

关于进化论稳进一号证券投资基金
增加投资限制的公告

尊敬的份额持有人：

您好，感谢持有我司管理的“进化论稳进一号证券投资基金”（以下简称“本基金”）。本基金自设立以来，严格按照中国证券投资基金业协会（以下简称“协会”）的规则要求以及《进化论稳进一号证券投资基金合同》（以下简称《基金合同》）的约定开展投资。

2024 年 4 月 30 日，协会发布《关于发布<私募证券投资基金运作指引>的公告》（以下简称《公告》）及《私募证券投资基金运作指引》（以下简称《运作指引》），根据《公告》及《运作指引》的规定，如私募证券投资基金开展场外衍生品交易，应当符合《运作指引》第十七条的具体要求。

为保障本基金全体份额持有人的利益，确保本基金持续符合协会的监管要求，现在对本基金《基金合同》的有关条款进行变更，增加对本基金投资场外衍生品（收益凭证/收益互换/场外期权）的限制。本次条款变更是根据《运作指引》的要求进行统一调整，对本基金的投资策略无实质影响，具体变更内容如下：

基金全称	【进化论稳进一号证券投资基金】
基金备案代码	【S65181】
基金管理人名称	海南进化论私募基金管理有限公司
变更类型	增加基金的投资限制
变更内容	一、《基金合同》条款具体修改如下： 1、在《基金合同》“私募基金的投资”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、收益凭证交易的，基金管理人应当在本基金下一估值日前向基金托管人提供场外衍生品、收益凭证的交易情况、交易文件、交易对手方确认邮件等托管人要求的材料，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）。基金合同各当事方同意并确认，基金托管人仅根据基金管理人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，如因管理人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）起对上述涉及场外衍生品、收益凭证的条款进行监督。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而产生口径及含义差异、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。” 2、上述变更内容自【2024】年【8】月【1】日起开始生效。
变更生效日期	2024 年 08 月 01 日

我司已按照《基金合同》约定通知本基金全体份额持有人，如您有任何疑问，可与我司或委托募集机构联系。感谢您的支持和理解。

特此公告。

海南进化论私募基金管理有限公司

2024 年 7 月 18 日