

关于 征询“众壹资产量合尊享一号私募证券投资基金” 变更意见的回函

致【上海众壹资产管理有限公司】：

我部已收悉贵司发送的关于征询“众壹资产量合尊享一号私募证券投资基金” 变更意见的事项，征询意见函的内容详见附件。

我司对于贵司征询“众壹资产量合尊享一号私募证券投资基金” 变更事项内容无异议。



国泰君安证券股份有限公司

资产托管部

2024年12月04日

《众壹资产量合尊享一号私募证券投资基金私募基金合同》变更告知函

致国泰君安证券股份有限公司：

我司拟根据《众壹资产量合尊享一号私募证券投资基金私募基金合同》的相关约定通过公告形式对该基金合同条款进行变更，特向贵司告知相关变更事宜。

一、众壹资产量合尊享一号私募证券投资基金私募基金合同条款具体修改如下

（一）修订第十一章“私募基金的投资”第（二）条“投资范围”

原表述：

“（1）权益类：证券交易所交易的股票（包括但不限于新股申购、优先股、上市公司非公开发行股票等）、港股通标的范围内的股票、证券交易所交易的存托凭证。

（2）固定收益类：银行存款（包括定期存款、活期存款、协议存款）、现金、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、证券交易所或银行间市场交易的资产支持证券、银行间市场交易的资产支持票据和标准化票据、证券交易所质押式报价回购、同业存单。

（3）期货和衍生品类：证券交易所及期货交易所交易的衍生品（包括但不限于期货、期权、权证等）、上海黄金交易所交易的合约品种。

（4）其他：公募基金、银行及其理财子公司发行的理财产品、信托计划、证券公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募证券投资基金管理人发行的私募基金、债券通用质押式回购、证券公司收益凭证、转融通证券出借交易（即本基金将其持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司）、融资融券交易。

（4）中资产如涉及（1）（2）（3）中资产类别的，则计入相应资产类别计算。”

修改为：

“（1）固定收益类：银行存款（包括定期存款、活期存款）、现金、国债。

(2) 期货和衍生品类：证券交易所及期货交易所交易的衍生品（包括但不限于期货、期权、权证等）、上海黄金交易所交易的合约品种。

(3) 其他：公募基金、于基金业协会官方网站公示已登记的私募证券投资基金管理人发行的私募基金。本条中所列示资产如涉及前述资产类别的，则计入相应资产类别计算。”

(二) 修订第十一章“私募基金的投资”第(三)条“投资策略”

原表述：

“本基金运用量化程序化交易策略，通过趋势跟踪模型、多因子模型、均值回归模型、基本面因子模型、事件驱动模型、动量驱动模型等多种策略分散配置市场品种，严控风险，力争实现基金的长期稳健收益。”

修改为：

“本基金运用量化程序化交易策略，通过趋势跟踪模型、多因子模型、均值回归模型、基本面因子模型、事件驱动模型、动量驱动模型等多种策略分散配置市场品种，严控风险，力争实现基金的长期稳健收益。”

同时，本产品采用复合策略投资投资范围内可投资品种标的，其中私募基金可投资包括量化CTA策略私募基金等”

(三) 修订第十一章“私募基金的投资”第(四)条“投资限制”

删除表述：

“6、本基金持有的存托凭证，以市值合计，不得超过基金资产净值的100%；

7、本基金参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的收益凭证（如雪球结构场外衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的25%。”

(四) 修订第十一章“私募基金的投资”第(九)条“私募基金管理人自有风控措施”

删除表述：



“（2）同一实际控制人控制的私募证券投资基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%，中国证监会、基金业协会另有规定的除外；

（3）本基金不得参与证券交易所上市公司股票协议转让；

（4）本基金如投资信托计划，不得为资产服务信托，且其资金不得用于投资以下标的：非标债权类资产（不含债券及资产证券化产品）、未上市企业股权、除公募证券投资基金外的其他资产管理产品及私募基金、各类资产收益权；”

（五）删除第十一章“私募基金的投资”第（十三）条“参与融资融券及其他场外证券业务的情况（如有）”，后序号自动顺延

删除表述：

“（十三）参与融资融券及其他场外证券业务的情况（如有）

根据本基金投资范围，本基金可参与融资融券业务，在放大投资收益的同时也放大了投资风险，同时还须支付相应的利息和费用，由此承担的风险可能远远超过普通证券交易。

本基金可参与“私募基金的投资”章节之“投资范围”中约定的场外证券业务，投资收益受挂钩标的的市场价格、市场利率、波动率或相关性等因素的影响，导致本基金收益产生不确定性的风险。”

二、合同条款变更生效事宜

如贵司未提出书面反对意见的，相关合同条款变更将自【2024】年【12】月【5】日起正式生效，我司将以公告等形式向投资者披露本函变更的具体内容，并可设置临时开放日或者其他保障投资者赎回私募证券投资基金权利的措施，但本次变更内容有利于投资者的除外。

管理人：上海众益资产管理股份有限公司

