

关于万葵聚富湾 115 号家族私募证券投资基金 基金合同变更（202502）的意见征询函

尊敬的基金份额持有人：

东莞市万葵资产管理有限公司（以下简称“我司”）在招商证券股份有限公司托管的万葵聚富湾 115 号家族私募证券投资基金（以下简称“该基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。为更好地为该基金投资者提供投资服务，我司拟根据《万葵聚富湾 115 号家族私募证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定对该基金相关条款进行变更。

我司特向基金份额持有人征询关于基金合同相关条款变更的意见。

一、基金合同条款具体修改如下：

序号 1

二十、风险揭示 （三）基金投资风险揭示

5、金融衍生品及资产管理产品投资风险

新增条款：

（4）场外衍生品风险（如有）

1）政策风险

场外衍生品（包括互换、场外期权）属于创新业务，监管部门可视业务的开展情况对相关政策和规定进行调整，引起场外衍生品（包括互换、场外期权）业务相关规定、运作方式变化或者证券市场波动，从而给投资者带来损失的风险。

2）市场风险

市场风险是指由于场外衍生品（包括互换、场外期权）中挂钩标的的市场价格、市场利率、波动率或相关性等因素的变化，导致投资者收益不确定的风险。

3）交易对手不能履约的风险

交易对手因停业、解散、撤销、破产，或者被有权机构撤销相关业务许可、责令停业整顿等原因不能履行场外衍生品（包括互换、场外期权）中约定的义务，可能给投资者带来损失的风险。

4）估值风险

在估值日因第三方或场外衍生品的交易对手提供的估值结果或估值报告异常导致本基

金净值波动的风险，或因无法获得第三方或交易对手提供的估值结果或估值报告而由管理人采取的估值方法计算的结果与实际价值产生差异的风险。场外衍生品不存在如场内交易一样的竞价机制，其公允价值形成机制尚不健全。场外衍生品估值价格主要由交易对手方或计算机构根据相关合同约定定期提供给基金管理人和基金托管人，如交易对手方或计算机构不能及时、准确提供场外衍生品定价结果和合约具体损益变动情况，本基金持有的场外衍生品估值可能与其实际价值产生背离，对基金财产的及时、准确估值造成不利影响。

二、变更流程

我司于 2025 年 3 月 5 日至 2025 年 3 月 7 日通过本函以公告的方式就我管理的“**万葵聚富湾 115 号家族私募证券投资基金**”（以下简称“该基金”）的合同变更事项向基金份额持有人征询意见，按照基金合同的约定向基金份额持有人披露基金合同变更事宜（含生效前申购但未确认份额的在途投资者），征询基金份额持有人合同变更意见。

基金份额持有人应于 2025 年 3 月 7 日之前书面回复意见。若基金份额持有人不同意合同变更条款，我司将于 2025 年 3 月 10 日开放日，为不同意此次变更的基金份额持有人安排赎回。若基金份额持有人未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内赎回该基金的，视为基金份额持有人同意合同变更。

特此公告。

