

衍复优优中证 1000 指数增强二号私募证券投资基金基金合同变更的公告

尊敬的委托人：

您持有的由上海衍复投资管理有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）管理的且由【招商证券股份有限公司】（托管人）托管的衍复优优中证 1000 指数增强二号私募证券投资基金主要投资于《基金合同》中约定的标的基金衍复优优中证 1000 指数增强私募证券投资基金。为更好地为委托人提供服务，基于法律法规的变化（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》”）），我司采用与托管人协商一致向投资人披露的变更方式，按照《运作指引》第十七条关于场外衍生品交易的规定处理标的基金基金合同的整改，并同步更新《基金合同》“基金的投资”章节所述的标的基金合同条款。具体修订内容如下：

一、《基金合同》“基金的投资”章节所述的标的基金衍复优优中证 1000 指数增强私募证券投资基金投资限制中增加约定如下：

“本基金开展场外衍生品交易的，自 2024 年 8 月 1 日（含）起应当符合下列要求：

（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%；”

我司将设置临时开放日 2024 年 7 月 10 日接受投资者的赎回申请。

上述变更内容自 2024 年 7 月 12 日起开始生效。

特此公告。

上海衍复投资管理有限公司（盖章）

2024 年 7 月 4 日

