

盛泉恒元多策略量化对冲 2 号基金

增加投资限制的公告

尊敬的投资人：

盛泉恒元多策略量化对冲 2 号基金（以下简称“本基金”）自成立以来一直坚持规范运作，现根据基金业协会《私募证券投资基金运作指引》的要求，增加相关投资限制，具体约定如下：

“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) 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。前述交易文件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）。基金合同当事方同意并确认，基金托管人仅根据基金管理人、基金管理人授权的交易对手方或相关交易清算机构提供的材料进行形式审核，管理人应确保所提供材料的真实性和有效性，如因基金管理人、基金管理人授权的交易对手方或相关交易清算机构过错导致托管人无法有效履职的，托管人不承担任何责任。

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、交易文件缺失、交易文件内容有误、交易文件因交易对手方的标准不统一导致口径及含义存在差异的、交易文件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。

受证券期货市场波动、证券发行人合并、私募证券投资基金规模变动等私募基金管理人之外的因素影响，导致私募证券投资基金的投资比例不符合本指引规定或者基金合同约定的，私募基金管理人应当在 20 个交易日内调整至符合要求。因资产流动性受限导致无法完成前述调整的，应当在相关资产可出售、可转让或者恢复交易后的 20 个交易日内调整至符合要求。”

同时，为维护基金份额持有人利益，我司设置 2024 年 7 月 15 日为临时赎回开放日，不同意本次变更的投资者可在该开放日赎回持有的本基金全部份额，且不受份额锁定期（如有）的限制、不收取赎回费用（如有）。本次变更生效日为 2024 年 8 月 1 日。

特此公告！

管理人：南京盛泉恒元投资有限公司

2024 年 7 月 11 日

