

《宏锡创盈量化 CTA30 号五期私募证券投资基金私募基金合同》变更告知函

尊敬的基金份额持有人：

我司拟根据《宏锡创盈量化 CTA30 号五期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，特向投资者告知相关变更事宜。

一、宏锡创盈量化 CTA30 号五期私募证券投资基金私募基金合同条款具体修改如下

（一）修订第七章“私募基金的申购、赎回和转让”第（一）条“申购和赎回的场所、时间”第 2 款“申购和赎回的开放日（以下简称为 T 日或开放日）及时间”

1、原表述：

固定开放日	基金成立之后的每月最后一个交易日。
-------	-------------------

修改为：

固定开放日	基金成立之后的每周周二和周三，如遇非交易日顺延至本周的下一个交易日，如本次顺延后与下一次开放日重叠，则两次开放日合并为一次，不再继续顺延。若本周无交易日可顺延，则不再顺延至下周，即本次不进行开放。
-------	--

2、新增表述：

“私募基金管理人拟调整本章节所约定的相关申购、赎回规则，包括但不限于申赎开放日频率或日期、程序以及限制事项（如锁定期、封闭期等）的，应当及时通知全体份额持有人，若有份额持有人提出异议的，私募基金管理人应当及时通过设置临时开放日等方式供该等份额持有人赎回（该等赎回不受本合同中关于基金赎回的期限限制），基金份额持有人未赎回基金份额的视为其同意前述变更。为免疑义，若上述内容调整涉及合同变更的，私募基金管理人应当按照“基金合同的效力、变更、解除及终止”章节约定履行变更程序变更基金合同。”

（二）修订第十一章“私募基金的投资”第（二）条“投资范围”

1、原表述：



“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）、新三板精选层挂牌公司股票、港股通标的范围内的股票、证券交易所发行上市的存托凭证、证券交易所或银行间市场发行交易的债券、证券交易所或银行间市场发行交易的资产支持证券、银行间市场发行及交易的资产支持票据、证券公司收益凭证（含非本金保障型收益凭证）、债券逆回购、证券交易所质押式报价回购、现金、银行存款（包括定期存款、活期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、同业存单、融资融券交易、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）、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）、上海黄金交易所上市的合约品种、仅以证券公司/期货公司/银行及其子公司为交易对手的证券期货市场场外衍生品（仅包括收益互换及场外期权）、公募基金、银行理财产品、证券公司及其子公司资产管理计划。”

修改为：

“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）、新三板精选层挂牌公司股票、港股通标的范围内的股票、证券交易所发行上市的存托凭证、证券交易所或银行间市场发行交易的资产支持证券、银行间市场发行及交易的资产支持票据、证券公司收益凭证（含非本金保障型收益凭证）、债券逆回购、证券交易所质押式报价回购、现金、银行存款（包括定期存款、活期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、同业存单、融资融券交易、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）、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）、上海黄金交易所上市的合约品种、仅以证券公司/期货公司/银行及其子公司为交易对手的证券期货市场场外衍生品（仅包括收益互换及场外期权）、公募基金、银行理财产品、证券公司及其子公司资产管理计划。”

（三）修订第十一章“私募基金的投资”第（十二）条“投资经理”

1、原表述：

“1、投资经理简介

刘锡斌，中山大学研究生硕士，金融专业方向，工信部数据分析师。广东宏锡基金管理有限公司总经理、投委会主席，主要负责基金公司的量化CTA策略研究和风险管理，具有10年以上的量化CTA策略研究、交易和风控经验，熟悉国内外趋势跟踪策略与多种量化CTA模型，并擅于运用计算机科技对历史交易数据进行分析统计与策略模型构建，认同

Winton 量化投研体系。

以上投资经理已取得基金从业资格并在基金业协会完成注册。

2、投资经理变更

私募基金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基金份额持有人和私募基金托管人。私募基金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私募基金份额持有人，即视为履行了告知义务。”

修改为：

“1、投资经理简介

刘锡斌，中山大学研究生硕士，金融专业方向。广东宏锡基金管理有限公司投委会主席与总经理，主要负责基金公司的量化 CTA 策略研究和风险管理，具有 10 年以上的量化 CTA 策略研究、交易和风控经验，熟悉国内外趋势跟踪策略与多种量化 CTA 模型，并擅于运用计算机科技对历史交易数据进行分析统计与策略模型构建。

2、投资经理变更

私募基金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基金份额持有人和私募基金托管人。私募基金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私募基金份额持有人，即视为履行了告知义务。在完成投资经理变更后，若有份额持有人对此提出异议的，私募基金管理人应当及时通过设置临时开放日等方式供该等份额持有人赎回。”

(四) 修订第十六章“私募基金的费用与税收”第(二)条“基金费用计提方法、计提标准和支付方式”第 2 款“基金的托管费”

1、原表述：

“本基金的托管费率为年费率 0.04%。在通常情况下，基金托管费按前一自然日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：”

修改为：

“本基金的托管费率为年费率 0.03%。在通常情况下，基金托管费按前一自然日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：”

(五) 修订第十六章“私募基金的费用与税收”第(二)条“基金费用计提方法、计提标准和支付方式”第 3 款“基金的运营服务费”

1、原表述：

“本基金的运营服务费率为年费率 0.04%。在通常情况下，基金运营服务费按前一自然日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：”

修改为：

“本基金的运营服务费率为年费率 0.03%。在通常情况下，基金运营服务费按前一自然日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：”

上述变更内容自【2024】年【06】月【20】日起开始生效。我司承诺合同变更生效后将根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求及时履行报告义务以及向投资者披露。

特此通知。

管理人：广东宏锡基金管理有限公司



【2024年06月20日】