

宁水精选三期私募证券投资基金基金合同变更公告

(2024 衍)



尊敬的基金投资者、中泰证券股份有限公司：

为有效落实《私募证券投资基金运作指引》第十七条关于场外衍生品交易的有关规定及整改要求，我司（厦门宁水私募基金管理有限公司）经与基金托管人协商，决定对由我司发行管理、中泰证券股份有限公司提供托管服务的宁水精选三期私募证券投资基金（以下简称“本基金”）涉及场外衍生品交易的相关内容进行基金合同变更，具体变更内容如下：

一、基金合同变更内容

1. 基金的投资章节投资限制条款中新增如下条款：

“自 2024 年 8 月 1 日（含）起，本基金应当遵循以下投资限制：

（1）本基金参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的收益凭证（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%。”

2. 越权交易及投资监督章节投资监督条款新增如下条款：

“特别地，如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、交易文件等交易信息提供给基金托管人。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交易信息并持续提供估值信息。基金管理人应当督促交易对手方、相关交易的清算机构及时向基金托管人提供场外衍生品交易文件交易信息并持续提供估值信息，基金托管人认为必要的情况下，有权要求私募基金管理人及相关机构补充提供其他交易信息或估值信



息。如投资范围和投资比例及限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等监控的，基金托管人的投资监督依赖于基金托管人收到的基金管理人或交易对手方提供的交易信息和估值信息，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，基金托管人的投资监督频率亦受限于基金托管人收到的基金管理人或交易对手方提供的交易信息和估值信息频率；由于场外衍生品、收益凭证属于非标准化资产，前述交易信息和估值信息可能由于交易对手方的标准不统一，其信息口径或含义可能存在较大差异，进而影响监控结果；基金管理人应按照监管机构的要求确保相关资产交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性，基金托管人不负责审核交易信息和估值信息，不对交易信息和估值信息的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前述交易信息和估值信息可能不真实、不准确、不完整、不及时，或者因前述信息数据口径不明确等原因导致基金托管人无法监控、未能监控或监控不准确、不及时的，基金托管人不承担任何责任。”

二、基金合同变更生效时间及临时开放安排

上述变更自【2024】年【 7 】月【 26 】日起正式生效。

为保障基金投资者赎回的权利，如有基金投资者不同意上述基金合同变更内容的，我司将设置【2024】年【 7 】月【 22 】临时开放日允许不同意本次基金合同变更的基金投资者赎回本基金，上述临时开放日不受基金合同中关于基金份额不允许赎回期限的限制；基金投资者未提出不同意见或未申请赎回的，视为基金投资者同意上述变更内容，并愿意承担因此而产生的后果及风险。

三、基金管理人声明与承诺

我司作为基金管理人将严格按照法律法规、监管规定、自律规则相关规定及基金合同的约定，勤勉尽责履行基金管理人职责，及时向基金投资者披露变更的具体

内容，确保全体基金投资者充分知悉本次基金合同的变更内容，并根据法律法规、监管规定、自律规则相关规定及基金合同的约定，及时履行向中国基金业协会的报告义务。

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，合同变更内容符合法律法规、监管规定及自律规则相关规定。本次基金合同变更生效后，基金管理人须确保在合同变更生效后新参与的基金投资者所签署的基金合同或其附件包含本次变更的内容。因我司违反上述约定所导致的问题，或因新参与的基金投资者所签署的基金合同或其附件内容与实际不符而导致的后果，均由基金管理人承担，基金托管人不承担任何责任。

特此公告！

管理人：厦门宁水私募基金管理有限公司

【 2024年 7 月 5 日 】

