

# 关于东方港湾马拉松二号私募投资基金 临时开放的公告

尊敬的投资者：

根据《私募证券投资基金运作指引》第十七条、第四十二条等的规定，管理人应在基金合同中新增场外衍生品相关自律规定。本基金资产主要投资于东方港湾马拉松一号私募投资基金（以下简称“标的基金”），标的基金的管理人与基金托管人就前述变更事项已达成一致，具体请见附件。

如您不接受标的基金该等变更事项，我司设置临时开放日【2024年7月17日】允许不接受标的基金该等变更事项的本基金份额持有人进行赎回。如您在本次临时开放日未全部退出的，即视为接受上述变更事项。

特此公告。

深圳东方港湾投资管理股份有限公司

2024年7月11日

## 附 件

### 关于在基金合同中新增场外衍生品相关自律规定的事项

鉴于中国证券投资基金业协会（以下简称协会）发布《私募证券投资基金运作指引》（以下简称《运作指引》），并于2024年8月1日正式实施。已备案私募证券投资基金基金合同不符合《运作指引》第十七条的，应在实施之日前按《运作指引》要求及协会规定修改基金合同。我公司作为基金管理人就所涉及私募基金产品基金合同的变更内容向基金托管人国泰君安证券股份有限公司（以下简称“基金托管人”）出具《深圳东方港湾投资管理股份有限公司产品合同变更告知函》，经基金管理人与托管人共同确认，《基金合同》按照如下变更方案变更相关条款：

#### （一）修订“私募基金的投资”中“投资限制”小节

新增最后一条表述：

“自2024年8月1日（含）起，本基金投资应当遵循以下限制。私募基金托管人对以下限制的监督，依赖于本私募基金管理人、交易商、经纪商等机构提供的数据的真实性、准确性、完整性、及时性，监督频率亦受限于私募基金托管人收到数据的频率（可能以季度或更低的频率对相关指标进行核算、监督）。若因收到数据不真实、不准确、不完整、不及时导致私募基金托管人无法准确监督相关投资限制，给基金资产或投资者造成损失的，私募基金托管人不承担赔偿责任。

（1）本基金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；本基金参与场外期权交易的，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) 本基金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;本基金参与挂钩股票、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) 本基金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(如雪球结构场外衍生品)的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%;”

2、特别提示:私募基金托管人投资监督职责的履行受限于其能够及时、准确、完整获取资本市场公开资讯数据,亦受限于私募基金管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他服务机构或交易对手方、相关交易的清算机构等及时提供相关数据和信息的真实性、准确性、完整性和有效性,私募基金托管人无法对前述数据和信息的真实性、准确性、完整性和有效性进行核验。如因相关数据和信息的获取不符合前述要求而导致私募基金托管人对相关投资范围、投资限制无法监督或无法准确进行监督的,可能会对私募基金管理人、基金份额持有人造成相关损失以及可能会对基金运作产生其他不利的影响。

**3、上述《基金合同》的变更内容自 2024 年 7 月 18 日起生效执行。**

深圳东方港湾投资管理股份有限公司

2024 年 07 月 11 日