

[首页](#) > [旗下产品](#) > [公告详情](#)


关于国泰君安君享指数增强集合资产管理计划合同变更的公告

时间: 2023-08-17

尊敬的各位委托人:

国泰君安君享指数增强集合资产管理计划(以下简称“本集合计划”或“君享指数增强集合”)成立于2017年04月11日,为了持续服务广大投资者,满足广大投资者的投资需求。根据《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划资产管理合同》(以下简称《管理合同》)和《国泰君安君享指数增强集合资产管理计划说明书》(以下简称《说明书》)的约定,管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司,就君享指数增强集合合同变更事宜已获得托管人的同意,变更生效后将按照相关规定向相关监管机构进行报备。

本次合同变更主要修改如下:

章节	原条款	变更后条款
第1部分 前言	增加: 资产管理计划财产为信托财产,其债务由资产管理计划财产本身承担,投资者以其出资为限对资产管理计划财产的债务承担责任。资产管理合同依照《证券投资基金法》另有约定的,从其约定。	
第2部分 释义	《管理办法》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]) 《运作规定》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) 投资者/合格投资者	《管理办法》指2023年1月12日中国证监会公布并于2023年3月1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203号]) 《运作规定》指2023年1月12日中国证监会公布并于2023年3月1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【2023】2号) 投资者/合格投资者



		增加“信义义务：托管人信义义务是指托管人恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则，根据相关法律法规和监管规定，在本资产管理合同约定范围内尽职尽责履行安全保管托管资产等托管人职责。”
第3部分 合同当事人	二、管理人 法定代表人：龚德维 联系人：胡崇海 托管人 联系人：鲍一沛	二、管理人 法定代表人：陶耿 联系人：曹天翼 三、托管人 联系人：刘昱昊
第4部分 集合计划的基本情况 四、投资范围和投资组合设计	2、投资组合比例 (3) 投资于商品及金融衍生品类资产的持仓合约价值占总资产的比例（包括股票期权、股指期货）：0%~80%； 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。因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，计划管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的十五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，计划管理人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。	2、投资组合比例 (3) 投资于期货和衍生品类资产的持仓合约价值占总资产的比例（包括股票期权、股指期货）：0%~80%； 因证券期货市场波动、证券发行人合并、资产管理计划规模变动等证券期货经营机构之外的因素导致本集合计划投资不符合法律、行政法规和中国证监会规定的投资比例或者合同约定的投资比例的，计划管理人应当在流动性受限资产可出售、可转让或者恢复交易的二十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，计划管理人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。



<p>第4部分 集合计划的基本情况</p> <p>十一、本集合计划的各项费用</p>	<p>3、管理费率</p> <p>本集合计划的年管理费率为1.5%。</p> <p>4、托管费率</p> <p>本集合计划的年托管费率为0.15%。</p> <p>5、业绩报酬</p> <p>当年化收益率R > 中证500指数年化收益率R1 > 0%时, 本集合计划对 (R - R1) 的超额收益部分提取20%的业绩报酬。</p> <p>当年化收益率R > 0% > 中证500指数年化收益率R1时, 本集合计划对超过0的收益部分提取20%的业绩报酬。</p> <p>具体计算方法详见本合同第13部分集合计划的费用、业绩报酬。</p>	<p>3、管理费率</p> <p>本集合计划的年管理费率为0.5%。</p> <p>4、托管费率</p> <p>本集合计划的年托管费率为0.02%。</p> <p>5、业绩报酬</p> <p>本集合计划不提取业绩报酬。</p>
<p>第5部分 集合计划的参与和退出</p> <p>二、集合计划的退出</p>	<p>(一) 退出的办理时间</p> <p>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。</p> <p>本集合计划封闭期满后每周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。</p>	<p>(一) 退出的办理时间</p> <p>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。</p> <p>本集合计划封闭期满后每周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90天。</p>
<p>第6部分 管理人自有资金参与集合计划</p>	<p>1、自有资金参与的条件: 无。</p> <p>2、自有资金的参与方式: 管理人以自有资金参与本集合计划, 将在本集合计划推广机构参与。</p> <p>3、自有资金参与的份额和比例: 参与份额不超过本集合计划总份额20%。具体参与金额以管理人公告为准。管理人及其附属机构以自有资金参与本集合资产管理计划的份额合计不得超过该计划总份额的 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。</p> <p>4、自有资金的收益分配: 管理人以自有资金参与本集合计划持有的份额与其他投资者享有同等收益分配的权利和义务。</p> <p>5、自有资金责任承担方式和金额: 除本合同另有约定外, 管理人以自有资金参与本集合</p>	<p>1、自有资金参与、退出的条件: 管理人以自有资金参与、退出本集合计划, 应符合《管理办法》、《运作规定》及中国证监会等监管机构的相关规定。</p> <p>2、自有资金的参与、退出方式: 管理人以自有资金参与、退出本集合计划, 将在本集合计划销售机构进行。</p> <p>3、自有资金参与的份额和比例: 参与份额不超过本集合计划总份额16%, 且不得低于资产管理计划最低参与金额, 具体参与情况以管理人公告为准。证券期货经营机构及其子公司 (如有) 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%。中国证监会对证券期货经营机构自有资金投资比例另有规定的, 从其规定。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</p>



	<p>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。募集推广期投入且承担责任的自有资金（如有）在约定责任解除前不得退出。为应对集合计划巨额赎回（如有），解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以自有资金参与或退出集合计划可不受前款规定限制，但需事后及时告知客户和资产托管机构，并按照相关规定向监管机构报备。</p> <p>7、风险提示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本集合计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>8、信息披露：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。</p>	<p>有同等收益分配的权利和义务。</p> <p>5、自有资金责任承担方式和金额：除本合同另有约定外，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。</p> <p>6、自有资金参与、退出的方式及持有期限：管理人有权在募集期内参与本集合计划，具体参与情况以管理人公告为准；除法律法规另有规定以及本合同另有约定外，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，告知全体投资者，通过邮件或其他书面方式告知托管人，并取得其同意；投资者不同意，管理人保障其退出的权利；管理人自有资金参与集合资产管理计划的，持有期限不得少于6个月。</p> <p>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，但需事后及时告知投资者和资产托管机构，并按照相关规定向监管机构报备。</p> <p>7、风险提示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本集合计划规模变动情况，控制流动性风险。</p> <p>8、信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前5个工作日通过管理人网站公告参与、退出时间和参与、退出金额、持有期限等信息（监管允许可不予提前告知或者合同另有约定等情形除外）。</p>
第8部分 利益冲突及关联交易	<p>增加：</p> <p>（一）关联交易及利益冲突情形</p> <p>1、本集合计划投资管理人、托管人、投资顾问及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券；</p> <p>2、本集合计划投资管理人、托管人及关联方发行的其他金融产品；</p>	



管理费、托管费，以及资产管理计划与关联方进行银行间或交易所市场的交易等)

5、法律法规、中国证监会等监管机构规定的其他情形。

(二) 一般关联交易与重大关联交易区分标准

关联交易是指资产管理计划与管理人、托管人、投资顾问及其控股股东、实际控制人或者其他关联方之间发生的转让或受让资产、提供或接受服务等行为。

管理人根据会计准则、监管法规以及内部制度机制将资产管理计划关联交易区分为一般关联交易和重大关联交易。其中，重大关联交易是指本集合计划投资于管理人、托管人、投资顾问及其控股股东、实际控制人或者其他关联方发行的证券或者承销期内承销的证券，且单笔金额超过1亿元（不含），视为该资产管理计划的重大关联交易。中国法律、中国证监会或自律组织等对上述重大关联方交易另有规定的，以其规定为准。

一般关联交易是指除上述重大关联交易以外的关联交易。

(三) 关联交易及利益冲突的应对及处理

投资者签署本合同即同意并授权管理人，本集合计划可以从事一般关联交易，管理人承诺运用受托管理资产从事关联交易不会损害投资者利益；投资者签署本合同即视为对本集合计划运作期间所有可能发生的一般关联交易的同意答复，管理人以本合同为依据进行关联交易。关联交易完成后，管理人按照法律法规及中国证监会的有关规定，应当通过定期资产管理报告向投资者及托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告；

涉及重大关联交易的，管理人应事先逐笔征求意见或者公告确认等方式征得投资者的同意，投资者不同意的，管理人应保障其退出的权利。关联交易完成后，管理人应当通过公告或者合同约定的其他方式向投资者及托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告；并按照法律法规及中国证监会的有关规定，通过定期资产管理报告向投资者及托管人披露，并向中国证监会相关派出机构报告。

(四) 本计划关联方范围

本资产管理计划关联方主要包括管理人、托管人及前述机构的控股股东、实际控制人或者其他关联方。管理人和托管人关联方名单详见附件2。管理人关联方名单如有更新，管理人应及时在指定网站上公告，托管人关联方名单以公开披露的最新报告中的关联方为准。

(五) 关联交易审批程序

管理人严格按照内部制度执行关联交易审批。资产管理计划进行关联交易投资的，由投资经理发起关联交易审批流程，由风险管理部门或公司其他有权部门对交易进行审批后方可进行；若涉及重大关联交易，还应根据公司制度相关规定进行审议和决策。资产管理计划发生的日常费用支付等关联交易（如管理费、托管费、交易佣金、交易费用等）按照公司日常费用审批流程进行审批。

管理人从事关联交易，应遵循本计划投资者利益优先原则，严格履行内部审批机制、按照市场公平合理价格执行，并防范利益输送等违法违规行为。证券期货经营机构私募资产管理业务相关法律法规、中国证券投资基金业协会自律规范对关联交易另有规定的，从其规定，届时以管理人公告为准。

	基金份额净值无公布的, 按此最近交易日的基金份额净值估值; 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计提红利。	的, 按此最近交易日的基金份额净值估值; 持有的货币市场基金按基金管理公司公布的估值日的每万份收益计提红利。
第14部分 集合计划的费用、业绩报酬一、集合计划费用计提方法、计提标准和支付方式	<p>1、托管人的托管费</p> <p>本集合计划应给付托管人托管费, 按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年托管费率为0.15%。计算方法如下:</p> $H = E \times 0.15\% \div 365$ <p>2、管理人的管理费</p> <p>本集合计划应给付管理人管理费, 按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为1.5%。计算方法如下:</p> $H = E \times 1.5\% \div 365$	<p>1、托管人的托管费</p> <p>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0.02%。计算方法如下:</p> $H = E \times 0.02\% \div 365$ <p>2、管理人的管理费</p> <p>本集合计划应给付管理人管理费, 按前一日的资产净值的年费率计提。本集合计划的年管理费率为0.5%。计算方法如下:</p> $H = E \times 0.5\% \div 365$
第14部分 集合计划的费用、业绩报酬三、管理人提取业绩报酬	<p>三、管理人提取业绩报酬</p> <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终止清算或结算时提取业绩报酬, 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、委托人退出确认日或集合计划清算日。</p> <p>2、业绩报酬计提办法</p> <p>(1) 退出提取</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; 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;</p>	三、管理人不提取业绩报酬

A1为业绩报酬计提日的中证500指数收盘价;

C1为上一个业绩报酬计提日的中证500指数收盘价;

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

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

业绩报酬计提标准为:

1) 当年化收益率 $R >$ 中证500指数年化收益率 $R1 > 0\%$ 时,本集合计划对 $(R - R1)$ 的超额收益部分提取20%的业绩报酬,即 $E=K \times (R - R1) \times 20\% \times (T \div 365)$ 。

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

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

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

业绩报酬 $= (1,000,000 \times 1.03) \times (10.12\% - 9.14\%) \times 20\% \times (280 \div 365) = 1,548.67$ 元。

2) 当年化收益率 $R > 0\% >$ 中证500指数年化收益率 $R1$ 时,本集合计划对超过0的收益部分提取20%的业绩报酬,即 $E=K \times (R - 0\%) \times 20\% \times (T \div 365)$ 。



国泰君安证券资产管理
GUOTAI JUNAN SECURITIES ASSET MANAGEMENT

向善 · 向上 · 向上

公司首页 旗下产品 关于我们 信息披露 客户服务 个人中心 人员公示

资产累计净值为1.05元, 上一个业绩报酬计提日的单位净值为1.03元、中证500指数收盘价为6,123.49, 退出申请日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为280天, 则

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

$$R1 = (5,947.32 - 6,123.49) \div 6,123.49 \times (365 \div 280) \times 100\% = -3.75\%$$

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

例3: 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。

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

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。

1) 当年化收益率R > 中证500指数年化收益率R1 > 0%时, 本集合计划对 (R - R1) 的超额收益部分提取20%的业绩报酬, 即 $E = K \times (R - R1) \times 20\% \times (T \div 365)$ 。

例1: 某委托人分红日持有份额1,000,000份, 分红日单位资产累计净值为1.20元、中证500指数收盘价为6,552.62, 上一个业绩报酬计提日单位资产累计净值为1.05元, 上一个业绩报酬计提日的单位净值为1.03元、中证500指数收盘价为6,123.49, 退出申请日至上一个业绩报酬计提日的间隔天数为280天, 则

$$R = (1.20 - 1.05) \div 1.03 \times (365 \div 280) \times 100\% = 18.98\%$$

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

$$\text{业绩报酬} = (1,000,000 \times 1.03) \times (18.98\% - 9.14\%) \times 20\% \times (280 \div 365) = 15,549.90 \text{元。}$$

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0.01元, 则

$$\text{业绩报酬} = \min(15,549.90, 1,000,000 \times 0.01) = 10,000 \text{元}$$

2) 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, 即 $E = K \times (R - 0\%) \times 20\% \times (T \div 365)$ 。

例2: 某委托人分红日持有份额1,000,000份, 分红日单位资产累计净值为1.13元、中证500指数收盘价为5,947.32, 上一个业绩报酬计提日单位资产累计净值为1.05元, 上一个业绩报酬计提日的单位净值为1.03元、中

	<p>10.12%</p> $R1 = (5,947.32 - 6,123.49) \div 6,123.49 \times (365 \div 280) \times 100\% = -3.75\%$ <p>业绩报酬 = (1,000,000 × 1.03) × (10.12%) × 20% × (280 ÷ 365) = 15,992.37元。</p> <p>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0.01元, 则业绩报酬 = min(15,992.37, 1,000,000 × 0.01) = 10,000元</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>管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成, 相关信息在注册登记机构记录。</p> <p>3、业绩报酬支付</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, 管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成, 相关信息在注册登记机构记录, 托管人不承担复核责任。</p>	
<p>第17部分 投资决策与风险控制</p> <p>二、投资程序</p>	<p>1、投资决策程序</p> <p>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。管理人私募投资决策委员会负责确定以下事项:</p> <p>(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;</p>	<p>1、投资决策程序</p> <p>管理人资产管理业务投资决策体系由管理人投资决策委员会、投资部门、投资经理三级体系组成。管理人投资决策委员会负责确定以下事项:</p> <p>(1) 授权各投资部门履行相应的投资管理和决策职能;</p> <p>(2) 讨论和研判最新宏观经济和证券市场运行的变化趋势等;</p>



公司首页 旗下产品 关于我们 信息披露 客户服务 个人中心 人员公示

	<p>(4) 拟订公司级私募投资管理制及流程、公司级研究管理制度及流程;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(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;</p> <p>(10) 公司行政办公会授予的其他职责。</p>	<p>路;</p> <p>(5) 听取和审阅风险管理部门对投资业绩的归因分析与绩效评估, 以及关于投资管理过程中存在的各类风险事项的汇报, 并针对投资运作管理过程中的重大风险事项出具指导意见;</p> <p>(6) 负责公司重大投资风险事件的应急处理, 如重大流动性风险处置、重大信用风险处置等;</p> <p>(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, 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;</p> <p>(8) 审议新基金成立、产品变更投资经理时, 投资人员的建仓或调仓方案及影响基金投资的其它重大事项;</p> <p>(9) 审议决定投资经理的任免及授权事项, 决定投资经理不能正常履职时的代履职安排, 对投资经理进行绩效考核, 对投资经理的投资活动进行监督和管理;</p> <p>(10) 审议决定公司基金产品/资产管理产品的投资逻辑和投资实现路径;</p> <p>(11) 公司总经理办公会指派的其他职能授予的其他职责。</p>
<p>第18部分 越权交易的界定 (新增)</p>	<p>增加:</p> <p>一、越权交易的界定</p> <p>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计划份额持有人的授权而进行的投资交易行为。</p> <p>管理人应在有关法律法规和本合同规定的权限内运用计划财产进行投资管理, 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。</p> <p>二、越权交易的处理程序</p> <p>(一) 违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为</p> <p>托管人根据本部分第三条约约定, 发现管理人的投资指令违反法律法规的规定, 或者违反本合同约定的, 应当拒绝执行, 立即通知管理人并有权报告监管机构。</p>	

	<p>的越权事项未能在限期内纠正的, 托管人应报告监管机构。</p> <p>(二) 越权交易所发生的损失及相关交易费用由管理人负担, 所发生的收益归本计划财产所有。</p> <p>三、托管人对管理人投资运作的监督</p> <p>(一) 托管人对下列资产管理计划的投资事项及管理人投资行为进行监督:</p> <p>1. 对本合同约定的投资范围进行监督;</p> <p>2. 对本计划以下投资限制进行监督:</p> <p>(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%;</p> <p>(2)、集合资产管理计划申购新股, 申报的金额不得超过该计划的总资产, 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>(3)、集合计划的总资产占集合计划的净资产不得超过140%。</p> <p>(4)、投资于期货和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%。</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> <p>(三) 托管人对计划财产的投资监督和检查自本合同生效之日起开始执行。托管人在本合同约定范围内, 对本计划的直接投资履行监督职能。</p> <p>(四) 管理人应当及时、准确、完整地向托管人提供履行投资监督所需的数据和信息。托管人投资监督的真实性、准确性和完整性受限于管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的数据和信息。基于交易程序限制, 托管人根据管理人、证券经纪商及其他中介机构提供的交易数据对管理人的场内交易结果进行事后监督。</p> <p>(五) 如需托管人对资产管理计划关联交易进行监督的, 管理人应于合同生效前提供关联方名单, 并在合同期限内根据变化及时更新关联方名单。若管理人没有及时提供关联方信息, 导致托管人无法及时对关联方证券进行监督, 由过错方承担相应的责任。</p> <p>(六) 如因投资需要或法律法规修改导致托管人监督事项发生变化的, 各方除履行必要的合同变更流程外, 还应为托管人调整监督事项留出必要的时间。</p>	
<p>第19部分 投资限制与禁止行为</p> <p>一、投资限制</p>	<p>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%。</p> <p>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。</p>	<p>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%。银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券等中国证监会认可的投资品种除外。</p> <p>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</p>



		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%。
第20部分 集合计划的信息披露	1、集合计划单位净值报告。 管理人在每周第二个工作日（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，并于开放日公告前第二个交易日的份额净值、累计净值，供投资人参考。	1、集合计划单位净值报告。 管理人在每周第二个工作日（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，并于开放日公告前第二个交易日的份额净值、累计净值及于开放日后的第二个交易日公布开放日的单位份额净值及累计单位净值，供投资人参考。
第23部分 集合计划的终止与清算 一、有下列情形之一的，集合计划应当终止：	4. 存续期内，连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；	4.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；
第24部分 当事人的权利与义务 二、管理人的权利和义务	(二) 管理人的义务 20、法律、行政法规、中国证监会有关规定及本合同约定的其他义务。	(二) 管理人的义务 20、按照我国有关反洗钱法律、行政法规，履行客户身份识别反洗钱义务，识别、核实资产委托人的身份及资产管理计划的受益所有人，并按监管规定保存相关身份信息、资料；在客户身份识别的基础上对客户进行洗钱风险等级划分，对高风险的客户采取适当的风控措施；在法律允许范围内，配合资产托管人开展客户身份识别特别是受益所有人的识别工作，并提供必要客户信息、资料等；履行可疑交易报告义务，并对可疑客户采取必要的管控措施。根据反洗钱政策及法规，要求资产委托人积极配合完成（包括本合同签订前和履行过程中的）反洗钱调查等必要程序。 根据《中国人民银行关于加强反洗钱客户身份识别有关工作的通知（银发【2017】235号）》（以下称“235号文”）、《中国人民银行关于进一步做好受益所有人身份识别工作有关问题的通知（银发【2018】164

	<p>品的受益所有人；不存在上述条件自然人的，将基金经理或者直接操作管理基金的自然人判定为托管产品受益所有人；不存在上述条件自然人的，将主要负责人、主要管理人或者主要发起人等作为托管产品的受益所有人。</p> <p>21、采取了适当的措施，确保资产管理计划的委托人、受益所有人等不得为我国公安部等有权部门发布的恐怖活动组织及恐怖活动人员名单，不得为联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的反洗钱和反恐怖融资名单，或中国人民银行及其他监管机构要求执行的反洗钱和反恐怖融资名单。</p> <p>22、资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他国家（地区）发布且得到我国承认的有关经济制裁或反洗钱法律法规，或用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。</p> <p>23、除必要的信息披露及监管要求外，管理人不得以托管人的名义进行营销宣传。</p> <p>24、保证向投资者支付的受托资金及收益返回其参与资产管理计划时使用的结算账户或其同名账户。</p> <p>25、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。</p>
第26部分 风险提示	<p>删除：</p> <p>18、其他风险</p> <p>(12) 当发生分红时，管理人将根据年化收益率（R）提取业绩报酬，业绩提取方式与退出提取相同，分红时集合计划参与份额的参与日重定为该分红日（即参与份额以该分红日作为新的参与日，以分红后的份额净值作为新的参与净值，以此作为下次年化收益率的计算基准）。当分红额不足提取业绩报酬时，以分红额为限。如管理人已经提取业绩报酬，即使委托人退出本集合计划时净值有所下跌，则该部分已提取业绩报酬亦不退还委托人。</p> <p>增加：</p> <p>19、特别风险提示：</p> <p>(6) 关联交易风险</p> <p>①一般关联交易的风险提示</p>

	<p>时关注管理人的信息披露内容的风险。</p> <p>②重大关联交易的风险提示</p> <p>如本计划运用计划财产从事重大关联交易的，管理人将事先通知投资者并取得其同意，事后及时告知投资者以及托管人。若投资者未通过本计划销售机构（如适用）及时更新有效联系方式，可能影响管理人征求其意见的效率，进而可能影响本计划的投资策略实施。</p> <p>此外，对于上述一般关联交易和重大关联交易，虽然管理人积极遵循投资者利益优先的原则、遵守相关法律法规的规定进行操作、积极防范利益冲突，但仍存在利益输送、内幕交易的风险，进而可能影响投资者的利益。该类证券价格可能会出现下跌，从而使本计划收益下降，甚至带来本金损失。此外，管理人运用计划财产从事关联交易时可能依照相关法律法规、监管机构、自律组织的规定被限制相关权利的行使，进而可能影响计划财产的投资收益。管理人可向托管人申请托管人关联方名单，如果因托管人未及时向管理人提供关联方名单导致管理人无法审查相关投资是否构成关联交易的，管理人不承担相关责任。</p>
附件一	<p>增加 托管专户</p> <p>户名：上海国泰君安证券资产管理有限公司君享指数增强 账号：216200100101497856 开户银行：兴业银行上海分行营业部 大额支付号：309290000107</p>

此外，根据监管规定和管理人、托管人实际情况对相关法律法规、制度依据、联系信息等一并进行调整，详见变更后的《管理合同》。《说明书》、《风险揭示书》根据最新的管理合同，同步进行调整。

管理人将更新和调整后的《管理合同》、《说明书》、《风险揭示书》及相关文件通过管理人网站进行披露，敬请各位委托人认真阅读。

经履行本集合计划合同变更相应的程序之后，我公司对合同变更的后续事项做如下安排：

- 1、同意本次合同变更的委托人请于本公告公布之日起5个工作日内填写《关于同意国泰君安君享指数增强集合资产管理计划合同变更事项的回函》、签名并邮寄至上海国泰君安证券资产管理有限公司（上海市静安区新闻路669号博华广场22楼，邮编200041，收件人“君享指数增强集合合同变更”）或扫描邮件至zgsckfb@gtjas.com。
- 2、不同意本次合同变更的委托人请于本公告公布之日起5个工作日内填写《关于不同意国泰君安君享指数增强集合资产管理计划合同变更的回函》、签名并邮寄至上海国泰君安证券资产管理有限公司（上海市静安区新闻路669号博华广场22楼，邮编200041，收件人“君享指数增强集合合同变更”）或扫描邮件至zgsckfb@gtjas.com，并于本公告公布之日起5个工作日内办理退出。
- 3、委托人回复意见不同意变更且未按照上述2办理退出的，则管理人有权在公告公布之日起满5个工作日后、本次合同变更生效之日前将相关份额强制退出计划，由此发生的相关税费或或有损失由委托人自行承担；
- 4、委托人未回复意见且未办理退出的，视为同意合同变更，管理人不再另行通知。
- 5、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2-3处理。
- 6、管理人在上述期间内若确认本次合同变更满足《资产管理合同》相关条件后，将有权按监管机构要求在公司网站发布合同变更生效公告，确定合同变更生效日，并按照规定履行相关合同变更报备手续，同时本公告于合同变更生效日起成为合同不可分割的一部分；若确认本次合同变更不能满足《资产管理合同》相关条件的，则本次合同变更失效。

7、上述期间如遇开放期则暂停办理参与业务。

特此公告。



- [国泰君安君享指数增强集合资产管理计划说明书 \(清洁版\) .doc](#)
- [国泰君安君享指数增强集合资产管理计划风险揭示书 \(清洁版\) .doc](#)
- [国泰君安君享指数增强集合资产管理计划管理合同 \(清洁版\) .docx](#)
- [关于同意国泰君安君享指数增强集合资产管理计划合同变更的回函.docx](#)

版权所有© 1999-2023上海国泰君安证券资产管理有限公司 网站备案号: 沪B2-20040408-6 沪公网安备: 31010602006306 本网站现已支持 IPv6
Copyright© 1999-2023.Guotai Junan Securities Asset Management Co., Ltd All Rights Reserved
总部地址: 上海市静安区新闻路669号博华广场22-23层及25层 联系电话: 021-38679666
廉洁举报电话: 021-38676999 廉洁举报邮箱: gjzghgl@gtjas.com

客服热线:
95521

