

2025/5

合同编号:

国泰君安君享大类资产全天候 16 号  
集合资产管理计划管理合同  
(券商结算模式-银保柜台)

管理人：上海国泰君安证券资产管理有限公司  
托管人：中国建设银行股份有限公司云南省分行  
2025 年



## 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 .....	9
第 4 部分 合同当事人 .....	11
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 .....	21
第 7 部分 资产管理计划的成立与备案 .....	26
第 8 部分 资产管理计划的参与、退出与转让 .....	28
第 9 部分 份额持有人大会及日常机构 .....	36
第 10 部分 资产管理计划份额的登记 .....	37
第 11 部分 集合计划的投资 .....	39
第 12 部分 投资顾问 .....	48
第 13 部分 集合计划的分级安排 .....	49
第 14 部分 利益冲突及关联交易 .....	50
第 15 部分 投资经理的指定与变更 .....	52
第 16 部分 资产管理计划的财产 .....	53
第 17 部分 投资指令的发送、确认和执行 .....	55
第 18 部分 交易及清算交收安排 .....	59
第 19 部分 越权交易的界定 .....	62
第 20 部分 集合计划财产的估值和会计核算 .....	64
第 21 部分 集合计划的费用、业绩报酬 .....	69
第 22 部分 投资收益与分配 .....	75
第 23 部分 信息披露与报告 .....	77
第 24 部分 风险揭示 .....	80
第 25 部分 合同的变更、展期、终止与财产清算 .....	89
第 26 部分 违约责任 .....	96
第 27 部分 争议处理 .....	98
第 28 部分 合同的成立与生效 .....	99
第 29 部分 或有事项 .....	101

## 重要提示

本合同投资者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；投资者作为本合同一方，以电子签名方式签署本合同即表明投资者完全接受本合同项下的全部条款，同时本合同成立。

投资者、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，三方一致同意投资者自签署《电子签名约定书》之日起，投资者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。

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 1 部分前言

为规范国泰君安君享大类资产全天候 16 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《国泰君安君享大类资产全天候 16 号集合资产管理计划管理合同》当事人的权利与义务，依照《中华人民共和国民法典》《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）《中华人民共和国证券法》（以下简称《证券法》）《中华人民共和国期货和衍生品法》《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称《管理办法》）《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称《运作规定》）《集合资产管理计划资产管理合同内容与格式指引》等法律、行政法规、中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）规定以及中国证券投资基金业协会（以下简称协会）有关规定，投资者、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。

管理人应当按照规定向协会办理资产管理计划的设立、变更备案，并及时报送资产管理计划的运行情况、风险情况以及终止清算报告等信息。

证券投资基金业协会办理资产管理计划备案不代表协会对资产管理计划的合规性、投资价值及投资风险作出保证和判断，也不表明协会对备案材料的真实性、准确性、完整性作出保证。投资者应当充分了解资产管理计划的投资范围、投资策略和 risk 收益等信息，根据自身风险承担能力审慎选择资产管理计划，自主判断投资价值，自行承担投资风险。

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

本合同中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

资产管理计划、集合计划、本集合计划或本计划或资管计划	指国泰君安君享大类资产全天候 16 号集合资产管理计划
《集合计划说明书》或《说明书》	指《国泰君安君享大类资产全天候 16 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
《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	指《国泰君安君享大类资产全天候 16 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
《证券投资基金法》	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》
《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）
《交易指引》	指 2013 年 8 月 21 日经中国证监会发布并施行的《证券公司参与股指期货、国债期货交易指引》
《指导意见》	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》（银发[2018]106 号）
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	指中国建设银行股份有限公司云南省分行

投资者或持有人	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受能力，投资于单只资产管理计划不低于一定金额且符合下列条件的自然人、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、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；</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、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）；</p> <p>（六）中国证监会视为合格投资者的其他情形。</p> <p>私募资产管理产品不得投资于本产品；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。</p>
销售机构、推广机构	指富滇银行股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、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，具体内容包括投资者集合计划账户管理、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投资者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投资者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	指为投资者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	指投资者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投资者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
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
信义义务	一是忠实义务，资产托管人按照合同约定义务为投资者利益行事，不为自己或他人谋取私利。二是勤勉义务，资产托管人勤勉尽职、专业审慎履行本合同约定义务。

## 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投资者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投资者的风险偏好、风险认知能力和承受能力，对投资者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受托财产，不保证受托财产一定盈利，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。

4. 资产管理人对本资产管理计划的合规性负责，由于资产管理计划本身的合规性问题给投资者、资产托管人造成损失的，资产管理人应承担相应的赔偿责任。作为本资产管理计划的资产管理人，将勤勉尽责履行资产管理人义务，按照合同约定管理资产管理计划的投资运作，确保本计划不存在结构化问题（包括发行和交易环节）、非法代持、利益输送等情况。

### 二、托管人承诺

1. 托管人承诺具备从事资产托管业务的资格和能力。

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受托财产，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、投资者承诺与声明

1. 投资者符合《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. 投资者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。投资者未使用贷款、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、投资者承诺其知悉《中华人民共和国反洗钱法》、《金融机构大额交易和可疑交易报告管理办法》、《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》等反洗钱相关法律法规的规定，将严格遵守上述规定，不会违反任何前述规定；承诺用于投资的资金来源不属于违法犯罪所得及其收益；承诺出示真实有效的身份证件或者其他身份证明文件，积极履行反洗钱职责，配合进行受益所有人识别，不借助本业务进行洗钱等违法犯罪活动。

投资者承诺，其不属于中国有权机关、联合国以及其他中国政府认可的制裁名单内的企业或个人，不位于被中国有权机关、联合国以及其他中国政府认可的制裁的国家和地区。

4、投资者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。

5、投资者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。

6、投资者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。

7、投资者承诺对受托财产拥有合法所有权或处分权，投资行为系基于投资者的真实意思表示，已取得合法、有效的授权，且不会违反对投资者有约束力的任何协议、合同或其他法律文件。

8、投资者承诺知晓：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，不能取代投资者的投资判断，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投资者自行承担。

## 第 4 部分合同当事人

### 一、投资者、管理人和托管人的基本情况

#### (一) 投资者

投资者的详细情况在各投资者分别与管理人、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：陶耿

住所：上海市黄浦区南苏州路 381 号 409A10 室

联系地址：上海市静安区新闻路 669 号博华广场 22 楼

联系电话：021-38676999

传真：021-68872521

联系人：刘海

#### (三) 托管人

托管人名称：中国建设银行股份有限公司云南省分行

单位负责人：杨中仑

联系地址：云南省昆明市金碧路306号建行大厦

联系电话：0871-63060312

联系人：崔桎源

### 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、投资者的权利和义务

#### (一) 投资者的权利

(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) 依据合同约定的时间和方式，查询受托财产的资产配置、净值变动等相关信息；

(8) 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) 投资者的义务

(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) 按照规定向管理人或者资产管理计划销售机构提供信息资料以及身份证明文件，配合管理人或者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；

(5) 按照资产管理合同约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担资产管理合同约定的管理费、业绩报酬（如有）、托管费、审计费、税费等合理费用；

(6) 认真阅读并签署风险揭示书；

(7) 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；

(8) 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；承诺其提供的材料真实、准确、完整，遵守各方反洗钱与反恐怖融资相关管理规定，对具备合理理由怀疑涉嫌洗钱、恐怖融资的客户，接受管理人及/或托管人按照中国人民银行反洗钱监管规定采取的必要管控措施，或单方面终止本合同。

(9) 不得违反本合同的约定干涉管理人的投资行为；

(10) 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；

(11) 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、投资信息等，依法依规提供信息除外；；

(12) 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) 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；

(5) 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；

(6) 对投资者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，有权依法拒绝与投资者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；

(7) 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) 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，向合格投资者非公开募集资金；

(4) 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；

(5) 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；

(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，对所管理的不同资产管理计划的受托财产分别管理，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) 按照本合同约定接受投资者和托管人的监督；

(9) 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；

(10) 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；

(11) 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；

(12) 对《管理办法》第三十八条第（五）项规定的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；

(13) 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；

(14) 聘请符合《证券法》规定的会计师事务所对年度财务会计报告进行审计；

(15) 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；

(16) 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；

(17) 办理与受托财产管理业务活动有关的信息披露事项；

(18) 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；

(19) 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；

(20) 对于托管人违反法律、行政法规规定或者资产管理合同，对资产管理计划财产以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；

(21) 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以及其他当事人利益的活动；不得向管理人以及任何第三人输送利益；不得委托第三人运作资产管理计划财产；

(22) 不得利用资产管理计划，通过直接投资、投资其他资产管理产品或者与他人进行交叉融资安排等方式，违规为本机构及其控股股东、实际控制人或者其他关联方提供融资；

(23) 建立并保存投资者名单；

(24) 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；

(25) 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；

(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) 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；

(28) 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、核实资产投资者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，要求资产投资者积极配合完成（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 号）》（以下称“164 号文”）的相关要求，单一资产管理计划、集合资产管理计划将直接持有或穿透后持有超过 25% 权益份额的自然人作为托管产品的受益所有人；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。

(29) 采取了适当的措施，确保资产管理计划的投资者、受益所有人等不得被列入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，不得被列入联合国及其他国家（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。

(30) 资产管理计划的投资行为不得违反我国、联合国及其他可适用的经济制裁或反洗钱法律法规，不得被用于其他洗钱、恐怖融资、逃税、欺诈等非法用途。

(31) 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。

(32) 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) 按照本合同约定监督管理人集合计划的投资运作，发现管理人的投资或清算指令违反本协议之附件《投资监督事项表》对投资范围、投资比例及限制约定的，有权予以制止。

(4) 查询集合计划的经营运作情况；

(5) 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) 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；

(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，具体以公开市场披露的主体信息和证券信息为准；

(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) 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) 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；

(13) 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；

(14) 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；

(15) 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；

(16) 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

一、名称：国泰君安君享大类资产全天候 16 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：本集合计划自成立次日起每月 10 日、20 日（如遇节假日顺延至下一个工作日）开放办理参与和退出业务。特别的，投资者每笔份额持有时间不得少于 270 天。合同另有约定的，从其约定。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。

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 40 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

本集合计划以为客户获取长期稳健的绝对回报为投资目标。

2、主要投资方向及比例

（1）主要投资方向

1) 资管计划可根据资金管理的需求，投资于现金、银行存款（包括但不限于活期存款、定期存款、协议存款、大额存单等）、货币市场基金、债券逆回购以及其他经中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的货币市场工具；

2) 资管计划可投资于公募证券投资基金，包括股票型基金、偏股混合型基金、债券型基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF（含商品 ETF）等；

3) 资管计划可投资于股指期货、商品期货、国债期货等期货及衍生品类资产；

4) 法律、法规、规范性文件、监管机构允许投资的其他投资品种（包括前述各产品类型的 QDII 产品）。

特别揭示：本计划可投资于债券回购。投资者已充分理解并接受本计划投资债券回购所附带的信用风险、流动性风险、利率风险等风险。

（2）投资比例（占集合计划资产总值）

- 1) 固定收益类资产：0%~80%；
- 2) 权益类资产：0%~80%；
- 3) 期货及金融衍生品类账户权益：0%~20%；

本集合计划投资于公募证券投资基金，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算，上述投资比例符合《运作规定》组合投资的要求。托管人将依据管理人提供的数据进行监控。

### 3、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高风险(R4)。

## 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、集合计划份额初始募集面值

本集合计划份额的初始募集面值为 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、资产管理计划的费用

### 1、参与费率：如下表所示：

参与金额	参与费率
$M < 300$ 万元	0.50%
$300 \text{ 万元} \leq M < 1000$ 万元	0.20%
$M \geq 1000$ 万元	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 0.8%。

### 4、托管费率

本集合计划的年托管费率为 0.02%。

### 5、业绩报酬

管理人对投资者每笔计划份额计算年化收益率并计提业绩报酬。具体计算方法如

下<sup>1</sup>:

持有期年化收益率(R)	提取比例	业绩报酬(E)
$R \leq R'$	0	0
$R > R'$	20%	$E = K \times (R - R') \times 20\% \times T / 365$

#### 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。

#### 十一、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。

<sup>1</sup> R 为各段持有期年化收益率, R' 为业绩报酬计提基准, T 表示上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数, E 为管理人应收取的业绩报酬, K 为投资者每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额

## 第 6 部分资产管理计划的募集

### (一) 资产管理计划份额的募集期限、募集方式、募集对象

#### 1. 募集期限

本计划募集期限（即初始销售期间）自计划份额发售之日起不超过 60 个自然日。初始募集期指集合计划接受投资者认购日至募集期结束日。管理人可根据销售情况提前终止初始销售，并在管理人网站及时公告，视为履行完毕提前终止初始销售的程序。

管理人发布公告提前结束募集的，本资产管理计划自公告之时起不再接受认购申请。

#### 2. 募集方式

销售机构：富滇银行股份有限公司、国泰海通证券股份有限公司、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。

本集合计划应当面向合格投资者销售，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，介绍产品特点并揭示风险，推荐与客户风险承受能力相匹配的集合计划。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。

管理人可以根据本合同约定，选择使用管理人网站、电子邮件、手机信息等方式向投资者告知本集合计划相关信息。

#### 3. 募集对象

委托投资本计划初始净认购金额不低于 40 万元人民币（不含认购费用），且能够识别、判断和承担相应投资风险的自然人、法人、依法成立的组织或中国证监会认可的其他合格投资者。本计划的投资者人数不少于 2 人，不得超过 200 人。

### (二) 资产管理计划份额的认购和持有限额

认购资金应以现金形式交付。投资者初始净认购金额不低于 40 万元人民币（不含认购费用）并可追加认购，追加认购的最低金额为人民币 1 万元。

### (三) 资产管理计划份额的认购费用

#### 1. 认购费率如下表所示

认购金额	认购费率
M < 300 万元	0.50%
300 万元 ≤ M < 1000 万元	0.20%
M ≥ 1000 万元	0%

#### 2. 初始销售期间认购款项及利息的处理方式

投资者的认购参与款项加计其在初始销售期形成的利息将折算为资产管理计划份额归投资者所有。其中利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

#### 3. 认购份额的计算

本计划每份计划份额初始面值均为人民币 1.00 元。

本计划的认购金额包括认购费用和净认购金额。计算方法如下：

$$(1) \text{ 认购费用} = \text{认购金额} \times \text{认购费率} / (1 + \text{认购费率})$$

(2)  $\text{认购份额} = (\text{认购金额} + \text{初始募集期利息} - \text{认购费用}) / \text{集合计划初始募集面值}$ 。认购份数保留小数点后两位，小数点后第三位四舍五入。

$$(3) \text{ 净认购金额} = \text{认购金额} - \text{认购费用}$$

(4) 如本集合计划在初始募集期内客户数达到 200 户的，可提前终止初始募集期。

(5) 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”方法对集合计划总户数实行限量控制。

(6) 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。

(7) 投资者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。

注：本计划份额计算时采用四舍五入，保留至 0.01 份，由此产生的误差计入计划资产；多笔认购时，按上述公式进行逐笔计算。

举例如下：

例 1: 某投资者投资 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=认购金额\*认购费率/(1+认购费率)=2,000,000\*0.5%/(1+0.5%)  
=9,950.25 元

认购份额=(认购金额+初始募集期利息-认购费用)/集合计划初始募集面值=  
(2,000,000+60-9,950.25)/1.00=1,990,109.75 份

即: 投资者投资 2,000,000 元认购本集合计划, 可得到 1,990,109.75 份集合计划份额(含利息折份额部分)。

例 2: 某投资者投资 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, 对所有投资者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投资者账户。

假定前述投资者的申请单序号为 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;

假定前述投资者的申请单序号为 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投资者账户。

假定前述投资者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投资者账户。

投资者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。

#### (四) 认购资产管理计划的具体规定

以下事项由管理人根据相关法律法规以及本合同的规定确定, 并在计划说明书中披露。

##### 1、投资者认购原则

(1) 本集合计划采用电子合同的方式签署，投资者在各销售网点，签署合同。投资者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投资者提供的信息和资料进行审查并如实记录。投资者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) 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。

## 2、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。

## 3、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）为投资者登记权益并办理注册登记手续。

## 4、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投资者的认购申请：

(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) 销售机构对投资者资金来源表示疑虑，投资者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投资者利益；

(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）项暂停认购情形时，管理人应当通过管理人网站公告投资者。

## (五) 初始销售期间特定客户资金的管理

管理人应当将资产管理计划初始销售期间特定客户的委托资金存入专门账户，在资产管理计划初始销售行为结束前，任何机构和个人不得动用。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（不含），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，管理人通过管理人网站公告资产管理计划成立。管理人应当在集合计划成立且资金划至托管账户后通知托管人，托管人在确认资金到账后两小时内提供资金到账通知书盖章件。

本集合计划成立的时间为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、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（如需），完成备案后向托管人提供备案证明。集合计划无法完成备案的，管理人应当在确认上述事项后次一个工作日内告知投资者，并按照合同约定履行终止清算程序。

集合计划设立完成前，投资者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，任何机构和个人不得动用投资者参与资金。资产管理计划完成备案前，可以以现金管理为目的，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。

### 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（不含）或者投资者户数低于 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 日内退还集合计划投资者，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投资者，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。

集合计划无法完成备案或者基金业协会不予备案的，管理人应当在确认上述事项后次一个工作日内告知投资者，并按照合同约定履行终止清算程序。

### 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。

本集合计划自成立次日起每月 10 日、20 日（如遇节假日顺延至下一个工作日）开放办理参与业务。特别的，投资者每笔份额持有时间不得少于 270 天。合同另有约定的，从其约定。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。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投资者（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。

管理人可以根据实际情况，选择使用管理人网站、电子邮件、手机信息等方式向投资者告知本集合计划相关信息。

#### (二) 参与的原则

1、投资者于存续期首次参与本集合计划的，应与计划管理人、托管人签署合同。

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 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投资者。

#### (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后,构成本合同的有效组成部分;
- (4) 投资者参与申请确认后,其参与申请和参与资金不得撤销;
- (5) 投资者于T日提交参与申请后,可以T+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)为投资者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工作;
- (2) 管理人认为本集合计划出现或可能出现超额募集情况;
- (3) 证券交易所在交易时间非正常停市,导致无法计算当日的集合计划资产净值;
- (4) 管理人认为集合计划资产规模过大,可能对集合计划业绩产生负面影响,从而损害现有集合计划投资者的利益;
- (5) 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;
- (6) 销售机构对投资者资金来源表示疑虑,投资者不能提供充分证明的;
- (7) 管理人认为会有损于现有集合计划投资者利益;
- (8) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停参与的情形。

发生上述(1)到(5)、(7)、(8)项暂停参与情形时,管理人应当通过管理人网站公告投资者。

### (六) 参与费及参与份额的计算

#### 1、参与费率:如下表所示

参与金额	参与费率
M<300 万元	0.50%
300 万元≤M<1000 万元	0.20%
M≥1000 万元	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。

投资者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

本集合计划投资者只能于本集合计划的开放期办理退出申请。

本集合计划自成立次日起每月10日、20日（如遇节假日顺延至下一个工作日）开放办理退出业务。特别的，投资者每笔份额持有时间不得少于270天。合同另有约定的，从其约定。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。

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。

管理人可以根据实际情况，选择使用管理人网站、电子邮件、手机信息等方式向投资者告知本集合计划相关信息。

### （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，即对投资者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. 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。

### (三) 退出的程序和确认

1、退出申请的提出：投资者可在原参与网点，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投资者退出申请的 T+1 日对该交易的有效性进行确认，投资者通常可在 T+2 日到网点查询退出的确认情况。

3、退出申请款项的支付：投资者退出申请确认后，管理人将指示托管人将退出款项从集合计划托管账户划往注册登记机构指定账户，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投资者的指定资金账户，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：

退出费率为 0%。

2、退出金额的计算方法及退出方式

投资者退出金额为退出总额扣减业绩报酬（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单位净值

退出费用=【退出总额-管理人业绩报酬（如有）】×退出费率

退出金额=退出总额-管理人业绩报酬（如有）-退出费用

#### (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) 单个投资者大额退出的认定和处理方式

##### 1、单个投资者大额退出的认定

对单个投资者单日退出份额超过集合计划总份额10%，即视为单个投资者大额退出。

##### 2、单个投资者大额退出的处理方式

单个投资者大额退出申请，管理人应当接受其退出申请。若触发巨额退出的条件，管理人将按照巨额退出的流程办理。

#### (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20%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20%。

##### 2、巨额退出及连续巨额退出的退出顺序、价格确定

投资者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；退出价格以投资者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投资者持有的剩余份额的资产净值不符合《集合资产管理合同》约定的最低投资金额而须强制赎回的，管理人亦有权拒绝该投资者的退出申请。

①全额退出：当管理人认为有足够能力支付投资者的全额退出申请时，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，经销售机构划往投资者指定资金账户。

②全部或部分延期退出：当管理人认为全额支付投资者退出申请有困难或认为全额支付投资者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 20%的前提下, 对其余退出申请可延期予以办理。管理人对单个投资者的退出申请, 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, 确定该投资者当日办理的退出申请份额。投资者在申请退出时, 可以选择将当日未获办理的退出申请份额予以撤销。投资者选择延期退出的, 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。因延期退出而导致投资者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, 经销售机构划往投资者指定资金账户。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投资者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

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。

#### (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投资者的退出申请:

1. 因不可抗力的原因导致集合计划无法正常运转;
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, 并报告给投资者。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，投资者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，可以暂停接受投资者的退出申请，并按照规定向相关监管机构报备（如需）。

暂停集合计划退出，管理人应及时通过管理人网站告知投资者，并制定相应的补救措施。

投资者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，投资者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。转让后投资者持有集合计划份额的资产净值不得低于规定的最低投资金额，投资者合计不超过 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投资者集合计划账户转移到另一投资者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。

投资者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、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。

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。

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，管理人依法及时调整，但应当事后及时告知全体投资者和托管人。

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，告知全体投资者和托管人，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。

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。

7、风险揭示：管理人自有资金退出，可能遭遇流动性风险，从而影响本集合计划损益。管理人将认真履行管理人职责，关注本集合计划规模变动情况，控制流动性风险。

8、信息披露：管理人以自有资金参与或退出本集合计划，应该提前 5 个工作日通过管理人网站公告参与、退出时间和参与、退出金额等信息（监管允许可不予提前告知或者合同另有约定等情形除外）。

六、管理人定期将资产管理计划资产投资者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、全体投资者、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，注册登记机构为投资者开立集合计划账户，用于记录投资者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，具体内容包括资产投资者账户管理、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、建立和保管资产投资者账户资料、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、对资产投资者的账户信息负有保密义务，因违反该保密义务对资产投资者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，为资产投资者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

全体集合计划投资者同意管理人、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

本集合计划主要投资于金融产品，在风险有效控制的基础上，力争实现投资资产的稳健增值。

### 二、 投资范围及比例

#### 1、 投资范围

1) 资管计划可根据资金管理的需求，投资于现金、银行存款（包括但不限于活期存款、定期存款、协议存款、大额存单等）、货币市场基金、债券逆回购以及其他经中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的货币市场工具；

2) 资管计划可投资于公募证券投资基金，包括股票型基金、偏股混合型基金、债券型基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF（含商品 ETF）等；

3) 资管计划可投资于股指期货、商品期货、国债期货等期货及衍生品类资产；

4) 法律、法规、规范性文件、监管机构允许投资的其他投资品种（包括前述各产品类型 QDII 产品）。

特别揭示：本计划可投资于债券回购。投资者已充分理解并接受本计划投资债券回购所附带的信用风险、流动性风险、利率风险等风险。

### 三、 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，并以维护集合计划投资者利益作为最高准则。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。

#### （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。

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

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、资产配置策略

本资管计划采用以“全天候策略”为思想，以国泰君安安全全天候指数(CI011001.WI)为业绩比较基准，力图通过大类资产的配置复制该指数的表现。按照各类资产的配置比例选择合适的标的进行配置：(1) 针对权益类资产：A股，沪深300指数，根据基差情况选择IF期货或者300ETF进行相应的配置；美股，标普500指数，根据所需买卖金额选择在二级市场买卖或者向基金公司直接申购赎回标普500ETF的方式进行配置；(2) 针对固收类资产，根据所需买卖金额选择在二级市场买卖国债ETF、申购债券基金，或者开平国债期货的方式进行配置；(3) 针对商品类资产，根据所需买卖金额在期货市场或者商品ETF等资产上进行配置；(4) 针对现金类资产，根据所需买卖金额在货币基金、国债逆回购等资产上进行配置。

#### 2、商品期货投资策略

集合计划管理人在对中国宏观经济情况及市场阶段走势把握的基础上，通过对宏观经济运行、行业景气变化、宏观经济政策及证券市场走势的前瞻性研究，进行战略性资产配置及战术性资产配置，选择适当的商品期货进行投资。集合计划管理人通过对投资对象的风险收益特征分析以及投资特性分析，将灵活运用对冲、套利以及系统化交易等多种投资策略进行组合投资，获取稳健基础上的额外投资收益。并积极进行主动管理，追求资本在低风险下的长期平稳复利增长。

#### 3、基金策略

产品基于对国内外宏观经济周期和货币周期变化情况的深度研究，在战略上采用定量方法和定性研究相结合的策略，确定并动态调整权益类基金、固定收益类基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)等各类基金资产的配置比例，在战术上，则通过行业轮动、风格轮动、择时等策略确定并动态调整具体权益类基金的选择及仓位。

(1) 定量策略

根据产品的风险收益特征定位，确定产品在权益类和固定收益类的配置比例，在综合考虑基金的市值规模、流动性、代表性等因素的基础上，采用分层抽样的方法，选择优质基金来构建投资组合，并根据优化模型确定投资组合中的基金配置比例。

(2) 定性策略

从宏观经济、政策及法规及资本市场等因素出发，重点考察各种定量因素，结合美林投资时钟的分析框架，评估宏观经济变量变化趋势及对固定收益投资品和权益类投资品的影响，识别经济周期的重要转折点，从而及时转换资产，做出适当的资产配置以实现利润最大化。

(3) 行业轮动策略

通过自上而下的宏观周期分析，对不同行业进行跟踪分析，同时辅以对积极型行业和防御型行业轮动特点的趋势研究，形成行业配置的策略框架。在确定重点投资行业后，通过考量基金的流动性、跟踪误差、信息比以及基金费用等指标，精选相关行业ETF及行业指数基金进行投资。

(4) 风格轮动策略

基金从选股风格上来看可分为成长型、价值型和均衡型，从市值风格上来看可分为大盘、中盘和小盘。本产品将在不同市场环境下对不同风格的基金品种进行研究和跟踪分析，形成风格配置的策略框架。管理人将密切跟踪不同风格基金的超额收益情况，对组合的风格暴露程度进行调节，使得组合达到最优的风险收益比。管理人将通过考量基金的流动性、跟踪误差、信息比以及基金费用等指标，精选风格明晰且稳定的基金进行投资。

(5) 择时策略

通过综合分析股票市场整体的平均市盈率水平、市场流动性水平、债券市场的资金价格水平、基金折溢价水平以及衍生品市场的情绪等指标形成对不同资产的短期超配或低配的决策信号，以辅助管理人对组合进行再平衡。

4、风险平价策略

风险的量化管理是量化投资的一个重要组成部分，如何管理好各类资产的风险，达到投资绩效的最优化已成为越来越多投资者追求的目标。风险平价策略就在这种需求下应运而生，其目标是通过平衡分配不同资产类别在组合风险中的贡献度，实现了投资组合的风险结构优化。通过风险平价配置，投资组合不会暴露在单一资产类别的

风险敞口中，因而可以在风险平衡的基础上实现理想的投资收益。与传统的投资策略相比，风险平价策略具有风险均衡、收益稳定的特点，并且具有良好的可操作性。

量化大类资产配置策略从标准风险平价策略出发，借鉴 CPPI 策略中的风险乘数规则，并参考美林投资时钟理论，结合宏观指标将市场分为四个阶段，在不同的市场阶段分别给予不同大类资产相应的风险乘数调整，通过适当调高风险资产的总体配置比例的方式增强收益。同时，我们还对各风险资产的权重加入回撤控制，计算各资产在过去一段时间中的最大回撤。若最大回撤 $<$ 回撤控制系数，则该资产止损，权重请零，其他资产权重同比例提高。各资产的风险乘数及回撤控制系数，通过历史数据滚动最优化的方式生成。通过以上的改进，在控制策略整体风险的基础之上，策略加大在风险资产上的配置比例，提高了收益。

#### 5、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。

#### 6、国债期货投资策略

本集合计划参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本集合计划将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

#### 四、 投资比例

##### 1、 投资比例（占集合计划资产总值）

- 1) 固定收益类资产：0%~80%；
- 2) 权益类资产：0%~80%；
- 3) 期货及金融衍生品类账户权益：0%~20%；

本集合计划投资于公募证券投资基金，大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算，上述投资比例符合《运作规定》组合投资的要求。托管人将依据管理人提供的数据进行监控。

#### 五、 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 20 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，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（如需）。

#### 六、 投资限制及禁止行为

##### （一）投资限制

- 1、 产品的总资产不得超过资产净值的 200%；
- 2、 本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的 20%。开放退出期内，产品资产组合中七个工作日可变现资产的价值，不低于资产净值的 10%；
- 3、 投资于同一资产的资金不得超过本产品资产净值的 25%；产品管理人管理的全部产品投资于同一资产的资金，不得超过该产品的 25%；银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方债券等中国证监会认可的投资品种除外。法律法规另有规定的，从其规定；
- 4、 市值或成本计算，持有单一股票型、混合型基金不超过产品资产净值的 20%，且持有的份额不过该基金总发行额的 25%；
- 5、 本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产的 50% 时，集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 120%，但本集合计划投资于国债、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的除

外。

6、相关法律法规及中国证监会禁止的其他行为。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、承销证券；
- 14、投资于商业银行信贷资产；
- 15、直接或者间接投资于违反国家产业政策、环境保护政策的项目（证券市场投资除外）；
- 16、法律、行政法规和中国证监会禁止的其他行为。

## 七、投资金融期货的特殊约定

1) 资产管理计划参与金融期货交易，应当制定参与金融期货交易的相关制度，包括投资决策流程、投资目的、投资规模及风险控制等事项，应当按照规定向相关监管机构报备。

2) 金融期货交易的投资目的为套期保值和提高收益。

3) 金融期货交易的比例限制

因证券期货市场波动、资产管理计划规模变动等管理人之外的原因致使金融期货投资比例不符合规定的，管理人应当在 20 个交易日内调整完毕，同时在该情形发生之日起按照规定向相关监管机构报备。

#### 4) 金融期货交易的信息披露及报告

本资管计划参与金融期货交易，应当按合同约定的方式向客户充分披露资产管理计划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，并在资产管理计划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。

管理人应当在集合计划清算结束后 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。

#### 5) 金融期货交易的风险控制及责任承担

本资管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。

管理人参与金融期货交易应当符合法规规定和合同约定，使相关风险控制指标符合规定标准。

本资管计划投资金融期货交易的风险由投资者自行承担，管理人、托管人不以任何方式对投资者资产本金不受损失或者取得最低收益作出承诺。

#### 6) 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，管理人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，管理人将首先运用资管计划资产从市场上拆借资金；如仍不能满足保证金缺口的，管理人将及时变现资管计划资产，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

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），管理人不承担赔偿责任。

#### 八、业绩比较基准（如有）及确定依据

国泰君安安全天候指数 (CI011001.WI)。国泰君安安全天候指数 (CI011001.WI) 以全天候思想为基础,标的资产池包括国内外股票、债券、大宗商品、黄金等类别,覆盖了经济增长风险、利率风险、通胀风险等多维度风险,指数的底层资产构成、编制逻辑和本产品的投资范围,运作思路较为相近,选择国泰君安安全天候指数作为业绩比较基准,可以较为直观的体现本产品运作的策略目标和风险特征。

#### 九、风险收益特征

管理人根据相关法律法规及其内部相关制度规定,将本集合计划的风险评级评价为中高风险 (R4),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积极型 (C4)、激进型 (C5) 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。

#### 十、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。

#### 十一、规避特定风险的安排

无

#### 十二、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。

#### 十三、预警线与平仓线

本集合计划不设置预警线与平仓线。

#### 十四、证券交易资金前端风险控制

管理人应当根据《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,及时申报有关信息,确保申报信息真实、完整、有效,切实履行资金前端控制各项职责。证券交易所根据申报人申报的符合要求的自设额度,对其相关交易单元实施资金前端控制。

## 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

### （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附件二。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托管人公开披露的最新关联方为准。

#### （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

### 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：

钟玉聪先生，中国科学院数学与系统科学研究院概率论与数理统计博士，14年证券从业经验。2006年加入国泰君安证券，历任国泰君安证券衍生产品部研究员、国泰君安证券资产管理总部研究员等职，现任“上证央企”、“君享全天候”系列投资经理。在量化模型等方面有深入研究及丰富投资经验，尤其擅长期权定价与结构化产品设计、对冲、套利及alpha策略、大类资产配置策略等。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。

傅林钊，香港中文大学理学硕士，9年证券从业经验。现就职于上海国泰君安证券资产管理有限公司，从事结构化产品业务及衍生品等投资工作。加入国君资管之前，曾就职于Serisys Solutions Ltd、国泰君安证券（香港）有限公司、国泰君安证券股份有限公司，历任量化分析师、结构化产品投资经理、研究员等工作，善于运用定性和定量相结合的方法进行多策略投资，使用衍生品工具表达投资观点。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。

### 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投资者和托管人，并向托管人提供投资经理身份信息资料。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投资者和托管人，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，债券投资及其应计利息，股票、基金投资及其分红，其他资产等。

### 二、 集合计划账户的开立

托管人为本集合计划开设托管账户，保管集合计划的银行存款，该托管账户是指托管人在集中清算模式下，代表所托管的包括本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。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。该账户不得透支、提现，保管期间资产投资者、资产管理人、资产托管人三方均不得采取任何使该账户无效的行为。当本集合计划的托管账户被有权机关查询、冻结或扣划款项时，托管人按照有权机关要求依法予以执行，因此影响托管账户资金划付的，托管人不负任何责任。相关手续办理完毕后，托管人及时通知管理人，，但法律法规或监管要求另有规定的除外。

管理人为本集合计划开立证券账户，证券账户名称为“国君资管—建设银行—君享大类资产全天候 16 号集合资产管理计划” [备注：证券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投资者建立集合计划交易账户，记录投资者通过该销售机构买卖本集合计划份额的变动及结余情况。

注册登记机构为投资者开立集合计划账户，用于记录投资者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. 集合计划财产为信托财产，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。托管人

对实际交付并控制下的集合计划财产承担保管职责，对于证券登记机构、期货经纪公司或结算机构等非托管人保管的财产不承担责任。

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。划款指令授权书应以原件送达资产托管人，资产托管人确认划款指令授权书要素齐备、无空白及修改痕迹后，划款指令授权书自原件送达资产托管人之日起生效，如授权书中注明的生效日期晚于前述原件到达日，以授权书中注明的生效日期为准，如授权书中注明的生效日期早于原件到达日期，以原件送达资产托管人之日为准。划款指令授权书原件未及时送达资产托管人的，资产托管人有权拒绝执行该授权书对应的划款指令，且无须承担由此造成的任何损失。

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

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、支付日期、金额、付款账户信息、收款账户信息等，书面指令还应加盖授权书授权的印章及被授权人签字或签章。

### 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），管理人应优先以电子指令形式向托管人发送指令，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，以传真或电子邮件发送指令扫描件作为应急方式备用。

(2)若管理人未与托管人建立深证通指令直连，且未申请托管网银的，指令由管理人用传真方式、电子邮件发送指令扫描件或托管人和管理人认可的其他方式向资产

托管人发送。

(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、确认与执行

(1) 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，托管人不承担责任。托管人依照本协议及“划款指令授权书”约定的方法确认指令有效后，方可执行指令。

托管人收到管理人发送的指令后，应对划款指令进行审查，验证指令的要素是否齐全、指令内容是否与本合同约定相符，书面指令上的印鉴与签字是否与划款指令授权书预留的印鉴与签字样本相符。复核无误后依据本合同约定在规定期限内及时执行，不得延误。若存在异议或不符，托管人立即与管理人指定人员进行电话联系和沟通，并要求管理人重新发送经修改的指令。对于管理人依照本协议及“划款指令授权书”发出的指令，管理人不得否认其效力。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。管理人在发送指令时，应为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，管理人应给资产托管人预留出距划款截至时点2个工作小时的指令执行时间。由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管理人承担。

(2) 托管人可以要求管理人以传真、电子邮件或双方认可的其他方式提供相关交易凭证、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。

(3) 管理人向托管人下达指令时，应确保托管账户有足够的资金余额，对管理人在托管账户没有充足资金的情况下向托管人发出的指令，托管人应拒绝执行，并立即通知管理人，托管人不承担因为不执行该指令而造成的损失。

(4) 管理人应将银行间同业拆借中心的成交通知单加盖印章后以传真或电子邮件方式发送给托管人。在本集合计划财产申购/认购开放式基金时，管理人应在向托管人提交划款指令的同时将经有效签章的基金申购/认购申请书以传真或电子邮件方式送达托管人。

## 四、 托管人暂缓、拒绝执行指令的情形和处理程序

托管人在本合同第 19 部分第三条约定的投资监督事项范围内发现管理人发送的指令违反《基金法》、本合同或其他有关法律法规的规定时，不予执行，并应及时以书面形式通知管理人纠正，管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对托管人发出回函确认，由此造成的损失由管理人承担。

## 五、 管理人发送错误指令的情形和处理程序

管理人发送错误指令的情形包括指令发送人员无权或超越权限发送指令及交割信息错误，指令中重要信息模糊不清或不全等。托管人在履行监督职能时，发现管理人的指令错误时，应当拒绝执行，并及时通知管理人改正。

## 六、 更换指令被授权人的程序

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。管理人应于新授权书生效前将新授权书书面文件送达资产托管人。该变更将在资产托管人收到正式书面通知原件并经电话确认后正式生效，同时原授权书作废。被授权人变更通知生效前，资产托管人仍应按原约定执行指令，资产管理人不得否认其效力。如果资产管理人授权人员名单、权限有变化时，未能按本合同约定及时通知资产托管人并预留新的印鉴和签字样本而导致计划资产受损的，资产托管人不承担任何形式的责任。

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。

## 七、 投资指令的保管

指令、指令授权书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，则正本由管理人保管，托管人保管传真件、扫描件。当两者不一致时，以托管人收到的传真件、扫描件为准。

## 八、 其他相关责任

托管人正确执行管理人符合本合同规定、合法合规的划款指令，集合计划财产发生损失的，托管人不承担任何形式的责任。在正常业务受理渠道和指令规定的时间内，因托管人原因未能正确执行符合本合同规定、合法合规的划款指令而导致集合计划财产受损的，托管人应承担相应的责任，但托管账户余额不足或托管人遇到不可抗力

的情况除外。

如果管理人的划款指令存在事实上未经授权、欺诈、伪造或未能按时提供划款指令人员的预留印鉴和签字样本等非托管人原因造成的情形，只要托管人根据本合同相关规定验证有关印鉴与签名无误，托管人不承担因正确执行有关指令而给管理人或集合计划财产或任何第三人带来的损失，相应责任由管理人承担。

## 第 18 部分交易及清算交收安排

### （一）选择证券、期货经纪机构的程序

计划份额持有人授权管理人、托管人与证券公司签订《资产管理合同之操作协议》（具体以实际签约名称为准），委托证券公司下属营业部作为经纪服务商为本计划项下的证券资产及资金提供证券经纪服务。本计划财产投资于证券发生的所有场内交易的清算交割由经纪服务商负责根据相关登记结算公司的结算规则办理。管理人应在证券经纪服务协议或其他协议中约定由选定的证券经纪服务商承担资金安全保管责任。

### （二）投资证券后的清算交收安排

#### 1. 场内证券资金结算

管理人向托管人发送银证转账指令，划拨场内投资资金。本着安全保管本计划财产的原则，在不影响本计划投资管理且和管理人协商一致的前提下，托管人可根据管理人的指令定期或不定期将证券资金账户余额划入托管资金账户。

本计划的银行管理账户与证券资金账户通过“第三方存管”平台同步，经纪服务商日终清算完成后将交易所格式数据以约定方式发送给管理人、托管人。管理人、托管人根据 T 日交易数据各自进行清算并与经纪服务商 T 日提供的证券资金账户对账单进行核对。

本计划场内证券投资的具体操作按照管理人、托管人及证券经纪机构签署的《资产管理合同之操作协议》（以实际名称为准）的约定执行。

#### 2. 场外证券资金结算

管理人负责场外交易的实施，托管人负责根据管理人划款指令以及相关交易附件进行指令审核并完成场外交易资金的划付。

### （三）开放式基金投资的清算交收安排

1、开放式基金申购（认购）相应的资金划拨由托管人依据管理人的划款指令逐笔划付。管理人申购（认购）开放式基金时，应将划款指令连同基金申购（认购）申请单一并传真或邮件至托管人。托管人审核无误后，应及时将划款指令交付执行。管理人应实时调整当日可用资金余额。管理人在收到基金申购（认购）确认回单后，应立即传真或邮件至托管人。

2、管理人赎回开放式基金时，应在向基金管理公司或代销机构发出基金赎回申请书的同时将赎回申请书传真或邮件至托管人；管理人在收到赎回确认回单后，应及

时传真或邮件至托管人。

3、为确保本计划财产会计核算及估值的及时处理，管理人应于开放式基金交易（包括认购、申购、赎回、基金转换、红利再投资、现金分红等）的确认日及时获取确认单等单据的传真件或邮件，要求并督促基金管理公司于当日传真或邮件给管理人，管理人收到后应立即传真或邮件至托管人。

#### （四）银行间交易资金结算安排

1、管理人负责对交易对手的资信控制，按银行间债券市场的交易规则进行交易，并负责解决因交易对手不履行合同或不及时履行合同而发生的纠纷。

2、管理人应在交易结束后将银行间同业市场债券交易成交单加盖印章后及时传真或邮件给托管人，并电话确认。如果银行间中债综合业务平台或上海清算所客户终端系统已经生成的交易需要取消或终止，管理人应书面通知托管人。

3、银行间交易结算方式采用券款对付的，托管资金账户与本计划在登记结算机构开立的 DVP 资金账户之间的资金调拨，除了登记结算机构系统自动将 DVP 资金账户资金退回至托管资金账户之外，应当由管理人出具资金划款指令，托管人审核无误后执行。由于管理人未及时出具指令导致本计划在托管资金账户的头寸不足或者 DVP 资金账户头寸不足导致的损失，由管理人承担责任。

#### （五）投资银行存款的特别约定

1、本计划投资银行存款前，应与存款银行签署投资银行定期存款协议。

2、本计划投资银行存款，必须采用管理人和托管人认可的方式办理。

3、管理人投资银行存款或办理存款支取时，应提前书面通知托管人，以便托管人有足够的时间履行相应的业务操作程序。

#### （六）其他场外交易资金结算

1、管理人负责场外交易的实施，托管人负责根据管理人划款指令和相关投资文件进行场外交易资金的划付。管理人应将划款指令连同相关交易文件一并传真至托管人，托管人根据本合同“十七、投资指令的发送、确认和执行”的约定审核后及时执行划款指令。

2、相关交易文件中约定的其他转让或划款条件由管理人负责审核。管理人同时应以书面形式通知托管人相关收款账户名、账号、交易费率等。投资或收益分配资金必须回流到本计划托管资金账户内，不得划入其他账户。

#### （七）资金、证券账目及交易记录的核对

管理人和托管人应定期对账。

对计划财产的资金账目，以管理人与托管人约定方式核对，确保相关各方账账相符。

对计划财产的证券账目，由相关各方根据外部第三方对账数据定期进行对账。对计划财产的交易记录，管理人与托管人核对估值结果之前，应保证所有实际交易记录与会计账簿上的交易记录完全一致，如果实际交易记录与会计账簿记录不一致，造成会计核算不完整或不真实，由此导致的损失由管理人承担。

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

## 第 19 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受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、从事投资。

### 二、对越权交易的处理

#### 1、违反有关法律法规和本合同规定进行的投资交易行为

托管人在本合同第 19 部分第三条约定的投资监督事项范围内，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，应当拒绝执行，立即通知管理人，并有权及时按照规定向相关监管机构报备（如需）。

托管人在本合同第 19 部分第三条约定的投资监督事项范围内，发现管理人依据交易程序已经生效的划款指令违反法律法规的规定，或者违反本合同约定的，应当立即通知管理人，并有权及时按照规定向相关监管机构报备（如需）。

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。管理人对托管人通知的越权事项未能在限期内纠正的，托管人有权按照规定向相关监管机构报备（如需）。

越权交易所发生的损失及相关交易费用由过错方负担，所发生的收益归集合计划资产所有。

### 三、托管人对管理人投资运作的监督

1、托管人对管理人的投资行为行使监督权。托管人承诺对附件一《投资监督事项表》的内容进行监督，如本合同其他章节的约定与本条约定不一致的，托管人对管理人投资行为的监督内容与标准均以《投资监督事项表》为准。

2、托管人按本条第 1 款约定对管理人的投资监督和检查自本合同生效之日起开始，至本计划进入清算程序之日起终止监督。

3、托管人履行投资监督义务受限于管理人、证券经纪机构、期货经纪机构及其他中介机构提供的数据和信息。托管人对上述机构提供信息的真实性、准确性、及时性和完整性不作任何担保、暗示或表示，并对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟

所引起的损失不承担任何责任。

## 第 20 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，并依法进行基金、债券交易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、《管理办法》、《运作规定》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))，按前一交易日估值日的基金份额净值估值；前一交易日估值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前一交易日估值日的每万份收益每日计提红利；

### (2) 投资证券衍生品的估值方法

1) 从持有确认日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证按估值日在证券交易所挂牌的该权证的收盘价估值；估值日没有交易的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如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，调整最近交易市价，确定公允价格。

2) 因持有股票而享有的配股权, 以及停止交易但未行权的权证, 采用估值技术确定公允价值进行估值。

3) 期货以估值日金融期货交易所的当日结算价估值, 该日无交易的, 以最近一日的结算价估值。

### (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。

### (4) 股指期货的估值方法

股指期货合约的投资, 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。

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全价进行估值。

4、如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映集合计划资产公允价值的, 管理人可根据具体情况, 在综合考虑市场成交价、市场报价、流动性、收益率曲线等多种因素基础上, 在与托管人商议后, 按最能反映集合计划资产公允价值的方法估值;

5、相关法律法规以及监管部门有强制规定的, 从其规定。如有新增事项, 按国家最新规定估值;

如管理人或托管人发现集合估值违反合同订明的估值方法、程序及相关法律法规的规定或者未能充分维护投资者利益时, 应立即通知对方, 共同查明原因, 双方协商解决。

根据有关法律法规, 资产净值计算和会计核算的义务由管理人承担。本集合的会计责任方由管理人担任, 因此, 就与本集合有关的会计问题, 如经相关各方在平等基础上充分讨论后, 仍无法达成一致的意见, 按照管理人对集合资产净值的计算结果对外予以公布。

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

## (八) 估值程序

日常估值由管理人、托管人双方通过电子直连或电子邮件进行核对。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邮件、电子对账、录音电

话或双方认可的方式等形式进行，托管人复核无误后返回给管理人。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 0.0001 元，小数点后第五位四舍五入。

#### (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。

1、当发生净值计算错误时，由管理人负责处理，由此给投资人和集合计划造成损失的，由管理人对投资人或者集合计划先行支付赔偿金。管理人和托管人应根据实际情况界定双方应承担的责任，经确认后按以下条款进行赔偿；

(1) 本集合计划的会计责任方由管理人担任。与计划有关的会计问题，如经管理人和托管人在平等基础上充分讨论后，尚不能达成一致时，按会计责任方的建议执行，由此给投资人和集合计划造成的损失，托管人不承担责任；

(2) 如管理人计算的计划财产净值已由托管人复核确认的，但因资产估值错误给投资人和集合计划造成损失的，由管理人与托管人各自承担相应的赔偿责任；

(3) 如管理人和托管人对计划份额净值的计算结果，虽然多次重新计算和核对，尚不能达成一致时，为避免不能按时向投资人报告份额净值的情形，以管理人的计算结果对外公布，由此给投资人和集合计划造成的损失，托管人不承担责任；

2、法律法规、部门规章或者监管部门另有规定的，从其规定。如果行业有通行做法，管理人和托管人应本着平等和保护投资人利益的原则进行协商。

#### (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按照上述估值方法不能客观反映其公允价值的，管理人可根据具体情况与托管人商定后，按最能反映公允价值的价格进行估值调整。

#### (十一) 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，导致管理人、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。

#### (十二) 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。

#### (十三) 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，有关会计制度变化、管理人或托管人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。但管理人和托管人应当积极采取必要的措施消除或减少由此造成的影响。

由于注册登记机构发送的数据有误，处理方法等同于交易数据错误的处理方法。

## 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公历年度的1月1日至12月31日。

2、本集合计划的记账本位币为人民币，以人民币元为记账单位。

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 21 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、集合计划的托管费；
- 2、集合计划的管理费；
- 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 0.02%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.02\% \div 365$$

H 为每日应计提的托管费；

E 为前一日集合计划资产净值。成立日首日按照成立规模计算。

托管人的托管费自本计划成立日起每日计提，逐日累计至每月月底，按自然月支付，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，并经托管人复核后在月初 5 个工作日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，则管理人在不可抗力情形消除后的首个工作日出具划款指令进行支付。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： 托管费收入暂收暂付户

开户行：建行云南省分行本级核算

账 号： 530085036156313999000000019

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 0.8%。计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div 365$$

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。成立日首日按照成立规模计算。

管理人的固定管理费自本计划成立日起每日计提，逐日累计至每季度末，按季度支付，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，并经托管人复核后在下季季初 5 个工作日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，则管理人在不可抗力情形消除后的首个工作日出具划款指令进行支付。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、证券结算风险基金等费用，作为交易成本或作为当期费用直接扣除。

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

集合计划存续期间，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审查。

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。

7、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；

在计划完成备案后，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。

本条第3至7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受托资产中优先划扣抵偿，投资者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) 管理人收取业绩报酬的原则：

(1) 按投资者每笔参与份额分别计算年化收益率并计提业绩报酬，如期间业绩报酬计提基准出现调整，每笔参与份额分段计算年化收益率并在业绩报酬计提日分段计算业绩报酬。

(2) 在符合业绩报酬计提条件时，在计划分红权益登记日、投资者退出日和计划终止日（合称“业绩报酬计提日”）计提业绩报酬。业绩报酬应当从分红资金、退出资金或清算资金中提取，从分红资金中提取业绩报酬的频率不得超过每6个月一次。

(3) 业绩报酬从分红资金、退出资金或清算资金中扣除。

(4) 在计划分红权益登记日，管理人对全部存续份额计提业绩报酬；在投资者退出或计划终止时，业绩报酬按投资者退出份额或计划终止时持有份额计算。如退出份额包括一笔参与份额的一部分，则将该部分参与份额视为一笔参与份额进行核算，剩余未退出的份额不受影响。

#### 2) 业绩报酬的计提方法：

(1) 在业绩报酬计提日，若持有期年化收益率  $R$  小于或等于业绩报酬计提基准，管理人不提取业绩报酬。

(2) 在业绩报酬计提日，若持有期年化收益率  $R$  大于业绩报酬计提基准，管理人提取超出部分的一定比例作为业绩报酬，具体计算方法见下文“（4）管理人以超额比例的方式提取业绩报酬”。

(3) “持有期年化收益率”系指上一个业绩报酬计提日（如上一个业绩报酬计提日不存在，募集期参与的为计划成立日，存续期参与的为参与确认日；特

别的，若计划分红权益登记日未发生业绩报酬计提，该日仍为业绩报酬计提日；下同)到本次业绩报酬计提日的年化收益率，作为计提业绩报酬的年化收益率。各段持有期年化收益率的计算公式如下：

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

R 为各段持有期年化收益率

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 表示上一个业绩报酬计提日到本次业绩报酬计提日的天数。

(4) 管理人以超额比例的方式提取业绩报酬

具体计算方法如下：

持有期年化收益率(R)	提取比例	业绩报酬(E)
$R \leq R'$	0	0
$R > R'$	20%	$E=K \times (R-R') \times 20\% \times T/365$

注：①E 为管理人对投资者每笔参与份额(在计划分红权益登记日与计划终止日，指投资人持有的每一笔存续份额；在投资者退出申请日，指投资者退出的每一笔份额；下同)应提取的业绩报酬。

②R 为各段持有期年化收益率，R' 为业绩报酬计提基准，仅在开放期调整，具体详见管理人相关公告。

③K 为投资者每笔参与份额在上一个业绩报酬计提日的资产净值总额。

④于业绩报酬计提日，管理人有权收取的业绩报酬总额，为所有投资者参与笔数对应的管理人业绩报酬的总和。

⑤业绩报酬计提基准仅作为管理人提取业绩报酬的计算标准，不代表对资产管理计划未来收益的承诺或保证。管理人不保证资产管理计划一定盈利，也不保证最低收益。

⑥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。

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以邮件、传真或双方约定的方式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，并由托管人于业绩报酬提取日后5个工作日内按照管理人指令从本集合计划资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

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、托管人对受托资产收益状况的任何承诺和担保，投资者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、托管人与全体投资者协商一致通过后由管理人向投资者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受托财产承担。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，管理人有权以受托财产予以预提税费或其他方式从受托财产中扣除相关应缴增值税税费；管理人在向投资者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，投资者应按照管理人通知要求进行补缴，管理人亦有权以投资者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，管理人有权从受托资产中划扣抵偿，投资者不以任何方式要求管理人向其返还或补偿该等税费；投资者未按照本条款约定缴纳税款给管理人造成损失的，投资者承担全部赔偿责任。

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 22 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，选择采取红利再投资形式的，分红资金将按除权日的份额净值转成相应的份额；
- 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投资者自行承担；
- 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投资者。

### 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

投资者可以选择收益分配方式为现金或红利再投资于本集合计划，未做选择

的默认是现金分红。投资者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，再划入推广机构指定的收款账户，最后由推广机构划入投资者账户。

#### 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，由托管人核实收益分配总额（托管人无复核义务的数据除外）后由管理人以公告形式告知投资者。

#### 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投资者自行承担。

#### 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、管理人通知投资者；
- 6、注册登记人实施分配方案。

#### 十二、收益分配的执行

在收益分配方案公布后，管理人依据具体方案的规定就支付的现金收益向托管人发送划款指令，托管人按照管理人的指令及时进行现金收益的划付。

## 第 23 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第一个交易日的份额净值、累计净值，供投资人参考。在开始办理集合计划存续期参与后，管理人应当在每个开放日后的第一个工作日，通过管理人网站披露开放日的经过托管人复核的集合计划份额净值。

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；
- （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、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（如需）。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（如需）。

#### 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，通过管理人网站向投资者披露，并按照规定向相关监管机构报备（如需）。

#### 4、对账单

管理人每年度结束后一个月内以电子邮件、短信或其他电子形式向持有本集合计划份额的持有人提供对账单，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。

## 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等方式及时向投资者披露。临时报告的情形包括但不限于：

（1）集合计划运作过程中，负责集合资产管理业务的高级管理人员或投资主办人员发生变更，或出现其他可能对集合计划的持续运作产生重大影响的事项；

（2）暂停受理或者重新开始受理参与或者退出申请；

（3）发生巨额退出并延期支付；

（4）集合计划终止和清算；

（5）合同的补充、修改与变更；

（6）与集合计划有关的重大诉讼、仲裁事项；

（7）管理人以自有资金参与或退出本集合计划；

（8）管理人、托管人因重大违法违规，被中国证监会取消相关业务资格；

（9）管理人、托管人因解散、破产、撤销等原因不能履行相应职责；

（10）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）上披露，投资者可随时查阅。管理人网站发布公告即视为履行了告知义务。

## 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，供投资者查询。

## 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，投资者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），供投资者查阅。

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。

## 六、向监管机构提供的报告

管理人、托管人应当根据法律法规和监管机构的要求履行报告义务。

## 第 24 部分 风险揭示

投资者投资于本计划可能面临以下风险，有可能因下述风险导致投资者本金或收益损失。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、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》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，可能给投资者带来一定的风险。

#### 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。投资者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：

本集合计划存在未在证券投资基金业协会完成备案的风险，管理人不保证本集合计划成立后一定能获得协会的成功备案。除以现金管理为目的投资于银行活期存款外，资产管理计划在完成基金业协会备案前不得开展投资活动。如果本集合计划成立后不能及时完成备案，将可能导致本计划错过市场行情或投资机会；如果本集合计划在成立后无法通过协会的备案或不予备案，则将直接影响本集合计划设立目的的实现。当出现无法通过协会备案或不予备案的情形，本集合计划提前终止，由此直接影响资产投资者参与本集合计划的投资目的。如本集合计划未通过协会备案的，管理人将在确认上述事项后次个工作日内告知投资者，并按照合同约定履行终止清算程序。

## 5. 关联交易风险

### ①一般关联交易的风险提示

投资者签署本合同即视为已经充分理解并同意管理人从事本合同已经明确列明的一般关联交易情形，管理人无需就前述具体一般关联交易再行分别取得投资者的授权。管理人承诺该等一般关联交易投资应按照市场通行的方式和条件参与，公平对待计划财产，防止利益冲突，不得损害投资者利益，并依据相关要求履行信息披露和监管报告义务。投资者存在未及时关注管理人的信息披露内容的风险。

### ②重大关联交易的风险提示

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。

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。

托管人关联方名单以公开披露的最新报告为准，如因报告未披露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。

## 二、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。

本计划属于中高风险（R4）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积极型（C4）、激进型（C5）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）后三十日内退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（适用于期货及衍生品、非标准化债权、未上市股权及收益权等）

#### (1) 投资金融期货的特有风险

##### 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

对于期货交易而言，信用风险发生的概率极小，原因是在进行期货交易时，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

投资者期货投资的结算及投资者期货资金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。

对从事期货投资的投资者来说，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) 衍生品风险：

金融衍生品具有杠杆效应且价格波动剧烈，会放大收益或损失，在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。

#### (3) 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。

3) 标的金融产品的管理人投资管理能力及其聘请的投资顾问（如有）的投资建议水平，均会对标的金融产品的收益水平产生重大影响，进而影响计划的收益水平。

4) 标的金融产品可能并非随时开放申购、赎回，其申购、赎回的限制可能给计划的流动性造成影响，也可能造成计划不能及时执行预警止损机制（如有）。

5) 标的金融产品本身将会收取一定的费用，虽然该等费用可能并非直接在计划项下列支，但相比较于资产投资者直接对标的金融产品进行投资的情况，资产投资者通过投资于计划间接投资于标的金融产品，实质上同时承担了计划、标的金融产品项下的费用。

#### （4）投资于同业存款、协议存款的风险

1) 法律与政策风险：因国家政策及相关法律、法规的调整与变化，导致存单投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

2) 信用风险：因融资人未按存单交易合同的约定履行还款义务而导致的风险。

3) 市场风险：因宏观政策、经济周期、市场价格等因素的变化，导致存单投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

4) 操作风险：在存单投资的发放与管理过程中，非因管理人原因（不可抗力除外）产生的不完善或有问题的程序和不适当的管理措施，导致存单投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

5) 不可抗力风险：因发生委托人或受托人不能预见、不能避免和不能克服的客观情况，导致存单投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险。

6) 其他风险：是指除上述风险外，所有导致存单投资无法按时收回或无法按时足额收回的风险（因管理人违反本合同约定导致的除外）。

7) 承担相关法律费用的风险：根据存单投资合同约定采取诉讼或仲裁等相应措施收回本息时，如需委托他人代为诉讼或仲裁，委托人可能将承担相应实现存单收益的费用，包括但不限于诉讼（仲裁）费、律师费、差旅费、执行费、保全费及其他实现存单收益的必要费用，从而带来风险。

#### （5）投资于逆回购的风险

逆回购的风险主要包括利率风险、流动性风险、信用风险、市场风险、法律和监管风险。

**利率风险：**逆回购的利率取决于市场供需关系和国债的利率水平。如果市场利率下降，国债逆回购的利率也会随之下降，这可能导致投资者的收益下降，甚至出现亏损。

**流动性风险：**国债逆回购是固定到期产品，可能会导致投资者在需要资金时无法

及时卖出。此外，如果市场出现异常波动，也可能导致投资者无法及时平仓或交割。

信用风险：在国债逆回购交易中，如果该投资者无法按时归还资金，可能会导致投资者遭受损失。

市场风险：国债逆回购是市场交易，受市场波动的影响。市场因素如供需关系、政治事件、宏观经济数据等都可能对国债逆回购的价格产生影响。

法律和监管风险：国债逆回购的法律和监管环境可能发生变化，从而对合同和协议产生影响。投资者需要了解相关法规和政策的变化，以确保他们的交易合法合规。

## 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。

## 三、其它风险

### 1. 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投资者利益受损。

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主办人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投资者利益受损。

#### (7) 预警止损的风险

本计划未设置预警止损机制，由此当市场大幅下跌或遭遇其他特殊市场不利环境，本计划可能出现本金大幅亏损的风险。

(8) 投资者提供信息不真实、不准确、不完整或投资者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。

## 2. 其他一般风险

### (1) 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投资者的利益受到影响。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。

### (2) 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。

### (3) 杠杆风险

本计划杠杆比例较高，杠杆投资会放大收益或损失，投资者投资金额存在较大损失的可能。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，因杠杆投资导致的损失由本计划资产承担。

(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）就合同变更内容向投资者征询意见，在征得投资者意见后，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

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。

(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。

(9) 通过第三方基金销售机构投资开放式基金的风险

本资产管理计划可通过第三方基金销售机构投资开放式基金，资产管理人负责选择销售机构，并确保在销售机构预留的备案回款账户为银行托管账户。资产托管人对于通过第三方基金销售机构投资开放式基金不承担任何风险。

由于通过第三方销售平台购买，可能会存在认（申）购、赎回（现金分红）基金时资金被挪用的风险；第三方销售平台对基金账户管理不当造成投资人持有基金份额

不准确的风险；认（申）购款未能用于购买指定基金的风险；以及第三方基金销售平台无基金销售资质的风险。

（10）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

### 一、合同的变更

1、各方一致同意，以下事项可由资产管理人自行决定变更：

- (1) 调低资产管理人的报酬标准；
- (2) 调低参与费、退出费的费率；
- (3) 投资经理的变更；

(4) 对本资产管理计划的认购、参与、退出、资产管理计划份额转让的业务规则(包括但不限于总规模、单个投资者首次认购、参与金额及持有的本资产管理计划总金额限制等)进行调整；

(5) 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

2、各方一致同意，以下事项可由资产管理人和资产托管人协商后变更：

(1) 调低资产托管人或投资顾问(如有)的报酬标准；

(2) 因法律法规或中国证监会、基金业协会的相关规定、要求发生变化需要变更本资产管理合同，资产管理人可以与资产托管人协商后修改本资产管理合同，并由资产管理人按照本资产管理合同约定及时向投资者披露变更的具体内容；

(3) 不会对资产管理计划份额持有人权利义务产生实质不利影响的资产管理合同相关事项变更，但资产管理人有权自行决定变更的事项除外；

(4) 法律法规规定或本资产管理合同约定的其他情形。

3、上述 1、2 所述情形，更新或修改的内容在管理人网站公告后生效。除上述 1、2 所述情形外，为了投资者的利益，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)向投资者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) 投资者不同意变更的，管理人保障其退出权利，投资者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，该等退出不受本计划每笔份额持有期限的限制；

(2) 投资者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投资者自行承担；

(3) 投资者未回复意见且逾期未退出，视同投资者同意本合同变更，管理人不再

另行通知；

(4) 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(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。

4、投资者同意，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。

5、投资者同意并确认，若经全体投资者、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。

6、合同变更后，投资者、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。

7、投资者、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，或排除投资者自行承担投资风险和损失。

8、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（如需）。

## 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) 新任管理人由全体投资者一致同意并共同选定。全体投资者应当于上述管理

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投资者一致同意并共同选定。管理人和全体投资者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，无需事先征得投资者同意。

## 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，本集合计划运作规范，管理人、托管人未违反法律、行政法规、中国证监会规定和《集合资产管理合同》的约定；

2、展期没有损害投资者利益的情形；

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投资者。

3、投资者回复的方式

投资者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) 投资者不同意展期的处理办法

若投资者明确回复不同意展期，投资者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；若投资者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；若投资者回复意见不明确的，则视为该投资者不同意展期，按照不同意展期的情况处理；若投资者未回复意见的，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投资者人数不少于 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投资者人数低于 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。

资产管理合同发生展期的，管理人应当自资产管理合同展期之日起 5 个工作日内

报协会备案。

#### 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，经全体投资者、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，集合计划投资者少于 2 人时；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投资者低于 2 人时，当日投资者的退出申请管理人将有权做失败处理，本集合计划进入清算程序；
6. 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；
7. 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；
8. 未在证券投资基金业协会完成备案或不予备案的情形；
9. 法律、法规规定、中国证监会规定及《集合资产管理合同》约定的其他情况。

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（如需），前述第（8）项约定的情形除外。

#### 五、集合计划的清算

##### （一）清算小组

- 1、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五个工作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财产的保管、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。管理人负责资产管理计划财产的清算、估价、变现和分配，托管人负责资产管理计划财产的保管，执行管理人分配指令划付资金。

##### （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、管理人制作清算报告并经托管人复核；
- 5、对集合计划剩余财产进行分配；

### （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。

清算费用包括但不限于：

- （1）聘请律师以及其他工作人员等所发生的报酬（若有）；
- （2）集合计划资产的保管、清理、估价、变现和分配产生的费用；
- （3）信息披露所发生的费用；
- （4）诉讼、仲裁、保全等维护计划受托财产利益所发生的费用；
- （5）其他与清算事项有关的费用。

除交易所、登记结算机构、开户银行等自动扣缴的费用外，所有清算费用由管理人向托管人出具指令，由托管人复核后办理支付。

### （四）集合计划财产清算过程中剩余资产的分配

依据集合计划财产清算的分配方案，将集合计划财产清算后的全部剩余资产扣除集合计划财产清算费用及各项负债后，向投资者进行分配。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；如集合计划无法完成备案的而导致清算的，免收管理费、托管费和业绩报酬（如有）；
- 4、清算后如有剩余，按集合计划投资者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）。

计划财产未按前款 1、2、3 项约定清偿前，不分配给投资者。在完成前款 1、2、3 项程序后的剩余财产，管理人将按照投资者所持份额占本计划总份额的比例，以现金形式向投资者进行分配，《集合资产管理合同》另有约定的除外。

### （五）二次清算

计划终止后，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本计划所持有的已变现资产进行清算，并按《集合资产管理合同》约定向投资者进行分配，对集合计划持有的未变现的资产，可采取二次清算的方式。待集合计划持有的上述未变现资产完成变现后，管理人应及时对剩余资产进行二次清算，并将该部分财产根据《集合资产管理合同》的约定分配给全体投资者。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（或多次清算）期间，管理人、托管人不计提管理费、托管费。二次清算（或多次清算）流程同一次清算。集合计划因受托财产流动性受限等原因延期清算的，管理人应当及时向相关监管机构报备（如需）。

（六）集合计划财产清算报告的告知安排

清算结束后 15 个工作日内，集合计划清算小组应制作清算报告，在管理人网站公布或书面通知投资者。

管理人应当在集合计划清算结束后将清算报告报基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构（如需）。投资者在此同意，上述清算报告不再另行审计，亦不需要律师出具法律意见，除非法律法规或监管部门要求必须进行审计或律师出具法律意见的。

（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并全部划出托管账户后，管理人应在十个工作日内向托管人发出销户申请，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。

（十）管理人应当自资产管理计划终止之日起 5 个工作日内报告协会，并在资产管理计划清算结束后 5 个工作日内将清算报告报送协会。

## 第 26 部分违约责任

一、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，给本计划财产或者投资者造成损害的，应当分别对各自的行为依法承担赔偿责任，但不承担连带赔偿责任；因管理人、托管人双方原因给本计划财产或者投资者造成损害的，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。任何一方当事人延迟履行合同义务后，发生了上述不可抗力事件致使合同当事人无法全部或部分履行本合同，该方不能减轻或免除相应责任。

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

3、管理人由于按照合同规定的投资原则行使或不行使其投资权而造成的损失等；

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

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

6、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。

7、在本合同中约定的管理人、托管人可以免责的其他情形。

二、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。

三、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。

四、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投资者损失，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。

五、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。

六、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。

七、投资者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。

八、在投资者的集合计划资产被司法机关或其他政府机构扣押和查封的情况下，管理人和托管人没有义务代表投资者就针对集合计划资产所提起的司法或行政程序进行答辩，但是可以提供必要的协助。

## 第 27 部分争议处理

### 一、协商解决

因履行本合同所产生的任何争议，协议签订各方应秉持平等、互利、诚信的原则，首先通过友好协商予以解决。各方应在知悉争议发生之日起 [10] 个工作日内，向其他方书面提出协商请求，协商应在提出请求后的 [5] 个工作日内启动，并在合理期限内持续进行，尽力达成一致解决方案。

### 二、仲裁选择

若协商未能在启动后的 [10] 个工作日内达成令各方满意的结果，任何一方均有权将争议提交至上海国际仲裁中心进行仲裁。仲裁程序将严格依照该中心现行有效的仲裁规则执行，并在上海以中文进行。仲裁裁决为终局裁决，对协议签订各方均具有法律约束力。各方承诺尊重并切实履行仲裁裁决所确定的义务。

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 28 部分合同的成立与生效

### 一、 合同签署方式

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。

本合同的签署采用电子签名的方式进行的，由投资者签署。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，管理人执壹份，托管人执壹份，每份均具有同等法律效力，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。

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，且托管人加盖公章或合同专用章以及法定代表人/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、管理人加盖公章以及法定代表人/负责人或授权代表签字或盖章，且托管人加盖公章或合同专用章以及法定代表人/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）加盖公章以及双方法定代表人或授权代表签字或盖章，且托管人加盖公章或合同专用章以及法定代表人/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、托管人和投资者签署后成立。

本合同成立后，同时满足以下条件时生效：

- 1、投资者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投资者、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

《国泰君安君享大类资产全天候 16 号集合资产管理计划说明书》、《国泰君安君享大类资产全天候 16 号集合资产管理计划风险揭示书》、经管理人确认有效的投资

者参与、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 29 部分或有事项

无

(以下无正文)

集合资产管理计划管理合同

(本页无正文,为投资者、管理人上海国泰君安证券资产管理有限公司与托管人中国建设银行股份有限公司云南省分行签署《国泰君安君享大类资产全天候16号集合资产管理计划管理合同》的签署页)

管理人确认已向投资者明确说明集合计划的风险,不保证投资者资产本金不受损失或者取得最低收益;投资者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。

投资者(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

签订日期:年月日  
2025年04月11日

托管人:中国建设银行股份有限公司云南省分行(合同专用章)

法定代表人/授权代理人:

签订日期:2025年04月11日

集合资产管理计划管理合同

附件一：投资监督事项表

序号	监督项目	监督内容
一	投资范围	<p>1、投资范围</p> <p>1) 资管计划可根据资金管理的需求, 投资于现金、银行存款(包括但不限于活期存款、定期存款、协议存款、大额存单等)、货币市场基金、债券逆回购以及其他经中国证监会、中国人民银行认可的具有良好流动性的货币市场工具;</p> <p>2) 资管计划可投资于公募证券投资基金, 包括股票型基金、偏股混合型基金、债券型基金、交易所上市的封闭式证券投资基金和 LOF、ETF(含商品 ETF) 等;</p> <p>3) 资管计划可投资于股指期货、商品期货、国债期货等期货及衍生品类资产;</p> <p>4) 法律、法规、规范性文件、监管机构允许投资的其他投资品种(包括前述各产品类型的 QDII 产品)。</p> <p>特别揭示: 本计划可投资于债券回购。投资者已充分理解并接受本计划投资债券回购所附带的信用风险、流动性风险、利率风险等风险。</p> <p>2、投资比例(占集合计划资产总值)</p> <p>1) 固定收益类资产: 0%~80%;</p> <p>2) 权益类资产: 0%~80%;</p> <p>3) 期货及金融衍生品类账户权益: 0%~20%;</p> <p>本集合计划投资于公募证券投资基金, 大类资产配置比例、总资产占净资产比例应当按照穿透原则合并计算, 上述投资比例符合《运作规定》组合投资的要求。托管人将依据管理人提供的数据进行监控。</p>
二	投资限制	<p>(一) 投资限制</p> <p>1、产品的总资产不得超过资产净值的 200%;</p> <p>2、本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值在开放退出期内合计不得超过本集合计划资产净值的 20%。开放退出期内, 产品资产组合中七个工作日可变现资产的价值, 不低于资产净值的 10%;</p> <p>3、投资于同一资产的资金不得超过本产品资产净值的 25%; 产品管理人管理的全部产品投资于同一资产的资金, 不得超过该产品的 25%(管理人自行监控); 银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方债券等中国证监会认可的投资品种除外。法律法规另有规定的, 从其规定;</p> <p>4、市值或成本计算, 持有单一股票型、混合型基金不超过产品资产净值的 20%, 且持有的份额不过该基金总发行额的 25%;</p> <p>5、本集合计划投资于同一发行人及其关联方发行的债券的比例超过净资产的 50%时, 集合资产管理计划的总资产占净资产的比例不超过 120%, 但本集合计划投资于国债、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的除外。</p> <p>6、相关法律法规及中国证监会禁止的其他行为。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, 托管人不承担投资监督事项表约定以外的投资监督职责。

2、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。

集合资产管理计划管理合同

附件二：管理人关联方名单：

管理人关联方名单：

（注：本关联方证券名单如有变化，需及时更新，且以更新后的名单为准）

序号	关联关系	关联类型
1	上海国有资产经营有限公司	母公司控股股东
2	上海国际集团有限公司	母公司实际控制人
3	国泰海通证券股份有限公司	本公司的母公司
4	Guotai Junan Futures (Singapore) Pte. Ltd.	受同一母公司控制的其他企业
5	Guotai Junan Global Ltd.	受同一母公司控制的其他企业
6	Guotai Junan Holdings Limited	受同一母公司控制的其他企业
7	Guotai Junan International Asset Management (Singapore) Pte. Limited	受同一母公司控制的其他企业
8	Guotai Junan International Securities (Singapore) Pte. Limited	受同一母公司控制的其他企业
9	Guotai Junan International (Singapore) Pte. Limited	受同一母公司控制的其他企业
10	Guotai Junan Securities USA Holding, Inc.	受同一母公司控制的其他企业
11	Guotai Junan Securities USA, Inc.	受同一母公司控制的其他企业
12	Guotai Junan Securities (UK) Limited	受同一母公司控制的其他企业
13	Guotai Junan Securities (Vietnam) Corporation	受同一母公司控制的其他企业
14	国泰君安（香港）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
15	国泰君安财务（香港）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
16	国泰君安创新投资有限公司	受同一母公司控制的其他企业
17	国泰君安风险管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
18	国泰君安国际控股有限公司	受同一母公司控制的其他企业
19	国泰君安金融产品有限公司	受同一母公司控制的其他企业
20	国泰君安金融控股有限公司	受同一母公司控制的其他企业
21	国泰君安期货（香港）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
22	国泰君安期货有限公司	受同一母公司控制的其他企业
23	国泰君安融资有限公司	受同一母公司控制的其他企业
24	国泰君安外汇有限公司	受同一母公司控制的其他企业
25	国泰君安源成（上海）私募基金管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
26	国泰君安证券（澳门）一人有限公司	受同一母公司控制的其他企业
27	国泰君安证券（香港）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
28	国泰君安证券投资（香港）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
29	国泰君安证裕投资有限公司	受同一母公司控制的其他企业
30	国泰君安咨询服务（深圳）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
31	国泰君安资产管理（亚洲）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
32	华安基金管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
33	华安未来资产管理（上海）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
34	华安资产管理（香港）有限公司	受同一母公司控制的其他企业
35	上海国泰君安格隆创业投资有限公司	受同一母公司控制的其他企业
36	上海国泰君安好景投资管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
37	上海国泰君安君彤投资管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
38	国泰君安君本（上海）私募基金管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
39	上海国翔置业有限公司	受同一母公司控制的其他企业
40	青岛国泰君安新兴一号股权投资基金合伙企业（有限合伙）	母公司合营企业

集合资产管理计划管理合同

41	厦门君欣股权投资合伙企业（有限合伙）	母公司合营企业
42	上海国君创投隆盛投资中心（有限合伙）	母公司合营企业
43	上海国君创投隆旭投资管理中心（有限合伙）	母公司合营企业
44	上海国君创投隆兆投资管理中心（有限合伙）	母公司合营企业
45	上海国君创投证盛二号股权投资合伙企业（有限合伙）	母公司合营企业
46	上海国泰君安创新股权投资母基金中心（有限合伙）	母公司合营企业
47	上海君政投资管理有限公司	母公司合营企业
48	上海中兵国泰君安投资中心（有限合伙）	母公司合营企业
49	盐城国泰君安致远一号股权投资中心（有限合伙）	母公司合营企业
50	济南惠建君安绿色产业投资基金合伙企业（有限合伙）	母公司联营企业
51	济南惠建君安智造产业投资基金合伙企业（有限合伙）	母公司联营企业
52	上海城市更新引导私募基金合伙企业（有限合伙）	母公司联营企业
53	上海国有资本投资母基金有限公司	母公司联营企业
54	上海集攀咨询管理有限公司	母公司联营企业
55	上海科创中心股权投资基金管理有限公司	母公司联营企业
56	上海临港国泰君安科技前沿产业私募基金合伙企业（有限合伙）	母公司联营企业
57	上海浦东引领区国泰君安科创一号私募基金合伙企业（有限合伙）	母公司联营企业
58	上海证券有限责任公司	母公司联营企业
59	安徽华茂产业投资有限公司	母公司其他关联方
60	北京富泰华管理咨询有限公司	母公司其他关联方
61	广东粤财信托有限公司	母公司其他关联方
62	浦银金融租赁股份有限公司	母公司其他关联方
63	上海国际集团（香港）有限公司	母公司其他关联方
64	上海国鑫创业投资有限公司	母公司其他关联方
65	上海国鑫投资发展有限公司	母公司其他关联方
66	上海农村商业银行股份有限公司	母公司其他关联方
67	上海浦东发展银行股份有限公司	母公司其他关联方
68	上海正海国鑫投资中心（有限合伙）	母公司其他关联方
69	深圳能源集团股份有限公司	母公司其他关联方
70	深圳市投资控股有限公司	母公司其他关联方
71	长城证券股份有限公司	母公司其他关联方
72	中国对外经济贸易信托有限公司	母公司其他关联方
73	中证信用增进股份有限公司	母公司其他关联方
74	国泰君安投资管理股份有限公司	母公司其他关联方
75	上海城投环保金融服务有限公司	母公司其他关联方
76	上海国和现代服务业股权投资管理有限公司	母公司其他关联方
77	湖州产投创新引领股权投资合伙企业（有限合伙）	母公司其他关联方
78	上海股权托管交易中心股份有限公司	母公司其他关联方
79	上海国际集团资产管理有限公司	母公司其他关联方
80	深圳市特发集团有限公司	母公司其他关联方
81	通联支付网络服务股份有限公司	母公司其他关联方
82	新华资产管理股份有限公司	母公司其他关联方
83	银河基金管理有限公司	母公司其他关联方
84	上海海通证券资产管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
85	海通國際證券集團有限公司	受同一母公司控制的其他企业
86	海通恒信国际融资租赁股份有限公司	受同一母公司控制的其他企业
87	海富通基金管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
88	海通开元投资有限公司	受同一母公司控制的其他企业

集合资产管理计划管理合同

89	海通创新证券投资有限公司	受同一母公司控制的其他企业
90	上海惟泰置业管理有限公司	受同一母公司控制的其他企业
91	海通国际控股有限公司	受同一母公司控制的其他企业
92	海通期货股份有限公司	受同一母公司控制的其他企业
93	海通恒信金融集团有限公司	受同一母公司控制的其他企业
94	富国基金管理有限公司	母公司其他关联方

托管人关联方名单：以托管人定期披露的最新关联方名单为准。

附件三

**资金到账通知书**

上海国泰君安证券资产管理有限公司

贵公司受托管理的“xxx号集合资产管理计划”的募集资金已于x年x月x日划拨至该基金专用托管账户：

银行：

户名：

账号：

金额：（大写）xx元整（人民币）

（小写）¥xx元（人民币）

特此通知。

托管人：

日期：x年x月x日