

国泰君安新盈雪球增利 3 号集合资产管理计划起始运作公告

时间：2021-07-21

根据《国泰君安新盈雪球增利 3 号集合资产管理计划管理合同》，国泰君安新盈雪球增利 3 号集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）已于 2021 年 7 月 16 日投资起始运作，即 2021 年 7 月 16 日为本集合计划投资起始运作日。期初参考价格为中证 500 指数（代码：000905.SH）在期初观察日的收盘价，具体为 6925.12；敲出价格=期初参考价格*100%，即 6925.12；敲入价格=期初参考价格*75%，即 5193.84。本集合计划后续安排如下：本集合计划自投资起始运作日起的 24 个月称为“首个运作期”，期间封闭运作。具体的敲出付息观察日及每个观察日的业绩报酬计提基准安排如下：

i	第 i 个月敲出付息观察日	业绩报酬计提基准 B_i
3	2021 年 10 月 18 日	13.70%
4	2021 年 11 月 16 日	13.70%
5	2021 年 12 月 16 日	13.70%
6	2022 年 1 月 17 日	13.70%
7	2022 年 2 月 16 日	13.70%
8	2022 年 3 月 16 日	13.70%
9	2022 年 4 月 18 日	13.70%
10	2022 年 5 月 16 日	13.70%
11	2022 年 6 月 16 日	13.70%
12	2022 年 7 月 18 日	13.70%
13	2022 年 8 月 16 日	13.70%
14	2022 年 9 月 16 日	13.70%
15	2022 年 10 月 17 日	13.70%
16	2022 年 11 月 16 日	13.70%
17	2022 年 12 月 16 日	13.70%
18	2023 年 1 月 16 日	13.70%
19	2023 年 2 月 16 日	13.70%
20	2023 年 3 月 16 日	13.70%
21	2023 年 4 月 17 日	13.70%

22	2023 年 5 月 16 日	13.70%
23	2023 年 6 月 16 日	13.70%
24（期末 观察日）	2023 年 7 月 17 日	13.70%

注：若前述敲出观察日非交易日，则顺延至下一交易日。

- 1、若存在某一敲出付息观察日挂钩标的收盘价大于或等于敲出价格（即发生敲出事件），本计划于发生该事件的下一工作日终止。
- 2、若所有的敲出付息观察日挂钩标的收盘价均小于敲出价格，且观察期内所有的预定交易日挂钩标的收盘价均大于或等于敲入价格，则本计划于期末观察日的下一工作日终止。
- 3、若所有的敲出付息观察日挂钩标的收盘价均小于敲出价格，且存在观察期内存在某一预定交易日挂钩标的收盘价小于敲入价格（即发生敲入事件），则本集合计划投资起始运作日起满 24 个月的对日（如遇节假日则顺延至下一工作日，若该月没有对日的，则顺延至下一工作日）开放退出。首次开放后每满 3 个月的对日（如遇节假日则顺延至下一工作日，若该月没有对日的，则顺延至下一工作日）开放退出。

本计划首个封闭期预计将主要投资证券市场柜台交易的期权合约或收益凭证，获得与挂钩标的指数（中证 500 指数）涨跌幅相关的投资回报（收益或亏损）。如本计划首个运作期未发生提前终止的情况，则本计划首个封闭期结束后开放，并于开放后的首个投资运作日按照如下投资策略进行投资运作。

首个封闭期结束开放后的首个投资运作日起，本计划将采取指数增强策略进行投资，具体方式为精选挂钩标的指数（中证 500 指数）的增强型收益互换或收益凭证等金融衍生品，力求在跟踪挂钩标的指数表现基础上获得额外的增强回报。

特此公告