

国泰君安新盈雪球增利3号集合资产管理计划说明书

二〇二一年

特别提示:

本说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》(银发[2018]106号)、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》(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》)、《国泰君安新盈雪球增利3号集合资产管理计划管理合同》(以下简称《管理合同》或管理合同)及其他有关规定制作,管理人保证本说明书的内容真实、准确、完整,不存在任何虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

委托人承诺以真实身份和自有资金参与集合计划,保证委托资产的来源及用途合法,并已阅知本说明书和《管理合同》全文,了解相关权利、义务和风险,知悉本产品为非保本产品,愿意自行承担投资风险和损失。

管理人承诺以诚实信用、审慎尽责的原则管理和运用集合计划资产,但不保证集合计划一定盈利,也不保证最低收益。

投资者签订《管理合同》且合同生效后,投资者即为《管理合同》的委托人,其认购或申购集合计划份额的行为本身即表明其对《管理合同》及本说明书的承认和接受,委托人将按照《管理办法》、《管理合同》、本说明书及有关规定享有权利、承担义务。

集合计划基本信息	名称	国泰君安新盈雪球增利3号集合资产管理计划
	类型	商品及金融衍生品类集合资产管理计划。
	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(不含认购费)不低于100万元,总参与客户数不超过200户。
	管理期限	本集合计划存续期限为自成立之日起10年(可展期)。 在本集合计划封闭期内,在特定日期挂钩标的上涨触及衍生品合约规定的价格上限时(即全部发生敲出事件,在某敲出付息观察日挂钩标的收盘价大于或者等于敲出价格),则本计划于发生该事件的下一工作日终止;在本集合计划封闭期满后首个开放日,管理人可提前终止。本集合计划提前终止具体安排以管理人公告为准。
	初始募集期	本集合计划初始募集期自份额发售之日起不超过60天。
	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。
	开放期、开放日	本集合计划自成立日起封闭运作,并在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。开放期仅办理退出业务。 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。
	初始份额面值	人民币1.00元
	最低金额	单个委托人首次参与的最低金额为人民币100万元(不含认购费)。对于已经是本集合计划的持有人,其新增参与资金最低金额为人民币1万元。
	相关费率	1、参与费率:本计划不开放参与; 2、退出费率:0%; 3、年托管费率:0.02%; 4、固定管理费:首个运作期的年固定管理费率为1.93%,后续运作期的年固定管理费率为1.0%; 5、业绩报酬:实际年化收益率超过业绩报酬计提基准部分的20%作为业绩报酬。
投资范围	投资范围	本集合计划投资于证券市场柜台交易的期权合约、收益互换、收益凭证及其他金融衍生品、银行存款、货币基金、公募基金等金融产品。
	投资策略	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。

		<p>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。</p> <p>除法律法规另有规定外, 若本集合计划拟修改投资策略的, 管理人应事先取得投资者同意并履行合同变更程序。投资策略变更应为调整投资组合及资产托管人调整监督事项等留出必要的时间。</p> <p>若本计划存续期内因监管机构对资产管理计划的投资比例限制等变更导致《管理合同》约定的投资策略无法继续适用, 管理人有权根据届时法律法规及监管要求做出调整。</p>
	投资限制	<p>1、集合计划投资于同一资产的资金不得超过计划资产净值的 25%; 管理人全部集合资产管理计划投资于同一资产的资金, 不得超过该资产的 25%;</p> <p>2、本集合计划资产总值占资产净值的比例不超过 200%;</p> <p>3、本集合计划不得违反资产管理计划中的投资范围规定;</p> <p>4、本集合投资非标准化债权资产的终止日不得晚于本集合计划的最近一次开放日;</p> <p>5、本集合计划不得投资于除公募基金以外的其他资产管理产品;</p> <p>6、本集合计划开放退出期内, 其资产组合中 7 个工作日可变现资产的价值, 不低于该计划资产净值的 10%;</p> <p>7、法律法规、中国证监会、基金业协会以及《管理合同》规定的其他投资限制。</p> <p>如法律法规或监管部门修改或取消上述限制, 履行合同变更程序后, 本集合计划可相应调整投资组合限制的规定, 则本集合计划不受上述限制。</p>
	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)。
	适合推广对象	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。
当事人	管理人	上海国泰君安证券资产管理有限公司
	托管人	上海浦东发展银行股份有限公司上海分行
	销售机构	国泰君安证券股份有限公司、上海国泰君安证券资产管理有限公司(直销)以及中国证监会认可并与管理人签署相关协议的其他销售机构。
集合计划的募集	初始募集	如本集合计划在初始募集期内客户数达到 200 户, 管理人可提前终止初始募集期。管理人在初始募集期内使用“金额优先+金额同等情况下时间优先”方法对集合计划认购总户数实行限量控制。
	认购的原则	<p>1、本集合计划采用电子合同的方式签署, 委托人在各销售网点, 签署合同。委托人应当如实提供与签署合同相关的信息和资料, 管理人和其他销售机构应当按照有关规定对委托人提供的信息和资料进行审查并如实记录。委托人保证其所提供的信息及资料真实、准确、完整, 否则应当承担由此造成的一切后果。</p> <p>2、“金额参与”原则, 即认购以金额申请。</p> <p>3、本集合计划的单个委托人首次认购最低金额(不含认购费)为 100 万元人民币, 追加认购的最低金额为人民币 1 万元。认购资金应以现金方式划付至销售机构指定账户或由销售机构代扣。</p> <p>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。</p> <p>5、委托人的认购资金在划入集合计划募集户之前产生的利息, 由销售机构按其相关约定支付, 认购资金划入集合计划募集户之后在募集户产生的利息, 折成集合计划份额归委托人所有, 利息折成委托人份额以注册登记机构的记录结果为准。</p>
集合计划的参与		本集合计划存续期内不办理参与业务。
集合计划	办理时间	<p>本集合计划委托人只能于本集合计划的开放期办理退出申请。</p> <p>本集合计划自成立日起封闭运作, 并在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。</p>

的 退 出		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《管理合同》执行。
	退出原则	<p>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；</p> <p>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；</p> <p>3. “先进先出”原则，即对委托人在该销售机构参与的集合计划份额进行退出处理时，参与确认日期在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；</p> <p>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；</p> <p>5. “预约退出”原则，预约退出期包括开放日（T 日）前的第 10 个工作日（T-10 日）至开放日前的第 8 个工作日（T-8 日），共 3 个工作日。拟在开放日办理退出的委托人应通过在预约退出期内向推广机构提交预约退出申请的方式办理退出申请。未经预约申请，管理人有权拒绝委托人的退出申请。</p> <p>6. 委托人部分退出本集合计划的，其退出后持有的剩余份额资产净值应当不低于《管理合同》约定的首次参与最低金额。委托人持有的本集合计划份额净值低于首次参与最低金额时，需要退出本集合计划的，应当申请一次性全部退出。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。</p>
	退出费	本集合计划无退出费。
管理人自有资金参与情况		管理人不以自有资金参与本集合计划。
集合计划的分级		本集合计划不分级。
集合计划成立的条件		<p>集合计划初始募集规模不低于 5000 万元，投资者人数不少于 2 人，且不超过 200 人，募集过程应符合法律、行政法规和中国证监会的规定。募集金额缴足之日起 10 个工作日内，管理人应当委托具有证券相关业务资格的会计师事务所进行验资并出具验资报告，并在取得验资报告后于管理人网站公告资产管理计划成立。</p> <p>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。</p> <p>管理人应当在集合计划成立之日起五个工作日内，将资产管理合同、投资者名单与认购金额、验资报告或者资产缴付证明等材料报证券投资基金业协会备案，并抄报中国证监会相关派出机构(如需)。</p> <p>集合计划设立完成前，委托人的参与资金只能存入集合计划注册登记机构指定的专门账户，不得动用。</p> <p>集合计划在成立后备案完成前，不得开展投资活动，以现金管理为目的，投资于银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的投资品种的除外。</p>
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5000万元（不含）或者委托户数低于2户（不含）条件下，集合计划设立失败，管理人以固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，并将已认购资金在初始募集期结束后30日内退还集合计划委托人，认购资金产生的利息自初始募集期结束之日起至下一个结息日后的五个工作日内退还集合计划委托人，各方互不承担其他责任。利息金额以本集合计划注册登记机构的记录为准。
集合计划份额转让		<p>本计划成立后，管理人可以按照规定申请份额转让事宜。</p> <p>集合计划存续期间，委托人可以通过证券交易所以及中国证监会认可的其他方式转让集合计划份额，份额转让应遵守交易场所相关规定及要求，并按规定办理份额变更登记手续。转让后委托人持有集合计划份额净值不得低于规定的最低投资金额，委托人合计不超过200户且不少于2户。受让方应符合合格投资者资格，受让方首次参与集合计划，应先与管理人、托管人签订集合资产管理合同。</p>
费 用、	费用种类	<p>(1) 集合计划的托管费；</p> <p>(2) 集合计划的管理费；</p>

报酬	<p>(3) 集合计划的业绩报酬;</p> <p>(4) 投资交易费用;</p> <p>(5) 与本集合计划相关的审计费;</p> <p>(6) 违约处置费用;</p> <p>(7) 集合计划财产划拨支付的银行费用;</p> <p>(8) 按照法律、行政法规的规定及《管理合同》的约定可以在本集合计划财产中列支的其他费用</p>										
不列入集合计划费用的项目	<p>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。</p>										
业绩报酬	<p>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。业绩报酬仅在首个运作期本计划终止时(含提前终止,下同)提取,即业绩报酬计提日为首个运作期计划终止日(含提前终止日)。</p> <p>在业绩报酬计提日,管理人对年化收益率超过业绩报酬计提基准部分的 20%提取业绩报酬。请投资者注意,上述业绩报酬计提基准不为管理人对未来业绩的承诺和保证,提请投资者关注产品投资风险、亏损风险。业绩报酬具体计算方法为:</p> $\text{业绩报酬} = \text{MAX} \{ [(A_t - N) - \text{MAX}(N * B * D / 365, 0)] * 20\%, 0 \}$ <p>其中,</p> <p>A_t 为首个运作期计划终止日提取业绩报酬前的计划资产净值;</p> <p>N 为计划投资起始运作日集合计划份额总数*1 元/份;</p> <p>D 为计划投资起始运作日(含)至首个运作期计划终止日(含)之间的自然日天数;</p> <p>B 为本集合计划的业绩报酬计提基准,业绩报酬计提基准的确定方法如下,</p> <p>定义:敲出价格=期初参考价格*X1%,敲入价格=期初参考价格*X2%(X1、X2 具体以管理人公告为准)。</p> <p>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,本集合计划的业绩报酬计提基准 $B = B_i$ ($i=3, 4, \dots, 24$),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以管理公告为准。</p> <table border="1" data-bbox="568 1238 1323 1536"> <tr> <th>第 i 个月敲出付息观察日 (具体敲出付息观察日以管理人公告为准)</th><th>B_i (具体基准以管理人公告为准)</th></tr> <tr> <td>$i=3$</td><td>B_3</td></tr> <tr> <td>$i=4$</td><td>B_4</td></tr> <tr> <td>...</td><td>...</td></tr> <tr> <td>$i=24$ (期末观察日)</td><td>B_{24}</td></tr> </table> <p>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, $B = B_{24}$。</p> <p>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), $B = \min(0, \text{期末参考价格}/\text{期初参考价格} - 1 - \text{相关费率}) * 365/D$。</p> <p>金融衍生品的相关说明:</p> <p>(1) 挂钩标的收盘价指中证指数有限公司公布的中证 500 指数(代码: 000905.SH)的收盘价。如因不可抗力导致该收盘价未能公布,则按照相关规则及《管理合同》约定处理。</p> <p>(2) 观察期指期初观察日(含)至期末观察日(含)期间的所有预定交易日。期初参考价格为挂钩标的在期初观察日的收盘价。期初观察日为计划投资起始运作日,具体日期以管理人届时公告为准。预定交易日指上海证券交易所/深圳证券交易所预定开市的正常交易日。期末观察日为本计划投资起始运作日满 24 个月对日的前一预定交易日,具体日期以管理人公告为准。期末参考价格为挂钩标的在期末观察日的收盘</p>	第 i 个月敲出付息观察日 (具体敲出付息观察日以管理人公告为准)	B_i (具体基准以管理人公告为准)	$i=3$	B_3	$i=4$	B_4	$i=24$ (期末观察日)	B_{24}
第 i 个月敲出付息观察日 (具体敲出付息观察日以管理人公告为准)	B_i (具体基准以管理人公告为准)										
$i=3$	B_3										
$i=4$	B_4										
...	...										
$i=24$ (期末观察日)	B_{24}										

		<p>价。</p> <p>(3) 敲出付息观察日为本计划投资起始运作日满 i 个月 ($i=3,4,\dots,24$) 对日的前一预定交易日, 对应称为第 i 个月敲出付息观察日, 具体敲出付息观察日以管理人公告为准。</p> <p>(4) 受干扰日: 在交易所或相关交易所的预定交易日, 如遇交易所无法交换或者收盘前一小时挂钩标的有严重交易干扰 (由期权合约、收益凭证、收益互换的交易对手裁定), 或者交易所或相关交易所提早收市但给予少于了一小时的提醒或者至实际下单截止时小于一小时提醒, 那么该日成为“受干扰日”。若观察期内的任一交易日为受干扰日, 相关交易日为后一非受干扰日的预定交易日。除非该受干扰日之后连续 8 个预定交易日均为受干扰日, 那么第 8 个预定交易日即使为受干扰日仍为交易日。期权合约交易对手将本着诚信原则以第 8 个预定交易日的估算收盘价格作为收盘价。</p> <p>(5) 市场中断事件: 挂钩标的在本计划观察期内的任一原定交易日发生闭市、提早闭市、标的停牌、交易中断、交易所中断等影响期权交易对手观察挂钩标的收盘价、对冲、交易等的事件。其中, 交易中断、交易所中断、提早闭市等市场中断事件相关定义同《中国证券期货市场场外衍生品交易权益类衍生品定义文件 (2014 年版)》。</p> <p>(6) 市场中断事件处理: 期权交易对手有权根据其自身判断并依照诚信原则及商业合理原则确定期权挂钩标的的价格或调整期权相关费率或采取暂停观察或顺延挂钩标的的观察日期等处理方式, 并以此作为结算依据。</p> <p>(7) 提前终止事件: 在本集合计划封闭期内, 在特定日期挂钩标的的上涨触及衍生品合约规定的价格上限时 (即全部发生敲出事件, 在某敲出付息观察日挂钩标的的收盘价大于或者等于敲出价格), 则本计划于发生该事件的下一工作日终止; 在本集合计划封闭期满后首个开放日, 管理人可提前终止。本集合计划提前终止具体安排以管理人公告为准。</p> <p>(8) 投资者知悉: 如发生《管理合同》与挂钩标的相关的未穷尽列举事件情形继而对业绩报酬计提基准 (年化) 计算产生实质性影响, 管理人将依照相关的法律法规、交易协议或补充协议, 基于诚信原则处理。</p> <p>4、业绩报酬支付:</p> <p>业绩报酬在业绩报酬计提日计提, 由管理人在计提当日向托管人发送业绩报酬计提金额, 其中集合计划的存续期及存续期内的业绩报酬计提基准由管理人邮件提供给托管人, 托管人不对业绩报酬计提基准的计算结果与准确性进行核对。托管人复核后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。</p>
收益分配		本集合计划存续期内不进行收益分配。
集合计划展期		本集合计划可以展期。
终止		<p>有下列情形之一的, 集合计划应当终止:</p> <ol style="list-style-type: none"> 1. 本集合计划管理期限届满且未展期的; 2. 管理人被依法撤销资产管理业务资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产, 且在六个月内没有新的管理人承接的; 3. 托管人被依法撤销基金托管资格或者依法解散、被撤销、被宣告破产, 且在六个月内没有新的托管人承接的; 4. 存续期内, 经全体委托人、管理人、托管人协商一致可以提前终止本集合计划; 5. 存续期内, 集合计划委托人少于 2 人时; 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委托人低于 2 人时, 当日委托人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. 提前终止事件: 在本集合计划封闭期内, 在特定日期挂钩标的的上涨触及衍生品合约规定的价格上限时 (即全部发生敲出事件, 在某敲出付息观察日挂钩标的的收盘价大于或者等于敲出价格), 则本计划于发生该事件的下一工作日终止; 在本集合计划封闭期满后首个开放日, 管理人可提前终止。本集合计划

	<p>划提前终止具体安排以管理人公告为准;</p> <p>8.战争、自然灾害等不可抗力发生导致本集合计划不能存续;</p> <p>9.未在基金业协会完成备案或不予备案的情形;</p> <p>10.法律、法规规定或中国证监会规定的其它情况。</p> <p>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9项约定的情形除外。</p>
<p>信息披露的内容、频率和方式</p>	<p>一、信息披露的内容和频率:</p> <p>一) 定期报告</p> <p>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。</p> <p>1、集合计划单位净值报告。</p> <p>管理人在每周第二个工作日(若遇节假日,则顺延至下一个工作日)通过管理人网站披露经过托管人复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二个交易日的份额净值、累计净值,供投资人参考。</p> <p>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:</p> <p>(1) 管理人履职报告;</p> <p>(2) 托管人履职报告;</p> <p>(3) 资产管理计划投资表现;</p> <p>(4) 资产管理计划投资组合报告;</p> <p>(5) 资产管理计划运用杠杆情况(如有);</p> <p>(6) 资产管理计划财务会计报告;</p> <p>(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;</p> <p>(8) 资产管理计划投资收益分配情况;</p> <p>(9) 投资经理变更、重大关联交易等涉及投资者权益的重大事项;</p> <p>(10) 中国证监会规定的其它事项。</p> <p>资产管理计划季度报告应当披露前款除第(6)项之外的其它信息。</p> <p>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。</p> <p>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)。</p> <p>3、年度审计报告。</p> <p>管理人应当聘请具有证券相关业务资格的会计师事务所对本集合资产管理计划的运营情况进行年度审计,并在每年度结束之日起4个月内将审计报告提供给托管人,通过管理人网站向委托人披露,并按照规定向相关监管机构报备。</p> <p>4、对账单</p> <p>管理人每季度结束后通过书面或电子邮件等方式向委托人提供对账单信息,对账单内容应包括集合计划产品特性,投资风险提示,委托人持有计划份额的数量及净值,参与、退出明细,收益分配以及计划的差异性、风险等情况。</p> <p>二) 临时报告</p> <p>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。</p> <p>三、 管理人关联方参与本集合计划的信息披露</p>

	<p>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。</p> <p>四、信息披露方式</p> <p>本集合计划的信息披露将严格按照《管理办法》、《运作规定》、《管理合同》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。</p> <p>1、管理人网站（www.gtjazg.com）信息披露</p> <p>2、管理人、销售机构指定营业网点查询</p> <p>3、国泰君安证券资产管理客服电话（95521）</p> <p>五、信息披露文件的存放及查阅</p> <p>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），供委托人查阅。</p>
委托人权利与义务	<p>（一）委托人的权利</p> <p>（1）分享资产管理计划财产收益；</p> <p>（2）取得分配清算后的剩余资产管理计划财产；</p> <p>（3）按照《管理合同》的约定参与、退出和转让资产管理计划份额；</p> <p>（4）根据《管理合同》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；</p> <p>（5）按照法律法规及《管理合同》约定的时间和方式获得资产管理计划的信息披露资料；</p> <p>（6）监督管理人、托管人履行投资管理及托管义务的情况；</p> <p>（7）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定的和《管理合同》约定的其他权利。</p> <p>（二）委托人的义务</p> <p>（1）认真阅读并遵守《管理合同》，保证投资资金的来源及用途合法；</p> <p>（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；</p> <p>（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；</p> <p>（4）认真阅读并签署风险揭示书；</p> <p>（5）按照《管理合同》约定支付资产管理计划份额的参与款项，承担《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；</p> <p>（6）在持有的资产管理计划份额范围内，承担资产管理计划亏损或者终止的有限责任；</p> <p>（7）向管理人或销售机构提供法律法规规定的信息资料及身份证明文件，配合管理人或其销售机构完成投资者适当性管理、非居民金融账户涉税信息尽职调查、反洗钱等监管规定的工作；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《管理合同》。</p> <p>（8）不得违反《管理合同》的约定干涉管理人的投资行为；</p> <p>（9）不得从事任何有损资产管理计划及其投资者、管理人管理的其他资产及托管人托管的其他资产合法权益的活动；</p> <p>（10）保守商业秘密，不得泄露资产管理计划的投资计划、投资意向等；不得利用资产管理计划相关信息进行内幕交易或者其他不当、违法的证券期货业务活动；</p> <p>（11）法律法规、中国证监会及证券投资基金业协会规定和《管理合同》约定的其他义务。</p>
风险揭示	<p>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。本计划可能面临的风险包括但不限于市场风险、流动性风险、管理风险、信用风险、操作风险及其他风险等。</p>

	具体风险揭示内容详见《国泰君安新盈雪球增利3号集合资产管理计划风险揭示书》。
利益冲突情况以及可能影响投资者合法权益的其他重要事项	<p>委托人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、客观地告知托管人，并通过资产管理季度报告向委托人披露。同时向相关监管机构报告（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。</p> <p>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。</p>
特别说明	本说明书作为《管理合同》的重要组成部分，与《管理合同》具有同等法律效力。若无特别说明，本说明书中的所有术语与《管理合同》中的相关表述具有相同涵义。如两者不一致的，以《管理合同》的相关内容为准。