

# 关于世纪前沿优优指数增强 1 号私募证券投资基金 基金合同变更的征询意见函（202601）

世纪前沿优优指数增强 1 号私募证券投资基金基金委托人：

世纪前沿优优指数增强 1 号私募证券投资基金（基金编号：SAAV97）系海南世纪前沿私募基金管理有限公司（下称“本公司”）管理、东方财富证券股份有限公司托管的私募基金。

根据基金业协会《私募证券投资运作指引》（中基协发〔2024〕5 号，下称《运作指引》）的规定，本公司拟采用征询意见函的方式变更本基金的基金合同相关约定：

## 一、《基金合同》变更的相关约定

《世纪前沿优优指数增强 1 号私募证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）第二十二章“基金合同的效力、变更、解除与终止”下“(二)基金合同的变更”对《基金合同》变更程序进行了约定：“法律法规和自律规则发生变化需要对本合同进行变更的，基金管理人可与基金托管人协商后修改基金合同，并由基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。……对基金合同进行重大的变更、补充，基金管理人应当在变更或补充生效之日起 5 个工作日内向基金业协会报告。”

《基金合同》第十一章“基金的投资”约定，本基金的投资范围、投资限制发生变更时，若有份额持有人提出异议的，私募基金管理人应及时通过设置临时开放日等方式供其赎回。

## 二、《基金合同》变更主要内容

鉴于《运作指引》属于前述自律规则发生变化，本公司拟变更《基金合同》如下内容：

	规范前产品要素	规范后产品要素
《基金合同》第二章	-	<b>【新增】：</b> 37、流动性受限资产：指到期日在 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、

		<p>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、场外期权、收益互换、收益凭证、私募类资产管理产品（含私募基金，但不含【世纪前沿优优指数增强1号a期私募证券投资基金】），私募基金管理人与私募基金托管人可根据法律法规和自律规则的要求协商一致进行调整。</p> <p>38、同一资产：系《私募证券投资基金运作指引》（中基协发〔2024〕5号）第四十一条第（九）项规定，即：</p> <p>（1）标准化股权类资产按照单一上市公司公开发行的股票、存托凭证，视为同一资产；</p> <p>（2）标准化债权类资产按照单只债券、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，视为同一资产；</p> <p>（3）非标准化债权类资产（如证券公司发行的保本型收益凭证、质押式报价回购、质押式协议回购、标准化票据）按照同一“融资主体”及其关联方视为同一资产；</p> <p>（4）基金类资产按照单只证券投资基金或者资产管理产品视为同一资产；</p> <p>（5）标准化期货和衍生品类资产按照单只期货或者期权合约视为同一资产；</p> <p>（6）场外衍生品类资产：场外期权及证券公司发行的非保本型收益凭证按照同一“交易对手方”视为同一资产；收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产。</p> <p>如法律法规、自律规则发生变化的，以最新规则或要求为准。</p>
<p>《基金合同》第十一章“（三）投资范围”</p>	<p>1、国内证券交易所依法发行上市的股票（含新股申购）、港股通、存托凭证、权证；</p> <p>2、在证券交易所以及银行间市场发行的资产支持证券；</p> <p>3、国内期货交易所期货、场内期权；</p> <p>4、与证券公司开展融资融券业务、转融通证券出借交易（即本基金将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司）、公开募集的证券投资基金、证券公司发行的收益凭证、银行存款、大额</p>	<p><b>【修改为】：</b></p> <p>本基金将主要财产投资于“世纪前沿优优指数增强1号a期私募证券投资基金”（以下简称“标的基金”）的A类份额，其余财产可以投资货币市场基金、银行活期存款、国债、中央银行票据。</p>

	<p>存单、同业存单、货币市场基金、国债逆回购（仅限于交易所债券通用质押式逆回购）；</p> <p>5、由海南世纪前沿私募基金管理有限公司管理的并具有证券投资基金托管资格的机构托管的私募证券投资基金、证券期货经营机构管理的证券投资类的资产管理计划……</p>	
《基金合同》第十一章“（四）投资策略”	<p>本基金采用指数增强策略，通过多因子量化选股策略等分析方法进行股票交易，积极把握股票市场波动，实现股票日内回转，在此基础上力争为投资人带来持续稳定的长期回报。</p> <p>本基金投资策略由私募基金管理人制定，具体实施过程由管理人自行把握和监控，托管人不负责监控。</p>	<p>本基金主要投资于“标的基金”的A类份额，同时辅以各类其他管理手段，谋求资产的增值。</p> <p>本基金投资策略由私募基金管理人制定，具体实施过程由管理人自行把握和监控，托管人不负责监控。</p>
《基金合同》第十一章“（五）投资限制”	<p>“……</p> <p>1、基金总资产与净资产的比例不得超过200%；</p> <p>2、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制；</p> <p>3、参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的25%；</p> <p>……”</p>	<p><b>【修改为】:</b></p> <p>“……</p> <p>1、本基金投资于股票等股权类资产的比例，按市值计算，不得低于本基金已投资资产（不包含现金管理工具）的80%；如本基金投资其他资管产品（含私募基金）的，本条监控按照穿透合并计算进行；</p> <p>2、基金总资产与净资产的比例不得超过200%；</p> <p>3、以市值计算，本基金投资于“标的基金”的比例不低于基金净资产的90%（含）；</p> <p>4、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%；</p> <p>5、本基金不得投向未经具有证券投资基金托管资格的机构托管的私募基金。</p> <p>6、本基金不得投资于结构化金融产品（含资产证券化产品）的次级/劣后级份额。</p> <p>7、法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。</p> <p>……”</p>

<p>《基金合同》第十一章“(十三)“标的基金”的相关情况”</p>	<p>-</p>	<p><b>【新增】:</b></p> <p>1、“标的基金”投资目标</p> <p>“标的基金”在严格有效控制风险的前提下，力争获取长期稳定的投资回报。</p> <p>2、“标的基金”投资范围</p> <p>1) 国内证券交易所依法发行上市的股票（含新股申购）、港股通、存托凭证、权证；</p> <p>2) 在证券交易所以及银行间市场发行的资产支持证券；</p> <p>3) 国内期货交易所期货、场内期权；</p> <p>4) 与证券公司开展融资融券业务、转融通证券出借交易（即本基金将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司）、公开募集的证券投资基金、证券公司发行的收益凭证、银行活期存款、大额存单、同业存单、货币市场基金、国债逆回购（仅限于交易所债券通用质押式逆回购）；</p> <p>3、“标的基金”投资策略</p> <p>“标的基金”采用量化指数增强投资策略，以【中证 500】指数作为基金投资组合的标的指数，通过多因子量化选股模型结合高中低频信号，构建对标指数的投资组合获取股票超额收益，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。策略主要通过多因子模型精选个股，在量价、基本面、另类因子等层面持续挖掘出大量有效性显著、相关性低、稳定且具有相当超额能力的因子，高中低全频段覆盖，不断扩充底层因子池，采用线性和非线性方法构建因子组合，坚持长周期、多样化、大容量概念，在保持对基准指数有效跟踪的同时，力争实现对基准指数的长期超越。</p> <p>以上内容为“标的基金”的基金管理人对于“标的基金”全部或部分投资品种相应投资策略的阐述，不构成对于“标的基金”投资范围、投资比例及限制或其他投资风控指标的补充。</p> <p>“标的基金”投资策略由“标的基金”的基金管理人制定，具体实施过程由“标的基金”的管理人自行把握和监控，本基金托管人不负责监控。</p>
------------------------------------	----------	---

		<p>4、“标的基金”投资限制</p> <p>1) 本基金投资于股票等股权类资产的市值不低于本基金已投资资产 80%；如本基金投资其他资管产品（含私募基金）的，本条监控按照穿透合并计算进行；</p> <p>2) 基金总资产与净资产的比例不得超过 200%；</p> <p>3) 参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%。</p> <p>4) 以市值计算，“标的基金”投资于同一资产的资金占基金资产净值的比例不超过 25%；</p> <p>5) 以市值计算，“标的基金”管理人管理的全部私募证券投资基金投资于同一资产的资金，不得超过该资产的 25%（法律法规、自律规则另有豁免情况的除外）；</p> <p>6) “标的基金”持有的 AA 级及以下信用债（不含可转债）及流动性受限资产合计不得超过基金净资产 20%（债券评级参照债项评级，无债项评级参照主体评级，相关评级均不参考中债资信）；</p> <p>7) “标的基金”管理人的实际控制人控制的私募证券基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计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%，中国证监会、协会另有规定的除外；</p> <p>8) 法律法规、中国证监会以及本合同规定的其他投资限制。</p> <p>上述第 3、4 项不包括银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种。</p> <p>5、风险收益特征：目标基金风险等级为 R4，适合风险承受能力等级为【C4、C5】的合格投资者。</p> <p>6、“标的基金”A 类份额的费用</p> <p>（1）基金管理人的管理费：A 类份额不收取管理费；</p>
--	--	---

	<p>(2) 基金托管人的托管费：基金资产净值 0.024%/年；</p> <p>(3) 行政服务机构的行政服务费：基金资产净值 0.016%/年；</p> <p>(4) 投资顾问的投资顾问费；</p> <p>(5) 基金管理人的业绩报酬：A 类份额不计提业绩报酬；</p> <p>(6) 基金的证券交易费用及各类账户开户费用（包括但不限于印鉴刻制费、账户开立费、网银 U 盾费、网银证书年费等）；</p> <p>(7) 为基金募集、运营、审计、法律顾问、投资顾问等提供服务的基金服务机构的相应服务费；</p> <p>(8) 基金的银行汇划费、银行账户维护费；</p> <p>(9) 与本基金销售、签约有关的费用（包括纸质合同印刷费用（如有）、投资者适当性管理费用（如有）、电子合同服务费用（如有）等）；</p> <p>(10) 本基金投资运作直接相关应税项目或应税行为产生的增值税及附加税费；</p> <p>(11) 基金终止时的清算费用；</p> <p>(12) 召开基金份额持有人大会等相关费用；</p> <p>(13) 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。</p> <p>上述关于“标的基金”的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“标的基金”的基金合同表述不一致的，以“标的基金”的实际合同表述为准。</p> <p>在“标的基金”存续期间，“标的基金”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，无需另行征得本基金份额持有人的同意。但“标的基金”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</p>
--	---

		<p>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，“标的基金”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），基金托管人不对“标的基金”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。</p> <p>在“标的基金”存续期间，“标的基金”的基金管理人应确保满足以下规定：（1）“标的基金”投资于同一资产的资金，不得超过该基金净资产的25%；（2）“标的基金”的基金管理人管理的全部私募证券投资基金投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%。符合前款第（1）项分散投资要求的私募证券投资基金投资单只私募基金的资金，可以不受前款第（2）项规定的投资比例限制。</p>
--	--	--

### 三、《基金合同》变更的流程

我司将于 2026 年 1 月 7 日至 2026 年 1 月 12 日（以下简称“征询期”）向基金委托人就上述本次《基金合同》条款变更事项（以下简称“本次合同变更事项”）征询意见。我司将指定 2026 年 1 月 12 日为赎回开放日，若基金委托人不同意本次合同变更条款的，应于该开放日赎回其所有基金份额，上述赎回开放日不受《基金合同》中关于基金份额不允许赎回期限的限制。

若基金委托人未在本征询意见函指定的开放日赎回本基金的，均视为基金委托人同意本次变更。

本次合同变更将于 2026 年 1 月 13 日起正式生效。

特此公告。

海南世纪前沿私募基金管理有限公司（盖章）

2026 年 1 月 6 日