完整。管理人应设立信息披露负责人,并建立相应的程序进行信息的收集、组织、审核和发布工作,以此加强对信息的审查核对,使所公布的信息符合法律法规的规定,同时加强对信息披露的检查和评价,对存在的问题及时提出改进办法。

4、全程风险管理控制

(1) 建立风险控制构架,完善风险控制制度和体系。

在制度管理方面,除了公司的基本制度和内控规范外,针对资产管理业务还系统地制定了投资管理、交易、风险控制、产品开发、客户服务和营运管理等制度,对资产管理业务的投资决策体系、投资管理流程、权限管理、交易工作流程、

可投资证券库的建立及维护程序、产品开发程序、客户服务机制等都做出了具体的规定。

在组织架构方面，将市场营销、投资管理、交易执行、综合支持、风险管理等予以内部岗位分设，通过职能分离形成制衡，并设立了独立的风控岗位加强风险监控。

(2) 风险识别：对各类风险及各个风险点进行全面有效识别。

公司已按照资产管理业务流程，对本集合计划的设计开发、合同签订、委托人开户、投资决策、投资执行、交易、财务清算与资金、客户管理等各环节风险点进行全面梳理。本集合资产管理计划的主要风险为市场风险、流动性风险、信用风险和管理风险等。

对于股指期货将加强实时动态监控，对股指期货投资策略和套期保值的可行性、有效性进行验证、评估、监控，并督促投资部门及时调整风险敞口确保投资策略或套期保值的可行性、有效性。

(3) 风险度量：综合运用各类分析方法，评估各类风险及各个风险点的风险水平。

对于本集合资产管理计划已建立了风险管理指标体系，包括合规性指标、配置管理指标、权限管理指标、市场风险指标、流动性风险指标、信用风险指标等。公司已建立风险管理绩效评估系统，借助量化手段进行风险评估。

(4) 风险处理：依据各类风险及各个风险点的风险水平，参照既定的风险控制目标，建议并监督实施一定的控制措施。

根据设定的风控指标、投资范围及其他限定性条件在投资管理系统中设置阈值或限制，当投资及交易出现超出限定范围情况时，系统可自动预警；通过资产管理业务的交易系统等业务进行实时监控；对于资产配置的策略、计划和组合，不同的决策层面定期进行评估、检讨，分析业务风险并进行相应调整；对于重大突发风险，则启动应急机制。

(5) 风险报告与反馈：建立自下而上的风险报告程序，使各个层面及时掌握风险状况，从而以最快速度自上而下做出决策反馈。

公司制定了多层的业务报告制度，投资管理及风险状况每日需报告部门领

导，周报、月报、季报需分别上报部门领导、公司分管领导和公司风控部门，投资实施及风险状况受到多重的监管。

(6) 监督与检查：评估风险管理的有效性，适时加以修正。

公司风险控制部门定期或不定期地检查业务内控的有效性，对内控机制的设计或运行中的缺陷提出改进意见，完善风控措施。

第 17 部分 投资限制及禁止行为

一、投资限制

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：

- 1、投资于单一股票的比例不得超过集合计划资产净值的 20%；
- 2、集合资产管理计划申购新股，申报的金额不得超过该计划的现金总额，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量。

3、集合计划的总资产占集合计划的净资产不得超过 140%。

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，则本集合计划不受上述限制。

二、禁止行为

本集合计划的禁止行为包括：

- 1、违规将集合计划资产用于资金拆借、贷款、抵押融资或者对外担保等用途；
- 2、将集合计划资产用于可能承担无限责任的投资；
- 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；
- 4、挪用集合计划资产；
- 5、募集资金不入账或者其他任何形式的账外经营；
- 6、募集资金超过计划说明书约定的规模；
- 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；
- 8、使用集合计划资产进行不必要的交易；
- 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；
- 10、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

第 18 部分 集合计划的信息披露

一、定期报告

定期报告包括集合计划单位净值报告、集合计划的资产管理季度（年度）报告、资产托管季度（年度）报告和年度审计报告。

1、集合计划单位净值报告。

管理人在每周二（若遇节假日，则顺延至下一个工作日）通过管理人网站披露经过托管人审核的上周最后一个交易日份额净值、累计净值，并于每月开放之日，公告前第二个交易日的份额净值、累计净值，供投资人参考。

2、集合计划的资产管理季度报告和托管季度报告。

管理人、托管人在每季度分别向委托人提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每季度截止日后 15 个工作日内通过管理人网站披露，并根据规定向相关监管机构报备。集合计划成立不足 2 个月时，管理人、托管人可以编制当期的季度报告，集合计划终止当季，管理人、托管人可以编制当季报告。

3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告

管理人、托管人在每年度分别向委托人提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告，对报告期内集合计划资产的配置状况、价值变动情况、重大关联交易做出说明。上述报告应于每个会计年度截止日后 3 个月内通过管理人网站披露，并根据规定向相关监管机构报备。集合计划成立不足 3 个月时，管理人、托管人可以编制当期的年度报告，集合计划终止当年，管理人、托管人可以编制年度报告。

管理人将按照《交易指引》的相关规定，管理人将在资产管理报告中充分披露集合资产管理计划参与股指期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并充分说明投资股指期货对集合资产管理计划总体风险的影响以及是否符合既定的投资目的，并在年度报告中披露相应内容。

4、年度审计报告。

管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合资产管理计划的运营情况进行年度审计，并在每年度结束之日起 3 个月内将审计报告提供给托管人，通过管理人网站向委托人披露，并根据规定向相关监管机构报备。

5、对账单

管理人在每季度结束后 15 个工作日内通过书面或电子邮件等方式向委托人提供对账单信息，对账单内容应包括集合计划产品特性，投资风险提示，委托人持有计划份额的数量及净值，参与、退出明细，收益分配以及计划的差异性、风险等情况。

二、临时报告

集合计划存续期间，发生对集合计划持续运营、客户利益、资产净值产生重大影响的事件，管理人应当以管理人网站公告方式及时向客户披露。临时报告的情形包括但不限于：

- (1) 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主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；
- (2) 暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；
- (3) 发生巨额退出并延期支付；
- (4) 集合计划终止和清算；
- (5) 合同的补充、修改与变更；
- (6) 与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；
- (7) 负责本集合计划的推广机构发生变更；
- (8) 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；
- (9) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；
- (10) 管理人自有资金参与和退出；
- (11) 管理人认为的其他重大事项。

三、信息披露方式

本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《实施细则》、集合资产管理合同及其他有关规定进行。集合计划的信息披露事项将以下列方式进行披露。

1、管理人网站信息披露

本计划《说明书》、《集合资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等有关集合计划的信息，将在集合计划管理人网站（www.gtjazg.com）上披露，委托人可随时查阅。

2、管理人、托管人、推广机构指定营业网点查询

本计划《说明书》、《集合资产管理合同》、其他备查文件、相关报告等文本存放在集合计划管理人、集合计划托管人和集合计划推广机构的住所，委托人可在营业

时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。对委托人按上述方式所获得的文件及其复印件，集合计划管理人和集合计划托管人保证其内容与所披露的内容完全一致。

3、国泰君安证券资产管理客服电话

本集合计划披露的有关集合计划的信息，委托人可以通过国泰君安证券资产管理客服电话（95521）查询。

四、信息披露文件的存放及查阅

本集合计划的定期公告与报告、临时公告与报告存放在管理人、托管人的办公场所，委托人可在办公时间查阅。

管理人和托管人应当妥善保存客户开户资料、委托记录、交易记录和与内部管理、业务经营有关的各项资料，任何人不得隐匿、伪造、篡改或者毁损。

第 19 部分 集合计划份额的转让、非交易过户和冻结

一、集合计划份额的转让

本计划成立后，管理人可以按照规定申请份额转让事宜。

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。

二、集合计划的非交易过户

非交易过户是指不采用参与、转让、退出等集合计划交易方式，将一定数量的集合计划份额按照一定规则从某一委托人集合计划账户转移到另一委托人集合计划账户的行为。

注册登记机构只受理继承、捐赠以及其他形式财产分割或转移等情况下的非交易过户。具体业务规则以注册登记机构业务规则为准。

委托人办理因上述原因引起的非交易过户须提供注册登记机构要求的相关证明文件等材料到注册登记机构处办理。对于符合条件的非交易过户申请自申请受理日起 2 个月内办理，并按注册登记机构规定的标准收费。

三、其他情形

集合计划份额冻结、解冻的业务，由注册登记机构办理。

集合计划注册登记机构只受理国家有关机关依法要求的集合计划份额的冻结与解冻以及注册登记机构认可的其他情况的集合计划份额的冻结与解冻。

当集合计划份额处于冻结状态时，集合计划注册登记机构或其他相关机构有权拒绝集合计划份额的退出、非交易过户等业务的申请。

第 20 部分 集合计划的展期

本集合计划管理期限为 5 年，可展期。

一、展期的条件

- 1、在存续期间，本集合计划运营规范，管理人、托管人未违反《集合资产管理合同》、《说明书》的约定；
- 2、展期没有损害委托人利益的情形；
- 3、托管人同意继续托管展期后的集合计划资产；
- 4、中国证监会规定的其他条件。

二、展期的安排

1、通知展期的时间

不晚于在集合计划到期前 1 个月。

2、通知展期的方式

管理人将通过管理人网站公告通知委托人。

3、委托人回复的方式

委托人应当在管理人网站公告之日起 5 个工作日内以书面或管理人约定的其他方式明确回复意见。

三、委托人不同意展期的处理办法

若委托人明确回复不同意展期，委托人有权按照管理人公告内容在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理退出手续；若委托人未在存续期届满日前（含届满日）到推广机构办理集合计划份额退出手续，则由管理人决定对上述份额于存续期届满之日做自动退出处理或视为委托人同意管理人的展期安排。若委托人未回复意见或回复意见不明确的，并未在上述期限内办理退出手续的，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

四、展期的实现

如果同意集合计划展期的委托人户数不少于 2 户，则集合计划存续期将依法展期；如果同意本集合计划展期的各委托人户数低于 2 户则集合计划到期终止，将按照《集合资产管理合同》等相关法律文件的规定办理计划到期终止和清算事宜。

第 21 部分 集合计划终止与清算

一、有下列情形之一的，集合计划应当终止：

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事故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。

二、集合计划的清算

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。

第 22 部分 当事人的权利与义务

一、委托人的权利和义务

(一) 委托人的权利

- 1、取得集合计划收益；
- 2、通过管理人网站查询等方式知悉有关集合计划投资运作的信息，包括集合计划的资产配置、投资比例、损益状况等；
- 3、按照本合同及《说明书》的约定，参与、退出集合计划；
- 4、按持有份额取得集合计划清算后的剩余资产；
- 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；
- 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。

(二) 委托人的义务

- 1、委托人应认真阅读本合同及《说明书》，并保证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；
- 2、按照本合同及《说明书》约定划付委托资金，承担本合同约定管理费、托管费及其他费用；
- 3、按本合同及《说明书》约定承担集合计划的投资损失；
- 4、不得违规转让其所拥有的计划份额；
- 5、法律、行政法规、中国证监会的有关规定及本合同、《说明书》约定的其他义务。

二、管理人的权利和义务

(一) 管理人的权利

- 1、根据本合同及《说明书》的约定，独立运作集合计划的资产；
- 2、根据本合同及《说明书》的约定，收取管理费等费用；
- 3、按照本合同及《说明书》的约定，停止办理集合计划的参与，暂停办理集合计划的退出事宜；
- 4、根据本合同及《说明书》的约定，终止本集合计划的运作；
- 5、监督托管人，并针对托管人的违约行为采取必要措施保护委托人的利益；
- 6、行使集合计划资产投资形成的投资人权利；

7、集合计划资产受到损害时，向有关责任人追究法律责任；

8、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》约定的其他权利。

（二）管理人的义务

1、在集合计划投资管理活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，为委托人服务，以专业技能管理集合计划的资产，依法保护委托人的财产权益；

2、建立健全内部风险控制、财务管理及人事管理等制度；

3、根据中国证监会有关规定、本合同、《说明书》和托管协议的约定，接受托管人的监督；

4、管理人负责集合资产管理计划资产净值估值等会计核算业务，编制集合资产管理计划财务报告，并接受托管人的复核；

5、按规定出具资产管理报告，保证委托人能够及时了解有关集合计划投资组合、资产净值、费用与收益等信息；

6、保守集合计划的商业秘密，在集合计划有关信息向委托人披露前，不泄露集合计划的投资安排、投资意向等信息（法律、行政法规、中国证监会另有规定或相关司法部门、监管机构另有要求的除外）；

7、按照本合同及《说明书》约定向委托人分配集合计划的收益；

8、依法对托管人、推广机构的行为进行监督，如发现托管人、推广机构违反法律、行政法规和中国证监会的规定，或者违反托管协议、推广协议的，应当予以制止，并按照规定向相关监管机构报备；

9、按照有关法律、行政法规、中国证监会有关规定及《说明书》的约定，指定注册登记机构办理集合计划的开户登记事务及其他与注册登记相关的手续；

10、按照法律、行政法规、中国证监会有关规定和本合同及《说明书》的约定，及时向退出集合计划的委托人支付退出款项；

11、按相关法律法规妥善保存与集合计划有关的合同、协议、推广文件、交易记录、会计账册等文件、资料和数据；

12、在集合计划终止时，与托管人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜；

13、在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产或因其他原因不能继续履行管理人职责时，及时向委托人和托管人报告；

14、因管理人过错导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，应承担赔偿责任；

15、因托管人过错导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时，代委托人向托管人追偿；

16、聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合计划的运营情况进行专项审计，集合计划审计报告应当在每年度结束之日起3个月内，根据规定向相关监管机构报备，同时向托管人和委托人披露；

17、在与关联方发生交易行为时，保证对关联方及非关联方公平对待；

18、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。

三、托管人的权利和义务

(一) 托管人的权利

1、依法托管集合计划的资产；

2、按照本合同、《说明书》和托管协议的约定收取托管费；

3、监督管理人集合计划的经营运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定或者本合同、《说明书》和托管协议约定的，要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行；

4、查询集合计划的经营运作情况；

5、托管协议与本合同、说明书约定不一致的，托管人的托管职责以托管协议的约定为准。

6、法律法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》、《托管协议》约定的其他权利。

(二) 托管人的义务

1. 依法为集合计划开立专门的资金账户和专门的证券账户等相关账户；

2. 非依法律、行政法规和中国证监会有关规定或合同约定，不得擅自动用或处分集合计划资产；

3. 在集合计划托管活动中恪尽职守，履行诚实信用、谨慎勤勉的义务，保管集合计划的资产，确保集合计划资产的独立和安全，依法保护委托人的财产权益；

4. 安全保管集合计划资产，执行管理人的投资或者清算指令，负责办理集合计划名下的资金往来；

5. 定期核对资产管理业务资产情况;
6. 监督管理人集合计划的经营运作,发现管理人的投资或清算指令违反法律法规、中国证监会的有关规定和本合同、《说明书》以及托管协议约定的,应当要求其改正;未能改正的,应当拒绝执行,并按照规定向相关监管机构报备;
7. 复核、审查管理人计算的集合计划的资产净值、份额净值;
8. 保守集合计划的商业秘密,在集合计划有关信息向委托人披露前予以保密,不向他人泄露(法律法规、中国证监会另有规定或有权机关要求的除外);
9. 按规定出具集合计划托管情况的报告;
10. 妥善保存与集合计划托管业务有关的合同、协议、交易记录、会计账册等文件、资料和数据,保存期不少于二十年;
11. 在集合计划终止时,与管理人一起妥善处理有关清算和委托人资产的返还事宜;
12. 在解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时,及时报告委托人和管理人;
13. 因托管人过错导致集合计划资产损失或损害委托人合法权益时,应承担赔偿责任;
14. 因管理人过错造成集合计划资产损失的,代委托人向管理人追偿;
15. 托管人承诺已取得兴业银行股份有限公司的内部有效授权担任集合计划的托管人,并受管理人与兴业银行股份有限公司签署的《国泰君安证券资产管理-兴业银行关于集合资产管理计划之资产托管协议(证券公司结算模式)》的约束,根据该托管协议和本合同约定履行权利义务;
16. 法律法规、中国证监会有关规定及本合同、《说明书》、《托管协议》约定的其他义务。

第 23 部分 违约责任与争议处理

一、违约责任

1、管理人、托管人在履行各自职责的过程中，违反法律、行政法规的规定或者本合同约定，给本计划财产或者委托人造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任；因共同行为给本计划财产或者委托人造成损害的，应当按各自的过错承担赔偿责任。但是发生下列情况的，当事人可以免责：

(1) 不可抗力

一方因不可抗力不能履行本合同时，应及时通知另一方，并在合理期限内提供受到不可抗力影响的证明，同时采取适当措施防止集合计划财产损失扩大。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

(2) 管理人和/或托管人按照当时有效的法律法规或中国证监会的规定作为或不作为而造成的损失等；

(3) 管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

(4) 在本计划运作过程中，管理人及托管人按照法律、行政法规的规定以及本合同的约定履行了相关职责，但由于其控制能力之外的第三方原因或其他原因而造成运作不畅、出现差错和损失的。

(5) 资产管理人、资产托管人对由于第三方（包括但不限于交易所、中登公司、保证金监控中心等）发送或提供的数据错误及合理信赖上述信息而操作给本计划资产造成的损失等。

(6) 管理人或托管人任一方不因另一方的失职行为而给集合计划财产或委托人造成的损失向委托人承担连带责任。

(7) 在本合同、托管协议中约定的管理人、托管人可以免责的其他情形。

2、合同当事人违反本合同，给其他当事人造成直接经济损失的，应当承担赔偿责任。在发生一方或多方当事人违约的情况下，合同能继续履行的，应当继续履行。

3、本合同一方当事人或多方当事人造成违约后，其他当事人应当采取适当措施防止损失的扩大；没有采取适当措施致使损失扩大的，不得就扩大的损失要求赔偿。守约方因防止损失扩大而支出的合理费用由违约方承担。

4、由于管理人、托管人不可控制的因素导致业务出现差错，管理人和托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现错误或者即使发现错误但因上述原因未能修正的，由此造成计划财产或委托人损失，管理人和托管人免除赔偿责任。但是管理人和托管人应积极采取必要的措施消除或减轻由此造成的影响。

5、一方当事人依据本合同向另一方当事人赔偿的损失，仅限于直接经济损失。

6、管理人违反法律、行政法规的有关规定，被中国证监会依法撤销证券资产管理业务许可、责令停业整顿，或者因停业、解散、撤销、破产等原因不能履行职责的，应当按照有关监管要求妥善处理有关事宜。

7、托管人对于没有保管在托管人处的有价证券及其他集合计划资产不负有保管责任，由于非托管人的过错致使其保管的资产发生毁损或灭失的，托管人不承担赔偿责任。

8、委托人的债权人通过司法机关对集合计划资产采取强制措施，由此造成集合计划资产损失的，管理人和托管人不承担任何责任。

二、争议的处理

因履行本合同发生的争议，由协议签订各方协商解决，协商不成的，任何一方均有权将争议提交上海国际仲裁中心(仲裁地:上海)并按其仲裁规则进行仲裁解决。仲裁裁决是终局的，对各方当事人具有约束力。争议的解决适用中华人民共和国法律(不包括香港、台湾和澳门地区)。

第 24 部分 风险揭示

委托人投资于本计划可能面临以下风险,有可能因下述风险导致委托人本金或收益损失。管理人承诺以诚实信用,谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划资产,管理人制定并执行相应的内部控制制度和风险管理制度,以降低风险发生的概率。但这些制度和办法不能完全防止风险出现的可能,管理人不保证本计划一定盈利,也不保证最低收益。本计划面临的风险包括但不限于以下风险:

1. 市场风险

本集合计划主要投资于证券市场,而证券市场中的投资品价格因受各种因素的影响而引起的波动将对本集合资产管理计划资产产生潜在风险,主要包括:

A、宏观经济层面的风险

(1) 政策风险

货币政策、财政政策、产业政策、地区发展政策等国家政策的变化对证券市场产生一定的影响,导致市场价格波动,影响集合资产管理计划收益而产生风险。

(2) 经济周期风险

证券市场是国民经济的晴雨表,而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响,从而产生风险。

(3) 利率风险

金融市场利率波动会导致股票市场及债券市场的价格和收益率的变动,同时直接影响企业的融资成本和利润水平。集合计划投资于股票和债券,收益水平会受到利率变化的影响,从而产生风险。

(4) 购买力风险

本集合计划投资的目的是使集合计划资产保值增值,如果发生通货膨胀,集合计划投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消,从而影响集合计划资产的保值增值。

(5) 再投资风险

由于金融市场利率下降造成的无法通过再投资而实现本合同目的的风险。

B、上市公司的经营风险

上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利发生变化，从而导致集合计划投资收益变化。

C、基金的业绩风险

所投资的证券投资基金由于其管理人的投资失误，造成业绩下降，也会影响到集合计划的收益率。

2. 新股申购风险

新股申购风险是指获配新股上市后其二级市场交易价格下跌至申购价以下的风险。由于网下获配新股的股票价格受各种市场因素、宏观政策因素等的影响，股票价格有可能下跌到申购价以下。

3. 模型风险

量化投资策略依赖各种量化投资模型，随着市场环境的变化模型数据不再能有效地刻画市场的真实状况和运行逻辑，使得模型在测算、评估时存在误差，导致投资策略在未来的表现不及历史表现。与此同时，量化模型的有效性以概率取胜，而小样本事件或者市场条件突然发生改变有可能使模型短期失效，从而对投资组合的收益产生不利影响。

4. 流动性风险

指集合计划资产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风险。在计划存续期间，可能会发生个别偶然事件，如出现巨额退出的情形，短时间委托人大量退出或出现集合计划到期时，证券资产无法变现的情况，上述情形的发生在特殊情况时可能会出现交易量急剧减少的情形，此时出现巨额退出，则可能会导致计划资产变现困难，从而产生流动性风险，甚至影响本计划份额净值。

流动性风险按照其来源可以分为两类：外生流动性风险和内生流动性风险。

(1) 外生流动性风险

外生流动性风险指的是由于来自资产管理人外部冲击造成证券流动性的下降，这样的外部冲击可能是影响所有证券的事件，也可能只是影响个别证券的事件，但是其结果都是使得所有证券、某类证券或者单只证券的流动性发生一定程度的降低，造成证券持有者可能增加变现损失或者交易成本。

(2) 内生流动性风险

所谓内生流动性风险是指由于本集合计划组合的资产需要及时调整仓位而面临的不能按照事前期望价格成交的风险,该风险可以以本集合资产管理计划资产变现(或购买证券)时成交价格小于(或大于)事前期望价格所产生的最大成本来度量。内生流动性风险在一定程度上是可控的,但其可控程度取决于流动性风险的来源及外部冲击。

5. 管理风险

本集合计划为动态管理的投资组合,存在管理风险。

在集合计划管理运作过程中,可能因管理人对经济形势和证券市场等判断有误、获取的信息不全等影响集合计划的收益水平。管理人和托管人的管理水平、管理手段和管理技术等对集合计划收益水平存在影响。

管理人在管理本集合计划,做出投资决定的时候,会运用其投资技能和风险分析方法,但是这些技能和方法不能保证一定会达到预期的结果。

管理人在管理本计划时,管理人的内部控制制度和风险管理制度可能没有被严格执行而对集合计划资产产生不利影响,特别是可能出现本集合计划资产与管理人自有资产、或管理人管理的其他集合计划资产之间产生利益输送。

6. 信用风险

信用风险是指证券投资中存在的交易对手在交收过程中的违约风险。

7. 合规性风险

指集合计划管理或运作过程中,违反国家法律、法规的规定,或者集合计划投资违反法规及《集合资产管理合同》有关规定的风险。

8. 操作风险

指相关当事人在业务各环节操作过程中,因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等所引致的风险,例如,越权违规交易、会计部门欺诈、交易错误、IT系统故障等风险。

9. 合同变更风险

管理人经托管人同意后可以对本合同做出调整和补充的,管理人应当及时通过管理人网站或书面形式(由管理人决定)就合同变更内容向委托人征询意见,

在征得委托人意见后，管理人确定是否变更管理合同。

10. 电子合同签约风险

本集合计划采用经中国证券登记结算责任有限公司等中国证监会认可的机构验证的电子合同签约方式，同所有网上交易一样存在操作的风险。

11. 份额转让风险

本集合计划成立后，管理人可以按照规定申请份额转让事宜。份额转让交易平台可以是证券交易所，也可以是中国证监会认可的其他交易平台。委托人通过交易平台转让份额的价格与集合计划份额净值可能不一致。

12. 对账单风险

本集合计划以邮寄或者电子邮件等方式向委托人提供对账单，可能由于委托人提供的联系信息不准确，或者投递系统出现故障，导致无法正常获得对账单信息。委托人应向管理人提供正确、有效的邮寄地址或者电子邮箱，采用电子邮件方式的，电子对账单自管理人系统出发出即视为送达；采用邮寄方式的，对账单自邮局寄出即视为送达。

13. 其它风险

- (1) 计划管理人、托管人因重大违法、违规行为，被中国证监会取消业务资格等而导致本集合计划终止的风险；
- (2) 计划管理人、托管人因停业、解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责导致本集合计划终止的风险；
- (3) 突发偶然事件的风险：指超出集合计划管理人自身直接控制能力之外的风险，可能导致集合计划或集合计划委托人利益受损。

其中“突发偶然事件”指任何无法预见、不能避免、无法克服的事件或因素，包括但不限于以下情形：

- 1) 发生可能导致集合计划短时间内发生巨额退出的情形；
- 2) 集合计划终止时，证券资产无法变现的情形；
- 3) 相关法律法规的变更，直接影响集合计划运行；
- 4) 交易所停市、上市证券停牌，直接影响集合计划运行；
- 5) 无法预测或无法控制的系统故障、设备故障、通讯故障。

- (4) 管理人操作或者技术风险、电力故障等都可能对本集合计划的资产净值造成不利影响;
- (5) 因集合计划业务快速发展而在人员配备、内控机制建立等方面不完善而产生的风险;
- (6) 因人为因素而产生的风险,如内幕交易、欺诈行为等产生的风险;
- (7) 对主要业务人员如投资主办人的依赖而可能产生的风险;
- (8) 因业务竞争压力而可能产生的风险;
- (9) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管银行违约等超出集合计划管理人自身直接控制能力外的风险可能导致集合计划或者集合计划委托人利益受损;
- (10) 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,可能导致集合计划资产的损失。
- (11) 委托人部分退出集合计划份额时,如其该笔退出完成后在该推广机构剩余的集合计划份额低于1万份时,则管理人自动将该委托人在该推广机构的全部份额退出给委托人。
- (12) 当发生分红时,管理人将根据年化收益率(R)提取业绩报酬,业绩提取方式与退出提取相同,分红时集合计划参与份额的参与日重定为该分红日(即参与份额以该分红日作为新的参与日,以分红后的份额净值作为新的参与净值,以此作为下次年化收益率的计算基准)。当分红额不足提取业绩报酬时,以分红额为限。如管理人已经提取业绩报酬,即使委托人退出本集合计划时净值有所下跌,则该部分已提取业绩报酬亦不退还委托人。

14. 特别风险提示:

(1) 管理人**不保证**委托人资产本金不受损失或取得最低收益,本集合计划可能出现净值损失,投资风险由委托人自行承担。

(2) 本集合计划首个封闭期结束后每个月开放一次,存在流动性风险。

(3) 本集合计划根据基准指数构建投资权益类投资组合,其收益率的波动与基准指数的波动相关性较大。

(4) 委托人签署本合同，即表示同意管理人将本集合计划资产投资于管理人及与管理人有关联方关系的公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，管理人将遵循客户优先原则，在发生上述所列投资证券事项时，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当将交易结果告知托管人，同时向证券交易所报告，通过资产管理季度报告向委托人披露。

第 25 部分 合同的成立与生效

一、合同的成立与生效

本合同经管理人、托管人和委托人签署后成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- 1、委托人参与资金实际交付并确认。
- 2、其他合同约定的生效条件。

二、合同的组成

《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划说明书》、经管理人确认有效的委托人参与、退出本集合计划的申请材料和各推广机构出具的集合计划参与、退出业务受理有关凭证等本合同的附件，是本合同不可分割的一部分，与本合同具有同等法律效力。附件内容与本合同相关内容有冲突的，以本合同的表述为准。

第 26 部分 合同的补充、修改与变更

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变化或修订，自该变化或修订生效之日起，本合同相关内容及条款按该变化或修订进行变更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国家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，未在上述期间申请退出本集合计划的，视为同意，管理人不再另行通知。

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，并采取如下权利保障措施及安排：

（1）委托人不同意变更的，管理人保障其退出权利，委托人应在征询意见函发出后的 5 个工作日或最近一个开放期内或按照管理人公告内容的安排提出退出本集合计划的申请；

（2）委托人不同意变更且逾期未退出的，则管理人有权在征询意见函或公告中说明的意见回复期限届满后将相关份额强制退出计划（退出价格为退出申请当日集合计划当日净值），由此发生的相关税费或或有损失由委托人自行承担；

（3）委托人未回复意见且逾期未退出，视同委托人同意本合同变更，管理人不再另行通知；

（4）委托人回复意见不明确的，则视为该委托人不同意变更，按照上述(1)-(2)处理。

本合同变更满足相关法律法规和本合同要求后，本合同变更生效。

自合同变更生效之日起，变更后的内容即成为本合同组成部分。

3、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。

4、委托人同意并确认，若经委托人、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。

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

6、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。

(以下无正文)

管理人、托管人确认，已向委托人明确说明集合计划的风险，不保证委托人资产本金不受损失或者取得最低收益；委托人确认，已充分理解本合同的内容，自行承担风险和损失。

本合同应由委托人本人签署，当委托人为机构时，应由法定代表人或者其授权代表签署并加盖公章。委托人以电子签名方式签署本合同的，视为按本条约定签署本合同，并具有同等效力。

委托人（签字）：
（盖章）：

管理人：上海国泰君安证券资产管理有限公司（公章）



托管人：兴业银行股份有限公司上海分行（公章）



签订日期：2017年2月28日

附件:

专用清算账户及资金划拨专用账户

注意: 账户如有变更, 请及时通知相关各方。

托管专户

户名:

账号:

开户银行:

大额支付号:

管理费收款账户

户名: 上海国泰君安证券资产管理有限公司

账号: 97020153850000203

开户银行: 上海浦东发展银行上海分行营业部

托管费收款账户

账户名: 证券公司客户资产管理计划托管业务收入

账号: 216200191675000146

开户行: 兴业银行上海分行营业部

大额支付行号: 309290000107