

# 关于万柏投资管理有限公司 旗下私募基金基金合同变更的公告

基金委托人：

关于万柏投资管理有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）管理的私募基金（本公告所涉及的基金管理人旗下的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”），根据私募基金对应的《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，私募基金的前述文件以下统称为“《基金合同》”）的约定及法律法规的变化（包括但不限于中基协发〔2024〕5号《私募证券投资基金运作指引》等），拟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。目前，我司已与私募基金托管人就私募基金《基金合同》的变更内容达成一致，现将具体变更内容公告如下。

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，自2024年8月1日（含）起应当符合下列要求：

（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%；

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)。

基金托管人自 2024 年 8 月 1 日(含)起对本条款进行监督。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。”

特别的：如《基金合同》中已载有与上述变更内容相关的条款(包括但不限于相关投资标的的投资限制、投资比例、风控措施等条款，以下简称“原条款”)，且原条款较上述变更方案中的约定更为严格(例如，原条款的规模门槛更高、可允许投资的比例限制更低、禁止投资某一具体场外衍生品种等，符合该情形的原条款以下简称“严格原条款”)，则上述变更内容不视为对《基金合同》严格原条款的删除、替代或修改，即使基金管理人已对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，《基金合同》的严格原条款依然有效，仍按照《基金合同》严格原条款执行；反之，如《基金合同》原条款较上述变更方案中的约定更为宽松(例如原条款的规模门槛更低、可允许投资的比例限制更高等)，且基金管理人对私募基



金的《基金合同》完成合同变更的，则按照上述公告变更内容执行。

○【上述变更内容将于【2024】年【7】月【12】日起正式生效，我司将指定【2024】年【7】月【16】日为赎回开放日，若基金委托人不同意本次合同变更条款的，应于该开放日赎回其所有基金份额，否则视为同意前述变更。】

二、我司承诺按照私募基金对应的《基金合同》的约定将本公告通知至各私募基金的全体基金委托人，并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。

特此公告。

基金管理人：万柏投资管理有限公司（盖章）



2024 年 7 月 10 日

附件：私募基金清单

序号	产品名称	产品代码
1	万柏多策略3号私募证券投资基金	SNB128
2	万柏礼赞5号私募证券投资基金	STE269



# 关于万柏投资管理有限公司旗下私募基金基金合同变更的 协商函（20240712）

中信证券股份有限公司：

关于万柏投资管理有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）在中信证券股份有限公司（以下简称“贵司”或“基金托管人”）托管的私募基金（本协商函所涉及的基金管理人旗下的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”），根据私募基金对应的《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，私募基金的前述文件以下统称为“《基金合同》”）的约定及法律法规的变化（包括但不限于中基协发〔2024〕5号《私募证券投资基金运作指引》等），现拟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私募基金《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，自2024年8月1日（含）起应当符合下列要求：

（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%；

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)。

基金托管人自 2024 年 8 月 1 日(含)起对本条款进行监督。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。”

特别的：如《基金合同》中已载有与上述变更内容相关的条款(包括但不限于相关投资标的的投资限制、投资比例、风控措施等条款，以下简称“原条款”)，且原条款较上述变更方案中的约定更为严格(例如，原条款的规模门槛更高、可允许投资的比例限制更低、禁止投资某一具体场外衍生品种等，符合该情形的原条款以下简称“严格原条款”)，则上述变更内容不视为对《基金合同》严格原条款的删除、替代或修改，即使基金管理人已按照本协商函对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，《基金合同》的严格原条款依然有效，仍按照《基金合同》严格原条款执行；反之，如《基金合同》原条款较上述变更

方案中的约定更为宽松（例如原条款的规模门槛更低、可允许投资的比例限制更高等），且基金管理人按照本协商函对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，则按照本协商函的上述变更内容执行。

上述变更内容自 2024 年 7 月 12 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，在收到贵司的《复函》后，我司将负责按照私募基金《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，并按监管规定及时向监管机构报备。

我司提供的协商函（含托管人《复函》）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、传真件、电子文件与纸质文件不一致的，以基金托管人留存的扫描件、传真件或电子文件为准。

若私募基金的《基金合同》变更事项涉及法律法规规定要求基金管理人保障基金委托人赎回权利的，我司将设置临时开放日允许不接受该等变更事项的基金委托人进行赎回，该等赎回申请不受《基金合同》关于份额锁定期（若有）、封闭期（若有）的限制。对于是否属于基金管理人应设置或有权设置临时开放日的任何情形，由我司自行负责判断和具体执行，基金托管人及/或行政服务机构不对此负责监督或承担其他任何责任。行政服务机构仅依据基金管理人的指示、通知进行相关配合。

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，若有新增基金委托人的，我司将确保其所签署的产品合同或其附件包含本次变更的内容。因新基金委托人签署的合同内容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： 万柏投资管理有限公司（盖章）

年 月 日

附件：私募基金清单

序号	产品名称	产品代码
1	万柏多策略 3 号私募证券投资基金	SNB128
2	万柏礼赞 5 号私募证券投资基金	STE269



## 复 函

万柏投资管理有限公司：

贵司发来的《关于万柏投资管理有限公司旗下私募基金基金合同变更的协商函（20240712）》已收悉，我司对贵司在上述协商函中所述的合同条款变更内容无异议。

本复函一式两份，双方各执一份。

中信证券股份有限公司托管部（公章/合同专用章）

年 月 日