

## 关于启林优优量化多策略 10 号 1 期私募证券投资基金基金合同变更的公告

尊敬的投资人：

上海启林投资管理有限公司作为“启林优优量化多策略 10 号 1 期私募证券投资基金”的管理人，为更好地为该基金份额持有人提供投资服务，我公司根据《启林优优量化多策略 10 号 1 期私募证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）约定对基金合同相关条款做如下变更：

变更条款：

### 基金合同“投资限制”处增加：

- 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

### 基金合同“投资禁止行为”处增加：

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

### 基金合同“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 】日起开始生效。

特此公告！

上海启林投资管理有限公司

2024年7月24日