

关于上海量兆资产管理合伙企业（有限合伙） 旗下私募基金基金合同变更的通知函

尊敬的私募基金份额持有人：

上海量兆资产管理合伙企业（有限合伙）（简称“本机构”）管理的私募基金（具体私募基金清单见附件，前述清单中每一个私募基金以下被单独称为“私募基金”）因产品运营需要，并经本机构与基金托管人中国国际金融股份有限公司协商一致，拟根据《私募证券投资基金运作指引》的相关规定、基金合同及其任何有效修订（以下统称“《基金合同》”），对《基金合同》的相关条款进行如下变更：

《基金合同》条款具体修改如下：

1、《基金合同》“基金的投资”章节中“投资限制”增加如下条款：

“如本基金投资场外衍生品的，自 2024 年 8 月 1 日起，对场外衍生品执行以下投资比例限制：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%；参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的 50%；参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%。”

2、《基金合同》“基金的投资”章节中“投资禁止行为”增加如下条款：

“如本基金投资场外衍生品的，自 2024 年 8 月 1 日起，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；”

3、《基金合同》“越权交易”章节“越权交易的例外”第 1 款变更为：

“（四）越权交易的例外

下列情形不构成越权交易：

1、自 2024 年 8 月 1 日起按以下约定执行：由于基金管理人之外的原因导致的投资限制出现不符合本合同约定的情形为被动超标，不属于越权交易，包括但不限于：证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等。发生被动超标时，基金管理人应在【20】个交易日内调整完毕，



因资产流动性受限或其他非基金管理人可以控制的原因导致无法完成前述调整的,应当在相关资产可出售、可转让或者恢复交易后的【20】个工作日内调整至符合要求。”。

4、除《基金合同》“越权交易”章节“越权交易的例外”第1款外,若《基金合同》其他章节对被动超标情形以及发生被动超标时管理人调整要求有约定的,则同步修改。

5、《基金合同》附件部分“投资监督事项表”中“投资限制”增加如下条款:

“如本基金投资场外衍生品的,自2024年8月1日起,对场外衍生品执行以下投资比例限制: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%;参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的,向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的50%;参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证(如雪球结构衍生品)的合约名义本金不得超过基金净资产的25%。”

6、若上述内容与《基金合同》原约定的相关内容有冲突的,则以本函的约定为准。

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【10】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。

基金管理人:上海量兆资产管理合伙企业(有限合伙) 盖章



2024年7月1日

附件:私募基金清单

产品名称	产品代码
私募工场量兆I期私募证券投资基金	SL0495