

关于世纪前沿优优指数增强 1 号私募证券投资基金 基金合同变更的公告

尊敬的投资者：

您好，感谢持有我司作为基金管理人发行的私募基金。根据《私募证券投资基金运作指引》，如私募基金不符合第十七条相关要求的，自 2024 年 8 月 1 日开始将不得新增投资者，不得展期，除因追加保证金需要募集外不得新增募集规模，合同到期后进行清算。

为了避免您持有的私募基金转入被动存续，我司基于保护投资人利益原则，结合相关监管文件要求以及基金合同约定，对基金合同场外衍生品内容（收益凭证/收益互换/场外期权）选择以下方案进行整改。

一、《基金合同》变更主要内容

鉴于《运作指引》属于前述自律规则发生变化，本公司拟变更《基金合同》如下内容：

	规范前产品要素	规范后产品要素
《基金合同》第十一章 “（五）投资限制”	-	（新增）3、参与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%； 本基金投资于场外期权、收益互换、收益凭证的，基金管理人应当要求交易对手方对场外衍生品交易是否涉及 DMA 多空互换、带敲入和敲出结构等投资限制作出书面说明。基金管理人应当向基金托管人提供该前述书面材料，基金管理人拒不提供的，托管人有权拒绝执行基金管理人的相关投资指令。
《基金合同》第十五章 “（三）基金托管人对基金管理人投资运作的监督”	-	（新增）10、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

		<p>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。</p>
<p>《基金合同》第十六章 “(一) 基金财产的估值 (13)”</p>	<p>若本基金进行收益互换或场外期权等场外衍生品投资的，根据交易对手或第三方提供的估值基准日估值报告进行估值。第三方或交易对手无法提供估值报告的，按成本估值。基金管理人应确保在本基金每个开放日对应的估值日内向基金托管人提供交易对手或第三方出具的最新估值报告。如果不属于上述情况的，则基金管理人应向基金托管人提供标的产品的估值方法和估值数据，并确保提供数据的真实、完整和有效，如内容不完整、不准确、不及时或不真实，由此造成的损失由基金管理人承担相应责任。</p>	<p>本基金参与场外衍生品交易的，按估值日其交易对手方提供的交易文件中体现的估值信息估值。基金管理人签订场外衍生品交易合约时，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通过邮件等托管人认可的方式向基金托管人提供估值日当日最新的场外衍生品交易文件，并持续提供相关估值信息。基金管理人应确保上述估值数据的真实、完整和有效，如内容不完整、不准确、不及时或不真实，由此造成的损失由基金管理人承担相应责任。</p>

二、《基金合同》变更的公告和生效

公司设置 2024 年 7 月 19 日为临时开放日，不同意上述变更的份额持有人可在该临时开放日赎回其持有份额。如份额持有人在临时开放日未赎回的，即视为份额持有人已以其行为表明同意上述合同变更事项。

上述变更自 2024 年 7 月 31 日起生效，本次变更不会影响本公司发行的私募基金的投

资策略以及合规运作，我司将继续专业合规运作私募基金，并按有关规定及时报中国证券投资基金业协会备案。

海南世纪前沿私募基金管理有限公司

2024年 7月 8日