

关于永利 8 号私募证券投资基金按运作指引十七条整 改的公告

尊敬的投资者：

您好，感谢持有我司作为基金管理人发行的“永利 8 号私募证券投资基金”（以下简称“本基金”）。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，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，对本基金场外衍生品内容（收益凭证/收益互换/场外期权）进行如下整改：

序号 1

“投资限制”增加：

- 1、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、参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收益互换合约名义本金的 50%；
- 3、参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；

序号 2

“投资禁止行为”增加：

如涉及投资场外衍生品的，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，基金净资产低于 5000 万元；新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产低于 1000 万元；

序号 3

“越权交易”章节增加：

特别地，如投资比例和投资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，基金托管人的越权交易监督依赖于基金管理人或交易对手方提供的交易信息和行情信



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；由于场外衍生品和收益凭证等场外衍生品属于非标准化资产，前述交易信息和行情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及基金业协会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，基金托管人不具体审核交易信息和行情信息，不对交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前述交易数据可能不真实、不准确、不完整、不及时，或者因前述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的，基金托管人不承担任何责任。

上述变更自 2024 年 8 月 1 日起生效，本次变更不会影响本基金合规运作，我司将继续专业合规运作本基金，并按有关规定及时报中国证券投资基金业协会备案。

感谢您一直以来对我司的支持。

特此公告！

浙江钱唐永利资产管理有限公司
2024年07月22日

