

版本号：【20201109HT0046-02-01】

国恩中证 500 指数增强 1 号私募证券投资基金  
基金合同（2024 年 2 月版）  
补充协议

基金管理人：深圳前海国恩资本管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

鉴于：

基金管理人、基金托管人和全体基金投资者三方均已签署《国恩中证 500 指数增强 1 号私募证券投资基金基金合同（2024 年 2 月版）》（下称“《基金合同》”）。现经三方协商一致，签署《国恩中证 500 指数增强 1 号私募证券投资基金基金合同（2024 年 2 月版）补充协议》（下称“本协议”），对《基金合同》做如下变更：

#### 一、《基金合同》变更内容

1、本基金的名称由“国恩中证 500 指数增强 1 号私募证券投资基金”变更为“国恩宏观精进 6 号私募证券投资基金”。

2、本基金的募集账户名称由“中信建投证券基金外包募集专户国恩中证 500 指数增强 1 号”变更为“中信建投外包专户国恩宏观精进 6 号”。

3、国恩中证 500 指数增强 1 号私募证券投资基金风险揭示书“二、风险揭示”“（一）特殊风险揭示”“12、其他特殊风险揭示”删除第 13 条：

#### “（13）关于产品名称的特别提示

本基金名称中的“指数增强”字样，仅作为本基金投资策略的提示，并不表明本基金投资标的必然与某一指数成分股票相同，也不必然按照某一指数相应成分股权重进行投资安排，请投资者仔细阅读基金合同相关内容，了解本基金投资范围，理性判断并谨慎做出投资决策。本基金的表现或将显著弱于市场同期股票指数的表现情况。”

#### 4、《基金合同》第十二章“私募基金的投资”“（一）投资经理”原表述为：

##### “（一）投资经理

本基金的投资经理由基金管理人指定。

投资经理：何文领、吴泾川

投资经理简介：

何文领先生，先后在各大券商、投资公司从事投资工作，对证券市场有着深刻的了解与研究，在从业经历中，能够敏锐洞察市场，主动寻找和挖掘交易机会，现任国恩资本公司投资总监。

吴泾川先生，复旦大学金融学硕士、软件工程学士，10 年以上金融从业经验，长期从事量化投资研究及投资组合管理工作，对基本面多因子策略体系、组合优化、交易系统设计等都有丰富的实践经验，现任国恩资本投资经理。

管理人保证其指定的投资经理介绍内容的合法性、真实性、准确性，同时保证其指定的投资经理已取得基金从业资格并在基金业协会完成注册，并且不存在任何任职禁止或任职冲突的情况。”

#### 现变更为：

##### “（一）投资经理

本基金的投资经理由管理人指定。管理人保证投资经理下述简介内容合法、真实、准确，保证投资经理已取得基金从业资格并在基金业协会完成注册，并且不存在任何任职禁止或任职冲突的情况。

#### 1、投资经理及简介：

何文领先生，先后在各大券商、投资公司从事投资工作，对证券市场有着深刻的了解与

研究，现任国恩资本公司投资总监。

吴泾川先生，复旦大学金融学硕士、软件工程学士，10 年以上金融从业经验，长期从事量化投资研究及投资组合管理工作，对基本面多因子策略体系、组合优化、交易系统的设计等都有丰富的实践经验，现任国恩资本投资经理。

## 2、投资经理变更程序

管理人可根据业务需要自主决定变更投资经理。管理人应当在变更后按照本合同约定及时通知投资者及托管人，并设置临时开放日允许不同意的投资者赎回。”

## 5、《基金合同》第十二章“私募基金的投资”“（四）投资策略”原表述为：

### “（四）投资策略

#### 1、指数增强投资策略

本基金对标中证 500 指数，主策略为 500 指数增强策略，在整个市场体系内，通过量化的多因子模型来筛选股票，多点投注、降低风险，利用行为因子非线性动力特征力争构建能稳定获得超额收益的现货组合。

#### 2、其他策略

本基金将根据市场变化和管理人的判断，投资本基金投资范围内约定的投资品种、投资工具等，力争实现基金资产的稳步增值。”

### 现变更为：

### “（四）投资策略

#### 1、大类资产配置策略

采用自上而下的分析方法，跟踪并研判宏观经济数据和政策变化，研究各类资产当前估值水平、周期阶段和市场情绪，从而做出对各大类资产的前瞻性战略判断，确定权益类、固收类、现金类、商品及衍生品类等资产的投资比例。该策略持续研判市场短中期的潜在热点和风险因素，持续优化资产配置和风险管理。

#### 2、固收类资产投资策略

本基金固定收益类投资策略，主要投资于短期融资券、中期票据、公司债、企业债等债券品种。投资策略基于管理人对宏观经济、利率走势、收益率曲线、信用变化、市场情绪等的研究，针对特定类别的债券和个券、发行主体进行深入细致研究，综合采取信用套利、流动性套利、久期套利、跨市场套利等多种投资模式，平衡管理信用风险、利率风险和流动性风险等多个风险来源，力争在风险可控前提下实现投资组合的收益目标。

#### 3、权益类资产投资策略

本基金权益类资产投资策略包括量化多头策略、量化中性策略和宽基指数择时配置策略。权益类量化多头策略采用多因子选股模型构建投资组合，并根据产品与市场情况采用日内交易算法增强收益，策略以获取相对稳定的超额收益为目标。权益类量化中性策略，结合量化多头策略和衍生品对冲，收益来源为超额收益与对冲成本的差额。量化多头策略采用自研风险模型，并通过自适应模型调整因子权重，以适应多种市场环境。宽基指数择时配置策略，利用 ETF 等工具构建投资组合，并通过研判市场形势，积极利用市场波动带来的择时交易机会。

#### 4、现金管理工具投资策略

本基金现金管理工具投资策略的目标是在严格控制风险的前提下，提升基金整体投资组合的流动性，并适当增厚收益。根据基金产品的潜在流动性需求、投资组合构成、当前市场机会情况等多个方面的考虑，来决定现金管理工具投资策略在投资组合中的占比。

#### 5、商品及衍生品投资策略

##### （1）股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以对冲为目的，有选择地投资于股指期货。

本基金在进行股指期货投资时，将通过研究对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

##### （2）国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。

##### （3）商品期货投资策略

采用自上而下、自下而上、量化投资等多种方法，跟踪并研判主要大宗商品的供求关系、基差、期限价差、价量等指标的变化，从而做出对商品期货的前瞻判断，在严格控制仓位和敞口的基础上，通过单边、对冲、套利等方式参与商品期货的投资。

**以上内容为私募基金管理人对于本基金全部或部分投资品种相应投资策略的阐述，不构成对于本基金投资范围、投资比例及限制或其他投资风控指标的补充。本基金存续期间，私募基金管理人也将根据市场情况及时动态调整相关品种的投资策略。”**

## 二、协议的效力

1、自本协议生效日起，本协议即作为《基金合同》不可分割的组成部分，与《基金合同》具有同等的法律效力。本协议自《基金合同》终止时止。除本协议明确约定修改的条款外，《基金合同》其余部分应继续有效。本协议与《基金合同》有冲突的，以本协议为准。

2、本协议自全体基金投资者、基金管理人、基金托管人签署后，于管理人向托管人出具的生效通知载明的生效日期作为本协议生效日期。基金托管人不就该等生效通知是否发送全体基金投资者承担审核监督职责。

3、本协议采用纸质合同方式签署的，应当由基金投资者本人签字或授权代表签字（基金投资者为自然人）或基金投资者法定代表人或授权代表签字（或盖章）并加盖公章或合同专用章（基金投资者为机构（法人或其他组织）、基金管理人和基金托管人加盖公章或合同专用章以及法定代表人或授权代表签字（或盖章）。本协议采用纸质合同方式签署的，亦可采用套印托管人/及管理人公章（或合同专用章）、法定代表人/执行事务合伙人或授权代表签字（或盖章）的套印版纸质合同方式与基金投资者进行签署，套印版纸质合同的生效及法律效力等同于基金管理人和基金托管人直接签署。

本协议采用电子签名方式签署的，各方应当采取符合《电子签名法》等法律法规、监管

规定有关要求的电子签名方式签署，电子签名与签署纸质合同具有同等法律效力。

4、本协议由管理人负责联系基金投资者签署，管理人对投资者签署本协议的真实性、准确性及完整性负责，托管人对投资者签署本协议不承担任何审核监督职责。如因投资者签署本协议不真实不准确不完整导致的协议无效、损害赔偿等任何责任，由管理人自行承担，与托管人无关。

5、管理人应当及时向托管人提供基金投资者签署的本协议文本并按本协议约定通知托管人本协议生效。如因管理人未及时提供投资者签署协议文本，或如因管理人未及时向托管人出具本协议生效通知的，由此造成本协议未及时生效、未生效等相关责任，由管理人自行承担。

### 三、其他事项

1、本协议如有未尽事宜，由协议当事人各方按有关法律法规的规定协商解决。

2、本协议生效日后新申购本基金份额的基金投资者，可以一并签署《基金合同》和本协议，也可以签署根据本协议修改后的新版《基金合同》（以实际签署的合同名称为准），具体签署方式以管理人决定为准。

3、本协议一式叁份，当事人各执壹份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文，接协议签署页。）

（本页无正文，为《国恩中证 500 指数增强 1 号私募证券投资基金基金合同（2024 年 2 月版）补充协议》的签署页）

基金投资者：

自然人（签字）：

法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签章）：

签署日期： 年 月 日

基金管理人：深圳前海国恩资本管理有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签章）：

签署日期： 年 月 日



基金托管人：中信建投证券股份有限公司（盖章）

法定代表人或授权代理人（签章）：

签署日期： 年 月 日

