

关于《涵元天璇量化 1 号投资基金基金合同》 变更的公告

尊敬的投资人：

上海涵元资产管理有限公司(以下简称“我公司”)管理的“涵元天璇量化 1 号基金”自成立以来，一直规范运作、稳健运营。因北交所业务开展需要，原基金合同的投资范围未对北交所业务进行约定，为更好地为投资人提供投资服务，特对《涵元天璇量化 1 号投资基金基金合同》第十章第七条“涵元天璇量化投资基金的相关情况”作如下变更：

序号 1

(七)“涵元天璇量化投资基金”的相关情况如下：

原条款：	现条款：
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、可转换债券）、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金（不包括 ETF 基金一级市场申购、赎回）、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	2、投资范围 本基金的投资范围包括国内证券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

券金融公司。	出借给证券金融公司。 本基金可投资于证券公司（含证券公司子公司）资产管理计划、期货公司（含期货子公司）资产管理计划、信托计划、基金公司（含基金子公司）资产管理计划、保险公司（含保险子公司）资产管理计划、银行理财产品、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募投资基金，但不可投资于上述产品的劣后级份额。
原条款：	现条款：
3、投资策略 1)、精选量化策略构建投资组合，追求绝对收益，通过优选多种立足于不同建模维度、具有不同风险收益特征的量化投资策略，重点配置与当下市场环境匹配的稳健型投资策略，注重策略组合搭配的风险分散，追求独立于市场的长期、持续、稳定的绝对回报。 2)、策略间注重风险隔离，严格控制组合风险，每个策略均有独立实盘统计和模拟跟踪，进行动态监控及风控管理。策略范围覆盖趋势市、平衡市及市场中性，每个策略根据量化系统风险收益评估，动态调整股票、债券、	3、投资策略 1)、精选量化策略构建投资组合，追求绝对收益，通过优选多种立足于不同建模维度、具有不同风险收益特征的量化投资策略，重点配置与当下市场环境匹配的稳健型投资策略，注重策略组合搭配的风险分散，追求独立于市场的长期、持续、稳定的绝对回报。 2)、策略间注重风险隔离，严格控制组合风险，每个策略均有独立实盘统计和模拟跟踪，进行动态监控及风控管理。策略范围覆盖趋势市、平衡市及市场中性，每个策略根据量化系统风险收益评估，动态调整股票、债券、

现金及衍生品的配置比例，严格控制单策略风险及总体组合风险。 3)、引入对冲工具，优化策略收益结构利用股指期货和商品期货等金融衍生品进行对冲，有效规避大量市场风险，减少市场不利波动对产品收益的冲击。	现金及衍生品的配置比例，严格控制单策略风险及总体组合风险。 3)、引入对冲工具，优化策略收益结构利用股指期货和商品期货等金融衍生品进行对冲，有效规避大量市场风险，减少市场不利波动对产品收益的冲击。 4) 对于存托凭证投资，本基金管理人将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。
原条款：	现条款：
4、投资限制 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。	4、投资限制 1) 本基金投资于国内证券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%； 2) 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。

序号 2

十九、风险揭示（一）市场风险

新增条款：

1、股票投资风险主要包括：

（4）本基金可投资于科创板及创业板股票，科创板及创业板股票发行采用注册制，在上市门槛、公司盈利能力、公司股权架构、发行价格、减持制度、交易机制、涨跌幅限制以及退市制度等方面与其他 A 股板块的股票不同，可能导致本基金净值波动更大；

（5）本基金可投资于北京证券交易所上市交易的股票，北京证券交易所上市交易的股票可能存在较高的流动性风险且日间交易不活跃，因此可能会面临估值不公允且无法及时变现的风险；北京证券交易所上市交易的股票可能实行高于沪深交易所的涨跌幅限制，当出现不利行情时，本基金所投资北京证券交易所上市交易的股票可能会产生较大波动从而可能导致本基金遭受较大损失的风险。

本次合同变更的生效日期为：2021 年 11 月 10 日

后续新投资人将签署（202101 版）基金合同，（202101 版）基金合同将会在基金合同中就本次变更条款直接调整。

特此公告



上海涵元资产管理有限公司

2021年11月23日