

关于清水源尊享1期基金产品合同变更的公告

致尊敬的投资者：

为更好地为产品投资者提供服务，鉴于中基协《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）将与2024年8月1日起施行，《运作指引》发布公告要求基金产品在2024年8月1日前针对其第十七条场外衍生品交易的规定完成合同整改。我司拟通过公告变更、协商函等形式对投资范围中含有场外衍生品的产品增加相关投资限制，特此告知相关变更事宜。

一、产品合同条款主要修改内容

“投资限制”增加最后一条表述：

自2024年8月1日（含）起，本基金投资应当遵循以下限制。

（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%；

（4）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，基金净资产不低于5000万元；新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产不低于1000万元；

基金管理人承诺确保本基金在实际投资运作中符合本条投资限制的约定，并负责主动协调交易对手方按时向基金托管人提供准确、完整的估值信息。基金管理人需确保交易文件和估值信息的真实性、准确性、完整性和及时性。前述交易文件和估值信息需覆盖以上投资限制所需的各种类



型标识和金额数据（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）。

“越权交易”章节增加：

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。

“基金财产的估值和会计核算”中关于场外衍生品交易估值的修改为：

若本基金参与场外衍生品交易的，基金管理人应当确保交易对手方在本基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给基金托管人。基金管理人签订场外衍生品交易文件时，应当明确授权由交易对手方在本基金下一估值日前直接向基金托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。基金管理人应确保在本基金每个开放日对应的估值日内，交易对手方向基金托管人提供最新的估值报告。基金管理人应确保上述估值数据的真实、完整和有效，如内容不完整、不准确、不及时或不真



实，由此造成的损失由基金管理人承担相应责任。

二、基金合同变更生效时间及临时开放安排

上述变更自【2024】年【8】月【1】日起正式生效。

为保障基金投资者赎回的权利，如有基金投资者不同意上述基金合同变更内容的，我司将设置临时开放日允许不同意本次基金合同变更的基金投资者赎回本基金，上述临时开放日不受基金合同中关于基金份额不允许赎回期限的限制；基金投资者未提出不同意见或未申请赎回的，视为基金投资者同意上述变更内容，并愿意承担因此而产生的后果及风险。

三、基金管理人声明与承诺

我司作为基金管理人将严格按照法律法规、监管规定、自律规则相关规定及基金合同的约定，勤勉尽责履行基金管理人职责，及时向基金投资者披露变更的具体内容，确保全体基金投资者充分知悉本次基金合同的变更内容，并根据法律法规、监管规定、自律规则相关规定及基金合同的约定，及时履行向中国基金业协会的报告义务。

特此公告！



管理人：深圳清水源投资管理有限公司

（盖章）

【2024 年 7 月 25 日】