

国泰君安君享优量 500 增强 1 号集合资产管理计划说明书

二〇一九年



特别提示:

本说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(银发[2018]106号)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(以下简称《管理办法》)、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》(以下简称《运作规定》)、《国泰君安君享优量 500 增强 1 号集合资产管理计划管理合同》(以下简称《管理合同》或管理合同)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和自有资金参与集合计划,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,知悉本产品为非保本产品,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         | 国泰君安君享优量 500 增强 1 号集合资产管理计划                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|          | 类型         | 混合类集合资产管理计划                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|          | 目标规模       | 本集合计划募集期与存续期均不设规模上限。单个客户首次参与金额不低于 50 万元,户数均不超过 200 户。                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|          | 管理期限       | 本集合计划存续期限为自成立之日起 10 年(可展期)。                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|          | 募集期        | 本集合计划初始募集期自份额发售之日起不超过 60 天。                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|          | 封闭期        | 开放期以外的期间,均为本集合计划的封闭期。封闭期内不办理参与、退出业务。                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|          | 开放期、开放日    | 本集合计划自成立之日起封闭 6 个月,封闭期满后的每周五为开放日(遇节假日不顺延),开放日可以办理参与和退出业务。特别的,委托人每笔份额持有时间不得少于 180 个自然日。                                                                                                                                                                                                                                    |
|          | 份额面值       | 人民币 1.00 元                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|          | 最低金额       | 单个委托人首次参与的最低金额为人民币 50 万元(不含参与费)。对于已经是本集合计划的持有人,其新增参与资金最低金额为人民币 1 万元。                                                                                                                                                                                                                                                      |
|          | 相关费率       | 1、参与费率: 0%;<br>2、退出费率: 0%;<br>3、年托管费率: 0.15%;<br>4、年固定管理费: 1.5%;<br>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。<br>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、银行存款等现金类金融产品,股指期货以及中国证监会认可的其他投资品种。                                                                                                                                                                                                                                                     |
|          | 投资管理的方法和标准 | 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。在具体的资产配置过程中,本集合计划以股票资产和中证 500 股指期货多头为主,以现金类金融资产和基准指数 ETF 等金融资产为辅,最大限度地保证资金的使用效率。<br>A. 行业配置<br>本集合计划在行业配置方面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。<br>B. 个股选择<br>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,而在投资组合管理层 |



|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | <p>面需要充分考虑其相对于中证 500 指数的风险偏离度。</p> <p><b>C.股票池的建立</b></p> <p>考虑到 Alpha 选股模型的强度理论上正比于投资广度的平方根（选股的范围），我们在策略选股的覆盖面上尽量保留符合风控要求的所有股票。基于这样的理念，模型训练和投资组合管理模型覆盖的股票较广，基本上能覆盖市场上 70%至 75%的股票，但是根据可交易性、个股的历史长度以及风控要求，一般情况下会剔除如下股票：上市不满一年的次新股；在过去半年流动性位居市场后 10%的股票或者期间平均市值位居市场后 10%的股票；被 ST 的股票，即将退市、被证监会立案调查或者出具警示函的股票；在年报业绩窗口期，过去两年业绩连续亏损的股票；根据市场政策变化，主要基于流动性考虑需要额外剔除的股票；其他客户特别要求剔除的股票等。</p> <p><b>D.选股策略</b></p> <p>本集合计划通过具有前瞻性、差异性和时效性的研究，致力于通过先进的机器学习模型和全方位覆盖的股票因子特征来捕捉市场短期失效带来的盈利空间。本集合计划通过对股票库中可选投资标的公司中短期的期望收益率、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的中短期主要驱动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以中高频的 Alpha 选股策略为主，Alpha 策略投资的详细过程需要分成 Alpha 因子库的维护、股票池的选择、模型的训练和个股信号预测（打分）、投资组合生成、策略库的维护和策略配置等几个环节。Alpha 因子库全方位覆盖股票的日频交易数据相关因子、股票定期报告衍生因子、分析师报告衍生因子、事件驱动合成因子、股票高频交易数据相关因子以及互联网和舆情数据因子等。在 Alpha 模型算法层面，以机器学习选股模型为核心，系团队根据当前学术界先进的机器学习算法结合股票市场的高噪音和时序性的特征自主研发而成，并已从低频机器学习模型切入高频机器学习统计套利模型。团队运作的 Alpha 量化策略以不同的投资组合的形式呈现，所有投资组合均严格控制其相对于基准指数的风险暴露，通过自主研发的风险模型和组合优化模型得到日频的投资组合（低频 Alpha 模型）或者实时的投资组合（短周期高频 Alpha 模型），在投资组合优化的过程中主要严格控制的风险为规模因子、Beta 因子、波动率因子、动量因子和行业因子等，在主要市场风险因子上的暴露程度均严格控制在 0.2 倍标准差之内，在行业因子上严格控制其相对于基准指数的行业偏离度不能超过 2%。团队在 Alpha 策略领域深耕多年，在 Alpha 策略库方面已经形成了日频 Alpha 策略、事件驱动策略、Smart Beta 策略以及短周期高频 Alpha 策略，并根据不同的基准指数每日盘后或者盘中按需生成对应投资组合。在 Alpha 策略配置方面，在一般情况下以配置短周期高频 Alpha 策略为主，但不排除在市场极端情况下低频 Alpha 策略，这充分考虑到我们在这两大 Alpha 策略领域的储备，高频 Alpha 策略在风格变化快且流动性好的市场环境下有低频 Alpha 策略无可比拟的优势，但是后者在单边动量市场或者流动性较差的市场环境下亦能形成高频 Alpha 策略的有效补充。</p> |
| 投资限制 | <ol style="list-style-type: none"> <li>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%。</li> <li>2、集合资产管理计划中购新股，申报的金额不得超过该计划的总资产，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。</li> <li>3、集合计划的总资产占集合计划的净资产不得超过 140%。</li> <li>4、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%；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%。</li> <li>5、集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过该资产管理计划资产净值的 20%。</li> <li>6、集合计划开放退出期内其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值，不低于该计划资产净值的 10%。流动性受限资产以及 7 个工作日可变现资产以《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（中国证券监督管理委员会公告〔2018〕31 号）规定为准。</li> <li>7、投资于商品及金融衍生品的持仓合约价值的比例不高于资产管理计划总资产 80%，且衍生品账户权益不超过资产管理计划总资产 20%。</li> </ol>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |

|         |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|---------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|         |        | 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|         | 风险收益特征 | 管理人根据相关法律法规及其内部相关制度规定，将本集合计划的风险评级评价为中高风险。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
|         | 适合推广对象 | 根据前述风险评级，本集合计划适合向合格投资者中的专业投资者和风险承受能力评估结果为积极型、激进型的普通投资者销售。但法律法规及推广机构另有规定的除外。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 当事人     | 管理人    | 上海国泰君安证券资产管理有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     |
|         | 托管人    | 海通证券股份有限公司                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|         | 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 集合计划的募集 | 初始募集   | 如本集合计划在初始募集期内客户数达到 200 户，管理人可提前终止初始募集期。管理人在初始募集期内使用“金额优先+金额相同情况下时间优先”方法对集合计划认购总户数实行限量控制。若管理人决定提前结束初始募集期，应提前一个工作日通知销售机构和注册登记机构。                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
|         | 认购的原则  | 1、本集合计划采用电子合同的方式签署，委托人在各销售网点，签署合同。委托人应当如实提供与签署合同相关的信息和资料，管理人和其他销售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。<br>2、“金额参与”原则，即认购以金额申请。<br>3、本集合计划的单个委托人首次认购最低金额（不含认购费）为 50 万元人民币，追加认购的最低金额为人民币 1 万元。认购资金应以现金方式按照本合同约定划付至管理人指定的账户。<br>4、本集合计划在初始募集期采用“已知价”原则，即认购价格以人民币 1.00 元为基准进行份额计算。<br>5、委托人认购资金在划入集合计划募集户之前产生的利息，由销售机构按其与委托人相关约定支付，认购资金划入集合计划募集户之后在募集户所产生的利息，折成集合计划份额归委托人所有，利息折成委托人份额的以注册登记机构的记录结果为准。 |
| 集合计划的参与 | 办理时间   | 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。<br>本集合计划自成立之日起封闭 6 个月，封闭期满后的每周五为开放日（遇节假日不顺延），开放日内，委托人可以按照本合同约定办理参与业务。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |
|         | 参与原则   | 1.投资者于存续期首次参与本集合计划的，应与计划管理人签署电子合同。<br>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 50 万元人民币（不含参与费），追加参与的最低金额为人民币 1 万元。<br>3.本集合计划存续期参与采用“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。<br>4.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客户数达到 200 户以上的，则对该开放日有效参与申请采用“金额优先+金额相同情况下时间优先”的原则给与确认，未确认的参与款项退还给投资者。                                                                                                                               |
|         | 参与费    | 参与费率为 0%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 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。<br>本集合计划自成立之日起封闭 6 个月，封闭期满后的每周五为开放日（遇节假日不顺延），委托人每笔份额持有时间不得少于 180 个自然日。开放日内，委托人可以按照本合同约定办理退出业务。                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|         | 退出原则   | 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；<br>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；                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |

|             |              |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|-------------|--------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|             |              | <p>3. “先进先出”原则，即对委托人在该销售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；</p> <p>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；</p> <p>5. 委托人部分退出本集合计划的，其退出后持有的份额净值应当不低于首次参与最低参与金额。委托人持有的本集合计划份额净值低于规定的最低投资金额时需要退出的，应当一次性全部退出。</p>                                                                                                                                                                                    |
|             | 退出费          | 退出费率0%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 管理人自有资金参与情况 |              | 管理人可以以自有资金参与本集合计划。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 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1,000万元人民币（含）且其委托人的户数为2户（含）以上，并经过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> <p>管理人应当在集合计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告等材料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>集合计划完成备案前不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p> |
| 集合计划设立失败    |              | <p>集合计划推广期结束，在集合计划规模低于人民币1,000万元（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。</p>                                                                                                                                                                                                              |
| 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首次最低参与金额，委托人合计不超过200户，不少于2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、托管人签订管理合同。</p>                                                                                                                                                                                                                      |
| 费用、报酬       | 费用种类         | <p>(1) 集合计划的管理费；</p> <p>(2) 集合计划的托管费；</p> <p>(3) 集合计划的业绩报酬；</p> <p>(4) 证券交易费用；</p> <p>(5) 与本集合计划相关的审计费；</p> <p>(6) 违约处置费用；</p> <p>(7) 按照法律、行政法规的规定及本合同的约定可以在本集合计划财产中列支的其他费用</p>                                                                                                                                                                                                                              |
|             | 不列入集合计划费用的项目 | 集合计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，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>1、业绩报酬计提原则</p> <p>在两类情况下管理人将根据年化收益率（R）提取业绩报酬，一类是委托人申请退出或本集合计划</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|      |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      | <p>终止清算时提取业绩报酬，称为退出提取；另一类是分红时提取业绩报酬，称为分红提取。</p> <p>管理人对同一委托人的每笔计划份额按参与时间的不同加以区分，按照《管理合同》第8部分“(二)退出的原则”，对每笔计划份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬。</p> <p><b>2、业绩报酬计提办法</b></p> <p><b>(1) 退出提取</b></p> <p>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。</p> <p>A为业绩报酬计提日的单位累计净值；<br/>C为上一个业绩报酬计提日的单位累计净值；<br/>C'为上一个业绩报酬计提日的单位净值；<br/>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；<br/>E=业绩报酬；<br/>K=退出份额×上一个业绩报酬计提日的单位净值；<br/>年化收益率 <math>R=(A-C)/C' \times 365/T \times 100\%</math>；<br/>A1为业绩报酬计提日的中证500指数收盘价；<br/>C1为上一个业绩报酬计提日的中证500指数收盘价；<br/>中证500指数年化收益率 <math>R1=(A1-C1)/C1 \times 365/T \times 100\%</math>；</p> <p>业绩报酬计提日为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。</p> <p>业绩报酬计提标准为：</p> <p>1) 当年年化收益率 <math>R &gt; \text{中证500指数年化收益率 } R1 &gt; 0\%</math>时，本集合计划对 <math>(R-R1)</math> 的超额收益部分提取20%的业绩报酬，即 <math>E=K \times (R-R1) \times 20\% \times (T \div 365)</math>。</p> <p>2) 当年年化收益率 <math>R &gt; 0\% &gt; \text{中证500指数年化收益率 } R1</math>时，本集合计划对超过0的收益部分提取20%的业绩报酬，即 <math>E=K \times (R-0\%) \times 20\% \times (T \div 365)</math>。</p> <p>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。</p> <p><b>(2) 分红提取</b></p> <p>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。当分红额不足提取业绩报酬时，以分红额为限。</p> <p>注：</p> <p>① 业绩报酬涉及的间隔天数计算管理人以确认日计算。</p> <p>② 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。</p> <p>(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。</p> <p><b>3、业绩报酬支付</b></p> <p>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，业绩报酬以管理人提供的数据为准。</p> <p>托管人根据管理人的指令将业绩报酬支付给管理人。</p> |
| 收益分配 | <p><b>一、收益分配原则</b></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、本计划默认收益分配方式为红利再投资；</p> <p>4、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；</p> <p>5、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>6、集合计划成立不满3个月可不进行收益分配；</p> <p>7、在符合有关分红条件和收益分配原则的前提下，分配频率不高于六个月一次，收益分配的相关事宜以管理人临时公告为准；</p> <p>8、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>9、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 集合计划展期        | 本集合计划可以展期。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 终止            | <p><b>有下列情形之一的，集合计划应当终止：</b></p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1. 本集合计划管理期限届满且未展期的；</li> <li>2. 管理人被依法撤销资产管理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管理人承接的；</li> <li>3. 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产，且在六个月内没有新的托管人承接的；</li> <li>4. 存续期内，经全体委托人、管理人、托管人协商一致可以提前终止本集合计划；</li> <li>5. 存续期内，集合计划委托人少于2户时；特别的，本集合计划存续期内因委托人申请退出导致集合计划当日户数低于2户时，当日委托人的退出申请管理人将做失败处理，本集合计划进入清算程序；</li> <li>6. 存续期内，当本集合计划资产净值低于500万元时，管理人有权提前终止本集合计划；</li> <li>7. 战争、自然灾害等不可抗力力的发生导致本集合计划不能存续；</li> <li>8. 未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；</li> <li>9. 法律、法规规定或中国证监会规定的其它情况。</li> </ol> <p>管理人应当自资产管理计划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，前述第7项约定的情形除外。</p>     |
| 信息披露的内容、频率和方式 | <p><b>一、信息披露的内容和频率：</b></p> <p>一) 定期报告</p> <p>1、集合计划单位净值报告。</p> <p>管理人在每周第一个工作日（若无，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，并于开放之日公告前一个交易日的份额净值、累计净值，供投资人参考。</p> <p>2、集合计划的资产管理季度报告。</p> <p>管理人、托管人在每季度提供一次准确、完整的季度资产管理报告和季度资产托管报告，季度资产管理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。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。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季度报告。</p> <p>3、集合计划的资产管理年度报告和托管年度报告</p> <p>管理人、托管人在每年度提供一次准确、完整的年度资产管理报告和年度资产托管报告。年度资产管理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4个月内通过管理人网站披露，并按照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。</p> <p>4、年度审计报告。</p> <p>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</p> |

|          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|----------|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|          | <p>度审计，并在每年度结束之日起4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，并按照规定向相关监管机构报备。</p> <p>5、对账单</p> <p>管理人每季度结束后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。</p> <p>二) 临时报告</p> <p>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。</p> <p>二、信息披露方式</p> <p>集合计划的信息披露事项将以下列方式进行披露。</p> <p>1、管理人网站（www.gtjzq.com）信息披露</p> <p>2、管理人、推广机构指定营业网点查询</p> <p>3、国泰君安证券资产管理客服电话</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 委托人权利与义务 | <p>(一) 委托人的权利</p> <p>(1) 分享资产管理计划财产收益；</p> <p>(2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；</p> <p>(3) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；</p> <p>(4) 根据本合同的规定，参加或申请召集资产管理计划份额持有人大会，行使相关职权；</p> <p>(5) 按照法律法规及本合同约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；</p> <p>(6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>(7) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和本合同约定的其他权利。</p> <p>(二) 委托人的义务</p> <p>(1) 认真阅读并遵守本合同，保证投资资金的来源及用途合法；</p> <p>(2) 接受合格投资者认定程序，如实填写风险识别能力和风险承受能力问卷，如实提供资金来源、金融资产、收入及负债情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，签署合格投资者相关文件；</p> <p>(3) 除公募资产管理产品外，以合伙企业、契约等非法人形式直接或者间接投资于资产管理计划的，应向管理人充分披露实际投资者和最终资金来源；</p> <p>(4) 认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>(5) 按照本合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担本合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；</p> <p>(6) 在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；</p> <p>(7) 向管理人或销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；</p> <p>(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>(9) 不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>(10) 保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；</p> <p>(11) 法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和本合同约定的其他义务。</p> |
| 风险揭示     | <p>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。本计划可能面临的风险包括但不限于市场风险、流动性风险、管理风险、信用风险、操作风险及其他风险等。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |

|                            |                                                                                                                                                           |
|----------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                            | 具体风险揭示内容详见《国泰君安君享优量 500 增强 1 号集合资产管理计划风险揭示书》。                                                                                                             |
| 利益冲突情况以及可能影响投资者合法权益的其他重要事项 | 委托人同意授权管理人可以将集合计划的资产投资于管理人、托管人及与管理人、托管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。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。 |
| 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。                                                          |

