

## 国恩高频量化9号私募证券投资基金私募基金合同补充协议（二）

甲方（基金份额持有人）

乙方（管理人）：深圳前海国恩资本管理有限公司

丙方（托管人）：国泰君安证券股份有限公司

鉴于甲方、乙方、丙方签署了《国恩高频量化9号私募证券投资基金私募基金合同》及合同变更文件（如有，包括通过补充协议、征询意见函、公告等法律法规规定或合同约定的方式进行合同变更的文件）（以下统称“原基金合同”），现三方在平等、自愿的基础上经友好协商，一致同意对原基金合同的相关内容进行修订，以兹各方共同遵守。

### 一、补充协议主要的内容

#### （一）修订基金名称

将本基金名称由【国恩高频量化9号私募证券投资基金】改为【国恩宏观精进17号私募证券投资基金】；

原合同封面、正文章节、签署页、附件及页眉部分中涉及“【国恩高频量化9号私募证券投资基金】”均修改为“【国恩宏观精进17号私募证券投资基金】”。

#### （二）修订第十一章“私募基金的投资”第（三）条“投资策略”

##### 1、原表述：

“1、量化模型选股：量化模型主要采用多因子选股以及机器学习模型，因子主要为量价指标，因子来源主要为研究员对市场的跟踪以及通过稳健统计挖掘出大量的市场规律和有效因子，再利用计量统计原理处理高维度、非线性数据，最终通过组合优化模型得出最优的投资组合；

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。

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。”

**修改为：**

“1、大类资产配置策略 本基金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、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、权益类资产投资策略 本基金权益类资产投资策略包括宽基指数择时配置策略和股票策略。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，以获取绝对收益为目标。股票策略在大类资产配置的框架之下，选择要参与的股票市场、考量股票仓位，基于对基本面分析、市场情绪分析和技术分析，进行个股挑选和组合构建，以获取绝对收益为目标。

3、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。

4、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）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。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。

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。私募基金托管人对投资策略条款不负有监督义务。”

**二、补充协议的成立、生效及效力**

1、本补充协议自三方签署之日起成立。

2、补充协议生效

本补充协议生效应当同时满足如下条件：

- (1) 全体份额持有人均与管理人、托管人合法签署完毕本补充协议；
- (2) 管理人向托管人出具符合托管人要求的《补充协议生效告知函》；

当满足上述条件后，本补充协议自托管人收到补充协议和《补充协议生效告知函》原件或扫描件之日起生效。若托管人收到补充协议和《补充协议生效告知函》原件或扫描件之日和《补充协议生效告知函》载明的协议生效日不一致的，生效时间以生效告知函中载明的协议生效日期和托管人收到生效告知函的时间孰晚的日期为准。

管理人仅可以下述三种方式向托管人发送《补充协议生效告知函》：

- (1) 通过托管人指定的网站上传，自网站显示审核通过时起视为已送达托管人；
- (2) 通过公认的快递的形式（不包括挂号信或平邮的形式）寄送的，管理人应当以书面形式告知托管人快递单号，自托管人签收之日起视为已经送达；
- (3) 通过电子邮件的形式向托管人发送的，自管理人收到托管人的表示收悉的邮件回复起视为已经送达。

如管理人通过两种或以上的方式向托管人发送《生效告知函》的，以确认送达托管人的较早时间为准。

3、补充协议的追溯效力

本补充协议约定的合同变更内容的生效时间按照下述第【2】种方式确定：

- (1) 本补充协议约定变更的内容需要追溯至【/】年【/】月【/】日生效，且管理人保证《补充协议生效告知函》应当正确载明该等追溯事项。
- (2) 本补充协议约定变更的内容无需追溯既往。

4、本补充协议生效后，管理人应根据托管人的具体要求及时将补充协议和《补充协议生效告知函》原件发送至托管人，并保证原件与扫描件一致。扫描件与原件不一致的，托管人以扫描件为准。

5、本补充协议有效期为补充协议生效日至新基金合同终止日。

6、本补充协议是对原基金合同的调整补充，构成原基金合同不可分割的组成部分，与原基金合同具有同等法律效力。若本补充协议与原基金合同存在任何冲突，以本补充协议约定为准。

7、本补充协议中使用的词语，除上下文另有所指外，与原基金合同中的词语具有相同的含义。

### 三、其他

1、本补充协议一式叁份，甲乙丙三方当事人各执壹份，每份均具有同等法律效力。

2、管理人承诺应在本补充协议生效后及时书面通知全体基金份额持有人，具体生效情况以管理人通知为准。

（以下无正文）

（本页无正文，为《国恩高频量化 9 号私募证券投资基金私募基金合同补充协议（二）》  
签署页。）

基金份额持有人：

自然人（签字）：

证件名称：身份证、军官证、护照、港澳台回乡证或台胞证

证件号码：

或机构（盖章）：

统一社会信用代码：

法定代表人或授权代表（签字或盖章）：

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

法定代表人或授权人（签字或盖章）：

基金管理人：深圳前海国恩资本管理有限公司

法定代表人或授权人（签字或盖章）：

签署时间：      年      月      日