

关于悦达醴泉悦顺5号私募证券投资基金根据新规规定对合同部分内容进行变更的临时公告

悦达醴泉公司旗下“悦达醴泉悦顺5号私募证券投资基金”，根据协会新规《私募证券投资基金运作指引》的第十七条规定以及基金合同约定就合同部分内容进行变更，现就本次变更进行披露，具体披露如下：

**根据《运作指引》第十七条修改以下内容：**

**“基金的投资”章节的“投资限制”条款新增以下内容：**

本基金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；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%。

本基金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；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%。

本基金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%。

本基金新增场外期权合约、收益互换合约及存续合约展期的，在场外投资划款指令到达托管人时，托管人对本基金净资产规模是否符合本条要求进行事中审核；本基金持有场外衍生品合约期间，托管



人仅根据交易对手方、相关交易的清算机构或管理人提供的交易文件和估值信息对本基金是否符合该条要求进行事后监督。托管人不对交易文件和估值信息进行任何实质性判断，也不对其真实性、准确性、完整性、及时性和/或所载内容的专业性、正确性负责。若出现交易对手方、相关交易的清算机构或管理人未按时发送交易文件和估值信息、交易文件和估值信息底层数据缺失、交易文件和估值信息内容有误、交易文件和估值信息因交易对手方的标准不统一产生口径及含义而导致存在差异的、交易文件和估值信息格式变化且未提前与托管人沟通确认、管理人和/或交易对手方的信息发送人、其所发送的信息未经其公司内部授权或确认等情形，导致托管人无法监督、未能监督或所监督内容与实际不符的，托管人不承担任何责任。

**“基金财产的估值和会计核算”章节新增以下内容：**

本基金参与场外衍生品交易的，基金管理人应当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、相关交易的清算机构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。

管理人应主动协调交易对手方按时向托管人提供准确、完整的估值信息，交易对手方未按时提供或提供不完整的由管理人负责补充提供，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估值及监控所需的各



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)。

以上变更事项特此披露。

悦达醴泉投资管理(上海)有限公司

2024年7月3日

