

《明泓稳健增长紫气 1 号私募证券投资基金私募基金合同》变更告知函

致基金份额持有人：

您所持有的明泓稳健增长紫气 1 号私募证券投资基金（以下简称“该基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。为更好地为您提供投资服务，我司拟根据《明泓稳健增长紫气 1 号私募证券投资基金基金合同》（以下简称“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，特向您告知相关变更事宜。

一、明泓稳健增长紫气 1 号私募证券投资基金基金合同条款具体修改如下

（一）修订第八章“当事人及权利义务”第（二）条“基金管理人”

1、原表述：

“名称：上海明泓投资管理有限公司

住所：上海市虹口区沽源路 110 弄 15 号（集中登记地）

通讯地址：上海市浦东新区世纪大道 1568 号中建大厦 501 室

法定代表人：裘慧明

联系人：田芩蔚

联系电话：021-61009699

网址：www.mhfunds.com ”

修改为：

“名称：上海明泓投资管理有限公司

住所：上海市虹口区沽源路 110 弄 15 号（集中登记地）

通讯地址：上海市虹口区东大名路 1089 号北外滩来福士东塔 39 楼

法定代表人：裘慧明

联系人：田芩蔚

联系电话：021-61009699

网址：www.mhfunds.com”

(二) 修订第十一章“基金的投资”第(八)条“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金(X=3, 4, 5...N)的相关情况如下”

1、原表述:

“① 明泓稳健增长 2 期私募投资基金

1、投资目标

基于模型和事件驱动的选股，选出最近能跑赢市场的股票组合，利用市场短期的效率残缺和滞后，通过交易和选股产生超额收益。

2、投资范围

本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可交换债券）、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金、期货、期权、权证、资产支持证券、收益互换、保险公司资产管理计划、证券公司及其子公司发行的资产管理计划、信托计划、基金公司（含基金子公司）特定客户资产管理计划、期货公司及其子公司发行的资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有相关资质机构托管的契约式私募投资基金、银行理财产品。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。

3、投资策略

以量化选股和事件驱动为主，择机参与宏观等策略。主策略用量化模型和事件驱动选股，找出市场低估的股票和最近热点股票，每天对股票池进行动态管理，剔除已经没有很大上行空间的持仓股票，加入新的强势股，

主策略是基于基本面和价量的选股和热点事件驱动的选股策略，不同的策略组合可以比单一策略有更好的收益风险比。

辅助交易策略为宏观策略，期货程序化，期货基本面套利和期权策略。宏观策略利用市场情绪，经济数据来分析股指和商品期货方向，在极端行情下能对冲股票的风险。本基金会采用期货程序化以及期货基本面套利，获取和主策略不同的超额收益。会择机参与期权交易，在资金规模不大的情况下获取比较高的收益。

4、投资限制

1) 持有的股指期货合约价值（非轧差计算）为委托财产净值的 0%~300%;

2) 持有的国债期货合约价值（非轧差计算）为委托财产净值的 0%~300%;

3) 交易性金融负债的市值为委托财产净值的 0%~50%;

4) 持有的权益类资产（包括证券交易所买入股票、证券投资基金（货币市场基金除外）等）市值、股指期货多头合约价值、股指期货空头合约价值、交易性金融负债的市值，合计（轧差计算）为委托财产净值的-250%~250%；

5) 固定收益类产品（央行票据、国债、金融债、短期融资券、企业债、中期票据、资产支持证券、债券逆回购、协议存款和通知存款等）的投资比例按成本计算为委托财产总值的 0%~100%；

6) 现金、货币市场基金等流动性资产的投资比例按成本计算为委托财产总值的 0%~100%。

5、基金的费用

(1) 托管费：年托管费率为 0.06%；

(2) 基金服务费：年基金服务费率为 0.06%；

(3) 基金的证券、期货交易费用及账户开户费用；

(4) 基金备案后与之相关的会计师费和律师费；

(5) 基金的银行汇划费用；

(6) 合同文件制作、印刷费用；

(7) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

② 明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=3, 4, 5...N)

1、投资目标

在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。

2、投资范围

本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股、权证）、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券，但不包括中小企业私募债和非公开发行公司债）、证券回购、存款、公开募集证券投资基金、期货、场内期权、在银行间债券市场交易的标准化票据、在交易所或银行间发行的资产支持证券和资产支持票据（但不包括次级）、证券公司收益凭证、收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。

3、投资策略

沪深 300 指数增强策略为主，使用多因子量化选股模型预测股票未来价格，找出市场低估的股票和最近热点股票，每天对股票池进行动态管理，剔除已经没有很大上行空间的持仓股票，加入新的强势股，最终获

取沪深 300 指数收益以及超额收益。同时根据基金管理的需要，通过合理投资基金合同所包含的其他投资标的，取得合理的预期回报。本基金可通过持有沪深交易所上市交易的存托凭证间接投资于境外基础证券。

4、投资限制

1) 本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-100%;

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。

5、基金 A 类份额的费用

(1) 托管费：年托管费率为 0.04%;

(2) 基金服务费：年基金服务费率为 0.04%;

(3) 基金的证券、期货交易费用及账户开户费用;

(4) 基金备案后与之相关的会计师费和律师费;

(5) 基金的银行汇划费用;

(6) 合同文件制作、印刷费用;

(7) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

上述关于“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=3, 4, 5...N)”合同条款的相关表述仅为列举，最终条款以实际签署的基金合同为准，如发生上述列举的条款与“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=3, 4, 5...N)”基金合同表述不一致的，以“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=3, 4, 5...N)”合同表述为准。

在“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=3, 4, 5...N)”存续期间，“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=3, 4, 5...N)”的基金管理人可以调整投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、基金费用，无需另行征得本基金份额持有人的同意。但“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=3, 4, 5...N)”的基金管理人决定调整投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、上调基金费率的，应将调整事项通知本基金份额持有人。本基金管理人应在本基金的下一开放日前向本基金份额持有人披露该调整事项，本基金份额持有人不认可该调整事项，应在本基金的下一个开放日（含临时开放日）赎回基金份额。如本基金份额持有人未在开放日申请赎回基金份额则视为同意该调整事项。该调整事项的生效时间应晚于本基金下一个开放日（含临时开放日）。本基金份额持有人签署本合同即认可并同意：虽有上述约定，但本基金份额持有人于下一开放日申请赎回时，“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=3, 4, 5...N)”相应调整事项仍可能已生效，且本基金可能已受到该调整事项影响（包括因该调整事项而导致本基金无法赎回的风

险)，托管人不对“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金(X=3, 4, 5...N)”相关调整事项是否生效及管理人是否已向本基金份额持有人披露进行监督。”

修改为：

“① 明泓稳健增长 2 期私募投资基金

1、投资目标

基于模型和事件驱动的选股，选出最近能跑赢市场的股票组合，利用市场短期的效率残缺和滞后，通过交易和选股产生超额收益。

2、投资范围

本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可交换债券）、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金、期货、期权、权证、资产支持证券、收益互换、保险公司资产管理计划、证券公司及其子公司发行的资产管理计划、信托计划、基金公司（含基金子公司）特定客户资产管理计划、期货公司及其子公司发行的资产管理计划、在基金业协会登记的私募基金管理人发行并由具有相关资质机构托管的契约式私募投资基金、银行理财产品。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。

3、投资策略

以量化选股和事件驱动为主，择机参与宏观等策略。主策略用量化模型和事件驱动选股，找出市场低估的股票和最近热点股票，每天对股票池进行动态管理，剔除已经没有很大上行空间的持仓股票，加入新的强势股，

主策略是基于基本面和价量的选股和热点事件驱动的选股策略，不同的策略组合可以比单一策略有更好的收益风险比。

辅助交易策略为宏观策略，期货程序化，期货基本面套利和期权策略。宏观策略利用市场情绪，经济数据来分析股指和商品期货方向，在极端行情下能对冲股票的风险。本基金会采用期货程序化以及期货基本面套利，获取和主策略不同的超额收益。会择机参与期权交易，在资金规模不大的情况下获取比较高的收益。

4、投资限制

1) 持有的股指期货合约价值（非轧差计算）为委托财产净值的 0%~300%；

2) 持有的国债期货合约价值（非轧差计算）为委托财产净值的 0%~300%；

3) 交易性金融负债的市值为委托财产净值的 0%~50%；

4) 持有的权益类资产（包括证券交易所买入股票、证券投资基金（货币市场基金除外）等）市值、股指期货多头合约价值、股指期货空头合约价值、交易性金融负债的市值，合计（轧差计算）为委托财产净值的-250%~250%；

5) 固定收益类产品（央行票据、国债、金融债、短期融资券、企业债、中期票据、资产支持证券、债券逆回购、协议存款和通知存款等）的投资比例按成本计算为委托财产总值的 0%~100%；

6) 现金、货币市场基金等流动性资产的投资比例按成本计算为委托财产总值的 0%~100%；

7) 向全部交易对手方缴纳的场外期权交易保证金和权利金合计不得超过基金净资产的 25%；

8) 参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收益互换合约名义本金的 50%；

9) 参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%。

5、基金的费用

(1) 托管费：年托管费率为 0.06%；

(2) 基金服务费：年基金服务费率为 0.06%；

(3) 基金的证券、期货交易费用及账户开户费用；

(4) 基金备案后与之相关的会计师费和律师费；

(5) 基金的银行汇划费用；

(6) 合同文件制作、印刷费用；

(7) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

② 明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金

1、投资目标

在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。

2、投资范围

本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股、权证）、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券，但不包括中小企业私募债和非公开发行公司债）、证券回购、存款、公开募集证券投资基金、期货、场内期权、在银行间债券市场交易的标准化票据、在交易所或银行间发行的资产支持证券和资产支持票据（但不包括次级）、证券公司收益凭证、收益互换与场外期权

（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。

3、投资策略

沪深 300 指数增强策略为主，使用多因子量化选股模型预测股票未来价格，找出市场低估的股票和最近热点股票，每天对股票池进行动态管理，剔除已经没有很大上行空间的持仓股票，加入新的强势股，最终获取沪深 300 指数收益以及超额收益。同时根据基金管理的需要，通过合理投资基金合同所包含的其他投资标的，取得合理的预期回报。本基金可通过持有沪深交易所上市交易的存托凭证间接投资于境外基础证券。

4、投资限制

1) 按市值计算，本基金投资于股票等股权类资产的比例不低于本基金已投资资产 80%；

权益类（股权类）：股票、存托凭证、优先股、股票型公开募集证券投资基金、混合型公开募集证券投资基金、公开募集基础设施证券投资基金（REITs）。

2) 本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-100%；

3) 本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过 200%；

4) 以市值计算，本基金投资单个上市公司股票市值不得超过基金资产净值的 10%；

5) 本基金投资于同一资产的资金（期货按单品种单月份合约占用保证金计算；场内期权买方按照单品种单月份期权合约支付的权利金市值计算，场内期权卖方按照单品种单月份期权合约占用的保证金计算，场外期权按缴纳的保证金及权利金计算，收益互换按保证金计算，其他资产按成本与市值孰低计算），不得超过本基金净资产的 25%；

6) 本基金投向 AA 级及以下（债券评级参照债项评级，无债项评级参照主体评级）信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不得超过基金净资产 20%（其中，场外衍生品按全部账户内已占用保证金计算；其他资产按成本与市值孰低计算）；

7) 除国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、中国基金业协会认可的投资品种外，本基金投资于同一债券的资金（按成本与市值孰低计算），不得超过基金净资产的 10%；且本基金投资于同一发行人及其关联方（关联方信息以公开数据为准）发行的债券资金总额（按成本与市值孰低计算），不得超过基金净资产的 25%；

8) 本基金投资债券质押式协议回购业务时，质押或者接受质押单一债券，按面值计算，不得超过基金净资产的 10%；质押或者接受质押同一发行人及其关联方（关联方信息以公开数据为准）发行的债券，按面值计算，不得超过本基金资产净值的 25%；与单一交易对手方开展回购交易的金额不得超过基金净资产的 10%；

上述债券均不含国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、协会认可的投资品种；

9) 本基金持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%；

10) 自 2024 年 8 月 1 日起，参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；

11) 自 2024 年 8 月 1 日起，参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收益互换合约名义本金的 50%

12) 自 2024 年 8 月 1 日起，向全部交易对手方缴纳的场外期权交易保证金和权利金合计不得超过基金净资产的 25%；

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。

5、基金 A 类份额的费用

(1) 违约赎回费：若基金份额持有时间少于 3 个月，收取违约赎回费率 1%；

(2) 托管费：年托管费率为 0.04%；

(3) 基金服务费：年基金服务费率为 0.04%；

(4) 基金的证券、期货交易费用及账户开户费用；

(5) 基金备案后与之相关的会计师费和律师费；

(6) 基金的银行汇划费用；

(7) 合同文件制作、印刷费用；

(8) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

③ 明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N)

1、投资目标

在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。

2、投资范围

本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、存托凭证、优先股、权证）、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券，但不包括中小企业私募债和非公开发行公司债）、证券回购、存款、公开募集证券投资基金、期货、场内期权、在银行间债券市场交易的标准化票据、在交易所

或银行间发行的资产支持证券和资产支持票据（但不包括次级）、证券公司收益凭证、收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。

3、投资策略

沪深 300 指数增强策略为主，使用多因子量化选股模型预测股票未来价格，找出市场低估的股票和最近热点股票，每天对股票池进行动态管理，剔除已经没有很大上行空间的持仓股票，加入新的强势股，最终获取沪深 300 指数收益以及超额收益。同时根据基金管理的需要，通过合理投资基金合同所包含的其他投资标的，取得合理的预期回报。本基金可通过持有沪深交易所上市交易的存托凭证间接投资于境外基础证券。

4、投资限制

1) 本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-100%;

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。

5、基金 A 类份额的费用

- (1) 托管费：年托管费率为 0.04%;
- (2) 基金服务费：年基金服务费率为 0.04%;
- (3) 基金的证券、期货交易费用及账户开户费用;
- (4) 基金备案后与之相关的会计师费和律师费;
- (5) 基金的银行汇划费用;
- (6) 合同文件制作、印刷费用;
- (7) 按照国家有关规定和本合同约定，可以在基金资产中列支的其他费用。

上述关于“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N)”合同条款的相关表述仅为列举，最终条款以实际签署的基金合同为准，如发生上述列举的条款与“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N)”基金合同表述不一致的，以“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N)”合同表述为准。

在“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N)”存续期间，“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N)”的基金管理人可以调整投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、基金费用，无需另行征得本基金份额持有人的同意。但“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、

明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N) ” 的基金管理人决定调整投资目标、投资策略、投资范围、投资限制、上调基金费率的，应将调整事项通知本基金份额持有人。本基金管理人应在本基金的下一开放日前向本基金份额持有人披露该调整事项，本基金份额持有人不认可该调整事项，应在本基金的下一个开放日（含临时开放日）赎回基金份额。如本基金份额持有人未在开放日申请赎回基金份额则视为同意该调整事项。该调整事项的生效时间应晚于本基金下一个开放日（含临时开放日）。本基金份额持有人签署本合同即认可并同意：虽有上述约定，但本基金份额持有人于下一开放日申请赎回时，“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N) ” 相应调整事项仍可能已生效，且本基金可能已受到该调整事项影响（包括因该调整事项而导致本基金无法赎回的风险），托管人不对“明泓稳健增长 2 期私募投资基金、明泓稳健增长 3 期私募证券投资基金、明泓稳健增长 X 期私募证券投资基金 (X=4, 5...N) ” 相关调整事项是否生效及管理人是否已向本基金份额持有人披露进行监督。”

二、变更具体流程

我司将指定【2025】年【08】月【29】日为本基金临时开放日，允许不接受该等变更事项的基金份额持有人进行赎回。本次临时开放日仅允许赎回，且不受基金合同“基金的申购、赎回与转让”中关于基金开放日及基金份额不允许赎回期限的限制（如有），且本次临时开放赎回的份额不收取赎回费（如有）。如份额持有人在上述临时开放日未退出的，即视为接受上述变更事项。本次临时开放日的设置，不影响基金合同中已约定的开放日安排。

三、合同条款变更生效事宜

相关合同条款变更将自【2025】年【09】月【02】日起正式生效。

管理人：上海明泓投资管理有限公司

