

# 关于银叶量化精选1期私募证券投资基金基金合同变更

## 新增场外衍生品限制的公告

尊敬的投资人：

由我司作为管理人、招商证券股份有限公司作为托管人的银叶量化精选1期私募证券投资基金基金合同中涉及场外衍生品交易投资范围，因法律、法规及有关政策发生变化，现就合同相关条款进行变更。

前述基金开展场外衍生品交易的，自2024年8月1日（含）起将符合下列要求：

（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%；

基金管理人承诺确保前述基金在实际投资运作中符合本条投资限制的约定，基金托管人自2024年8月1日（含）起对本条款进行监督。

我司承诺严格遵照基金合同约定的变更方式、程序完成变更（如基金合同有约定，则按合同约定采取设置开放日/临时开放日允许基金份额持有人赎回基金份额或者其他保障投资者赎回本基金权利的措施，上述开放日不受本合同中关于基金份额不允许赎回期限的限制，且开放赎回的份额不收取赎回费（如有）；如基金合同未有约定保障投资者赎回本基金权利的相关措施，且有基金份额持有人不同意变更内容的，我司将与基金托管人采取符合合同约定的其他方式进行变更），合同变更内容符合法律法规及自律规则相关规定。

特此公告。

上海银叶投资有限公司

2024年07月16日