

关于磐耀三期证券投资基金 合同变更临时开放公告

尊敬的份额持有人：

根据基金业协会最新发布的《私募证券投资基金运作指引》第十七条规定，因我司管理的“磐耀三期证券投资基金”（以下简称“本基金”）基金合同中投资范围涉及场外衍生品投资品种，所以需要对本基金合同内容进行修改。根据本基金合同“二十二、基金合同的变更、终止”相关约定，我司将采取与基金托管人【国金证券股份有限公司】双方协商一致的方式进行合同变更；并设置2024年06月28日作为临时开放日，受理不同意本次变更的基金份额持有人赎回事项，且该临时开放日的赎回申请不受份额锁定期（若有）、封闭期（若有）和巨额赎回（若有）的限制；该开放日所有未申请赎回的基金份额持有人均默认同意本次合同变更事项。

合同变更条款具体如附件一内容所示。

本次合同拟变更内容生效后将根据法律法规以及本基金合同的规定及时向投资者披露。

特此公告。

上海磐耀资产管理有限公司

2024年06月25日



附件一：

关于上海磐耀资产管理有限公司 旗下私募基金基金合同变更的协商函（20240624）

国金证券股份有限公司：

上海磐耀资产管理有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）在国金证券股份有限公司（“贵司”或“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、自律规则的变化（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。我司特与贵司协商关于每一个《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：

（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的同时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）。

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。”

上述变更自【 2024 】年【 8 】月【 1 】日起开始生效。

二、合同变更流程

我司通过本协商函向贵司征询意见，在与贵司书面达成一致意见并收到贵司的《复函》后，我司将负责按照《基金合同》的约定及时向基金委托人披露基金合同的变更事宜并按监管的规定及时向监管机构报备。为避免歧义，上述“书面”形式包括纸质文件、扫描件（含传真件，下同）或者电子文件等形式，如扫描件与纸质文件不一致的，以基金托管人留存的扫描件为准。

我司承诺将根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求就合同变更事项及时履行报告义务以及向基金委托人披露。本次合同变更生效后，对于新增基金委托人首次申购本基金的，基金管理人须确保其所签署的产品合同为根据变更内容调整后的最新有效的基金合同。因新投资者签署的合同版本与实际不符而导致

的损失，由基金管理人承担相应的责任，基金托管人不承担任何责任。

三、本函一式【两】份，基金管理人、基金托管人各执一份。

基金管理人： 上海磐耀资产管理有限公司（盖章）

年 月 日