

关于国泰君安优量量化对冲 1 号集合资产管理计划合同变更的公告



尊敬的各位投资者：

根据《国泰君安优量量化对冲 1 号集合资产管理计划管理合同》（以下简称《管理合同》）、《国泰君安优量量化对冲 1 号集合资产管理计划说明书》（以下简称《计划说明书》）和《国泰君安优量量化对冲 1 号集合资产管理计划风险揭示书》（以下简称《风险揭示书》）的约定，管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司，就国泰君安优量量化对冲 1 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）合同变更事宜已获得了托管人的同意，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：

	原条款	更改后条款
全文	委托资产	受托资产
	资产委托人/委托人	投资者
	委托财产	受托财产
	《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引（试行）》	《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》
重要提示	新增： 投资者在此同意并授权：管理人可以使用投资者提供的有关个人信息完成投资者适当性管理、反洗钱、反恐怖融资、非居民金融账户涉税信息尽职调查、证券投资穿透核查等法律法规要求，并在此过程中有可能根据相关要求将投资者个人信息提供给相关监管机构、自律机构以及投资标的受托人等；本计划在开立银行账户、证券期货账户等账户时或者在投资管理运作过程中，管理人可能会按照保管机构、证券经纪商（如有）、期货经纪商（如有）、证券承销商、投资标的管理人（如有）等合作机构的要求，基于业务所必需，根据有关规定或约定提供投资者个人信息。	

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）	《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） 指
第 2 部分 释义	投资者/合格投资者 （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； （五）基本养老金、社会保障基金、企业年金等养老基金，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）；	投资者/合格投资者 （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、商业银行理财子公司、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； （五）基本养老金、社会保障基金、年金基金等养老基金，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）；
第 2 部分 释义	新增： A 股主板：指上海证券交易所主板和深圳证券交易所主板 北交所：指北京证券交易所	
第 4 部分 合同当事人	（二）管理人 法定代表人：谢乐斌 联系人：胡冰涛	（二）管理人 法定代表人：陶耿 联系人：刘婕
第 4 部分 合同当事人 四、管理人的权利和义务	（二）管理人的义务 （26）本协议存续期内，管理人应依法律法规履行相应反洗钱义务，并主动配合托管人根据监管部门有关反洗钱要求开展客户身份识别工作，遵守反洗钱与反恐怖融资相关管理规定。	（二）管理人的义务 （26）管理人应根据法律法规及监管规定履行反洗钱义务，并根据人民银行有关规定向托管人发送本计划“受益所有人”信息，配合托管人履行反洗钱义务。
第 4 部分 合同当事人 五、托管人的权	（二）托管人的义务 （1）安全保管资产管理计划财产，依法保护委托人的财产权益；	（二）托管人的义务 （1）安全保管资产管理计划财产； （2）按规定开立和注销资产管理计划

利和义务	(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的财务数据, 并出具书面意见; (9) 编制托管年度报告, 发送给管理人, 由管理人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(如需); (10) 按照法律法规要求和本合同、托管协议约定, 根据管理人的划款指令, 及时办理清算、交割事宜; (11) 按照法律法规要求和资产管理合同约定, 根据管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜; (12) 托管人对实际交付并控制下的托管财产承担保管责任。 (13) 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; (14) 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	的托管账户及其他投资所需账户; (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) 按照资产管理合同约定, 根据管理人的投资指令, 及时办理清算、交割事宜; (5) 复核资产管理计划资产净值和份额净值; (6) 向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方, 以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息; (7) 投资于《管理办法》第三十八条第(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; (8) 根据本合同约定的监督内容和监督方式, 监督管理人的投资运作, 发现管理人的投资或者清算指令违反法律、行政法规、中国证监会的规定或者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; (9) 办理与资产管理计划托管业务有关的信息披露事项; (10) 对资产管理计划财务会计报告、年度报告出具意见; (11) 编制托管年度报告, 报送中国证监会相关派出机构; (12) 管理人未按规定召集或者不能召集份额持有人大会的, 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; (13) 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以及其他当事人利益的活动; (14) 不得为托管人以及任何第三人输送利益, 不得委托第三人托管资产管理计划财产; (15) 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;
------	--	--

	止之日起不得少于 20 年； (15) 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附件《交易监控合规表》约定的，应当要求其改正；未能改正的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权报告相关监管机构（如需）； (16) 托管银行承担的托管职责仅限于法律法规规定和托管合同约定，对实际管控的托管资金账户及证券账户内资产承担保管职责。托管银行的托管职责不包含以下内容，法律法规另有规定或托管合同另有约定的除外。 1) 投资者的适当性管理； 2) 对托管产品本金及收益提供保证或承诺； 3) 对未兑付托管产品后续资金的追偿； 4) 提供保证或其他形式的担保； 5) 自身应尽职责之外的连带责任。 (17) 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。	(16) 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、投资信息等，依法依规提供信息的除外； (17) 法律、行政法规、中国证监会及协会规定和资产管理合同约定的其他义务。
第 5 部分 集合计划的基本情况	四、封闭期、开放期 2、开放期：本集合计划成立后每周五为开放日（如遇非工作日不顺延），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 天。合同另有约定的除外。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特别开放期。	四、封闭期、开放期 2、开放期：本集合计划成立后每周五为开放日（如遇非工作日不顺延），开放日可以办理参与和退出业务。投资者合同另有约定的除外。除因根据合同变更或者展期等需要设立临时开放期供投资者退出外，本集合计划原则上不设立特别开放期。
第 5 部分 集合计划的基本情况	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（不含参与费）不低于 50 万元，总参与客户数不超过 200 户。	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（不含参与费）不低于 40 万元，总参与客户数不超过 200 户。
第 5 部分 集合	投资范围	投资范围

计划的基本情况 第 11 部分 集合计划的投资 附件一 投资监督事项表	本集合计划将主要投资于包括股票、公募基金、股票期权、股指期货、商品期货、国债期货、新股申购（含科创板、创业板）、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、创业板股票、现金类资产等以及中国证监会认可的其他投资品种。 其中，公募基金投资范围包括开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF（不含场内 ETF 申赎）、货币基金等；股指期货投资范围是在中国金融期货交易所挂牌交易的股指期货合约；现金类资产包括现金、银行活期存款、同业存单、国债逆回购。 管理人在进行港股通标的范围内的股票投资、股票期权交易前，必须与托管人就交收结算、核算估值等业务规则和流程进行沟通确定，在系统测试通过后才可投资，否则，由此产生的风险由管理人承担。 投资比例（占集合计划资产总值） （1）固定收益类资产（包括现金类资产、混合偏债型公募基金、债券型公募基金、货币基金）：0%~80%； （2）权益类资产（包括股票、混合偏股型公募基金、股票型公募基金、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、创业板股票、新股申购（含科创板、创业板））：0%~80%； （3）商品及金融衍生品类账户权益（股票期权、股指期货、商品期货、国债期货）：0~20%；	本集合计划将主要投资于包括股票（包括 A 股主板、科创板、创业板、北交所）、存托凭证、公募基金、股票期权、股指期货、商品期货、国债期货、新股申购（含 A 股主板、科创板、创业板、北交所）、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、创业板股票、现金类资产等以及中国证监会认可的其他投资品种。 其中，公募基金投资范围包括开放式基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF（不含场内 ETF 申赎）、货币基金等；股指期货投资范围是在中国金融期货交易所挂牌交易的股指期货合约；现金类资产包括现金、银行活期存款、同业存单、国债逆回购。 管理人在进行港股通标的范围内的股票投资、股票期权交易前，必须与托管人就交收结算、核算估值等业务规则和流程进行沟通确定，在系统测试通过后才可投资，否则，由此产生的风险由管理人承担。 投资比例（占集合计划资产总值） （1）固定收益类资产（包括现金类资产、混合偏债型公募基金、债券型公募基金、货币基金）：0%~80%； （2）权益类资产（包括股票、存托凭证、混合偏股型公募基金、股票型公募基金、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、创业板股票、新股申购（含 A 股主板、科创板、创业板、北交所））：0%~80%； （3）商品及金融衍生品类账户权益（股票期权、股指期货、商品期货、国债期货）：0~20%；
第 5 部分 集合计划的基本情况	新增： 十一、资产管理计划的费用 1、参与费率：0%。 2、退出费率：0%。	

	3、管理费率： 本集合计划的年固定管理费率为 0.5%。 4、托管费率 本集合计划的年托管费率为 0.01%。 5、业绩报酬 管理人对年化收益率（R）超过业绩报酬计提基准 6.5%的部分提取 15%作为管理人业绩报酬。具体详见本合同第 21 部分集合计划的费用、业绩报酬。 6、其他费用 其他费用及具体计算方法详见本合同第 21 部分集合计划的费用、业绩报酬。	
第 6 部分 资产管理计划的募集	四、 认购的原则 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划付至销售机构指定账户或由销售机构代扣。。	四、 认购的原则 3、本集合计划的单个投资者首次认购最低金额（不含认购费）为 40 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。
第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让	（二）参与的原则 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 10 万元。	（二）参与的原则 2. “金额参与”原则，即参与以金额申请。本集合计划的单个投资者首次参与最低金额为 40 万元人民币（不含参与费），追加参与的最低金额为人民币 10 万元。
第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让	（六）参与费及参与份额的计算 参与份额=（参与金额-参与费用）/开放日集合计划单位份额净值	（六）参与费及参与份额的计算 参与份额=（参与金额-参与费用）/参与申请日集合计划单位份额净值
第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让	（一） 退出的办理时间 本集合计划成立后每周五为开放日（如遇非工作日不顺延），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。合同另有约定的除外。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。	（一） 退出的办理时间 本集合计划成立后每周五为开放日（如遇非工作日不顺延），开放日可以办理退出业务。投资者合同另有约定的除外。因根据合同变更或者展期等需要而设立临时开放期供投资者退出的程序及披露比照本部分“二、集合计划的退出”执行。
第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让	（二）退出的原则 5. 委托人部分退出本集合计划的，其退出后持有份额的资	（二）退出的原则 5. 退出一般不受限制。投资者部分退出本集合计划的，其退出后持有

让	产净值应当不低于首次参与最低参与金额。委托人持有本集合计划份额的资产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。委托人未申请一次性全部退出的，管理人有权将委托人持有的全部份额一并强制退出。	份额的资产净值应当不低于首次参与最低参与金额。投资者持有本集合计划份额的资产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（包括仍未满足持有期要求的份额）。投资者未申请一次性全部退出的，管理人有权将投资者持有的全部份额一并强制退出。 6. 资产管理计划向投资者支付的受托资金及收益应当返回其参与本集合计划时使用的结算账户或者同名账户。
第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让	(六)巨额退出及连续巨额退出的认定和处置方式 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置方式。	(六)巨额退出及连续巨额退出的认定和处置方式 4、告知客户的方式 当发生巨额退出或连续巨额退出，且管理人决定延期退出或暂停退出时，资产管理人应当及时通知投资者，并说明有关处理方法；同时资产管理人应当按照法律法规、监管机构、自律组织的规定及时履行报告义务。
第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让	五、管理人自有资金参与 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，并按照规定向监管机构报备。	五、管理人自有资金参与 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，告知全体投资者，以邮件或其他书面形式告知托管人，并取得托管人同意。为应对集合计划巨额赎回（如有），解决流动性风险，在不存在利益冲突并遵守合同约定的前提下，管理人以自有资金参与或退出集合计划可不受前款规定限制，但需事后及时告知客户和资产托管机构，并按照规定向监管机构报备。
第 11 部分 集合计划的投资	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 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、集合资产管理计划规模变动等管理人之外	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 20 个交易日内将投资比例降至许可范围内；如因证券市场波动、证券发行人合并、集合资产管理计划规模变动等管理人之外的因素，造成集合计划投资比例超标，管理人应在流动性受限

	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个交易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（如需）。	资产可出售、可转让或者恢复交易的20个交易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（如需）。
第 11 部分 集合计划的投资	六、投资策略 （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	六、投资策略 （二）投资决策程序 管理人资产管理业务投资决策体系由管理人投资决策委员会、投资部门、投资经理三级体系组成。 1、管理人投资决策委员会负责确定以下事项： （1）授权各投资部门履行相应的投资管理和决策职能； （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； （3）听取各投资部门的投资管理工作的汇报，并对其做出指导和建议； （4）定期听取投资经理产品投资管理汇报，包括影响产品净值的重大投资事项投资思路； （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； （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； （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； （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

	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。	项； （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； （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； （11）公司总经理办公会指派的其他职能授予的其他职责。
第 14 部分 利益冲突及关联交易	委托人在此同意并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或从事重大关联交易时，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、全面、客观的告知托管人，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（如需），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（如需）。计划管理人承诺运用受托管理资产从事重大关联交易的不会损害投资者利益。	一、关联交易及利益冲突情形 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； 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； 3、与关联方开展现券交易、债券借贷、回购交易及接受或提供服务等其他关联交易，含逆回购交易对手方、质押券； 4、资产管理计划正常业务中发生的关联交易（包括但不限于资产管理计划通过关联方席位或交易单元进行的交易及支付相关佣金，从资产管理计划财产中支付给管理人、托管人的管理费、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）或占资产管理计划净资产的比例为20%以上（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本合同附件。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。
第 15 部分 投资经理的指定与变更	投资经理： 石人杰，爱丁堡大学金融数学硕士，5 年证券从业资格，具备基金从业资格。曾任国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部交易员、研究员，现任国泰君安证券资产管理有限公司权益与衍生品部投资经理。在量化模型等方面有深入研究，擅长 CTA 策略、高频 Alpha 策略及行业轮动策略等等。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。无外部兼职。 樊佳浩，复旦大学概率论与数理统计系硕士，7 年证券从业经验，曾任国泰君安证券研究所研究员、光大证券资产管理有限公司绝对收益投资部投资经理助理、方正证券股份有限公司交易与衍生品业务部投资经理，万家	投资经理： 石人杰，爱丁堡大学金融数学硕士，9 年证券从业资格，具备基金从业资格。曾任国泰君安证券资产管理有限公司量化投资部交易员、研究员，现任国泰君安证券资产管理有限公司权益与衍生品部投资经理。在量化模型等方面有深入研究，擅长 CTA 策略、高频 Alpha 策略及行业轮动策略等等。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。无外部兼职。 梅致远，美国福特汉姆大学量化金融学硕士，2021 年 6 月加入上海国泰君安证券资产管理有限公司，历任权益与衍生品部量化研究员助理，量化投资部研究员助理、投资经理助理，现任量化投资部投资经理。主要从事量化对冲、量化 CTA 等量化绝对收益策略相关投研工作，专注于时间序列上的择时策略开发。已取得基金从业

	基金管理有限公司量化投资部基金经理助理等职，现任上海国泰君安证券资产管理有限公司权益与衍生品部投资经理，主要从事Alpha策略的相关投研工作。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。无外部兼职。	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。无外部兼职。
第 16 部分 资产管理计划的财产	新增： 集合计划财产为信托财产	
第 16 部分 资产管理计划的财产	（六）投资定期存款的银行账户的开立和管理 计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴经各方<u>协议后预留</u>。本着便于计划财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下明确条款：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，托管人保管证实书正本<u>或者复印件</u>。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。	（六）投资定期存款的银行账户的开立和管理 计划财产投资定期存款在存款机构开立的银行账户，包括实体或虚拟账户，其预留印鉴<u>应包含托管人指定印章</u>。本着便于计划财产的安全保管和日常监督核查的原则，存款行应尽量选择托管人经办行所在地的分支机构。对于任何的定期存款投资，管理人都必须和存款机构签订定期存款协议，约定双方的权利和义务，该协议作为划款指令附件。该协议中必须有如下条款<u>或意思表示</u>：“存款证实书不得被质押或以任何方式被抵押，并不得用于转让和背书；本息到期归还或提前支取的所有款项必须划至托管资金账户（明确户名、开户行、账号等），不得划入其他任何账户。”如定期存款协议中未体现前述条款，托管人有权拒绝定期存款投资的划款指令。在取得存款证实书后，原则上由托管人保管证实书正本。管理人应该在合理的时间内进行定期存款的投资和支取事宜，若管理人提前支取或部分提前支取定期存款，若产生息差（即本计划财产已计提的资金利息和提前支取时收到的资金利息差额），该息差的处理方法由管理人和托管人双方协商解决。
第 16 部分 资	新增：（三、 集合计划财产的保管与处分）	

产管理计划的财产 三、集合计划财产的保管与处分	6. 本计划投资形成的证券类资产由相关法定登记或托管机构根据法律法规的规定实行保管，沪深交易所场内证券交易结算资金由托管人保管，因中国证券登记结算有限责任公司、证券交易所原因导致场内证券资产或结算资金损失的，托管人不承担责任。托管人对因为管理人投资产生的存放或存管在托管人以外机构的计划财产，或交由期货公司负责清算交收的计划财产（包括但不限于期货保证金账户内的资金、期货合约等）及其收益不承担保管职责；由于该等机构或该机构会员单位等本合同当事人外第三方的欺诈、疏忽、过失或破产等原因给计划财产造成的损失等不承担责任。 7. 对于因为管理计划投资产生的应收资产，应由管理人负责与有关当事人确定到账日期并通知托管人，到账日托管账户未收到应收资产的，托管人应及时通知管理人采取措施进行催收，由此给计划造成损失的，管理人应负责向有关当事人追偿。	
第 18 部分 越权交易的界定	二、对越权交易的处理 1、违反有关法律法规和本合同附件《交易监控合规表》规定进行的投资交易行为 托管人对于承诺监督的越权交易中，托管人依据本合同约定的审核方式发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同附件《交易监控合规表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人并有权及时报告中国证监会、基金业协会。 托管人对于承诺监督的越权交易中，托管人依据本合同约定的审核方式发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同附件《交易监控合规表》约定的，应当立即通知管理人并有权及时报告中国证监会、基金业协会。 管理人应向资产投资者和托管人主动报告越权交易。在限期内，资产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。管理人对资产投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权报告中国证监会、基金业协会。 2、法律法规禁止的超买、超卖行为 托管人如果发现受托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，	二、对越权交易的处理 1、违反有关法律法规和本合同附件《交易监控合规表》规定进行的投资交易行为 托管人对于承诺监督的越权交易中，托管人依据本合同约定的审核方式发现管理人的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同附件《交易监控合规表》约定的，应当拒绝执行，立即通知管理人及时报告中国证监会。 托管人对于承诺监督的越权交易中，托管人依据本合同约定的审核方式发现管理人依据交易程序已经生效的投资指令违反法律法规的规定，或者违反本合同附件《交易监控合规表》约定的，应当立即通知管理人及时报告中国证监会。 管理人应向资产投资者和托管人主动报告越权交易。在限期内，资产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。管理人对资产投资者和托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人报告中国证监会。 2、法律法规禁止的超买、超卖行为 托管人如果发现受托财产投资证券过程中出现超买或超卖现象，应提醒管理人，由管理人负责解决，由此给受托财产造成的损失由管理人承担。

	应提醒管理人，由管理人负责解决，由此给受托财产造成的损失由管理人承担。 3、非因管理人主观因素导致本计划投资突破本合同约定的投资比例的，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15个交易日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。	3、非因管理人主观因素导致本计划投资突破本合同约定的投资比例的，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20个交易日内调整完毕。法律法规、中国证监会等监管部门另有规定的从其规定。
第18部分 越权交易的界定	新增： 四、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，对本计划的投资履行监督职能。 五、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。 六、托管人向管理人披露托管人及其控股股东、实际控制人或者其他关联方，以及前述机构发行的证券或者承销期内承销的证券等信息，具体以托管人面向公开市场披露的信息为准。 七、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。 八、管理人经托管人催告仍不按约定与托管人对账，导致托管人无法及时履行投资监督职责的，由管理人承担相应的责任。	
第19部分 交易及交收清算安排	（二）投资证券后的清算交收安排 1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务： （1）托管人、管理人应共同遵守中登公司制定的相关业务规则和规定，该等规则和规定自动成为本款规定的内容。管理人在投资前，应充分知晓与理解中登公司针对各类交易品种制定结算业务规则和规定，并遵守托管人为履行特别结算参与人的义务所制定的业务规则与规定。 （2）托管人代理资产管理计划与中登公司完成证券交易及非交易涉及的证券资金结算业务，并承	（二）投资证券后的清算交收安排 1、关于托管资产在证券交易所市场达成的符合中国结算公司多边净额结算要求的证券交易以及新股业务： 资产托管人、资产管理人应共同遵守双方签署的《托管银行证券资金结算协议》及对该协议不时的更新。

	担由托管人原因造成的正常结算、交收业务无法完成的责任；若由于管理人原因造成托管人无法正常完成结算业务，托管人发现后应立即通知管理人，由管理人负责解决，由此造成托管人无法按时向中国证券登记公司支付证券清算款的责任以及由此给托管人所托管的其他财产造成的损失由管理人承担。 (3) 管理人签署本合同/协议，即视为同意管理人在构成资金交收违约且未能按时指定相关证券作为交收履约担保物时，托管人可自行向结算公司申请由结算公司协助冻结管理人证券账户内相应证券，无需管理人另行出具书面确认文件。投资者亦对此安排无异议。 (4) 托管人遵照中登公司上海分公司和中登公司深圳分公司备付金、保证金管理办法有关规定，确定和调整该委托财产受托财产最低结算备付金、证券结算保证金限额，管理人应存放于中登公司的最低备付金、结算保证金日末余额不得低于托管人根据中登公司上海和深圳分公司备付金、保证金管理办法规定的限额。托管人根据中登公司上海和深圳分公司规定向委托财产受托财产支付利息。 (5) 根据中登公司托管行集中清算规则，如委托财产受托财产 T 日进行了中登公司深圳分公司 T+1DVP 卖出交易，管理人不能将该笔资金作为 T+1 日的可用头寸，即该笔资金在 T+1 日不可用也不可提，该笔资金在 T+2 日才能划拨至托管资金账户。 (6) 根据中国证券登记结算有限责任公司的规定，结算备付金账户内的最低备付金、交易保证金账户内的资金按月调整按季结	
--	--	--

	息，因此，资产管理合同终止时，资产管理计划可能有尚存放于结算公司的最低备付金、交易保证金以及结算公司尚未支付的利息等款项。对上述款项，托管人将于结算公司支付该等款项时扣除相应银行汇划费用后划付至资产管理计划清算报告中指定的收款账户。资产管理合同终止后，中登根据结算规则，调增计划的结算备付以及交易保证金，管理人应配合托管人，向托管人及时划付调增款项，以便托管人履行交收职责。	
第 19 部分 交易及交收清算安排	新增：（五）投资银行存款的特别约定 4、因投资需要在托管银行以外的其他银行开立活期账户进行存款或其他投资的，管理人、托管人和存款行需在投资前另行签署协议，原则上为三方协议。	
第 20 部分 集合计划财产的估值和会计核算	2、具体投资品种估值方法 （1）股票和权证的估值方法 3）处于未上市期间的交易所有价证券应区分如下情况处理 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；首次公开发行未上市的股票和权证，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，按成本估值；在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。	2、具体投资品种估值方法 （1）股票和权证的估值方法 3）处于未上市期间的交易所有价证券应区分如下情况处理 送股、转增股、配股和公开增发的新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的估值方法估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；首次公开发行未上市的股票和权证，采用估值技术确定公允价值；在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值。
第 20 部分 集合计划财产的估值和会计核算	2、具体投资品种估值方法 （5）股指期货、国债期货和商品期货的估值方法 股指期货、国债期货和商品期货	2、具体投资品种估值方法 （5）期权、股指期货、国债期货和商品期货的估值方法 期权、股指期货、国债期货和商

	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。	品期货合约的投资，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。 （6）存托凭证的估值核算依照境内上市交易的股票执行，国家有最新规定的，按其规定进行估值。 （7）回购交易以成本列示，按商定利率在实际持有期间内逐日计提利息。 （8）同业存单按照第三方估值机构提供的估值日价格进行估值。
第 21 部分 集合计划的费用、业绩报酬	业绩报酬计提标准为： 当年化收益率 $R > 6.5\%$ 时，本集合计划对超过 6.5% 的收益部分提取 15% 的业绩报酬，即 $E = K \times (R - 6.5\%) \times 15\% \times (T \div 365)$。	业绩报酬计提标准为： 当年化收益率 R 小于等于 6.5% 时，本计划不计提业绩报酬。当年化收益率 $R > 6.5\%$ 时，本集合计划对超过 6.5% 的收益部分提取 15% 的业绩报酬，即 $E = K \times (R - 6.5\%) \times 15\% \times (T \div 365)$。
第 21 部分 集合计划的费用、业绩报酬	例 2：某委托人分红日持有份额 1,000,000 份，每份分红额为 0.50 元，分红日单位累计净值为 1.79 元，上一个业绩报酬计提日单位累计净值为 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 ...	例 2：某投资者分红日持有份额 1,000,000 份，每份分红额为 0.10 元，分红日单位累计净值为 1.79 元，上一个业绩报酬计提日单位累计净值为 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 ...
第 21 部分 集合计划的费用、业绩报酬	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划款指令将业绩报酬支付给管理人。	3、业绩报酬支付 业绩报酬在业绩报酬计提日计提，由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额，托管人据此计提应付管理人业绩报酬。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延，业绩报酬以管理人提供的数据为准。 因涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核由管理人完成，托管人根据管理人的划款指令进行划款，托管人不复核业绩报酬的计算。
第 23 部分 信息披露与报告	3、托管人履职报告（简称“托管报告”） （1）托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报	3、托管人履职报告（简称“托管报告”） （1）托管人履职报告作为管理人季度报告、年度报告内容的一部分，由托管人完成管理人季度报告的复核工作后，确定托管人履职报告

	告、年度报告的复核工作后，确定托管人履职报告内容并向管理人反馈，同时在管理人、托管人协商一致的季度报告、年度报告上盖章确认，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。	内容并向管理人反馈，由管理人根据本合同约定的方式向投资者披露。托管人履职报告内容包括托管人履职情况、对管理人投资运作的监督情况及有关报告财务数据的复核意见等。
第 24 部分 风险揭示	9、投资于的公募基金等标的金融产品的风险 (1) 该等标的金融产品的管理人在进行投资时，如出现判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当，或未勤勉尽责进行投资管理等情形，将对计划的收益甚至本金安全造成不利影响。 (2) 投资于该等标的金融产品时，仅能于投资时对标的金融产品的产品合同约定的投资范围是否符合计划合同约定进行判断，若该等标的金融产品实际投资范围超出约定范围，或标的金融产品变更其投资范围（可能无需经管理人同意），均可能给计划造成不利影响。 20、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。	9、投资于的公募基金等标的金融产品的风险 (1) 该标的金融产品的管理人在进行投资时，如出现判断有误、获取信息不全、或对投资工具使用不当，或未勤勉尽责进行投资管理等情形，将对计划的收益甚至本金安全造成不利影响。 (2) 投资于该标的金融产品时，仅能于投资时对标的金融产品的产品合同约定的投资范围是否符合计划合同约定进行判断，若该标的金融产品实际投资范围超出约定范围，或标的金融产品变更其投资范围（可能无需经管理人同意），均可能给计划造成不利影响。 22、对账单风险 管理人以电子邮件、短信或其他电子形式向本集合计划份额的持有人提供对账单服务，份额持有人也可通过网上直销系统（国泰君安资管 APP）查询对账单。由于持有人提供的邮寄地址、手机号码、电子邮箱不详、错误、未及时变更或邮局投递差错、通讯故障、延误等原因有可能造成前述服务无法按时或准确送达。因上述原因无法正常获得前述服务的持有人，敬请及时通过管理人官方网站或网上直销系统（国泰君安资管 APP），或拨打管理人客服热线查询、核对、变更预留联系方式。
第 24 部分 风险揭示	新增： 11、投资于北京证券交易所股票的风险 1. 上市企业经营风险	

	北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，其持续经营能力，核心技术，经营管理团队稳定性，财务数据稳定性存在较高的不确定性，企业应对外部政策、市场变化的能力较弱，可能面临一定的经营风险。因此，基金在追求北京证券交易所上市企业带来收益的同时，须承受北京证券交易所上市中小企业不确定性更大的风险，基金投资于北京证券交易所上市企业面临无法盈利甚至可能导致较大亏损的风险。 2. 股价大幅波动风险 北京证券交易所股票涨跌幅限制比例区间相对较大，股票上市的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%，股价大幅波动的风险可能大于 A 股其他板块，可能导致较大的股票价格波动。 3. 企业退市风险 北京证券交易所上市企业可能会触及相关法律法规、证监会以及北京证券交易所规定的退市情形，可能面临被终止上市的风险，进而可能对基金净值造成不利影响。 4. 流动性风险 北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少，流动性可能弱于 A 股其他板块；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个股形成一致预期，由此可能导致基金面临无法及时变现及其他相关流动性风险。 5. 集中度风险 北京证券交易所为新设交易所，初期可投标的较少，投资者容易集中投资于少量个股，市场可能存在高集中度状况，整体存在集中度风险。 6. 监管规则变化的风险 北京证券交易所相关法律、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完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致基金投资运作相应调整变化。 12、投资于存托凭证的风险 （1）发行相关的风险 可能存在公司公开发行并上市时尚未盈利，上市后仍无法盈利、持续亏损、无法进行利润分配、退市的情形；可能存在发行价格高于每股净资产账面价值或者境外市场价格；可能存在因境内外规定不同或者上市公司未实行完毕激励措施而给投资者带来风险。 （2）业务相关的风险 企业可能因重大技术、产品、经营模式、相关政策变化而出现经营风险；企业可能处于初步发展阶段，企业持续创新能力、主营业务发展可持续性、公司收入及盈利水平等具有较大不确定性；企业在项目研发结果、研发成果商业化前景、核心研发人员稳定性、所处市场竞争环境、客户群体变化等方面，均可能面临重大不确定性，并对公司盈利能力产生重大影响。 （3）境外发行人相关的风险 企业受注册地法律法规、境内外上市公司治理结构不同的影响，在境内存托凭证持有人享有的权益、权利的行使、维护权利成本等方面均可能受境外法律变化影响；针对会计准则、语言、工作时间等不同，具体披露时间、
--	---

	投资者对披露事项的理解可能存在一定差异。 (4) 存托凭证相关的风险 存托凭证持有人实际享有的权益与境外基础证券持有人的权益虽然基本相当,但并不能等同于直接持有境外基础证券,所代表的权利在范围和行使方式等方面存在差异,交易和持有存托凭证过程中需要承担义务或可能受到限制。 存托凭证存续期间,存托凭证项目内容可能发生重大、实质变化,包括但不限于存托凭证与基础证券转换比例发生调整、红筹公司和存托人可能对存托协议作出修改,更换存托人、更换托管人、存托凭证主动退市等。部分变化可能仅以事先通知的方式,即对投资者生效。投资者可能无法对此行使表决权。 存托凭证退市的,投资者可能面临存托人无法根据存托协议的约定卖出基础证券的风险。 (5) 交易机制相关的风险 由于时差和交易制度、停复牌制度、境内外证券价格的差异,导致给投资者带来风险;因不可抗力、交易或登记结算系统技术故障、人为差错等原因,导致存托凭证交易或登记结算不能正常进行、交易或登记结算数据发生错误等情形的,交易所和登记结算机构可以根据规则采取相关处置措施。交易所和登记结算机构对于因上述异常情况及其处置措施造成的损失不承担责任,可能给投资者带来风险。 23、份额强制退出风险 投资者于退出开放期间申请份额退出业务时,若某笔退出导致该投资者在某销售机构持有的份额合计净值低于本计划规定的合格投资者最低参与金额,则余额部分可能被强制一起退出。此外,强制退出份额不受持有期限限制。	
第 25 部分 合同的变更、展期、终止与财产清算	四、 集合计划的终止 有下列情形之一的,集合计划应当终止: 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;	四、 集合计划的终止 有下列情形之一的,集合计划应当终止: 5. 存续期内,持续五个工作日集合计划投资者少于 2 户时;特别的,本集合计划存续期内因投资者申请退出导致集合计划当日户数低于 1 户时,当日投资者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 28 部分 合同的成立与生效	新增: 对于已签署原合同的投资者,无需另行签署本合同,本合同自管理人公告的合同变更生效之日起对其生效。但本合同生效日之前,原合同当事人依据原合同已经履行的部分,依照原合同的约定执行。 原合同自本合同生效之日起同日失效。	
第 29 部分 或有事项	新增: (一) 合同其他方签署本合同即视为知悉/授权托管人可为订立、履行个人作为一方当事人的合同所必需或为履行法定职责或者法定义务所必需而处理个人信息;托管人承诺对上述个人信息的处理合法合规,个人亦已	

	知悉其享有《个人信息保护法》项下所有相关权利。如果个人信息系由一方向另一方提供的，提供方承诺已告知并获得相关个人同意向接收方提供个人信息，且个人已知晓个人信息的使用用途。
附件 1 投资监督事项表	新增：（投资限制） 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。
新增：附件 2 关联方名单	

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投资者请于本公告公布之日起 5 个工作日内填写《关于同意国泰君安优量量化对冲 1 号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“优量量化对冲 1 号集合合同变更”）或扫描邮件至 gjzgcfglb@gtjas.com。

2、不同意本次合同变更的投资者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优量量化对冲 1 号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“优量量化对冲 1 号集合合同变更”）或扫描邮件至 gjzgcfglb@gtjas.com，并于本公告公布之日起 5 个工作日内办理退出。

3、投资者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投资者自行承担；

4、投资者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、投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意变更，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《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《管理合同》相关条件



的，则本次合同变更失效。

7、上述期间至变更生效前如遇开放期则暂停办理参与业务。

特此公告。

上海国泰君安证券资产管理有限公司

2025 年 4 月 17 日

