

关于龙全5号私募证券投资基金 基金合同变更的公告

尊敬的投资人：

上海龙全投资管理有限公司（以下简称“我司”）在招商证券股份有限公司托管的龙全5号私募证券投资基金（以下简称“该基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。为了符合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》的新规要求，本基金合同拟增加场外衍生品投资限制条款（详见附件一）。

上述变更自【2024】年【8】月【1】日起正式生效。

上海龙全投资管理有限公司

2024年7月2日

附件：具体调整方案：

方案2

序号1 “投资限制”增加：

- 1、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、参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证

金比例不低于该收益互换合约名义本金的 50%;

3、参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%;

序号 2 “投资禁止行为” 增加:

如涉及投资场外衍生品的, 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, 基金净资产低于 5000 万元; 新增收益互换合约以及存续合约展期的, 基金净资产低于 1000 万元;

序号 3 “越权交易” 章节增加:

特别地, 如投资比例和投资限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等监控的, 基金托管人的越权交易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, 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; 由于场外衍生品和收益凭证等场外衍生品属于非标准化资产, 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监控、未能监控或监控不准确的, 基金托管人不承担任何责任。