

关于珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金
基金合同变更（202202）的意见征询函

尊敬的基金份额持有人：

上海珠池资产管理有限公司（以下简称“我司”）在招商证券托管的珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金（以下简称“该基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。为更好地为该基金投资者提供投资服务，我司拟根据《珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金基金合同》的约定对该基金相关条款进行变更。

我司特向全体份额持有人征询关于珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金基金合同相关条款变更的意见。

《珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金基金合同》条款具体修改如下：

一、珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金基金合同修改对照明细表

序号 1

四、基金的基本情况

原条款：					
（九）基金份额的分类 本基金按照投资者的身份条件不同分为两个类别，即 A 类基金份额和 C 类基金份额。两类份额分别设有不同的代码，分开募集，合并运作。 1、基金份额的分类 本基金分为 A 类基金份额和 C 类基金份额，由管理人在基金投资者认购/申购基金份额时根据其属性确定其基金份额类别。本基金的投资者的身份识别及份额分类由基金管理人确定，基金托管人及基金服务机构不承担监督职责，如因基金份额分类产生的问题基金托管人及基金服务机构不承担责任。					
基金 份额 类别	身份认定	申购费	赎回 费	管理费率	业绩报 酬
A	除 C 类以外的其他合格投资者	不收取	收取	管理费率：1%	收取
C	本基金管理人、管理员工、管	不收取	不收	不收取	不收取

	理人发行或担任投资顾问的资产 管理产品（含私募基金）		取		
--	-------------------------------	--	---	--	--

2、基金份额配比

本基金存续期内，A 类份额和 C 类份额没有固定的比例关系。

3、基金份额的参考净值计算

在产品存续期间，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，计算不同类别基金份额净值。

现条款：

（九）基金份额的分类

本基金按照投资者的身份条件不同分为两个类别，即 A 类基金份额和 C 类基金份额。两类份额分别设有不同的代码，分开募集，合并运作。

1、基金份额的分类

本基金分为 A 类基金份额和 C 类基金份额，由管理人在基金投资者认购/申购基金份额时根据其属性确定其基金份额类别。本基金的投资者的身份识别及份额分类由基金管理人确定，基金托管人及基金服务机构不承担监督职责，如因基金份额分类产生的问题基金托管人及基金服务机构不承担责任。

基金 份额 类别	身份认定	申购费	赎回 费	管理费率	业绩报 酬
A	除 C 类以外的其他合格投资者	不收取	收取	管理费率：1%	收取
C	本基金管理人、管理员工、管 理人发行或担任投资顾问的资产 管理产品（含私募基金）	不收取	不收 取	管理费率： 0.2%	收取

2、基金份额配比

本基金存续期内，A 类份额和 C 类份额没有固定的比例关系。

3、基金份额的参考净值计算

在产品存续期间，基金管理人在基金份额净值计算的基础上，计算不同类别基金份额净值。



--

序号 2

七、基金的申购、赎回与转让

原条款:	现条款:
(七) 申购和赎回的费用 2、赎回费用 本基金只针对 A 类份额收取赎回费, C 类份额不收取赎回费。 赎回费= (赎回份数×赎回价格-业绩报酬) ×赎回费率 赎回价格为基金赎回申请所对应开放日的 A 类基金份额的份额净值。 若基金份额持有时间少于 365 个自然日, A 类份额赎回费率 1%; 若基金份额持有时间大于等于 365 个自然日, A 类份额赎回费率 0。 赎回费率根据基金份额实际持有时间计算。其中, 基金份额持有人认购基金, 持有时间从基金成立日起计算至赎回申请所对应开放日; 基金份额持有人申购基金, 持有时间从申购申请所对应开放日起计算至赎回申请对应开放日; 含头不含尾。 基金份额持有人赎回费归管理人所有。	(七) 申购和赎回的费用 2、赎回费用 本基金只针对 A 类份额收取赎回费, C 类份额不收取赎回费。 赎回费= (赎回份数×赎回价格-业绩报酬 (如有)) ×赎回费率 赎回价格为基金赎回申请所对应开放日的 A 类基金份额的份额净值。 若基金份额持有时间少于 365 个自然日, A 类份额赎回费率 1%; 若基金份额持有时间大于等于 365 个自然日, A 类份额赎回费率 0。 赎回费率根据基金份额实际持有时间计算。其中, 基金份额持有人认购基金, 持有时间从基金成立日起计算至赎回申请所对应开放日; 基金份额持有人申购基金, 持有时间从申购申请所对应开放日起计算至赎回申请对应开放日; 含头不含尾。 基金份额持有人赎回费归管理人所有。

管理人可在存续期下调赎回费率，具体以基金管理人通知为准。	管理人可在存续期下调赎回费率，具体以基金管理人通知为准。
原条款：	现条款：
(八) 申购份额与赎回金额的计算方式 2、赎回金额计算 赎回金额=赎回份数×赎回价格-赎回费 (如有)-业绩报酬(如有) 赎回价格为赎回申请所对应开放日各类基金份额的份额净值。 赎回金额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。	(八) 申购份额与赎回金额的计算方式 2、赎回金额计算 赎回金额=赎回份数×赎回价格-赎回费 (如有)-赎回时提取的业绩报酬(如有) 赎回价格为赎回申请所对应开放日各类基金份额的份额净值。 赎回金额保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。

序号 3

十七、基金的费用与税收 (二) 费用计提方式、计提标准和支付方式

原条款：	现条款：
1、管理费 基金的年管理费率为 S%。计算方法如下： $H=E \times S\% \div N$ H：每日各类别基金份额应计提的管理费 E：前一日各类别基金份额的基金资产净值 N：当年天数	1、管理费 基金的年管理费率为 S%。计算方法如下： $H=E \times S\% \div N$ H：每日各类别基金份额应计提的管理费 E：前一日各类别基金份额的基金资产净值 N：当年天数

基金份额类别	管理费率 S%	基金份额类别	管理费率 S%
A 类份额	1%	A 类份额	1%
C 类份额	0	C 类份额	0.2%
本基金的管理费每日计提，按季支付给基金管理人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度初十五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。		本基金的管理费每日计提，按季支付给基金管理人。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在下个自然季度初十五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。	
原条款：		现条款：	
4、基金管理人的业绩报酬 本基金只对 A 类份额计提业绩报酬，对 C 类份额不计提业绩报酬。 业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。 当基金份额赎回、基金终止或分红时，管理人将提取赎回份额或分红份额当期超过年化收益 6%盈利部分的 U%作为业绩报酬。如本次基金分红时间距上次分红时间（如有）不足 3 个月（每月按 30 个自然日计算），则本次基金分红不对基金份额计提业绩报酬。 本次变更（202101 号）生效后首次分红时计		4、基金管理人的业绩报酬 本基金对 A 类份额、C 类份额都计提业绩报酬。 业绩报酬的计算采取“单客户单笔份额高水位法”：在两类情况下管理人将根据基金份额持有人的收益情况对本基金提取业绩报酬，一类是基金份额持有人申请赎回或本基金终止时提取业绩报酬；另一类是分红时提取业绩报酬。 当基金份额赎回、基金终止或分红时，管理人将提取赎回份额或分红份额当期超过年化收益 6%盈利部分的 U%作为业绩报酬。如本次基金分红时间距上次分红时间（如有）不足 3 个月（每月按 30 个自然日计算），则本次基金分红不对基金份额计提业绩报酬。	
		份额类别	业绩报酬计提



提业绩报酬间隔为距上次分红日（如有）而非本次变更生效日起算。 <table border="1"> <tr> <th>份额类别</th><th>业绩报酬计提比例 U</th></tr> <tr> <td>A 类份额</td><td>20</td></tr> <tr> <td>C 类份额</td><td>0</td></tr> </table> 业绩报酬的计提方法如下： 当基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据基金份额持有人每一基金份额的年化收益率（R）提取业绩报酬，经计算确认的业绩报酬从基金份额持有人赎回、基金分红款或基金资金清算款中以现金支付。 其中，基金分红时基金参与份额（红利转投份额）的参与日重定为上一个业绩报酬提取日。当分红款少于业绩报酬，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。 A=赎回日对应的开放日、分红除权日或基金终止日各份额类别的基金累计份额净值； C=上一个业绩报酬提取基准日各份额类别的基金累计份额净值；若“上一个业绩报酬提取基准日”不存在，则 C 为该份额申购开放日各份额类别的基金累计份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）； D=上一个业绩报酬提取日各份额类别的基金份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”		份额类别	业绩报酬计提比例 U	A 类份额	20	C 类份额	0
份额类别	业绩报酬计提比例 U						
A 类份额	20						
C 类份额	0						
	<table border="1"> <tr> <th></th><th>比例 U</th></tr> <tr> <td>A 类份额</td><td>20</td></tr> <tr> <td>C 类份额</td><td>20</td></tr> </table> 业绩报酬的计提方法如下： 当基金份额持有人申请赎回、基金分红或本基金终止时，管理人根据基金份额持有人每一基金份额的年化收益率（R）提取业绩报酬，经计算确认的业绩报酬从基金份额持有人赎回、基金分红款或基金资金清算款中以现金支付。 其中，基金分红时基金参与份额（红利转投份额）的参与日重定为上一个业绩报酬提取日。当分红款少于提取业绩报酬时，则管理人提取的业绩报酬以分红款为限。如分红和赎回同日发生时，当分红款少于业绩报酬，管理人提取的业绩报酬也以分红款为限。 A=赎回对应的开放日、分红除权日或基金终止日各份额类别的基金份额累计净值； C=上一个业绩报酬提取基准日各份额类别的基金份额累计净值；若“上一个业绩报酬提取基准日”不存在，则 C 为该份额申购开放日各份额类别的基金份额累计净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）； D=上一个业绩报酬提取日各份额类别的基金份额净值；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则 D 为该份额申购开放日各份额类别的基金份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）； E=业绩报酬；		比例 U	A 类份额	20	C 类份额	20
	比例 U						
A 类份额	20						
C 类份额	20						

不存在，则 D 为该份额申购开放日各份额类别的基金份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份额）； E=业绩报酬； E_{ij}：上一次基金分红除权日至本次基金分红除权日的存续自然天数（算头不算尾）； F=赎回份额或分红除权日持有份额； T=上一个业绩报酬提取日至本业绩报酬计提日的自然天数；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则为该份额申购开放日； 年化收益率 $R = \frac{A-C}{D} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ 业绩报酬计提标准（针对分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{ij} \geq 3$ 个月，每月按 30 个自然日计算，但对首次通过分红时提取业绩报酬则无需满足本条件）为： 当 $R > 6\%$ 时，对超过 6% 的收益部分提取 U% 的业绩报酬，即： $E = F \times D \times \left(\frac{A-C}{D} \times \frac{365}{T} - 6\% \right) \times \frac{T}{365} \times U\%;$ 当 $R \leq 6\%$ 时，则不提取业绩报酬。 如果管理人已经提取业绩报酬，即使基金份额持有人赎回时净值有所下跌，则该部分已提取的业绩报酬将不退还基金份额持有人。 业绩报酬在基金份额持有人分红、赎回时或本基金清算时由基金管理人负责计算，基金托管人不承担复核义务。业绩报酬从基金份额持有人的赎回资金、分红款或清算资	F=赎回份额或分红除权日持有份额； T=上一个业绩报酬提取日至本业绩报酬计提日的自然天数；若“上一个业绩报酬提取日”不存在，则为该份额申购开放日（如认购则为本基金成立日）； E_{ij}：上一次基金分红除权日至本次基金分红除权日的存续自然天数（算头不算尾）； 年化收益率 $R = \frac{A-C}{D} \times \frac{365}{T} \times 100\%$ 业绩报酬计提标准（针对分红时提取报酬须额外满足条件 $E_{ij} \geq 3$ 个月，每月按 30 个自然日计算，但对首次通过分红时提取业绩报酬则无需满足本条件）： 当 $R > 6\%$ 时，对超过 6% 的收益部分提取 U% 的业绩报酬，即： $E = F \times D \times \left(\frac{A-C}{D} \times \frac{365}{T} - 6\% \right) \times \frac{T}{365} \times U\%;$ 当 $R \leq 6\%$ 时，则不提取业绩报酬。 如果管理人已经提取业绩报酬，即使基金份额持有人赎回时净值有所下跌，则该部分已提取的业绩报酬将不退还基金份额持有人。 业绩报酬在基金份额持有人分红、赎回时或本基金清算时由基金管理人负责计算，基金托管人不承担复核义务。业绩报酬从基金份额持有人的赎回资金、分红款或清算资金中扣除后支付，由基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令，基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节
---	--

金中扣除后支付，由基金管理人向基金托管人发送业绩报酬划付指令，基金托管人根据基金管理人指令要求进行支付。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。 特别提示：本基金设置的业绩报酬计提基准并不构成对基金投资者投资本金不受损失或者取得最低或任何其他程度投资收益或者限定损失金额和比例的承诺。	假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日后的第一个工作日或不可抗力结束日后的第一个工作日支付。 特别提示：本基金设置的业绩报酬计提基准并不构成对基金投资者投资本金不受损失或者取得最低或任何其他程度投资收益或者限定损失金额和比例的承诺。
---	--

序号 4

二十、风险揭示（一）特殊风险揭示

新增条款： 8、业绩报酬采用“分红时提取方式”的风险 本基金业绩报酬采用“分红时提取方式”，如在基金进行收益分配时满足本合同约定的业绩报酬计提条件，则通过在分红款中扣除业绩报酬的方式提取业绩报酬，将导致基金份额持有人每一份基金份额实际获得的收益分配款少于管理人出具分配公告的每一份基金份额的分配金额（极端情况下有可能出现所有的收益分配金额均作为业绩报酬导致基金份额持有人不获得任何收益分配款的情况）。存在管理人在基金份额处于不允许赎回期限（如有）时通过分红方式计提业绩报酬的可能；也存在基金份额持有人赎回基金份额时可能会出现净值下跌但管理人已经提取了业绩报酬的情况。
--

针对变更生效时的存续份额：

本次合同变更生效后首次提取业绩报酬的起始基准为该笔份额上一个成功提取业绩报酬的份额累计净值/份额净值（若“上一个成功提取业绩报酬的提取日”不存在，则为该份额申购开放日所对应的份额累计净值/份额净值（申购份额）或基金份额初始面值（认购份

额)),而非本次合同变更生效日当日所对应的份额累计净值/份额净值;自上述计算起始基准之日起适用本次合同变更生效后的业绩报酬计提比例及业绩报酬计提基准(如有)。

如本次合同变更生效后该笔份额首次计提业绩报酬的时间距离该笔份额上一次成功提取业绩报酬的时间少于3个月(每月按30个自然日计算),则在该次业绩报酬计提日不对该笔份额提取业绩报酬(基金份额持有人赎回基金份额或在基金清算时提取业绩报酬的,不受上述间隔期的限制)。

二、变更流程

我公司将于2022年11月21日至2022年11月25日以公告方式就我公司管理的“珠池可转债量化精选2期私募投资基金”(以下简称“本基金”)的合同变更事项向基金份额持有人征询意见。基金份额持有人应于2022年11月25日之前书面回复意见。若基金份额持有人不同意合同变更条款,我公司将设置2022年11月28日为临时开放日,为不同意此次变更的份额持有人安排赎回。若基金份额持有人未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内赎回本基金的,视为基金份额持有人同意本次合同变更。

上海珠池资产管理有限公司

2022年 11 月 21 日

