

# 关于变更国恩宏观精进6号私募证券投资基金投资限制的公告

尊敬的投资者：

深圳前海国恩资本管理有限公司（以下简称“我司”）管理、中信建投证券股份有限公司托管的国恩宏观精进6号私募证券投资基金（以下简称“本基金”）目前处于正常存续阶段。现根据《私募证券投资基金运作指引》第十七条规定，我司拟变更本基金投资限制，增加投资场外衍生品相关投资限制。变更安排如下：

## 一、基金合同变更方式

本基金基金合同“基金合同的效力、变更、解除与终止”章节“基金合同变更方式”中约定因法律法规变化原因变更基金合同的，管理人经与托管人协商一致，可直接对本合同相关内容进行变更，无需事前征得投资者同意。我司依据前述约定开展本次基金合同变更工作。

## 二、基金合同变更安排

### 1、基金合同变更内容

#### 1) 基金合同“基金的投资”章节“投资限制”新增如下第 i 条限制：

“i、自2024年8月1日起本基金开展场外衍生品交易的，应符合下列要求：

(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%，但经管理人核实并确认全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于1000万元（穿透认定）的封闭式私募证券投资基金除外；

**特别约定：**本基金参与场外衍生品交易的，管理人应当在该基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给托管人。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该基金下一估值日前直接向托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。如因管理人（或交易对手方、相关交易的清算机构等）未提供/未及时向托管人提供前述材料或者向托管人提供虚假或不完整材料，导致基金估值结果

