

# 关于《智诚众惠 1 期私募证券投资基金基金合同》 变更的征询意见函（补充投资限制）

## 【智诚众惠 1 期私募证券投资基金】的基金托管人：

根据《私募证券投资基金运作指引》相关要求，我司作为基金管理人拟变更《智诚众惠 1 期私募证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的部分条款。本次拟变更内容如下：

### 一、合同变更内容

1. 修订“十一、基金的投资（五）投资限制”和“十五、越权交易（三）基金托管人对基金管理人越权交易的监督1、基金托管人对基金管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项如下（2）本基金的投资限制”

增加如下条款：

“X. 本基金资产净值不低于5000万元时，方可新增场外期权合约以及存续合约展期（仅开展商品类场外期权交易除外），且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资产净值的25%；

X. 本基金资产净值不低于1000万元时，方可新增收益互换以及存续合约展期；其中，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%；本基金开展收益互换不得参与DMA 多空收益互换业务；

X. 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）时，合约名义本金不得超过基金净资产的25%；”

### 二、合同变更流程

根据《基金合同》“二十四、基金合同的变更、解除与终止”约定，法律法规或相关规定发生变化需要对本合同进行变更的，基金管理人可与基金托管人协商后修改本合同，此种情况下，本合同的变更无需私募基金份额持有人同意，但基金管理人应当按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。

我司现向贵司进行意见征询。如贵司未于【2024】年【7】月【】日提出书面反馈意见的，视为贵司同意上述合同变更，上述相关合同条款变更自 2024 年 8 月 1 日起正式生效。我司将按照基金合同约定向基金份额持有人披露变更的具



体内容，并安排临时开放日，供不同意本次变更的基金份额持有人进行赎回。如因我司未向基金份额持有人披露变更内容或临时开放日安排导致的基金份额持有人纠纷，责任由我司承担，与贵司无关。本次变更生效之前，既有投资者及其他合同当事人依据变更前合同已履行的部分，依照变更前合同的约定执行；自本次变更生效之日起均按变更后合同约定执行。各方同意合同变更事宜无需另行签订补充协议。

