

关于宏锡量化CTA16号私募证券投资基金变更基金合同的公告

宏锡量化CTA16号私募证券投资基金（以下简称“本基金”）基金投资者、基金管理人和基金托管人已签订《宏锡量化CTA16号私募证券投资基金基金合同》及其合同变更文件（如有，包括补充协议、征询意见函等法律法规规定或基金合同约定的方式进行合同变更的文件，以下合称“《基金合同》”）。中国证券投资基金业协会发布的《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）将于2024年8月1日起施行，基于本基金投资运作安排，根据本基金《基金合同》约定，经与基金托管人确认，我司拟根据《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、原被动超限内容修订为：

受证券期货市场波动、证券发行人合并、证券投资基金规模变动等基金管理人之外的因素影响，导致本基金的投资比例不符合《基金合同》约定的，基金管理人应当在20个交易日内调整至符合要求。因资产流动性受限导致无法完成前述调整的，应当在相关资产可出售、可转让或者恢复交易后的20个交易日内调整至符合要求。

2、投资比例相关条款增加以下内容：

本基金开展场外衍生品交易的，自2024年8月1日起应当符合下列要求：

(1) 本基金新增场外期权合约以及存续合约展期（商品类场外期权除外）时，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以及存续合约展期时，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%。

3、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，前述交易文件和估值信息需覆盖以上投资比例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。

4、基金管理人的声明与承诺新增：

如本基金开展场外衍生品交易的，本基金及本基金投资者均不存在份额分级安排。私募基金管理人不得将场外衍生品交易异化为股票、债券等场内标的的杠杆融资工具，不得为基金销售机构向自然人投资者销售特定结构的场外衍生品提供通道服务，不得为投资者提供规避场外衍生品交易要求的通道服务。

5、删除“全国中小企业股份转让系统挂牌公司股票”或“新三板”投资范围，同时删除对应的投资限制及投资策略表述。

二、重要提示

1、上述变更自 2024 年 8 月 1 日起正式生效。

2、基金份额持有人不同意上述变更的，可于上述生效日期之前联系我司或者销售机构办理赎回，未在上述生效日期之前赎回的，视为同意本次变更。

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 9 日

