

少数派 29 号私募基金 基金合同变更及开放日公告

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。为了避免本基金转入被动存续，基于《私募证券投资基金运作指引》要求，需在2024年8月1日前针对场外衍生品交易的规定完成合同整改。

该项合同整改符合基金合同中规定：因有权机构对法律法规的修订、变更、解释、新增、废止等导致本合同与之存在冲突或不一致的，应当以届时有效的法律法规为准对本合同进行相应变更和调整，由基金管理人与基金托管人协商一致后对本合同相关内容进行变更。

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，经于托管方中信证券股份有限公司协商后，现我司通过公告变更形式对《基金合同》相关条款变更，增加相关的投资限制，特此告知全体《少数派 29 号私募基金》（基金编码：SM1208）基金份额持有人相关变更事宜。

产品合同条款具体修改内容如下：

1、在《基金合同》“基金的投资”章节的“投资限制”条款内容中增加如下约定：

“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。

基金管理人承诺确保本基金在实际投资运作中符合本条投资限制的约定，并负责主动协调交易对手方按时向基金托管人提供准确、完整的估值信息，交易对手方未按时提供或提供不完整的由基金管理人负责补充提供，基金管理人需确保交易文件和估值信息的真实性、准确性、完整性和及时性。前述交易文件和估值信息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和估值信息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和估值信息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和估值信息、交易文件和估值信息底层数据缺失、交易文件和估值信息内容有误、交易文件和估值信息因交易对手方的标准不统一而导致口径及含义存在差异的、交易文件和估值信息格式变化且未提前与基金托管人沟通确认、基金管理人未和/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。”

特别的：如《基金合同》中已载有与上述变更内容相关的条款（包括但不限于相关投资标的的投资限制、投资比例、风控措施等条款，以下简称“原条款”），且原条款较上述变更方案中的约定更为严格（例如，原条款的规模门槛更高、可允许投资的比例限制更低、禁止投资某一具体场外衍生品种等，符合该情形的原条款以下简称“严格原条款”），则上述变更内容不视为对《基金合同》严格原条款的删除、替代或修改，即使基金管理人已对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，《基金合同》的严格原条款依然有效，仍按照《基金合同》严格原条款执行；反之，如《基金合同》原条款较上述变更方案中的约定更为宽松（例如原条款的规模门槛更低、可允许投资的比例限制更高等），且基金管理人按照本协商函对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，则按照本协商函的上述变更内容执行。

上述相关合同条款变更自【 2024 】年【 8 】月【 1 】日起开始生效。

2024 年 7 月 31 日是本基金的产品开放日，故生效日前不再另设临时开放日，持有人可

根据基金合同相关约定办理申购或赎回业务。对于未在上述开放日全部赎回的份额持有人，视为同意本次变更。

特此公告。



上海少军投资管理有限公司

2024年7月12日