

关于明确上海展弘投资管理有限公司旗下产品同一资产监控口径的
说明函

尊敬的投资者：

我司管理，华泰证券股份有限公司提供托管服务的全部产品（含后续拟发行新产品），标准化期货和衍生品类资产的同一资产监控口径明确如下：“标准化期货和衍生品类资产按照单只期货或者期权合约视为同一资产，同一品种不同月份合约单独计算”，即期货按单一合约计算，场内期权按照同一品种不同月份期权合约合并视为同一资产，均不轧差。

若后续监管机构对于标准化期货和衍生品类资产的同一资产监控口径有明确规定的，从其规定。

特此说明。

基金管理人：  (章)

签署日期：2026年6月2日