
关于天算中证 1000 指数增强 5 号私募证券投资基金 合同变更的公告

尊敬的投资者：

天算中证 1000 指数增强 5 号私募证券投资基金（备案代码：SZV439）（以下简称“该基金”）由我司天算量化（北京）资本管理有限公司（登记编码：P1028908）担任基金管理人，招商证券股份有限公司担任基金托管人，目前处于正常存续阶段。

现根据《私募证券投资基金运作指引》的规定及基金合同约定，我司决定对该基金的基金合同条款进行变更。

该基金《基金合同》具体调整方案：

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。

我司已与托管人就增加场外衍生品相关投资限制达成一致意见，**上述变更自【 2024 】年【 8 】月【 1 】日起开始生效。**

特此通知。如您对变更事项有异议，您有权在本基金的开放日赎回基金份额，或在本机构发送本通知起【5】个工作日内向本机构申请设置临时开放日赎回基金份额，但不因此影响本次合同变更效力。

天算量化（北京）资本管理有限公司
2024年07月23日