

# 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征询函变更公告

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”）在国投证券股份有限公司（“基金托管人”）托管的私募基金（私募基金清单见附件）拟根据私募基金的《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》”））对私募基金清单中的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征询关于私募基金清单中全部私募基金《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、相关交易的清算机构按时向基金托管人提供准确、

完整的估值信息，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和/或相关交易的清算机构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。若出现交易对手方和/或相关交易的清算机构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、交易对手方和/或相关交易的清算机构的信息发送人、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 7 月 22 日起开始生效。我司承诺合同变更生效后将根据法律法规、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



附件：私募基金清单

产品名称	产品代码
宏锡瑞锋量化 CTA 私募证券投资基金	SLB362