

关于【蒙玺中证 1000 指数量化 5 号 1 期私募证券投资基金】

基金合同变更的公告

尊敬的全体基金份额持有人：

【蒙玺中证 1000 指数量化 5 号 1 期私募证券投资基金】（下简称“本基金”）由我司【上海蒙玺投资管理有限公司】担任基金管理人，光大证券股份有限公司担任基金托管人，已在中国证券投资基金业协会备案并成立。

根据《蒙玺中证 1000 指数量化 5 号 1 期私募证券投资基金基金合同》（含各私募基金的合同变更文件，变更文件包括通过补充协议、通知函、公告等法律法规规定或合同约定的方式进行合同变更的文件，以上统称为“《基金合同》”）的约定以及《私募证券投资基金运作指引》的要求，我司拟对《基金合同》按如下内容进行变更。

一、【蒙玺中证 1000 指数量化 5 号 1 期私募证券投资基金】基金合同修改对照明细表：

	原条款：	现条款：
第二节 释义	39. 流动性受限资产：是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产，以及场外衍生品、私募基金、资管产品等流动性较差的非标准化资产。	39. 流动性受限资产：是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在 10 个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具等资产，以及场外衍生品、私募基金（不包含【蒙玺中证 1000 指数量化 5 号私募证券投资基金】）、资管产品等流动性较差的非标准化资产。
第五节	（四）基金募集对象	（四）基金募集对象

基金的募集	新增表述	新增如下表述： 如本基金投资于私募资管产品（含私募基金）和银行理财产品的，本基金不得向公募证券投资基金以外的产品投资者募集，即本基金整体嵌套层级不得超过一层。法律法规规定、部门规章、行业自律组织另有规定的，从其规定。
第八节 当事人及权利义务	（二）管理人 1、管理人概况 名称：上海蒙玺投资管理有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区环湖西二路 888 号 C 楼 通讯地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号 2 号楼 1004 室 邮政编码：200127 法定代表人：李骧 联系人：廖阳 联系电话：021-68780985 传真：021-68780985 网站：http://mxifund.com	（二）管理人 1、管理人概况 名称：上海蒙玺投资管理有限公司 注册地址：中国（上海）自由贸易试验区临港新片区水芸路 89 号港城广场一街坊 13 号楼 1 层 105 室 通讯地址：上海市浦东新区杨高南路 759 号陆家嘴世纪金融广场 2 号楼 26 楼 邮政编码：200127 法定代表人：李骧 联系人：徐鹏 联系电话：021-68780985 传真：/ 网站：http://mxifund.com

第十一节 基金的投资	(四) 投资限制 1、本基金每个交易日日终，基金总资产占净资产的比例不超过 200%； 2、不得进行投资范围以外的投资活动。	(四) 投资限制 1、本基金总资产与净资产的比例不得超过 200%； 2、本基金投向 AA 级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不得超过本基金净资产 20%（流动性受限资产不包括蒙玺中证 1000 指数量化 5 号私募证券投资基金）。 3、本基金投资于“【蒙玺中证 1000 指数量化 5 号私募证券投资基金】”的市值不得低于基金净资产的 90%； 4、管理人应当确保“【蒙玺中证 1000 指数量化 5 号私募证券投资基金】”合同投资范围、投资限制符合《私募证券投资基金运作指引》第十二条要求。 5、同一实际控制人控制的私募证券投资基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%，中国证监会、协会另有规定的除外； 以上第【4、5】条投资限制由管理人自行监控，托管人不承担投资监督职责。 如本基金投资于其他私募资产管理产品，管理人应当协调下层产品管理人、托管人或基金服务机构，在基金份额确认后的 2 个工作日内提供给本基金托管人，并在本基金持有下层产品份额期间持续提供其估值信息及其他托管
-------------------	---	---

人认为需要的信息。托管人不对因上述数据缺失、不准确、不及时等原因造成的后果承担任何责任，同时托管人如认为上述不利情况可能对本基金正常运作产生影响的，有权采取暂停估值、暂停申赎等方式进行相应风险管控。

如本基金投资于其他私募资产管理产品，管理人应当协调下层产品管理人、托管人或基金服务机构，于每季度初十个工作日内将经复核的下层产品的估值表发送至本基金托管人指定邮箱 gztgtzjd@ebscn.com，对于投资比例、投资限制中涉及穿透计算的事项，托管人根据收到的下层产品的估值表作为履行投资监督的依据进行每季度一次的事后监督。若因管理人未按前述要求及时履行相关义务、或下层产品估值表提供方提供估值数据不及时、不完整、不准确导致投资比例、投资限制中相关指标穿透计算结果错误所产生的损失，本基金托管人不承担责任。

受证券期货市场波动、证券发行人合并、证券摘牌退市、基金规模变动等管理人之外的因素影响，导致基金投资比例不符合《运作指引》规定或者本基金合同约定的，管理人应当在 20 个交易日内调整至符合要求。因资产流动性受限或其他非管理人可以控制的原因导致无法完成前述调整的，管理人应当及时将相关情况主动告知托管人，并在相关资

		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。法律法规另有规定的从其规定。
第十一节 基金的投资	(十一) 关联交易 新增表述	(十一) 关联交易 基金投资者知悉并接受：本基金拟投资的【蒙玺中证 1000 指数量化 5 号私募证券投资基金】属于本条款项下的关联交易，但是该等投资为本基金的固有投资安排，不适用上述关于关联交易决策以及披露机制的安排。私募基金管理人在进行该等投资前无需经过内部机制决策，也无需就该等投资事项向投资者进行专项信息披露，但法律法规、监管规定要求管理人履行的其他相关信息披露义务除外。

二、我公司已就基金合同上述变更内容，通过双方认可的方式征得托管人同意或认可。

若基金份额持有人不同意合同变更条款，我公司将设置【2026】年【6】月【15】日为【指定赎回开放日】供基金份额持有人赎回其所有基金份额，具体赎回限制及赎回费的收取以基金合同约定为准。逾期未提交赎回申请或未申请赎回全部所持份额的，视为基金份额持有人同意本次合同变更。本次变更事项自【2026】年【6】月【16】日开始生效，对合同各方均具有法律效力。

本公告发布后，如投资者新增申购本基金的，视为已知悉并同意本公告内容。对于合同变更生效日前已持有本基金基金份额的投资者，如同意本次基金合同变更的，原则上无需另行签署补充协议或修订版基金合同等书面法律文件。



有限公司