

关于宏锡量化 CTA88 号私募证券投资基金

变更基金合同的公告

鉴于基金投资者、基金管理人和基金托管人已签署《宏锡量化 CTA88 号私募证券投资基金基金合同》及其合同变更文件（如有，合同变更文件包括通过补充协议、征询意见函、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）（以下简称“《基金合同》”）。根据法律法规的变化（中国证券投资基金业协会已发布《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”））以及宏锡量化 CTA88 号私募证券投资基金（以下简称“本基金”）《基金合同》的约定，经与基金托管人确认，广东宏锡基金管理有限公司就《运作指引》要求变更本基金相关投资条款，现将《基金合同》变更情况向基金份额持有人公告如下：

一、《基金合同》变更内容

1、第十一章“基金的投资”之“（五）投资比例和投资限制”相关条款增加以下内容：

（1）本基金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，最新经估值核对的基金净资产不低于 5000 万元。

（2）本基金投资的场外期权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%。

（3）本基金新增投资收益互换合约或存续合约展期的，最新经估值核对的基金净资产不低于 1000 万元。

（4）本基金参与挂钩股票、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%。

（5）本基金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%。

2、第十一章“基金的投资”新增“投资场外衍生品的特别说明”

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

理人应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，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）。

基金托管人的投资监督依赖于基金管理人或交易对手方提供的交易信息和行情信息；由于前述交易信息和行情信息可能由于交易对手方的标准不统一，其信息口径或含义可能存在较大差异，进而影响监控结果；基金管理人应按照监管及基金业协会的要求确保相关资产交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性，基金托管人不具体审核交易信息和行情信息，不对交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前述交易数据可能不真实、不准确、不完整、不及时，或者因前述数据口径不明确等原因导致基金托管人无法及时或准确进行投资监督的，基金托管人不承担任何责任。

二、重要提示

1、基金份额持有人不同意上述变更内容的，可在管理人设置的【2024】年【7】月【11】日临时开放日赎回本基金，上述临时开放日不受本基金合同中关于基金份额不允许赎回期限的限制，且开放赎回的份额不收取赎回费（如有）。对于未在上述临时开放日全部赎回的份额持有人，视为同意本次变更内容。

2、上述变更内容自 2024 年 7 月 12 日起正式生效。

特此公告。

基金管理人：广东宏锡基金管理有限公司

2024年7月4日

