

## 关于【明沅股票精选优优 1 号私募证券投资基金】所投标的基金增加投资限制的公告

致基金份额持有人：

您好！

您持有了我司作为管理人发行的【明沅股票精选优优 1 号私募证券投资基金】，该基金投资了【明沅股票精选 56 期私募证券投资基金】。鉴于中基协《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，《运作指引》发布公告要求在 2024 年 8 月 1 日前针对其第十七条场外衍生品交易的规定完成合同整改，我司拟增加【明沅股票精选 56 期私募证券投资基金】投资限制，特向您告知相关变更事宜。

### 一、【明沅股票精选 56 期私募证券投资基金】基金合同条款具体修改如下

#### 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。

## 二、变更具体流程

我司将指定【2024】年【07】月【17】日为本基金（临时）开放日，允许不接受该等变更事项的基金份额持有人进行赎回。本次（临时）开放日仅允许赎回，且不受基金合同“基金的申购、赎回与转让”中关于基金开放日及基金份额不允许赎回期限的限制（如有），且本次临时开放赎回的份额不收取赎回费（如有）。如份额持有人在上述（临时）开放日未退出的，即视为接受上述变更事项。本次临时开放日的设置，不影响基金《合同》中已约定的开放日安排。

## 三、合同条款变更生效事宜

本次【明沅股票精选 56 期私募证券投资基金】相关合同条款变更将自【2024】年【08】月【01】日起正式生效。

特此公告，请您知悉！

管理人：上海明沅投资管理有限公司

（盖章）

【2024年06月28日】

