

# 关于珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金

## 变更基金合同的公告

鉴于基金投资者、基金管理人和基金托管人已签署珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金及其合同变更文件（如有，合同变更文件包括通过补充协议、征询意见函、通知函、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）（以下简称“《基金合同》”）。根据法律法规的变化（中国证券投资基金业协会已发布《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”））以及珠池可转债量化精选 2 期私募投资基金（以下简称“本基金”）《基金合同》的约定，经与基金托管人确认，上海珠池资产管理有限公司就《运作指引》要求变更本基金相关投资条款，现将《基金合同》变更情况向基金份额持有人公告如下：

### 一、基金合同条款具体修改如下：

#### 序号 1

#### 二、释义

新增条款：
34、流动性受限资产：指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具、收益凭证、场外衍生品（指收益互换、场外期权）、私募资管产品（含私募基金）等中国证监会或中国基金业协会认可的流动性受限资产。

#### 序号 2

### 七、基金的申购、赎回与转让 （一）申购和赎回的开放日及时间

原条款：	现条款：
------	------

<p>基金投资者可在本基金开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本基金，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。基金投资者须在开放日或开放日之前的工作日的9：00-15：00内根据募集机构的规定向募集机构及其销售网点提交书面申请文件（如募集机构另有规定的，遵循募集机构相关规定办理申请提交事宜）。未提交书面申请文件的，募集机构及其销售网点有权拒绝投资者的申购或赎回申请。若法律法规、中国证监会、中国基金业协会有新的规定或出现其他特殊情况，基金管理人将视情况对开放时间进行相应调整并进行通知。</p> <p>本基金份额原则上自认购/申购之日（认购日为基金成立日、申购日为申购所对应开放日）起6个月（每月按30个自然日计算，含头不含尾，含满6个月当日）不允许基金份额持有人进行赎回，管理人同意的情况下可以进行调整。</p> <p>本基金申购开放日为每个自然周周一、二、三、五（遇法定节假日均顺延至下一工作日，如顺延至同一工作日，则上述重合的开放日只开放一个工作日），赎回开放日为每个自然季度的最后一个工作日，如申购开放日和赎回</p>	<p>基金投资者可在本基金开放日根据本合同相关约定申购和/或赎回本基金，但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或本合同的规定发布暂停申购和/或赎回通知时除外。基金投资者须在开放日或开放日之前的工作日的9：00-15：00内根据募集机构的规定向募集机构及其销售网点提交书面申请文件（如募集机构另有规定的，遵循募集机构相关规定办理申请提交事宜）。未提交书面申请文件的，募集机构及其销售网点有权拒绝投资者的申购或赎回申请。若法律法规、中国证监会、中国基金业协会有新的规定或出现其他特殊情况，基金管理人将视情况对开放时间进行相应调整并进行通知。</p> <p>本基金份额原则上自认购/申购之日（认购日为基金成立日、申购日为申购所对应开放日）起6个月（每月按30个自然日计算，含头不含尾，含满6个月当日）不允许基金份额持有人进行赎回，管理人同意的情况下可以进行调整。</p> <p>本基金申购开放日为每个自然周周一（遇法定节假日顺延至下一工作日；如本周无下一个工作日的，则本周无固定开放日），赎回开放日为每个自然月度的最后一个周一（遇法定节假日则顺延至该周下一周的对应日；以此类</p>
--	--

<p>开放日为同一工作日，则该日既可以申购，也可以赎回。</p> <p>出现以下情形时，管理人可增设临时开放日：法律、法规、自律规则及有关政策发生变化及其他情形需对本基金进行合同变更、能够公平保护所有投资者利益的基金投资运作需求、流动性管理等。临时开放日只可赎回不可申购，具体开放日期以管理人通知为准（管理人向托管人发出申购和/或赎回指令即视为已向托管人通知增设临时开放日，因管理人未及时通知基金投资者临时开放日导致的损失，托管人不承担责任）。</p>	<p>推），如申购开放日和赎回开放日为同一工作日，则该日既可以申购，也可以赎回。</p> <p>出现以下情形时，管理人可增设临时开放日：法律、法规、自律规则及有关政策发生变化及其他情形需对本基金进行合同变更、能够公平保护所有投资者利益的基金投资运作需求、流动性管理等。临时开放日只可赎回不可申购，具体开放日期以管理人通知为准（管理人向托管人发出申购和/或赎回指令即视为已向托管人通知增设临时开放日，因管理人未及时通知基金投资者临时开放日导致的损失，托管人不承担责任）。</p>
--	--

序号 3

十一、基金的投资 （六）投资限制

原条款：	现条款：
<p>本基金存续期内，基金总资产与净值产的比例不得超过 200%；</p> <p>本基金投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。</p> <p>基金管理人自本合同生效之日起 3 个月内使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原</p>	<p>1、本基金存续期内，基金总资产与净值产的比例不得超过 200%；</p> <p>2、按成本与市值孰低计算，投向 AA 级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不超过基金净资产 20%（债券评级参照债项评级，无债项评级参照主体评级）；（其中场外期权及收益互换按全部账户内已占用保证金计算）；</p> <p>本基金投资组合遵循相关法律法规</p>



<p>因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。除本合同另有约定外，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。</p> <p>在本基金到期日前 10 个交易日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限制可以不符合上述基金配置比例规定。</p>	<p>规或监管部门对于投资比例限制的规定的。</p> <p>基金管理人自本合同生效之日起 3 个月内使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标。除本合同另有约定外，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。</p> <p>在本基金到期日前 10 个交易日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限制可以不符合上述基金配置比例规定。</p>
--	--

## 二、重要提示

1、基金份额持有人不同意上述变更内容的，可在管理人设置的【2025】年【01】月【09】日临时开放日赎回本基金，上述临时开放日不受本基金合同中关于基金份额不允许赎回期限的限制，且开放赎回的份额不收取赎回费（如有）。

对于未在上述临时开放日全部赎回的份额持有人，视为同意本次变更内容。

2、上述变更内容自 2025 年 01 月 10 日起正式生效。

特此公告。

基金管理人：上海珠池资产管理有限公司

2025 年 01 月 06 日



