

## 国恩高频量化9号私募证券投资基金

### 按照运作指引十七条修改合同内容的公告

尊敬的投资人与销售机构（如有），

深圳前海国恩资本管理有限公司（以下简称“我司”）管理的“国恩高频量化9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。根据《私募证券投资基金运作指引》，如私募证券投资基金不符合第十七条相关要求的，自2024年8月1日开始不得新增投资者，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。

为避免本基金转入被动存续，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，与本基金托管人（国泰君安证券股份有限公司）协商一致，对本基金有关条款做出如下变更：

#### （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%。”

上述变更自 2024 年 7 月 31 日起生效,本次变更生效后,原基金合同将与上述变更内容、现行有效的公告(如有)、现行有效的补充协议(如有)以及其他现行有效的修订文件(如有)进行合并,合并后基金合同的具体生效事宜我司将另行通知。

感谢您一直以来对我司的支持。

特此公告!

深圳前海国恩资本管理有限公司

2024 年 7 月 12 日

