

合同编号：

# 国泰君安君享优量科创 1 号集合资产管理计划 管理合同

管理人：上海国泰君安证券资产管理有限公司

托管人：中国银行股份有限公司上海市分行

二〇一九年 月

## 目录

重要提示 .....	3
第 1 部分 前言 .....	4
第 2 部分 释义 .....	5
第 3 部分 承诺与声明 .....	10
第 4 部分 合同当事人 .....	12
第 5 部分 集合计划的基本情况 .....	18
第 6 部分 资产管理计划的募集 .....	20
第 7 部分 资产管理计划的成立与备案 .....	25
第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让 .....	26
第 9 部分 份额持有人大会及日常机构 .....	34
第 10 部分 资产管理计划份额的登记 .....	35
第 11 部分 集合计划的投资 .....	37
第 12 部分 投资顾问 .....	47
第 13 部分 集合计划的分级安排 .....	48
第 14 部分 利益冲突及关联交易 .....	49
第 15 部分 投资经理的指定与变更 .....	50
第 16 部分 资产管理计划的财产 .....	51
第 17 部分 投资指令的发送、确认和执行 .....	53
第 18 部分 越权交易的界定 .....	57
第 19 部分 集合计划财产的估值和会计核算 .....	59
第 20 部分 集合计划的费用、业绩报酬 .....	66
第 21 部分 投资收益与分配 .....	73
第 22 部分 信息披露与报告 .....	75
第 23 部分 风险揭示 .....	78
第 24 部分 合同的变更、展期、终止与财产清算 .....	88
第 25 部分 违约责任 .....	95
第 26 部分 争议处理 .....	97
第 27 部分 合同的成立与生效 .....	98



## 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。

委托人、管理人、托管人同意遵守《电子签名法》、《证券公司资产管理电子签名合同操作指引》的有关规定，三方一致同意委托人自签署《电子签名约定书》之日起，委托人以电子签名方式接受电子签名合同（即本合同）、计划说明书、风险揭示书或其他文书的，视为签署本合同、计划说明书、风险揭示书或其他文书，与在纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书上手写签名或者盖章具有同等的法律效力，无须另行签署纸质合同、纸质风险揭示书或其他文书。

## 第 1 部分 前言

为规范国泰君安君享优量科创 1 号集合资产管理计划（以下简称“资产管理计划”或“集合计划”）的运作，明确《国泰君安君享优量科创 1 号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》、《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》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》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。

管理人应当对集合资产管理计划的设立、变更、展期、终止、清算等行为向中国证券投资基金业协会（以下简称证券投资基金业协会）进行备案，并抄报中国证监会相关派出机构。

证券投资基金业协会接受集合资产管理计划备案不能免除管理人按照规定真实、准确、完整、及时地披露产品信息的法律责任，也不代表证券投资基金业协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险做出保证和判断。委托人应当自行识别产品投资风险并承担投资行为可能出现的损失。

## 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：

<b>资产管理计划、集合计划、本集合计划或本计划</b>	指国泰君安君享优量科创 1 号集合资产管理计划
<b>《集合计划说明书》或《说明书》</b>	指《国泰君安君享优量科创 1 号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
<b>《集合资产管理合同》、《管理合同》、本合同、电子合同或电子签名合同</b>	指《国泰君安君享优量科创 1 号集合资产管理计划管理合同》及其的任何有效修订和补充
<b>《证券投资基金法》</b>	指 2003 年 10 月 28 日发布，自 2004 年 6 月 1 日起施行，并于 2015 年 4 月 24 日修订的《中华人民共和国证券投资基金法》
<b>《管理办法》</b>	指 2018 年 10 月 22 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（证监会令[第 151 号]）
<b>《运作规定》</b>	指 2018 年 10 月 22 日中国证监会公布并于公布之日起施行的《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（证监会公告[2018]31 号）
<b>《交易指引》</b>	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》
<b>《指导意见》</b>	指中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局于 2018 年 4 月 27 日联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》

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	指中国银行股份有限公司上海市分行，亦称中行上分
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	<p>指具备相应风险识别能力和风险承担能力，投资于单只资产管理产品不低于一定金额且符合下列条件的自然人和法人或者其他组织。</p> <p>（一）具有 2 年以上投资经历，且满足以下条件之一：家庭金融净资产不低于 300 万元，家庭金融资产不低于 500 万元，或者近 3 年本人年均收入不低于 40 万元。</p> <p>（二）最近 1 年末净资产不低于 1000 万元的法人单位。</p> <p>（三）依法设立并接受国务院金融监督管理机构监管的机构，包括证券公司及其子公司、基金管理公司及其子公司、期货公司及其子公司、在证券投资基金业协会登记的私募基金管理人、商业银行、金融资产投资公司、信托公司、保险公司、保险资产管理机构、财务公司及中国证监会认定的其他机构；</p> <p>（四）接受国务院金融监督管理机构监管的机构发行的资产管理产品；</p> <p>（五）基本养老保险、社会保障基金、企业年金等养老金，慈善基金等社会公益基金，合格境外机构投资者（QFII）、人民币合格境外机构投资者（RQFII）；</p> <p>（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>已接受其他私募资产管理产品投资的私募资产管理产品不</p>

	得投资于本产品；其他可能导致本产品不符合《指导意见》等法律法规要求的投资人不得投资于本产品。
销售机构	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销售机构
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君资管
集合计划初始募集期间	指本集合计划开始接受委托人认购参与日至初始募集期结束日
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参与的期间
T 日	指办理日常参与、退出、业绩报酬计提或办理其他集合资产管理计划业务的工作日。
T+n 日	指自 T 日起的第 n 个工作日（不包含 T 日）
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到申请退出本集合计划之间的自然天数
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
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
股指期货的风险敞口	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
关联方、关联关系	指《企业会计准则第 36 号——关联方披露》中所定义的关联方、关联关系
托管协议	指管理人与托管人签署的《国泰君安君享优量科创 1 号集

	合资产管理计划托管协议》
--	--------------

## 第 3 部分

## 承诺与声明

### 一、管理人承诺

1. 在签订本合同前已自行或委托销售机构充分向委托人说明了有关法律法规和相关投资工具的运作市场及方式，并充分揭示了相关风险。

2. 已经了解或委托销售机构了解委托人的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对委托人的财务状况进行了充分评估。

3. 按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用委托财产，不保证委托财产一定盈利，也不保证最低收益或本金不受损失，以及限定投资损失金额或者比例。资产管理人应承担尽职调查等反洗钱工作职责，包括但不限于建立合理有效的反洗钱控制措施，对其自身客户开展反洗钱尽职调查等管控工作，审查所管理资金来源是否合法，资金管理使用不涉及恐怖融资或其他违法犯罪活动，不涉及被公安部等制裁规则制裁的人员或行为等。资产管理人应建立健全客户尽职调查等反洗钱内部控制机制，向托管人提供监管机构要求的与托管人履行反洗钱义务相关的客户尽职调查及其他相关情况。

### 二、托管人承诺

1、托管人承诺已取得其总行有效授权，具备担任本集合计划托管人的资质。

2、按照《基金法》恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管委托财产，履行信义义务以及本合同约定的其他义务。

3、根据法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会的规定和本合同的约定，对管理人的投资或清算指令等进行监督。

4、在管理人发生异常且无法履行管理职能时，依照法律法规及合同约定召集份额持有人大会（如有），维护投资者权益，份额持有人大会设立日常机构的除外。

### 三、委托人声明

1、委托人符合《运作规定》合格投资者的要求，向管理人或销售机构提供的有关身份信息、投资目的、投资偏好、投资限制、财产收入情况和风险承受能力等基本情况和材料真实、完整、准确、合法，不存在任何虚假陈述、重大遗漏或误导。当信息资料如发生任何实质性变更，及时书面告知管理人或销售机构。**特别的，当提供的非居民金融账户涉税信息发生变更时，应在 30 日内通知管理人或销售机构。**

2、委托人承诺以真实身份和自有资金参与集合计划，保证财产的来源及用途符合

国家有关规定，不存在任何洗钱嫌疑，并非毒品犯罪、黑社会性质的组织犯罪、恐怖活动犯罪、走私犯罪、贪污贿赂犯罪、破坏金融管理秩序犯罪、金融诈骗犯罪的所得及其产生的收益。委托人未使用贷款、发行债券等筹集的非自有资金投资资产管理计划，且投资事项符合法律法规的规定及业务决策程序的要求。

3、委托人已阅读并理解本合同、集合计划说明书、风险揭示书全文，了解相关权利义务，了解有关法律法规及所投资资产管理计划的风险收益特征，知晓管理人、托管人及相关机构不应对资产管理计划的收益状况或本金不受损失做出任何承诺，了解“卖者尽责，买者自负”的原则，投资于本计划将自行承担投资风险和损失。

4、委托人已充分了解证券期货市场相关廉洁从业要求，并承诺严格遵守其规定。

5、委托人承诺不以非法拆分转让为目的购买产品；不会突破合格投资者标准，将产品份额或其收益权进行非法拆分转让。

6、委托人承诺对委托财产拥有合法所有权或处分权，投资行为系基于委托人的真实意思表示，已取得合法、有效的授权，且不会违反对委托人有约束力的任何协议、合同或其他法律文件。

7、委托人承诺知晓：风险承受能力评估是管理人或销售机构履行适当性职责的一个环节，不能取代委托人的投资判断，也不会降低资产管理产品或资产服务的固有风险。同时，与资产管理产品或资产服务相关的投资风险、履约责任以及费用等将由委托人自行承担。

## 第 4 部分 合同当事人

### 一、委托人、管理人和托管人的基本情况

#### (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

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：上海市浦东新区东园路 111 号（邮政编码：200120）

联系电话：021-38676999

传真：021-68872521

联系人：胡崇海

#### (三) 托管人

托管人名称：中国银行股份有限公司上海市分行

负责人或授权代表：赵蓉

住所：上海市浦东新区银城中路200号

联系电话：021-58883676

联系人：王皓

### 二、集合计划份额

本集合计划设定为均等份额。除本合同另有约定外，每份份额具有同等的合法权益。

### 三、委托人的权利和义务

#### (一) 委托人的权利

- (1) 分享资产管理计划财产收益；
- (2) 取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；
- (3) 按照本合同的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；
- (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（如有），行使相关职权；

(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;

(6) 监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况;

(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。

## (二) 委托人的义务

(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;

(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担能力问卷, 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;

(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;

(4) 认真阅读并签署风险揭示书;

(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;

(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;

(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;

(8) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为;

(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;

(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;

(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。

## 四、管理人的权利和义务

### (一) 管理人的权利

(1) 按照本合同约定, 独立管理和运用资产管理计划财产;

(2) 按照本合同约定，及时、足额获得管理人管理费用及业绩报酬（如有）；

(3) 按照有关规定和本合同约定行使因资产管理计划财产投资所产生的权利；

(4) 根据本合同及其他有关规定，监督托管人，对于托管人违反本合同或有关法律法规规定、对资产管理计划财产及其他当事人的利益造成重大损失的，应当及时采取措施制止，并报告中国证监会相关派出机构及证券投资基金业协会；

(5) 自行提供或者委托经中国证监会、证券投资基金业协会认定的服务机构为资产管理计划提供募集、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务，并对其行为进行必要的监督和检查；

(6) 以管理人的名义，代表资产管理计划行使投资过程中产生的权属登记等权利；

(7) 对委托人采取相关措施仍无法进行客户身份识别或者经过评估超过其风险管理能力的，有权依法拒绝与委托人建立业务关系或者进行交易；已建立业务关系的，有权中止交易并按照规定处理，包括终止业务关系；

(8) 法律法规、中国证监会、证券投资基金业协会规定的及本合同约定的其他权利。

## (二) 管理人的义务

(1) 依法办理资产管理计划的销售、登记、备案事宜；

(2) 按照证券投资基金业协会要求报送资产管理计划产品运行信息；

(3) 按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用资产管理计划财产；

(4) 自行或委托销售机构对投资者的风险识别能力和风险承受能力进行评估，向符合法律法规规定的合格投资者非公开募集资金；

(5) 制作风险揭示书，自行或委托销售机构向投资者充分揭示相关风险；

(6) 配备足够的具有专业能力的人员进行投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作资产管理计划财产；

(7) 建立健全的内部管理制度，保证本集合计划财产与其管理的其他资产管理计划财产、管理人的固有财产相互独立，对所管理的不同财产分别管理，分别记账，分别投资；聘请投资顾问的，应制定相应利益冲突防范机制；

(8) 除依据法律法规、本合同及其他有关规定外，不得为管理人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作资产管理计划财产；

- (9) 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，依法依规提供信息的除外；
- (10) 公平对待所管理的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (11) 除规定情形或符合规定条件外，不得为管理人、托管人及其关联方提供融资；
- (12) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；
- (13) 以管理人的名义，代表投资者利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- (14) 召集资产管理计划份额持有人大会（如有），份额持有人大会设立日常机构的除外；
- (15) 按照资产管理合同约定计算并向投资者报告资产管理计划份额净值；
- (16) 确定资产管理计划份额参与、退出价格，采取适当、合理的措施确保份额交易价格的计算方法符合法律法规的规定和合同的约定；
- (17) 对非标准化资产和相关交易主体进行充分的尽职调查，形成书面工作底稿，并制作尽职调查报告；
- (18) 按照资产管理合同约定负责资产管理计划会计核算并编制财务会计报告；
- (19) 聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；
- (20) 按照资产管理合同的约定确定收益分配方案，及时向投资者分配收益；
- (21) 根据法律法规与资产管理合同的规定，编制向投资者披露的资产管理计划季度、年度等定期报告，向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；
- (22) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- (23) 建立并保存投资者名单；
- (24) 组织并参加资产管理计划财产清算小组，参与资产管理财产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (25) 按照法律、行政法规和中国证监会的规定，保存资产管理计划的会计账册，妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件、资料和数据，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；
- (26) 面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会相关



派出机构、证券投资基金业协会并通知托管人和投资者；

(27) 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义务。

## 五、托管人的权利和义务

### (一) 托管人的权利

- (1) 按照本合同约定，依法保管资产管理计划财产；
- (2) 按照本合同约定，及时、足额获得资产管理计划托管费用；
- (3) 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。

### (二) 托管人的义务

- (1) 安全保管资产管理计划财产；
- (2) 除依据法律法规规定和本合同的约定外，不得为托管人及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管资产管理计划财产；
- (3) 对所托管的不同财产分别设置账户，确保资产管理计划财产的完整与独立；
- (4) 公平对待所托管的不同财产，不得从事任何有损资产管理计划财产及其他当事人利益的活动；
- (5) 按规定开立和注销资产管理计划的托管账户及其他投资所需账户；
- (6) 复核资产管理计划资产净值和份额净值；
- (7) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项；
- (8) 根据相关法律法规和本合同约定，复核管理人编制的资产管理计划财产的定期报告，并出具书面意见；
- (9) 编制托管年度报告，并向证券投资基金业协会备案，抄报中国证监会相关派出机构；
- (10) 按照法律法规要求和本合同约定，根据管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (11) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的（如有），由托管人召集份额持有人大会，份额持有人大会设立日常机构的除外；
- (12) 保守商业秘密，除法律法规、本合同及其他有关规定另有要求外，不得向他人泄露；
- (13) 根据法律、行政法规和中国证监会的规定保存资产管理计划的会计账册，

妥善保存有关的合同、协议、交易记录等文件资料，保存期限自资产管理计划终止之日起不得少于 20 年；

(14) 监督管理人的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或资产管理合同约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并及时报告中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会；

(15) 投资于《管理办法》第三十七条第（五）项规定资产时，准确、合理界定安全保管资产管理计划财产、监督管理人投资运作等职责，并向投资者充分揭示；

(16) 国家有关法律法规、监管机构及资产管理合同规定的其他义务。

## 第 5 部分 集合计划的基本情况

一、名称：国泰君安君享优量科创 1 号集合资产管理计划。

二、类型：混合类集合资产管理计划。

三、运作方式：本集合计划为开放运作。

四、封闭期、开放期

1、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。

2、开放期：本集合计划成立后每月最后一个交易日开放，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 天。

除因根据合同变更或者展期等需要设立临时开放期供委托人退出外，本集合计划原则上不设立临时开放期。

五、目标规模

本集合计划初始募集期及存续期均不设规模上限。单个客户首次参与金额（不含认购/参与费）不低于 100 万元，总参与客户数不超过 200 户。

六、投资目标、主要投资方向、投资比例及产品风险等级

1、投资目标

本集合计划通过构建由权益类及固定收益类证券组成的现货投资组合，同时运用股指期货等对冲工具管理系统性风险，力争获取中长期稳定的阿尔法收益。

2、主要投资方向

本集合计划将主要投资于包括股票、基金、股票期权、股指期货、商品期货、国债期货、经港股通投资于其买卖规定范围内的香港联交所上市股票、科创板股票、货币基金、银行存款等以及中国证监会认可的其他投资品种；

3、投资比例（占集合计划总资产市值）

（1）固定收益类资产（包括货币基金、债券型基金、银行存款）市值：0%~80%；

（2）权益类资产（包括股票、权益型基金、经港股通投资于其买卖规定范围内的香港联交所上市股票、科创板股票）市值：0%~80%；

（3）投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值占集合计划总资产的比例（包括股票期权、股指期货、商品期货、国债期货）：0%~80%；

#### 4、产品风险等级

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风险。

投资目标、主要投资方向、投资比例及产品风险等级具体内容详见“第 11 部分集合计划的投资”。

#### 七、存续期限

本集合计划存续期限为自成立之日起 10 年（可展期）。

#### 八、集合计划初始份额面值

本集合计划初始份额的面值为 1 元。

#### 九、本集合计划的初始募集规模

本集合计划的初始募集规模不低于人民币 1000 万元，不设上限。

#### 十、份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构

本集合计划份额登记、估值与核算、信息技术系统等服务机构均为上海国泰君安证券资产管理有限公司。

## 第 6 部分 资产管理计划的募集

### 一、募集对象

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风险，且根据前述风险评级，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稳健型、积极型、激进型的普通投资者销售。但法律法规及销售机构另有规定的除外。

### 二、销售机构与销售方式

1、销售机构：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销售机构。

#### 2、销售方式

本集合计划将通过销售机构进行推广和销售。

销售机构应将本合同、计划说明书等正式推广文件，置备于销售机构。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。销售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。

管理人及销售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、自媒体（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。

### 三、初始募集期限

本集合计划初始募集期自份额发售之日起不超过 60 天。初始募集期指集合计划接受委托人认购日至募集期结束日。管理人有权提前终止本集合计划的初始募集期。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。

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+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划认购总户数实行限量控制。

#### 四、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。

2、“金额参与”原则，即认购以金额申请。

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 100 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划付至销售机构指定账户或由销售机构代扣。

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。

5、委托人的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以注册登记机构的记录结果为准。

#### 五、认购的程序和确认

##### 1、认购程序和确认

(1) 投资者按销售机构指定营业网点的具体安排，在初始募集期的交易时间段内办理；

(2) 投资者应开设销售机构认可的交易账户，并在交易账户备足认购的货币资金；若交易账户内认购资金不足，销售机构不受理该笔认购申请；

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

(4) 投资者认购申请确认后，其认购申请和认购资金不得撤销；

(5) 投资者初始募集期认购的，可于计划成立后 2 个工作日内到办理认购的营业网点查询认购确认情况。

##### 2、认购的注册登记

初始募集期投资者认购成功后，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。

## 六、拒绝或暂停认购的情形

如出现如下情形，管理人可以拒绝或暂停集合计划委托人的认购申请：

- (1) 战争、自然灾害等不可抗力的原因导致集合计划无法募集运作；
- (2) 管理人、托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分；
- (3) 销售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；
- (4) 管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益；
- (5) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停认购的情形。

除发生上述（3）项暂停认购情形外，管理人应当通过管理人网站公告委托人。

## 七、认购费及认购份额的计算

### 1、认购费率

本集合计划认购费率为 0%。

### 2、认购份额的计算方法：

#### （1）认购份额的计算

认购费用=认购金额\*认购费率/（1+认购费率）

认购份额=（认购金额+初始募集期利息-认购费用）/集合计划份额面值

认购份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

如本集合计划在初始募集期内客户数达到 200 户以上的，可提前终止初始募集期。

本管理人在初始募集期内使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划实行总户数限量控制。

①初始募集期内客户数不足 200 户（含 200 户）的情形：若初始募集期内认购申请全部确认后本集合计划客户数不足 200 户，则所有的有效认购申请全部予以确认。

②初始募集期内客户数超过 200 户的情形：若初始募集期内认购申请全部确认后本集合计划客户数超过 200 户，管理人将提前终止初始募集期。初始募集期客户数上限日是指，在初始募集期集合计划认购申请本集合计划的客户数累计超过 200 户的第一个交易日。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，同时公告初始募集期提前结束；在该交易日之后的申请全部予以拒绝。

初始募集期末日管理人根据委托人申请单申请认购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，直到累计确认客户数达到 200 户。未确认的委托人的认购款项由销售机构将认购资金退回委托人指定资金账户，并停止该集合计划接受认购申请。

管理人在 T+1 个工作日（设认购申请日为 T 日）对投资者认购的有效性进行确认。委托人认可管理人对其认购有效性的确认，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 元认购本集合计划。假设初始募集期内总户数不足 200 户，该笔认购将按照 100%比例全部确认，在初始募集期间产生利息 60.00 元，集合计划认购价格每份 1.00 元。则其可得到的认购份额为：

认购总金额=2,000,000 元

认购费用=0 元

认购份额=(2,000,000+60.00-0)/1.00=2,000,060 份

即：委托人投资 2,000,000 元认购本集合计划，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 200,000,000 元认购本集合计划，假设该笔认购申请发生在认购末日，本次认购末日之前有效认购共 190 户，认购末日的有效认购申请户数为 12 户。

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，并计算申请单累计认购金额，当累计总户数超过 200 户时，对该临界序号(不含)之前的申请序号代表的认购金额全部确认，对该临界序号(含)之后的申请序号代表的认购金额全部作为未确认金额，未确认金额将于本集合计划认购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 200,000,000 元认购申请全部确认。确认认购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，则其认购申请作为未确认金



额处理，将于本集合计划认购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，则其认购申请作为未确认金额处理，将于本集合计划认购结束后全部退回委托人账户。

委托人认可上述关于认购的原则及处理方法，接受管理人依据法律法规规定及本合同的约定所作出的暂停认购决定与相关认购份额及资金利息的计算。

#### **八、 募集账户的信息披露**

计划管理人应于本集合计划推广公告中披露本集合计划募集结算专用账户和销售机构委托募集账户（如有）。投资者可通过管理人网站查询上述公告。

## 第 7 部分 资产管理计划的成立与备案

### 一、集合计划成立的条件及日期

集合计划初始募集规模不低于 1000 万元，投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人，募集过程应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后于管理人网站公告资产管理计划成立。

本集合计划成立的时间为计划管理人于管理人网站公告资产管理计划成立的日期。

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、验资报告或者资产缴付证明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。

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。

集合计划在成立后备案完成前，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、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。

### 二、集合计划设立失败

集合计划初始募集期结束，在集合计划规模低于人民币 1000 万元或者委托人户数低于 2 户（不含）条件下，集合计划设立失败，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金在初始募集期结束后 30 日内退还集合计划委托人，认购资金产生的利息自初始募集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

自管理人公告集合计划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 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让

### 一、 集合计划的参与

本部分所称集合计划的参与指存续期参与。

#### (一) 参与的办理时间

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。

本集合计划成立后每自然月最后一个交易日开放，开放日可以办理参与业务，委托人可以按照本合同约定办理参与业务。

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+金额同等情况下时间优先”的原则给与确认，未确认的参与款项退还给委托人（户数控制参照初始募集期户数控制原则）。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参与办理的日期及时间进行相应的调整并公告。

#### (二) 参与的原则

1、投资者于存续期首次参与本集合计划的，应与管理人、托管人签署资产管理合同。

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（不含参与费），追加参与的最低金额为人民币 1 万元。

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。

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+金额同等情况下时间优先”的原则给与确认，未确认的参与款项退还给委托人。

#### (三) 参与金额

投资者在本集合计划存续期参与的，投资者应符合合格投资者标准，且参与金额应满足本集合计划最低参与金额限制（不含参与费），已持有本集合计划份额的投资者在本集合计划存续期追加参与的除外。

#### (四) 参与的程序和确认

##### 1、参与程序和确认

(1) 投资者按销售机构指定营业网点的具体安排, 在开放期的交易时间段内办理;

(2) 投资者应开设销售机构认可的交易账户, 并在交易账户备足参与资金; 若交易账户内参与资金不足, 销售机构不受理该笔参与申请;

(3) 投资者首次参与的, 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有效后, 构成本合同的有效组成部分;

(4) 投资者参与申请确认成功后, 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+2日后在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

投资者参与成功后, 注册登记机构在T+1日(T日为参与申请日)为委托人登记权益并办理注册登记手续。

### (五) 拒绝或暂停参与的情形

如出现如下情形, 管理人可以拒绝或暂停投资者的参与申请:

(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行;

(2) 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;

(3) 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;

(4) 管理人、托管人或注册登记机构的技术保障或人员支持等不充分;

(5) 销售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;

(6) 管理人认为会有损于现有集合计划委托人利益;

(7) 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(4)、(6)、(7)项暂停参与情形时, 管理人应当通过管理人网站公告委托人。

### (六) 参与费及参与份额的计算

#### 1、参与费率

本集合计划参与费率为0%。

#### 2、参与份额的计算方法:

参与费用=参与金额×参与费率/(1+参与费率)

参与份额=(参与金额-参与费用)/开放日集合计划份额净值

参与份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

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户数实行限量控制。

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规定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（如有）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。

本集合计划成立后每自然月最后一个交易日开放，开放日可以办理退出业务。特别的，委托人每笔份额持有时间不得少于 180 天。

因根据合同变更或者展期等需要而设立临时开放期供委托人退出的程序及披露比照本部分“二、集合计划的退出”执行。

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，参与确认日期在前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. 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。

### （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，或登录原参与销售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+1 日对该交易的有效性进行确认，委托人通常可在 T+2 日到网点查询退出的确认情况。巨额退出的情形按本部分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将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销售机构，并通过销售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+3 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退出费用及业绩报酬（如有）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×退出申请日集合计划份额净值

退出费用=0

退出金额=退出总额-管理人业绩报酬（如有）

#### （五） 退出的限制与次数

参照本部分第二条“（二）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

委托人必须至少提前5个工作日直接或通过销售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

1、巨额退出及连续巨额退出的认定

本集合计划单个开放日（T日），集合计划净退出申请份额超过上一日集合计划总份额的10%时，即认为发生了巨额退出。连续巨额退出是指连续两个开放日或以上，集合计划净退出申请份额超过上一日集合计划总份额的10%。

## 2、巨额退出及连续巨额退出的退出顺序、价格确定

委托人申请巨额退出或连续巨额退出时，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；退出价格以委托人申请退出日的集合计划份额净值为准。

## 3、巨额退出及连续巨额退出的处理方式

当出现巨额退出时，管理人可根据集合计划当时的资产组合状况决定全额退出、全部或部分延期退出或暂停接受退出申请或采取中国证监会认可的其他流动性管理措施。因巨额赎回原因导致委托人的剩余份额资产净值不足最低首参金额而须强制赎回的，管理人亦有权拒绝该委托人的退出申请。

① 全额退出：当管理人认为有足够能力支付委托人的全额退出申请时，按正常退出程序办理。当日（T日）在交易时间内提交的申请，退出申请成功确认的退出款项将在T+3日内从托管账户划出，经销售机构划往委托人指定资金账户。

② 全部或部分延期退出：当管理人认为全额支付委托人退出申请有困难或认为全额支付委托人退出申请可能会对集合计划资产净值造成较大波动时，管理人可以选择全部延期退出或部分延期退出。管理人选择部分延期退出的，在当日接受退出比例不低于上一日本集合计划总份额10%的前提下，对其余退出申请可延期予以办理。管理人对单个委托人的退出申请，应当按照其退出申请份额占当日本集合计划退出申请总份额的比例，确定该委托人当日办理的退出申请份额。委托人在申请退出时，可以选择将当日未获办理的退出申请份额予以撤销。委托人选择延期退出的，管理人对当日未办理的退出申请份额，延迟至下一工作日办理，退出价格为下一工作日的集合计划份额净值。因延期退出而导致委托人的份额净值较申请退出日增加或减少的，管理人不承担任何责任。转入下一个工作日的退出申请不享有优先权，以此类推，直到全部退出为止。退出申请成功确认的退出款项将在退出申请日后3个工作日内从托管账户划出，经销售机构划往委托人指定资金账户。如顺延后仍发生巨额退出，且管理人未宣布暂停退出，仍继续按比例受理退出份额。

③ 暂停退出：连续两个或以上开放日发生巨额退出的，管理人可以暂停接受退出申请；已经接受的退出申请可以延期支付退出款项，但暂停和延期期限不得超过20个工作日。

④ 管理人可以根据集合计划运作的实际情况在不损害委托人利益的前提下更改上述退出安排。本集合计划退出安排的更改将遵循本合同变更的相关程序。

#### 4、告知客户的方式

管理人将通过管理人网站公告巨额退出及连续巨额退出的处理方式。

#### (八) 拒绝或暂停退出的情形及处理

如出现下列情形，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行；
2. 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；
3. 因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额退出，导致本集合计划的现金支付出现困难；
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，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。因集合计划所投资的流动性受限资产无法在约定时间内变现而导致无法按上述时间支付退出款项的，委托人同意计划管理人在流动性受限资产可变现后进行支付。

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，但管理人有正当理由认为需要暂停接受退出申请的，可以暂停接受委托人的退出申请，并按照规定向相关监管机构报备。

暂停集合计划退出，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。

### 三、 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，委托人可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式转让集合计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。转让后委托人持有集合计划份额净值不得低于规定的最低投资金额，委托人合计不超过200户且不少于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、托管人签订集合资产管理合同。

### 四、 集合计划的非交易过户



非交易过户是指不采用参与、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、司法强制执行以及其他符合规定的情况下的非交易过户，具体业务规则、受理条件与流程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并按注册登记机构规定的标准收费。

## 五、 管理人自有资金参与

1、自有资金参与的条件：**【无】**。

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，将在本集合计划销售机构参与。

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。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合计划的份额合计不得超过本集合计划总份额的 50%。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。存续期内，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。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，并按照相关规定向监管机构报备。

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：存续期内，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。

六、 管理人承诺定期将资产管理计划资产委托人变更情况报送基金业协会。

## 第 9 部分 份额持有人大会及日常机构

经管理人、委托人、托管人一致同意，本集合计划不设置份额持有人大会及日常机构。

## 第 10 部分 资产管理计划份额的登记

### 一、登记机构

(一) 本集合计划的注册登记机构为上海国泰君安证券资产管理有限公司，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计划份额。

(二) 注册登记机构负责本集合计划份额的注册登记业务，具体指本资产管理计划的登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括资产委托人账户管理、份额注册登记、清算及交易确认、收益分配、建立并保管资产管理计划客户资料表等。

(三) 注册登记机构履行如下职责：

1、建立和保管资产委托人账户资料、交易资料、资产管理计划客户资料表等，并将客户资料表提供给资产管理人。

2、配备足够的专业人员办理本资产管理计划的注册登记业务。

3、严格按照法律法规和本资产管理合同规定的条件办理本资产管理计划的注册登记业务。

4、严格按照法律法规和本资产管理合同的规定计算业绩报酬（如有），并提供交易信息和计算过程明细给资产管理人。

5、接受资产管理人的监督。

6、妥善保存登记数据，并将资产管理计划投资者名称、身份信息以及资产管理计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的机构。其保存期限自资产管理计划账户销户之日起不得少于20年。

7、对资产委托人的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对资产委托人或资产管理计划带来的损失，须承担相应的赔偿责任，但法律法规或监管机构另有规定的除外。

8、按本资产管理计划合同，为资产委托人提供资产管理计划收益分配等其他必要的服务。

9、在法律法规允许的范围内，制定和调整注册登记业务的相关规则。

10、法律法规规定的其他职责。

### 二、数据备份

全体集合计划委托人同意管理人、份额登记机构或其他份额登记义务人将本集合计划投资者名称、身份信息以及本集合计划份额明细等数据备份至中国证监会认定的

机构。

## 第 11 部分 集合计划的投资

### 一、投资目标

本集合计划通过构建由权益类及固定收益类证券组成的现货投资组合，同时运用股指期货等对冲工具管理系统性风险，力争获取中长期稳定的阿尔法收益。

### 二、投资范围及比例

#### 1、投资范围

本集合计划可投资如下资产：

本集合计划将主要投资于包括股票、基金、股票期权、股指期货、商品期货、国债期货、经港股通投资于其买卖规定范围内的香港联交所上市股票、科创板股票、货币基金、银行存款等以及中国证监会认可的其他投资品种；

#### 2、投资比例（占集合计划总资产市值）

（1）固定收益类资产（包括货币基金、债券型基金、银行存款）市值：0%~80%；

（2）权益类资产（包括股票、权益型基金、经港股通投资于其买卖规定范围内的香港联交所上市股票、科创板股票）市值：0%~80%；

（3）投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值占集合计划总资产的比例（包括股票期权、股指期货、商品期货、国债期货）：0%~80%；投资场内期权需提前告知托管人并先行进行系统联测，测试通过后方可投资。

上述投资比例符合《运作规定》组合投资的要求。

3、资产管理计划改变投向和比例的，新增上述投资范围外的投资品种或各类型资产投资比例的，应当事先取得投资者同意，由全体委托人、管理人和托管人协商一致并签署补充协议对本章节内容进行变更。

### 三、投资比例超限的处理方式及流程

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 15 个工作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，管理人应在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的 15 个工作日内调整至符合相关要求。确有特殊事由未能在规定时间内完成调整的，证券期货经营机构应当及时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告。

### 四、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风险，且根据前述风险评级，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稳健型、积极型、激进型的普通投资者销售。但法律法规及销售机构另有规定的除外。

## 五、业绩比较基准（如有）及确定依据

无

## 六、投资策略

### （一）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》、《运作规定》、《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。投资程序

### （二）投资决策程序

管理人私募资产管理业务投资决策体系由管理人私募投资决策委员会、投资部门、投资经理三级体系组成。

1、管理人私募投资决策委员会负责确定以下事项：

（1）对宏观经济形势和市场走势作出分析判断，根据公司发展战略拟订公司私募投资研究发展子战略，拟订公司私募资产管理产品大类资产配置方案；

（2）拟订公司私募资产管理业务年度投资偏好方案；

（3）拟订公司私募投资决策分级授权方案，在职权范围内开展分级授权等工作；

（4）拟订公司级私募投资管理制度及流程、公司级研究管理制度及流程；

（5）审议决定私募投资经理的任免及授权事项，决定私募投资经理不能正常履职时的代履职安排，对私募投资经理进行绩效考核，对私募投资经理的投资活动进

行监督和管理；

(6) 审议决定公司私募资产管理产品的资产配置策略、投资决策程序及投资交易权限；

(7) 审议决定确定统一适用于公司资产管理业务的投资对象、构建与维护交易对手备选库的原则与程序，包括但不限于股票池、债券库、基金池和策略库等，私募投决会可授权具体部门根据该等原则与程序负责上述备选库的建立及维护等工作；

(8) 审议决定公司私募资产管理产品的投资逻辑和投资实现路径；

(9) 定期或不定期听取私募投资经理的私募资产管理计划运作报告，协调私募资产管理计划投资业务开展过程中的重大问题；

(10) 公司行政办公会授予的其他职责。

## 2、投资交易程序

管理人设置独立的交易部，投资经理下达的投资指令通过交易部实施。交易部接到投资经理的投资指令后，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经理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，投资经理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) 投资管理的方法和标准

### (1) 投资理念

基于对市场和基本面的深刻理解，对能够持续产生超额收益的投资思想进行数量化表述，运用计算机程序在全市场寻找符合此表述的投资机会，并进行风险、收益的



优化，以此获取与市场涨跌相关性较低的绝对收益，力争实现资产净值的高成长。

## (2) 投资策略

### 1、资产配置策略

在具体的资产配置过程中，本集合计划将根据量化工具动态判断组合的风险程度和收益特征，决定本集合计划资产在股票、股指期货、基金、现金等金融资产上的分布，并进行动态配比以规避系统性风险的影响，最大限度地确保计划资产的安全提升收益。

### 2、股票投资策略

#### ①行业配置

在行业配置方面，本集合计划根据管理人对各行业中长期的发展空间、盈利前景、行业结构以及行业中可选投资标的数量及有效流通市值等要素判断，优化实现各行业权重的合理配置。

#### 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。

## 3、科创板股票投资策略

### 1) 网下 IPO 申购策略

#### A、询价

参考美股、港股等科技股历史，按照科创板 IPO 公司不同发展阶段和特性，分别通过不同的估值模型对公司进行定价，确定询价范围，并进行申报。

#### B、投后管理

通过估值模型，对照可比公司 IPO 上市后一段时间的收益率，确定最终目标价格，对中签的科创板股票进行卖出操作获取相应的收益，同时对未达到预估价格但二级市场对其短期不看好的股票进行止盈止损处理。

### 2) 选股策略

对于科创板股票，我们的泛价值投资策略将一般意义的“成长股”和“价值股”统一到同一个投资框架中：价值选股的唯一标准是股票价格是否低于企业价值，而对企业价值的判断必然要将企业的成长性考虑在内。按照企业的不同发展阶段和特性，

我们的泛价值选股策略又可以分为“低估型选股”和“成长型选股”。

通过泛价值选股策略，我们选取的标的主要获得两方面收益：

①被市场低估的公司回归合理估值的收益；

②公司不断成长带来的价值提升的收益。

### 3) 组合策略

①在泛价值选股策略的基础上，对行业、风格、个股集中度进行优化和均衡，避免过偏、过于集中的风险，以期适应多变的市场环境；

②坚持有充分安全边际的分布买入策略，以尽可能实现事前风控，降低投资风险；

③对于优质公司以长期持有为主要手段，充分分享公司成长带来的股价成长，除非股价上涨过快过高；

④对于低估型股票，在明显低估、安全边际充分的情况下买入，在估值修复至合理区间逐步卖出；对于成长型股票，等待相对低估的时机买入，在进入估值偏高甚至泡沫阶段逐步卖出；

⑤不参与各类纯炒作的主题性机会。

### 4、套期保值策略

管理人认为在符合一定条件的市场环境中，有必要审慎灵活地综合运用股指期货进行套期保值交易来对冲系统性风险、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。

本集合计划参与套期保值交易大致可以分为多头套期保值和空头套期保值。多头套期保值是指在某一时点本集合产品持有或即将持有大量现金，但预期股市整体将会快速上涨，为了控制股票买入成本而先买入股指期货以实现部分锁定将来购入股票的成本，待未来买入股票现货后再将股指期货等多头头寸进行平仓交易。空头套期保值是指在某一时点本集合产品已持有现货股票投资，但预期股市将整体下跌，为了降低股票组合下行波动风险而卖出股指期货来部分对冲市场系统性下跌风险，待未来股指下跌后或卖出股票现货投资后将股指期货空头头寸进行平仓交易。

本集合计划参与股指期货套期投资时将综合考虑：1) 股指期货交易品种的流动性；2) 股指期货交易品种与现货市场的相关度；3) 通过股指期货进行套期保值交易的必要性；以及 4) 股指期货套期保值交易的综合成本，来判断是否进行套期保值交易或套期保值的合理对冲比率。

### 5、商品期货策略

管理人认为在复杂多变的内外部市场环境中，有必要增加策略的多样性来获得更

稳定的绝对收益，根据海外长期数据显示，CTA 策略与其他策略之间呈现出显著的低相关性。CTA 策略还具备“危机 Alpha”特性：股市和债市处于最坏阶段时，CTA 趋势跟踪策略表现最好。

本集合计划运用了商品期货多周期复合策略，短、中、长期策略分别对应了符合时段特征的技术面因子、基本面因子和宏观因子，通过全方面的综合比较从而构造商品的多空投资组合并根据风险模型动态调整权重。

本集合计划参与商品期货投资时将综合考虑：1) 商品期货交易品种的流动性；2) 商品期货品种之间的相关度；以及 3) 宏观因子下的市场划分，来判断是否进行 CTA 策略配置和配置权重。

## 6、期权策略

管理人认为在符合一定条件的市场环境中，有必要审慎灵活地综合运用非线性品种期权来增加投资组合策略和套期保值交易的多样性、降低投资组合波动性并提高资金管理效率。

本集合计划参与期权策略主要分为套期保值和套利两大类。前者和股指期货互为替代，在综合考虑对冲成本和流动性的前提下选择最优的对冲工具。后者由于期权非线性的特征提供了许多套利类组合方式，主要是在市场波动率异常的情况下进行波动率交易。

本集合计划参与期权投资时将综合考虑：1) 期权交易品种的流动性；2) 期权交易品种的杠杆和成本；3) 通过期权进行套期保值交易的必要性；以及 4) 期权各类套利策略的盈亏空间，来判断是否进行套期保值交易或套期保值的合理对冲比率以及是否参与套利交易。

## 七、投资限制及禁止行为

### (一) 投资限制

1. 投资单只股票投资的市值不超过集合计划净资产的 20%，投资单只创业板股票的市值不超过集合计划净资产的 10%，投资单只科创板股票的市值不超过集合计划净资产的 5%。

2. 单只股票投资比例不超过公司流通股本的 3%。

3. 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。

4. 投资于 ETF 的市值不超过集合计划净资产的 60%，单只 ETF 规模不超过集合计

划净资产的 20%。

5. 股指期货保证金占用不超过集合计划净资产的 20%。

6. 不得参与融资融券交易，不得参与股权质押。

7. 不得投资于 st, \*st, 以及有退市风险的股票，不得参与新三板交易。

8. 投资股指期货的，在任何交易日日终风险敞口不超过本集合计划资产净值的 20%。

9. 投资商品期货的，在任何交易日日终商品期货风险敞口不超过本集合计划资产净值的 20%。

10. 投资于期权的市值不得超过集合计划净资产的 20%。

11. 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%。

12. 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计划资产净值的 20%。（流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动性受限的新股及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。

13. 开放期内，本计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的市值，不得低于该计划资产净值的 10%。

14. 资产管理计划的总资产不得超过该计划净资产的 200%。

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、违规为地方政府及其部门提供融资；
- 11、要求或者接受地方政府及其部门违规提供担保；
- 12、直接或者间接投资法律、行政法规和国家政策禁止投资的行业或领域。
- 13、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

### （三）投资金融期货的特殊约定

- 1、金融期货交易的投资目的为套期保值。
- 2、金融期货交易的信息披露及报告

本集合计划参与金融期货交易，应当按合同约定的方式向委托人充分披露参与金融期货交易的有关情况，包括投资目的、持仓情况、损益情况等，并在资产管理相关报告中披露相应内容。

管理人应在金融期货交易编码申请后3个工作日内向相关监管机构备案。

管理人应当在委托资产清算结束后3个交易日内申请注销金融期货交易编码，并按照规定向相关监管机构报告。

### 3、金融期货交易的风险控制及责任承担

本集合计划参与金融期货交易的，管理人应建立健全相关风险管理及内部控制制度、有效的动态风险监控系統，确保参与金融期货交易的风险可测、可控、可承受。

本集合计划参与金融期货交易应当符合法律法规和本合同约定。

本集合计划投资金融期货的相关风险（包括但不限于被强制平仓导致的委托资产损失等情形）由委托人自行承担，管理人、托管人不得以任何方式对委托人资产本金不受损失或者取得最低收益作出承诺。

### 4、期货保证金的流动性应急处理机制

#### （1）应急触发条件

管理人收到追加保证金及/或强行平仓通知后，本集合计划未有足够的现金资产及时追加保证金到位或预计难以按要求自行减仓时，触发期货保证金的流动性应急处理机制。

#### （2）保证金补充机制

如出现保证金不足的情况时，管理人将首先运用本集合计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现本集合计划资产，变现时应重点考虑变现资产的流动性，以最大限度的降低损失。

### （3）损失责任承担等

委托资产的变现损失及非因管理人自身过错所造成的未及时追加保证金的损失（包括穿仓损失），由委托人自行承担。对于其他相关方的原因给委托人造成的损失，管理人不承担赔偿责任。

## 八、建仓期安排

本计划的建仓期为自产品成立之日起 6 个月。建仓期的投资活动，应当符合本合同约定的投向和风险收益特征。建仓期结束后，本集合计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。建仓期结束后，本集合计划的资产组合应当符合法律、行政法规、中国证监会规定和合同约定的投向和比例。

## 九、规避特定风险的安排

无

## 十、资产组合的流动性与参与、退出安排相匹配

上述投资的资产组合的流动性应与本集合计划的参与、退出安排相匹配。

## 十一、预警线和止损线

1、本集合计划预警线为单位净值0.95元。存续期内，当本集合计划单位净值小于等于0.95元时，本集合计划触及预警线。自本集合计划触及预警线的下一交易日起，管理人不得新增买入操作，直至集合计划单位净值恢复到0.95元以上时不受前述限制。

2、本集合计划止损线为单位净值0.90元。存续期内，当本集合计划单位净值小于等于0.90元时，本集合计划触及止损线，此时本集合计划进入终止清算程序。自触及止损线的下一交易日起，管理人对本集合计划持有的全部非现金资产开始进行不可逆变现，直至本集合计划全部变现为止。委托人同意并认可管理人的前述操作并自愿承担由此而产生的一切后果。

## 第 12 部分          投资顾问

本集合计划不聘请投资顾问。



## 第 13 部分 集合计划的分级安排

本集合计划不分级。

## 第 14 部分 利益冲突及关联交易

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、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，应当事后及时告知托管人，并通过资产管理季度报告向委托人披露。同时向中国证监会相关派出机构和证券投资基金业协会报告，投资于证券期货的关联交易还应当向证券期货交易所报告。

## 第 15 部分 投资经理的指定与变更

### 一、投资经理的指定

本集合计划的投资经理由管理人负责指定。

投资经理：

胡崇海先生，浙江大学数学系运筹控制专业博士，9 年证券从业经验，具备基金从业资格。曾任香港科技大学人工智能实验室访问学者，其后加盟方正证券研究所、国泰君安证券咨询部及研究所从事量化对冲模型的研发工作。后就职于国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部，现任权益与衍生品部投资经理，负责团队 Alpha 策略的相关投研工作，无外部兼职。他在 Alpha 量化对冲策略、指数增强以及事件套利策略等方面有独到且深入的研究，是国内较早将机器学习技术应用到实战投资的量化投资经理之一。从 2015 以来其管理的投资业绩每年均可位列同行同类产品前 20%。

截至合同签订时，胡崇海已取得基金从业资格，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

### 二、投资经理的变更

管理人可根据业务需要变更投资经理，并在变更后及时告知委托人和托管人。管理人自变更之日起 3 个工作日通过信函、传真、电子邮件、手机短信、网站公告等本合同规定的方式之一通知委托人和托管人，即视为履行了告知义务。

## 第 16 部分 资产管理计划的财产

### 一、 集合计划财产的构成

本集合计划的资产包括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，清算备付金及其应计利息，根据有关规定缴纳的保证金，应收参与款，股票、基金投资及其分红，其他资产等。

### 二、 集合计划账户的开立

托管人为本集合计划在托管银行开设托管账户，保管集合计划的银行存款，该托管专户是指托管人在集中清算模式下，代表所托管的包括集合计划在内的托管资产与中国证券登记结算有限责任公司进行一级结算的专用账户。集合计划的一切货币收支活动，包括但不限于投资、支付退出金额、支付计划收益、收取参与款，均需通过该账户进行。托管人可根据实际情况需要，为计划财产开立资金清算辅助账户，以办理相关的资金汇划业务。管理人应当在开户过程中给予必要的配合，并提供所需资料。【委托财产托管期间，托管专户预留印鉴为托管行被授权人名章+管理人公章/财务章】

托管人为本集合计划开立证券账户，证券账户名称为“国君资管—中国银行—君享优量科创 1 号集合资产管理计划” [备注：账户名称以实际开立账户名称为准]

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

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。

### 三、 集合计划财产的保管与处分

1. 本集合计划财产的债务由集合计划财产本身承担责任，投资者以其出资为限对集合计划财产的债务承担责任。

2. 集合计划财产独立于管理人和托管人的固有财产，并独立于管理人管理的和托管人托管的其他财产。管理人、托管人不得将集合计划财产归入其固有财产。

3. 管理人、托管人因集合计划财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入集合计划财产。

4. 管理人、托管人可以按照本合同的约定收取管理费、托管费以及本合同约定的其他费用。管理人、托管人以其固有财产承担法律责任，其债权人不得对集合计划财

产行使请求冻结、扣押和其他权利。管理人、托管人因依法解散、被依法撤销或者被依法宣告破产等原因进行清算的，集合计划财产不属于其清算财产。

5. 集合计划财产产生的债权不得与不属于集合计划财产本身的债务相互抵销。非因集合计划财产本身承担的债务，管理人、托管人不得主张其债权人对集合计划财产强制执行。上述债权人对集合计划财产主张权利时，管理人、托管人应明确告知集合计划财产的独立性，采取合理措施并及时通知投资者。

## 第 17 部分 投资指令的发送、确认和执行

### 一、 管理人对发送指令人员的授权

1、管理人应当事先向托管人发出划款指令授权书，向托管人提供指令的预留印鉴样本和被授权人签字样本，并在划款指令授权书上载明管理人被授权人名单及联系方式。

2、管理人向托管人发出划款指令授权书应加盖授权专用章。托管人在收到划款指令授权书后以回函或双方认可的方式确认。划款指令授权书自托管人收到通知时生效（如果划款指令授权书载明的生效日期与托管人收到授权书的日期不一致时，以后到日期为生效日期）。

3、管理人和托管人对划款指令授权书及其更改负有保密义务，其内容不得向有权发送指令人员及相关操作人员以外的任何人披露、泄露。

### 二、 划款指令的内容

1、划款指令包括管理人在运作计划资产时，向托管人发出的资金划拨书面文书，包括收款指令、付款指令（含退出、收益分配付款指令）及其他资金划拨指令等。

2、管理人发给托管人的书面指令应写明款项事由、支付时间、金额、付款账户信息、收款账户信息等，加盖预留印鉴并有被授权人签字或签章。对电子直连划款指令或者网银形式发送的指令（统称电子指令）应包括但不限于款项事由、支付时间、金额、付款账户信息、收款账户信息等，资产托管人以收到的电子指令为有效指令。

### 三、 划款指令的发送、确认和执行

#### 1、划款指令的发送

（1）若管理人已与托管人建立深证通指令直连或已申请托管人网上资产托管业务信息服务平台（简称托管网银），资产管理人应优先以电子指令形式向资产托管人发送指令，并应事先书面向资产托管人指定各业务类型划款指令的发送主渠道，以传真作为应急方式备用。

（2）若资产管理人未与资产托管人建立深证通指令直连，且未申请托管网银的，指令由资产管理人用传真方式或其他资产托管人和资产管理人认可的方式向资产托管人发送。

划款指令需有划款指令授权书确定的预留印鉴和签字，并由有权发送指令人员在指令上签字后，代表管理人用电子传真的方式向托管人发送，并电话确认托管人收到指令。

(3) 托管人应指定专人接收管理人的指令。托管人应预先书面或以双方认可的方式通知管理人接收人名单和联系方式。

## 2、指令的接收及确认

(1) 资产管理人有义务在发送指令后与托管人以录音电话的方式进行确认。因管理人未能及时与托管人进行指令确认，致使资金未能及时到账所造成的损失，资产托管人不承担责任。资产托管人依照本协议及“授权通知”约定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

托管人在接收指令时，应对指令是否由有权发送指令人员发送、指令的要素是否齐全、指令印鉴与签字是否与预留的授权文件内容、是否与管理合同内容相符进行审慎验证。对于资产管理人依照本协议及“授权通知”发出的指令，资产管理人不得否认其效力。资产管理人应按照相关法律法规以及本协议的规定，在其合法的经营权限和交易权限内发送划款指令，发送人应按照其授权权限发送划款指令。资产管理人在发送指令时，应为资产托管人留出执行指令所必需的时间。发送指令日完成划款的指令，资产管理人应给资产托管人预留出距划款截至时点 2 小时的指令执行时间。由资产管理人过错造成的指令传输不及时、未能留出足够划款所需时间，致使资金未能及时到账所造成的损失由资产管理人承担。

(2) 托管人可以要求管理人传真、电子邮件提供相关交易凭证、合同或其他有效会计资料（若有），以确保托管人有足够的资料来判断指令的有效性。资产托管人收到资产管理人发送的指令后，应对传真划款指令进行形式审查，验证指令的书面要素是否齐全、审核印鉴和签名是否和预留印鉴和签名样本相符，是否符合资产管理合同约定，复核无误后应在规定期限内及时执行，不得延误。对电子指令，资产托管人以收到的符合本协议约定的电子指令为合规有效指令。若存在异议或不符合，资产托管人应暂缓执行，并立即与资产管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求资产管理人重新发送经修改的指令。指令及相关资料若管理人以电子邮件发送扫描件或传真形式向托管人发出，管理人保留正本，托管人保留传真件、扫描件。正本应与传真件、扫描件内容一致，若有不一致的，以托管人收到的传真件、扫描件为准。

### 3、指令的执行

(1) 托管人确认指令有效后，方可执行指令。

(2) 托管人在复核后应在规定期限内执行适当的指令，不得延误。指令执行完毕后，托管人应通知管理人。托管人发现管理人的指令违反法律法规、《集合资产管理合同》或本协议约定的，应当要求改正，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。

(3) 中国证券登记结算有限责任公司向托管人发送的结算通知视为管理人向托管人发出的有效指令，托管人应予以执行。

### 4、执行中相关问题的处理方法

(1) 管理人下达的指令必须要素齐全，词语准确，管理人下达的指令要素不全或语意模糊的，托管人有权附注相应的说明后立即将指令退还给管理人，要求其重新下达有效的指令。

(2) 托管人因故意或过失错误执行指令或未及时执行指令，致使本计划资产的利益受到损害，应负赔偿责任。除此之外，托管人依据本协议约定正确执行管理人的指令，对计划资产造成的损失，不承担任何形式的责任。

(3) 管理人在发送指令时，应为托管人执行指令留出执行指令时所必需的时间。如托管人收到划款指令的时间与划款指令中要求的到账时间之间小于两个小时的，托管人应尽力在指定时间内完成资金划拨，但不保证资金划拨成功，因此导致指令未能及时执行的，托管人应及时以双方认可的方式通知管理人，但由此造成的损失托管人不承担。

(4) 管理人应确保计划的银行存款账户有足够的资金余额，确保计划的证券账户有足够的证券余额。对超头寸的指令，以及超过证券账户证券余额的指令，托管人可不予执行，因管理人过错造成的损失，由管理人负责赔偿。

## 四、被授权人的更换

1、管理人若对划款指令授权书的内容进行修改（包括但不限于有权发送指令人员的名单、联系方式的修改，指令上预留印鉴和签字样本的修改等），应当至少提前1个工作日通知托管人；授权变更通知的文件应由管理人加盖公章并由法定代表人或授权代表签署，若由授权代表签署，还应附上法定代表人的授权书，管理人应在授权变更通知中提供新被授权人的权限及其签字样本。管理人对划款指令授权书的修改应当以传真的形式发送给托管人，同时电话通知托管人，托管人收到变更通



知后以回函或双方认可的方式确认。管理人对划款指令授权书的内容的修改，自托管人收到变更通知时生效（如果变更划款指令授权书载明的生效日期与该日期不一致时，以后到日期为生效日期）。管理人在此后三个工作日内将被授权人变更通知的正本送交托管人。对于被授权人在授权权限内发出的指令，管理人不得否认其效力。托管人收到管理人发出的被授权人终止或更换书面通知生效之前，原被授权人及其签字继续有效。

2、托管人更改接受管理人指令的人员及联系方式，应预先书面或以双方认可的方式通知管理人。

## 第 18 部分 越权交易的界定

### 一、越权交易的界定

越权交易是指管理人违反有关法律法规的规定以及违反或超出本合同项下投资者的授权而进行的投资交易行为，包括：（1）违反有关法律法规和本合同投资范围的规定进行的投资交易行为；（2）法律法规禁止的超买、超卖行为。

管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用委托资产进行投资管理，不得违反有关法律法规和本合同的约定，超越权限管理、从事证券投资。

### 二、对越权交易的处理

对违反有关法律法规和本合同投资范围的规定进行的投资交易行为应采取如下处理措施：

1、托管人发现管理人的划款指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当立即要求管理人改正；未能改正或者造成客户委托资产损失的，托管人应当及时通知投资者，并报告管理人住所地中国证监会派出机构及相关监管机构。

2、根据交易规则，托管人只能在事后发现的越权交易，托管人在履行其及时通知管理人和投资者并及时报告管理人住所地中国证监会派出机构及相关监管机构的义务后，予以免责。

3、管理人应向投资者和托管人主动报告越权交易，在限期内，投资者和托管人有权随时对通知事项进行复查，督促管理人改正。管理人对投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人应报告管理人住所地中国证监会派出机构及相关监管机构。

4、托管人在行使监督职能时，如果发现委托资产投资过程中出现超买或超卖现象，应立即提醒管理人，由管理人负责解决，由此给委托资产或托管人托管的其他财产造成的损失由管理人承担。如果因管理人原因发生超买行为，管理人必须及时准备好资金，用以完成清算交收。

5、越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担，所发生的收益归委托资产所有。

### 三、托管人对管理人投资运作的监督和核查

根据有关法律法规规定、本合同约定，托管人应对涉及本计划资产的投资范围、投资比例、投资限制、本计划资产的核算、资产净值的计算、托管费和其他相关费

用的计提和支付、计划收益分配及计划清算等事项的合法性、合规性进行监督和核查。

资产托管人根据法律法规及本合同之约定在其可观测及系统支持的范围内对投资禁止行为进行监督。

对于需要外部市场公共数据支持才可以实现的监控指标，资产托管人不能完全保证外部数据的真实、完整、准确，但会尽勤勉义务督促外部数据提供商尽量保证所提供数据的真实、完整。

因投资政策变更导致的投资监督事项的调整，应经资产委托人、资产管理人和资产托管人协商一致，并为资产托管人调整监督事项留出必要的时间。具体监督事项，见附件《投资监督事项表》。

## 第 19 部分 集合计划财产的估值和会计核算

### 一、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，并依法进行股票、基金等资本市场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。本集合计划 T 日完成 T 日估值对账。

#### (七) 估值方法

估值应符合本合同、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》中的估值原则以及《证券公司客户资产管理业务估值方法指引》及其他法律、法规的规定，如法律法规未做明确规定的，参照行业通行做法处理。管理人、托管人的估值数据应依据合法的数据来源独立取得。对于固定收益类投资品种的估值应依据中国证券业协会基金估值工作小组的指导意见及指导价格估值。

##### 1、估值的基本原则

对存在活跃市场的投资品种，如估值日有市价的，应采用市价确定公允价值。估值日无市价，但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的，应采用最近交易市价确定公允价值。如估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化且证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值。

对不存在活跃市场的投资品种，应采用市场参与者普遍认同，且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。运用估值技术得出的结果，应反映估值日在公平条件下进行正常商业交易所采用的交易价格。采用估值技术确定公允价值时，应尽可能使用市场参与者在定价时考虑的所有市场参数，并应通过定期校验，确保估值技术的有效性。

有充足理由表明按以上估值原则仍不能客观反映相关投资品种的公允价值的，管理人应根据具体情况与托管人进行商定，按最能恰当反映公允价值的价格估值。

## 2、具体投资品种估值方法

### (1) 投资股票的估值方法

A. 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。

B. 上市流通股股票估值日无交易的，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了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；

C. 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。

D. 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股票的收盘价进行估值。

E. 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股票的收盘价进行估值。

F. 通过非公开发行有明确锁定期的股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。

(2) 投资证券投资基金的估值方法

a 持有的交易所上市基金(包括封闭式基金、上市开放式基金(LOF)、创新型分级基金等),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,或者类似投资品种的现行市价及重大变化因素,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值;

b 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;

c 持有的货币市场基金按基金管理公司公布的估值日前一交易日的每万份收益每日计提红利;

(3) 存款的估值方法

存款以本金列示,按存款利率逐日确认利息收入。

3、建仓期间以现金管理目的持有的国债、中央银行票据、政策性金融债的估值,选取第三方估值机构提供的相应品种当日的估值净价进行估值。

4、期货、期权合约的投资,一般以估值当日结算价进行估值,估值当日无结算价的,且最近交易日后经济环境未发生重大变化的,采用最近交易日结算价估值。

5、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;

6、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委托人利益时,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。

7、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，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。

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，管理人的赔偿范围以其在本合同项下所收取的管理费为限，对投资人实际直接经济损失承担赔偿责任；托管人以其在本合同项下所收取的托管费为限，对因此造成的实际直接经济损失承担赔偿责任。

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） 估值调整的情形与处理

因最近交易日后经济环境发生重大变化，或者有确凿证据表明集合计划上述估值方法不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的价格进行估值调整。

#### （十一） 差错处理

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“处理原则”给予赔偿并承担赔偿

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。

#### 1、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，则差错责任方和有协助义务的当事人应当承担相应的责任，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财产损失时，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财产损失时，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。

## 2、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。

## (十二) 暂停估值的情形

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。

3、证券/期货经纪服务机构未能提供估值所需资料，导致运营服务机构、托管人无法对集合计划资产进行正常估值时；

4、占集合计划相当比例的投资品种的估值出现重大转变，而管理人为保障投资者的利益，决定延迟估值的情形；

5、金融监管部门和本合同认定的其他情形。

如发生上述暂停估值的情形，托管人暂停对本集合计划的投资监督，自本集合计划恢复估值之日起，托管人恢复对本集合计划的投资监督。

## (十三) 资产管理计划份额净值的确认

根据有关法律法规，集合计划资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本产品的会计责任方由管理人担任，因此，就与本集合产品有关的会计问题，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，以管理人对基金资产净值的计算结果为准，由此造成的损失，托管人不承担任何责任。

## (十四) 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了错误但因前述原因无法纠正的，由此造成的集合计

划资产估值错误，管理人和托管人免除赔偿责任。但管理人和托管人当积极采取必要的措施消除或减少由此造成的影响。

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了错误但因前述原因无法纠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。

## 二、会计核算

本集合计划的会计政策比照现行政策或按照资产管理合同约定执行。

- 1、本集合计划的会计年度为自然年度。
- 2、本集合计划的记账本位币为人民币。

3、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；管理人应保留完整的会计账目、凭证并进行日常的会计核算，编制会计报表，同时还建立会计档案保管制度，确保档案真实完整。托管人应定期与管理人就资产管理计划的会计核算、报表编制等进行核对。

## 第 20 部分 集合计划的费用、业绩报酬

### 一、与集合计划运作有关的费用

- 1、集合计划的管理费；
- 2、集合计划的托管费；
- 3、集合计划的业绩报酬；
- 4、证券交易费用；
- 5、与本集合计划相关的审计费；
- 6、违约处置费用；
- 7、集合计划财产划拨支付的银行费用；
- 8、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。

### 二、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式

集合计划费用由集合计划资产承担。

#### 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 0.1%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div 365$$

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，逐日累计，按季支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，按照管理人指令或者双方认可的其他方式，在次季首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。闰年 2 月 29 日不计提托管费。本合同终止（包括提前或延期）后，依据清算程序向托管人支付尚未支付的托管费。

托管费收费账户信息如下：

户名：中国银行股份有限公司上海市分行

账号：

开户银行：

大额支付号：

上述托管人的账户信息如有变更，托管人可单独决定而无须变更本合同，但须在账户信息变更生效前至少三个工作日通知管理人。

## 2、管理人的固定管理费

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

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

H 为每日应计提的固定管理费；

E 为前一日集合计划资产净值。

管理人的固定管理费每日计提，逐日累计，按季支付，由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在次季首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。若因战争、自然灾害等不可抗力致使无法按时支付的，则在不可抗力情形消除后的首个工作日支付。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。闰年 2 月 29 日不计提管理费。集合计划终止后，依据清算程序向管理人支付尚未支付的管理费。

管理费收费账户信息如下：

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

## 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。在每季度首日起 10 个工作日内支付给

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、违约处置费用

在存续期间，管理人为维护集合计划资产安全而采取违约处置措施所发生的各项费用，包括但不限于诉讼费（仲裁费）、律师费、律师差旅费、评估费、保全费、拍卖费等违约处置费用。托管人根据管理人发送的指令和费用凭证对划款指令进行表面相符性的形式审查，对其真实性和合理性不承担复核责任。

6、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。

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，按照每次实际发生金额计入集合计划费用；

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；

在计划成立后，开立证券账户，开户费由集合计划资产承担，管理人向托管人发送证券账户开户费划付指令，开户费支付至托管人指定账户，由托管人负责开户。

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6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。

如需管理人以自有资产先行垫付上述各项费用的，管理人有权就垫付费用从委托资产中优先划扣抵偿，委托人不以任何方式要求管理人向其返还或补偿该等费用。

### 三、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。

### 四、管理人提取业绩报酬

#### 1、业绩报酬计提原则

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。业绩报酬计提日为计划分红日、委托人退出日或集合计划清算日。

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，按照本合同第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。

#### 2、业绩报酬计提办法

##### （1）退出提取

当委托人申请退出或本集合计划终止清算时，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；

$K = \text{退出份额} \times \text{上一个业绩报酬计提日的单位净值}$ ;

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

以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（对委托人每笔计划份额，如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，募集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  $R > 6\%$  时，本集合计划对超过 6% 的收益部分提取 20% 的业绩报酬，即  $E = K \times (R - 6\%) \times 20\% \times (T \div 365)$ 。

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，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，退出日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 280 天，则

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

业绩报酬 =  $(1,000,000 \times 1.03) \times (10.12\% - 6\%) \times 20\% \times (280 \div 365) = 6,510.73$  元。

例 2：某委托人于上一个业绩报酬计提日（2018 年 3 月 15 日）持有份额 1,000,000 份，上一个业绩报酬计提日单位累计净值为 1.06 元、单位净值为 1.03 元，后续于 2018 年 9 月 10 日申请退出份额 200,000 份、单位累计净值 1.13 元，以及于 2018 年 12 月 19 日后申请退出份额 300,000 份、单位累计净值 1.15 元，则

a) 针对退出份额 200,000 份，退出日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 180 天。具体业绩报酬计算方法参照例 1。

b) 针对退出份额 300,000 份，退出日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 280 天。具体业绩报酬计算方法参照例 1。

业绩报酬采用按账户计提的方式，多次参与、退出在计算份额持有天数时采用“先进先出”法，比如，某投资者 2017 年 1 月 9 日参与 100 万份，2017 年 5 月 22 日参与 100 万份，2019 年 3 月 18 日退出 150 万份，则认为其中 100

万份持有了 798 天，剩余 50 万份持有了 665 天，分别计算业绩报酬。

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。

### （2）分红提取

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。

例 1：某委托人分红日持有份额 1,000,000 份，每份分红额为 0.50 元，分红日单位资产累计净值为 1.79 元，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，分红日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为 280 天，则

$$R=(1.79-1.05) \div 1.03 \times (365 \div 280) \times 100\%=93.6\%$$

$$\text{业绩报酬}=(1,000,000 \times 1.03) \times (93.6\%-6\%) \times 20\% \times (280 \div 365) = 138,432.00 \text{ 元。}$$

注：当分红额不足提取业绩报酬时，以分红额为限。如假设每份分红额只有 0.10 元，则业绩报酬 =  $\min(138,432.00, 1,000,000 \times 0.10) = 100,000$  元

注：

①业绩报酬涉及的间隔天数计算管理人以确认日计算。

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。

（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。

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，相关信息以注册登记机构计算结果为准。

### 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，业绩报酬以管理人提供的数据为准。



托管人根据管理人的指令将业绩报酬支付给管理人。

4、业绩报酬计提基准不是预期收益或者保证收益率，不构成管理人、销售机构、托管人对委托人财产收益状况的任何承诺和担保，委托人仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

#### 五、费用调整

本集合计划各项费用调低，经管理人和托管人协商一致即可；若各项费用需调高，则应由管理人、托管人与全体委托人协商一致通过后由管理人向委托人发布公告后方可调整。

#### 六、其他税费

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。

在本集合计划存续期间产生的税费由委托财产承担。管理人有权按照法律法规规定进行扣缴。如依据相关法律法规或税务机关的规定，就本计划营运过程中发生的增值税等应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，各方一致同意：除本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳外，管理人有权以委托财产予以预提税费或其他方式从委托财产中扣除相关应缴增值税税费；管理人在向委托人交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关增值税税费的，委托人应按照管理人通知要求进行补缴，管理人亦有权以委托人的剩余计划财产予以缴纳；如果管理人以自有资产先行垫付上述增值税等税费的，管理人有权从委托资产中划扣抵偿，委托人不得以任何方式要求管理人向其返还或补偿该等税费；委托人未按照本条款约定缴纳税款给管理人造成损失的，委托人承担全部赔偿责任。

上述相关税款由管理人计算后向托管人出具划款指令，由托管人划付至管理人账户并由管理人依据税务部门要求完成相关税款申报缴纳。

## 第 21 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、本计划默认收益分配方式为现金分红；
- 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；
- 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；
- 6、集合计划成立不满 3 个月可不进行收益分配；
- 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；
- 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；
- 9、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持有本集合计划份额的委托人。

### 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注册登记机构的销售归集账户，再划入销售机构指定的收款账户，最后由销售机构划入委托人账户。

## 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】%。

## 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通知

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以公告形式告知委托人。

## 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、管理人确定收益分配的金额、时间；
- 3、管理人制定收益分配方案；
- 4、托管人对集合计划的收益分配方案进行复核；
- 5、管理人通知委托人；
- 6、注册登记人实施分配方案。

## 十二、收益分配的执行

托管人根据管理人的收益分配方案和提供的红利金额的数据，在红利发放日进行处理。

## 第 22 部分 信息披露与报告

### 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）报告和年度审计报告。

#### 1、集合计划单位净值报告。

管理人在每周第一个工作日（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。

2、管理人应当向投资者提供资产管理计划季度报告和年度报告，披露报告期内资产管理计划运作情况，年度报告包括但不限于下列信息：

- （1） 管理人履职报告；
- （2） 托管人履职报告（如适用）；
- （3） 资产管理计划投资表现；
- （4） 资产管理计划投资组合报告；
- （5） 资产管理计划运用杠杆情况（如有）；
- （6） 资产管理计划财务会计报告；
- （7） 资产管理计划支付的管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式；
- （8） 资产管理计划投资收益分配情况；
- （9） 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项；
- （10） 中国证监会规定的其他事项。

资产管理计划季度报告应当披露前款除第（6）项之外的其他信息。

资产管理计划成立不足三个月或者存续期间不足三个月的，管理人可以不编制资产管理计划当期的季度报告和年度报告。

季度报告应于每季度截止日后一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。年度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。

#### 3、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。

#### 4、对账单

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。

## 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，管理人应当在事项发生之日起五日内以管理人网站公告方式等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经理发生变更，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) 负责本集合计划的销售机构发生变更；

(8) 管理人以自有资金参与或退出本集合计划；

(9) 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；

(10) 管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

(11) 其他管理人认为的重大事项。

## 三、管理人关联方参与本集合计划的信息披露

管理人的董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与资产管理计划，应向投资者充分披露。

## 四、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》、《运作规定》、本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，将在管理人网站（[www.gtjazg.com](http://www.gtjazg.com)）上披露，委托人可随时查阅。

#### 2、管理人、销售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、相关报告等资料放置于管理人和集合计划销售机构，供委托人查询。

#### 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。

### 五、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、临时公告与报告披露于管理人网站（[www.gtjazg.com](http://www.gtjazg.com)），供委托人查阅。

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 23 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：

### 一、一般风险揭示

#### 1. 本金损失风险

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划财产，但不保证本集合计划财产中的认购或参与资金本金不受损失，也不保证一定盈利及最低收益。

本计划属于中风险投资品种，适合合格投资者中的专业投资者和风险承受能力评估结果为稳健型、积极型、激进型的普通投资者。

#### 2. 市场风险

资产管理计划的投资品种价格因受经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素影响而引起的波动，导致收益水平变化产生的风险。主要包括：政策风险、经济周期风险、利率风险、购买力风险、再投资风险、衍生品风险等。

#### 3. 管理风险

资产管理计划运作过程中，管理人依据资产管理合同约定管理和运用资产管理计划财产所产生的风险，由资产管理计划财产及投资者承担。投资者应充分知晓投资运营的相关风险，其风险应由投资者自担。

#### 4. 流动性风险

资产管理计划因市场整体或投资品种流动性不足、应付可能出现的投资者巨额退出或大额退出等原因，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的风险。

#### 5. 信用风险

交易对手方未能实现交易时的承诺，按时足额还本付息的风险，或者交易对手未能按时履约的风险。

#### 6. 募集失败风险

本计划的成立需符合相关法律法规的规定，本计划可能存在不能满足成立条件从而无法成立的风险。

管理人的责任承担方式：

(1) 以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

(2) 在资产管理计划募集期限届满（确认资产管理计划无法成立）后三十日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。

## 7. 投资标的风险

本集合计划投资标的的价值取决于投资对象的经营状况，相关市场宏观调控政策、财政税收政策、产业政策、法律法规、经济周期的变化以及区域市场竞争格局的变化等都可能影响所投资企业经营状况，进而影响资产管理计划投资标的的价值。

### (1) 投资金融期货和商品期货的特有风险

#### A、强制平仓和强制减仓风险

金融期货实行当日无负债结算制度，对资金管理要求非常高。价格波动剧烈的时候可能面临追加保证金的问题，如果没有在规定的时间内补足保证金，按规定将被强制平仓，投资者可能会因此导致亏损。

强制减仓是当市场出现连续两个及两个以上交易日的同方向涨停(跌)等特别重大的风险时，中金所为迅速、有效化解市场风险，防止会员大量违约而采取的措施，即，中金所将当日以涨跌停板价申报的未成交平仓报单，以当日涨跌停板价与该合约净持仓盈利投资者按持仓比例自动撮合成交。由上述减仓造成的经济损失由会员及其投资者承担。

强制平仓和强制减仓都有可能导致集合计划的多空头寸的市值不匹配，从而使集合计划面临股票市场的系统性风险暴露。

#### B、信用风险

对于金融期货交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行金融期货交易时，交易所有一套独特的交易体系，如设立一系列的保证金制度，最低资金要求，逐日盯市结算措施及强行平仓制度等，使整个市场的信用风险下降。但这种由结算公司充当所有投资者的交易对手，并承担履约责任，一旦结算公司出现风险暴露，由于其风险过度集中，在重大风险事件发生时，或风险监控制度不完善时也会发生信用风险。

#### C、结算风险



投资者金融期货投资的结算及投资者金融期货资产账户项下的资产保管由期货经纪公司负责。证券投资者如果选择了不具有合法证券经纪业务资格的证券及期货经纪公司从事证券交易，投资者权益将无法得到法律保护；或者所选择的证券及期货经纪公司在交易过程中存在违法违规经营行为或破产清算，也可能给投资者带来损失。

对从事金融期货的投资者来说，为投资者进行结算的结算会员或同一结算会员下的其他投资者出现保证金不足、又未能在规定的时间内补足，或因其他原因导致中国金融期货交易所对该结算会员下的经纪账户强行平仓时，投资者的资产可能因被连带强行平仓而遭受损失。

## （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）投资于港股通标的股票的风险

将面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异所带来的特有风险,包括但不限于:

### ①海外市场风险

本集合计划在参与港股市场投资时将受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统性风险。

### ②股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本集合计划的波动风险可能相对较大。

### ③汇率风险

本集合计划在交易时间内提交订单依据的港币买入参考汇率和卖出参考汇率，并不等于最终结算汇率，港股通交易日日终，中国证券登记结算有限责任公司进行净额换汇，将换汇成本按成交金额分摊至每笔交易，确定交易实际适用的结算汇率，本集合计划可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本集合计划在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，

该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本集合计划将因此而遭遇资金被额外占用进而降低投资效率的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险。

#### ④港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本集合计划可能因为港股通市场每日额度不足，而不能买入看好之投资标的进而错失投资机会的风险。

#### ⑤港股通可投资标的的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入，本集合计划可能因为港股通可投资标的的范围的调整而不能及时买入看好的投资标的，而错失投资机会的风险。

#### ⑥港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有沪港两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯、港股不能及时卖出的情形（如内地市场因放假等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），导致本集合计划所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应，可能带来一定的流动性风险，造成其价格波动骤然增大，进而导致本集合计划所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

#### ⑦交收制度带来的集合计划流动性风险

由于香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本集合计划在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）才能在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本集合计划可能面临卖出港股后资金不能及时到账，而造成支付赎回款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险。

#### ⑧港股通标的的权益分派、转换等的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本集合计划因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因

港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本集合计划存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

#### ⑨香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及\*ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。

因该等制度性差异，本集合计划可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而带来损失的风险。

#### ⑩港股通规则变动带来的风险

本集合计划是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响；本集合计划存在因港股通规则变动而带来投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

#### ⑪其他可能的风险

除上述显著风险外，本集合计划参与港股通投资，还可能面临的其他风险，包括但不限于：

i 除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本集合计划存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

ii 在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本集合计划投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

iii 在本集合计划参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

iv 存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；另外港股通境内结算实施分级结算原则，本集合可能面临以下风险：（a）因结算参与人

未完成与中国结算的集中交收，导致本集合计划应收资金或证券被暂不交付或处置；

(b) 结算参与人对本集合计划出现交收违约导致本集合未能取得应收证券或资金；

(c) 结算参与人向中国结算发送的有关本集合的证券划付指令有误的导致本集合权益受损；

(d) 其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本集合利益受到损害的情况。

#### (4) 投资于期权的风险

包括但不限于：

1) 价值归零风险：虚值（平值）的期权在接近合约到期日时期权价值逐渐归零，此时内在价值为零，时间价值逐渐降低。不同于股票的是，期权到期后即不再存续。

2) 高溢价风险：当期权的价格大幅高于合理价值时，可能出现高溢价风险。

3) 到期不行权风险：实值的期权在到期时具有内在价值，只有选择行权才能获取期权的内在价值。

4) 交割风险：无法在规定的时限内备齐足额的现金/现券，导致期权的行权失败或交割违约。

5) 流动性风险：在期权的合约流动性不足或停牌时无法及时平仓，特别是深度实值/虚值的期权合约。

6) 保证金风险：期权的卖方可能随时被要求提高保证金数额，若无法按时补交，会被强行平仓。

#### (5) 科创板投资的特别风险

1) 科创板企业所处行业和业务往往具有研发投入规模大、盈利周期长、技术迭代快、风险高以及严重依赖核心项目、核心技术人员、少数供应商等特点，企业上市后的持续创新能力、主营业务发展的可持续性、公司收入及盈利水平等仍具有较大不确定性，投资者应当关注科创板公司盈利能力巨变的风险。

2) 科创板企业可能存在首次公开发行前最近3个会计年度未能连续盈利、公开发行并上市时尚未盈利、有累计未弥补亏损等情形，可能存在上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配等情形。

3) 科创板退市制度较主板更为严格，退市时间更短，退市速度更快；退市情形更多，新增市值低于规定标准、上市公司信息披露或者规范运作存在重大缺陷导致退市的情形；执行标准更严，明显丧失持续经营能力，仅依赖与主业无关的贸易或者不具

备商业实质的关联交易维持收入的上市公司可能会被退市。

4)、科创板股票竞价交易设置较宽的涨跌幅限制，首次公开发行上市的股票，上市后的前5个交易日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为20%，应当关注可能产生的股价波动的风险。

5) 科创板股票的交易制度与主板存在明显差异。例如上市首日即可作为融资融券标的，与上交所主板市场存在差异，投资者应注意相关风险。科创板股票交易盘中临时停牌情形和严重异常波动股票核查制度与上交所主板市场规定不同，投资者应当关注与此相关的风险。

6) 科创板股票相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改，或者制定新的法律法规和业务规则，投资者应当关注规则变化的风险。

#### 8. 税收风险

契约式产品所适用的税收征管法律法规可能会由于国家相关税收政策调整而发生变化，投资者收益也可能因相关税收政策调整而受到影响。

## 二、特殊风险揭示

### 1. 资产管理合同与中国基金业协会合同指引不一致的风险

本资产管理合同是基于中国基金业协会发布的《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》而制定的，管理人对合同指引相关内容做出了合理的调整以及增加了其他内容，导致资产管理合同与中国基金业协会合同指引不一致的风险。投资人应当认真阅读本合同，理解本合同的全部条款，独立做出是否签署本合同的决定。

### 2. 委托募集的风险

本集合计划的销售机构包括管理人直销，以及其他销售机构。在其他销售机构代理推广本集合计划时，管理人将应属本机构负责募集事项委托其他机构办理，因其他销售机构不符合金融监管部门规定的资质要求、或不具备提供相关服务的条件和技能、或因管理不善、操作失误等，可能给委托人带来一定的风险。

### 3. 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。

#### 4. 产品备案风险:

因监管政策的原因导致备案不成功的风险由委托人自行承担。如计划备案不成功,管理人可在收到备案不成功信息后三十个工作日内,将已认购资金及投资收益(如有)返还给委托人。如计划资产暂时无法变现或仅能部分变现的,管理人可先将可变现部分变现后按比例返还给委托人,剩余部分在后续一次或多次变现后及时按比例向委托人进行返还,直至全部变现并返还完毕。

### 三、其它风险

#### 1. 其他一般风险

##### (1) 关联交易风险

本集合产品可投资于由管理人、托管人或其关联方管理的产品或者与管理人、托管人或其关联方进行交易,这构成与本集合产品的关联交易,存在关联交易风险。

##### (2) 技术风险和操作风险

在本集合计划的各种交易行为或者后台运作中,可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行或者导致委托人的利益受到影响。这种技术风险可能来自管理人、份额登记机构、证券/期货经纪机构、销售机构、证券交易所、登记结算机构等。

本集合计划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。

##### (3) 发生不可抗力事件的风险

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。

##### (4) 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。

##### (5) 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。

##### (6) 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。

#### (7) 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。

#### (8) 证券交易资金前端控制风险

根据《上海证券交易所、深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司证券交易资金前端风险控制业务规则》等有关规定，证券交易所、中国结算对管理人相关交易单元的全天净买入申报金额总量实施额度管理，并通过证券交易所对本计划实施资金前端控制。因此本计划存在因上述业务规则而无法完成某笔或某些交易的风险，从而可能造成损失。除管理人、托管人故意或重大过失造成本计划损失，由各过错方根据过错程度承担责任外，其他损失由本计划资产承担。

### 2. 其他特殊风险

(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；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；

(2) 突发偶然事件的风险：指超出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。

(3) 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；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；

(4) 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；因业务竞争压力而可能产生的风险；对主要业务人员如投资经理的依赖而可能产生的风险；

(5) 在现行期货交易结算模式下，集合计划资产进行期货投资相关交易及结算数据由期货公司负责发送，管理人及托管人据以履行期货相关会计核算、估值等职责。若因期货公司、中金所或其他原因造成期货公司向管理人、托管人传送的集合计划在中金所的交易及结算数据不准确、不完整或不真实，将为集合计划资产带来风险；

(6) 金融市场危机、行业竞争、代理商违约、托管人违约等超出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。

(7) 委托人提供信息不真实、不准确、不完整或委托人的参与导致本产品不符合《指导意见》、《管理办法》、《运作规定》等法律法规要求的，管理人有权对其申请参与份额不予确认或强制退出其已持有的份额，由此而产生的一切损失，管理人不承担任何责任。



## 第 24 部分 合同的变更、展期、终止与财产清算

### 一、合同的变更

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修订，自该修订生效之日起，本合同相关内容及条款必须变更资产管理合同的，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。

本合同变更内容满足法律法规和本合同的相关规定后，在上述意见回复期限届满且管理人宣布合同变更生效之日起生效。

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，若经全体委托人、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。

7、资产管理合同发生变更的，管理人应按照证券投资基金业协会要求及时向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。

## 二、管理人和托管人职责终止的情形

### （一）管理人职责终止的情形

有下列情形之一的，管理人职责终止：

- 1、管理人被依法撤销资产管理业务资格；
- 2、管理人依法解散、被依法撤销或宣告破产；
- 3、法律法规及中国证监会规定的或本合同约定的其他情形。

### （二）托管人职责终止的情形

有下列情形之一的，托管人职责终止：

- 1、托管人被依法撤销基金托管资格；
- 2、托管人依法解散、被依法撤销或被依法宣告破产；
- 3、法律法规及中国证监会规定的或本合同约定的其他情形。

### （三）管理人和托管人的变更程序

#### 1、管理人的变更程序

（1）新任管理人由托管人和全体委托人一致同意并共同选定。托管人和全体委托人应当于上述管理人职责终止事项发生后【20】个工作日内发起新任管理人的选定程序。管理人职责终止事项发生后6个月内未选定新任管理人的，本集合计划终止。

（2）新任管理人产生之前，由中国证监会或其他有权机构指定临时管理人。

（3）新任管理人的选任结果应向相关监管机构备案，备案完成后变更管理人生效。

（4）管理人应于变更管理人生效后的【5】个工作日内在管理人网站公告。

(5) 管理人职责终止的，管理人应妥善保管集合计划管理业务资料，及时向临时管理人或新任管理人办理集合计划管理业务的移交手续，临时管理人或新任管理人应及时接收。新任管理人或临时管理人应与托管人核对集合计划资产总值和净值。

(6) 管理人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划资产进行审计，并将审计结果予以公告，同时向相关监管机构备案，审计费用在集合计划资产中列支。

(7) 管理人更换后，如果原任或新任管理人要求，应按其要求替换或删除集合计划名称中与原任管理人有关的名称字样。

## 2、托管人的变更程序

(1) 新任托管人由管理人和全体委托人一致同意并共同选定。管理人和全体委托人应当于上述托管人职责终止事项发生后【20】个工作日内发起新任托管人的选任程序。托管人职责终止事项发生后6个月内未选定新人任托管人的，本集合计划终止。

(2) 新任托管人产生之前，由中国证监会或其他有权机构指定临时托管人。

(3) 新任托管人的选任结果应向相关监管机构备案，备案完成后变更托管人生效。

(4) 管理人应于变更托管人生效后的【5】个工作日内在管理人网站公告。

(5) 托管人职责终止的，托管人应当妥善保管集合计划资产和集合计划托管业务资料，及时向临时托管人或新任托管人办理移交手续，新任托管人或者临时托管人应当及时接收。新任托管人或临时托管人应与管理人核对集合计划资产总值和净值。

(6) 托管人职责终止的，应当按照法律法规规定聘请会计师事务所对集合计划资产进行审计，并将审计结果予以公告，同时向相关监管机构报备；审计费用在集合计划资产中列支。

(四) 本部分关于管理人、托管人变更条件和程序的约定，凡是直接引用法律法规的部分，如将来法律法规修改导致相关内容被取消或变更的，管理人与托管人协商一致并提前公告后，可直接对相应内容进行修改和调整，无需事先征得委托人同意。

## 三、集合计划的展期

(一) 本集合计划可以展期。

(二) 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、符合集合资产管理计划的成立条件；

5、中国证监会规定的其他条件。

(三) 展期的安排

1、通知展期的时间

不晚于集合计划到期前 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。

(四) 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）到销售机构办理退出手续或按本合同规定办理集合计划份额转让手续；若委托人未在存续期届满日前（含届满日）到销售机构办理集合计划份额退出、转让手续，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。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转让或退出手续，视为同意展期，管理人不再另行通知确认。

(五) 展期的实现

如果集合计划符合展期条件，并且同意集合计划展期的委托人人数不少于 2 人，则集合计划存续期将依法展期，管理人将在展期成功后书面通知托管人；如果集合计划不符合展期条件或同意本集合计划展期的各委托人人数低于 2 人则集合计划到期终止，将按照《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。

**四、集合计划的终止**

有下列情形之一的，集合计划应当终止：

1. 本集合计划管理期限届满且未展期的；
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；
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；
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；
5. 存续期内，持续五个工作日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；
6. 存续期内，本集合计划触及止损线；
7. 存续期内，集合计划资产规模低于 500 万元人民币时，管理人有权提前终止本集合计划；
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. 未在基金业协会完成备案或不予备案的情形；
10. 法律、法规规定或中国证监会规定的其他情况。

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（8）项约定的情形除外。

**五、具备下列情形之一的，资产托管人有权立即终止提供托管服务、冻结涉恐资金、要求赔偿损失或采取其他反洗钱管控措施：**

- 1、资产委托人、资产管理人被列入国际组织、当地监管或有关外国政府的制裁名单，且相关名单在资产托管人或当地监管禁止提供账户服务、禁止交易之列；
- 2、资产委托人、资产管理人从事洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为被司法机关定罪量刑；
- 3、资产委托人、资产管理人涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为被诉讼或调查，使资产托管人遭受或可能遭受巨大声誉、财务等损失；
- 4、有合理理由怀疑资产委托人、资产管理人涉嫌洗钱、恐怖融资或其他违法犯罪行为，要求资产委托人、资产管理人提供证明交易合法性、真实性等相关材料，资产委托人、资产管理人无合理理由拒绝配合；
- 5、资产委托人、资产管理人未建立合理有效的客户尽职调查等反洗钱内部控制机制，资产托管人评估认为资产委托人、资产管理人在反洗钱、恐怖融资及制裁合规

风险管理方面风险等级过高。

## 六、集合计划的清算

### （一）清算小组

1、本集合计划合同终止情形发生之日起五个交易日内，管理人应通知托管人和委托人本集合计划终止。自集合计划终止日起，本集合计划不得进行任何新增投资行为。

2、本集合计划终止之日起5个交易日内由管理人组织成立清算小组，开始清算程序。

3、清算小组成员由管理人、托管人等相关人员组成。清算小组可以聘用必要的工作人员。

4、清算小组负责本集合计划清算资产的保管、清理、估价、变现和分配。清算小组可以依法以进行必要的民事活动。

### （二）清算程序

- 1、清算小组成立后，由清算小组统一接管集合计划财产；
- 2、对集合计划财产和债权债务进行清理和确认；
- 3、对集合计划财产进行估值和变现；
- 4、制作清算报告；
- 5、对集合计划财产进行分配；
- 6、本集合计划清算完毕，资产管理合同终止。

### （三）清算费用

清算费用是指清算小组在进行集合计划财产清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由清算小组优先从集合计划资产中支付。

### （四）集合计划财产清算过程中剩余资产的分配

集合计划财产按如下顺序进行清偿

- 1、支付集合计划财产清算费用；
- 2、缴纳集合计划所欠税款；
- 3、清偿集合计划债务（包括但不限于管理费、托管费等）；
- 4、清算后如有余额，按集合计划委托人持有的集合计划份额比例进行分配并分别扣除应计提业绩报酬（如有）。

### （五）二次清算

因持有流通受限证券、投资的产品封闭期（含限售期、锁定期）超过集合计划存

续期等原因导致本集合计划财产无法及时变现的，管理人应当于本集合计划终止后对集合计划财产进行清算并先行分配已变现部分。待上述资产可以变现时，管理人及时完成剩余可变现集合计划资产的变现操作后进行二次清算，并将该部分财产另行分配给全体委托人。本集合计划持有多个流通受限的证券及投资产品的，管理人按本款约定进行多次变现及清算。二次清算期间，管理人、托管人不计提管理费、托管费。二次清算流程同一次清算。集合计划因委托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向管理人住所地中国证监会派出机构和中国证券投资基金业协会报告。

**（六）集合计划财产清算报告的告知安排**

集合计划清算程序开始后的 30 个交易日内，清算小组应确定集合计划剩余财产的分配方案，完成集合计划财产清算报告的制作，并告知全体委托人。

**（七）清算未尽事宜**

本合同中关于集合计划清算的未尽事宜以清算报告或管理人公告为准。

**（八）集合计划财产清算账册及文件由管理人保存 20 年以上。**

**（九）集合计划财产相关账户的注销**

集合计划财产清算完毕后，管理人和托管人应负责注销各自开立的集合计划财产相关账户，托管人按照规定注销资产管理计划财产的托管账户等投资所需账户，管理人应给予必要的配合。

## 第 25 部分 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；因双方原因给本计划财产或者委托人造成损害的，应当按照各自的过错程度分别承担赔偿责任。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。任何一方当事人迟延履行合同义务后，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直接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即使发现了错误但



因前述原因无法纠正的，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承担保管责任，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。

## 第 26 部分 争议处理

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并按其仲裁规则在上海用中文进行仲裁解决。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 27 部分 合同的成立与生效

### 一、 合同签署方式

本合同的签署采用电子签名的方式进行的，由委托人签署。管理人与托管人双方同时签署纸质合同，纸质合同原件一式贰份，由管理人与托管人各执壹份，管理人确保投资者以电子签名方式签署的合同内容与管理人和托管人签署的纸质合同内容保持一致。

资产管理合同是约定资产管理合同当事人之间权利义务关系的法律文件。投资者为法人或其他组织的，资产管理合同自投资者、管理人和托管人加盖公章以及各方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为自然人的，资产管理合同自投资者本人签字、管理人和托管人加盖公章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立；投资者为产品的，资产管理合同自该产品管理人、管理人（国君资管）和托管人加盖公章以及双方法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章之日起成立。

### 二、 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、 本集合计划成立。
- 3、 其他合同约定的生效条件。

本合同自生效之日起对委托人、管理人、托管人具有同等的法律效力。

投资者自签订资产管理合同即成为资产管理合同的当事人。在资产管理计划存续期间，投资者自全部退出资产管理计划之日起，该投资者不再是资产管理合同的当事人。

### 三、 合同期限

本合同期限自本合同生效之日起至本集合计划资产全部清算完毕之日止。

### 四、 合同的组成

《国泰君安君享优量科创 1 号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销售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 28 部分 或有事项

无

(以下无正文)

(本页为委托人、管理人与托管人签署《国泰君安君享优量科创1号集合资产管理计划管理合同》的签署页)

管理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；委托人确认本产品为非保本产品，已充分理解本合同的内容，知悉本产品为非保本产品，自行承担风险和损失。

委托人(签字)：

(盖章)：

签订日期：年月日

管理人：上海国泰君安证券资产管理有限公司(公章)

法定代表人/授权代理人



李德雄

签订日期 2019年7月3日

托管人：中国银行股份有限公司上海市分行(公章)

法定代表人/负责人/授权代理人



2019年 7月 09日

签订日期：年月日

附件：

《国泰君安君享优量科创 1 号集合资产管理计划资产管理合同》

(合同编号：)

投资监督事项表

序号	监督项目	监督内容
一	投资范围	<p>资产托管人自本资产管理合同生效之日起，于每一估值日后仅根据下列投资范围和投资限制对资产管理人进行监督</p> <p>本集合计划将主要投资于包括股票、基金、股票期权、股指期货、商品期货、国债期货、经港股通投资于其买卖规定范围内的香港联交所上市股票、科创板股票、货币基金、银行存款等以及中国证监会认可的其他投资品种；</p> <p>投资比例（占集合计划总资产市值）：</p> <p>（1）固定收益类资产（包括货币基金、债券型基金、银行存款）市值：0%~80%；</p> <p>（2）权益类资产（包括股票、权益型基金、经港股通投资于其买卖规定范围内的香港联交所上市股票、科创板股票）市值：0%~80%；</p> <p>（3）投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值占集合计划总资产的比例（包括股票期权、股指期货、商品期货、国债期货）：0%~80%；</p>

二	投资限制	<p>1. 投资于单只股票的市值不超过集合计划净资产的 20%，投资于单只创业板股票的市值不超过集合计划净资产的 10%，投资于单只科创板股票的市值不超过集合计划净资产的 5%。</p> <p>2. 单只股票投资比例不超过公司流通股本的 3%。</p> <p>3. 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。</p> <p>4. 投资于 ETF 的市值不超过集合计划净资产的 60%，单只 ETF 的市值规模不超过集合计划净资产的 20%。</p> <p>5. 股指期货保证金占用不超过集合计划净资产的 20%。</p> <p>6. 不得投资于 st, *st, 以及有退市风险的股票，不得参与新三板交易。</p> <p>7. 投资于期权的市值不得超过集合计划净资产的 20%。</p> <p>8. 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%；</p> <p>9. 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计划资产净值的 20%。（流动性受限资产是指由于法律法规、监管、合同或者操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动性受限的新股及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产。）</p> <p>10. 开放期内，本计划资产组合中 7 个工作日可变现资产的市值，不得低于该计划资产净值的 10%。</p> <p>11. 资产管理计划的总资产市值不得超过该计划净资产的 200%。</p> <p>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。</p>
---	------	---

备注：

1、本投资监督事项表内的事项由托管人负责监督。未免疑义，受限于托管人的监控系统，托管人仅对本投资监督事项表内的事项负责监督，管理人应按照《管理



合同》约定的投资范围、投资比例和投资限制进行投资运作，无论该等投资范围、投资比例和投资限制是否列入本投资监督事项表，对于未列入本投资监督事项表的投资范围、投资比例和投资限制，托管人不负责监督。

2、如果投资品种和监督比例需要调整，必须经过合同约定流程进行确认。