

关于广东宏锡基金管理有限公司 旗下私募基金基金合同变更的协商函（20240617）

尊敬的基金份额持有人：

广东宏锡基金管理有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）在中信证券股份有限公司（“基金托管人”）托管的每一个私募基金（私募基金清单见附件，前述清单中每一个私募基金以下被单独称为“私募基金”）拟根据每一个私募基金的《基金合同》（含各私募基金的合同变更文件，变更文件包括通过补充协议、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，每一个私募基金的前述文件以下统称为“《基金合同》”）的约定以及法律法规的变化（中基协已发布《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）对前述清单中每一个私募基金的基金合同相关条款进行变更。我司特与基金托管人协商关于每一个《基金合同》的如下条款变更的意见。

一、《基金合同》条款具体修改如下：

1、在《基金合同》“基金的投资”章节的“投资限制”条款内容中增加如下约定：

“本基金开展场外衍生品交易的，自2024年8月1日（含）起应当符合下列要求：

（1）新增场外期权合约以及存续合约展期的，除仅开展商品类场外期权交易外，基金净资产不低于5000万元；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%；

（2）新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产不低于1000万元；参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的50%；

（3）参与证券公司等机构发行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%；

本基金参与场外衍生品交易的，基金管理人应当在本基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给基金托管人。基金管理人签订场外衍生品交易文件时，应当明确授权由交易对手方、相关交易的清算机构在本基金下一



估值日前直接向基金托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。

基金管理人承诺确保本基金在实际投资运作中符合本条投资限制的约定，并负责主动协调交易对手方按时向基金托管人提供准确、完整的估值信息，交易对手方未按时提供或提供不完整的由基金管理人负责补充提供，基金管理人需确保交易文件和估值信息的真实性、准确性、完整性和及时性。前述交易文件和估值信息需覆盖以上投资限制所需的各种类型标识和金额数据(包括但不限于交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约交易结构、合约挂钩标的等信息)。

基金托管人自2024年8月1日(含)起对本条款进行监督。本基金新增场外期权合约、收益互换合约及存续合约展期的，在场外投资划款指令到达基金托管人时，基金托管人对基金净资产规模是否符合本条要求进行事中审核；本基金持有场外衍生品合约期间，基金托管人仅根据交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人提供的交易文件和估值信息对本基金是否符合本条要求进行事后监督。基金托管人不对交易文件和估值信息进行任何实质性判断，也不对其真实性、准确性、完整性、及时性和/或所载内容的专业性、正确性负责。若出现交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人未按时发送交易文件和估值信息、交易文件和估值信息底层数据缺失、交易文件和估值信息内容有误、交易文件和估值信息因交易对手方的标准不统一产生口径及含义而导致存在差异的、交易文件和估值信息格式变化且未提前与基金托管人沟通确认、基金管理人和/或交易对手方的信息发送人、其所发送的信息未经其公司内部授权或确认等情形，导致基金托管人无法监督、未能监督或所监督内容与实际不符的，基金托管人不承担任何责任。”

上述变更内容自【2024】年【6】月【17】日起开始生效。我司承诺合同变更后生效后将按根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求及时履行报告义务以及向投资者披露。

特此通知。

基金管理人：广东宏锡基金管理有限公司(盖章)

2024年06月17日



附件：私募基金清单

产品全称	产品代码
宏锡信享量化 CTA1 号私募证券投资基金	SAHE55
宏锡商品期货指数增强 A 期私募证券投资基金	SAEF11
宏锡钻选 CTA1 号私募证券投资基金	SB6939
宏锡量化 CTA78 号私募证券投资基金	SXU398
宏锡 CTA 海盈宜选一号私募证券投资基金	SQY113
宏锡信长量化 CTA 私募证券投资基金	SQZ294
宏锡量化 CTA7 号二期私募证券投资基金	SQP622
宏锡量化 CTA7 号三期私募证券投资基金	SQP623
宏锡恒享量化 CTA2 号私募证券投资基金	SQH297
宏锡量化 CTA29 号五期私募证券投资基金	SQE785
宏锡量化 CTA30 号十期私募证券投资基金	SQE891
宏锡量化 CTA60 号私募证券投资基金	SQL886
宏锡量化进取型 CTA 六号私募证券投资基金	SQG029
宏锡量化 CTA30 号八期私募证券投资基金	SQD500
宏锡量化 CTA 成长型 A 期私募证券投资基金	SQC657
宏锡量化 CTA 进取型 B 期私募证券投资基金	SQC660
宏锡恒享量化 CTA1 号私募证券投资基金	SQD225
宏锡沧海量化 CTA2 号私募证券投资基金	SNN537
宏锡量化 CTA55 号私募证券投资基金	SNQ130
宏锡量化 CTA53 号私募证券投资基金	SNL950
宏锡沧海量化 CTA1 号私募证券投资基金	SNG849
宏锡天宏量化 CTA9 号私募证券投资基金	SLW522
宏锡量化 CTA29 号二期私募证券投资基金	SLK574
宏锡量化 CTA30 号三期私募证券投资基金	SLD672
宏锡量化 CTA36 号私募证券投资基金	SJY197
宏锡量化 CTA27 号私募证券投资基金	SGD747

