

# 关于深圳市智诚海威资产管理有限公司变更旗下基金合同的征询函

国信证券股份有限公司：

中国证券投资基金业协会（以下简称协会）发布《私募证券投资基金运作指引》（以下简称《运作指引》），并于2024年8月1日正式实施。已备案私募证券投资基金基金合同不符合《运作指引》第十七条的，应在实施之日前按《运作指引》要求及协会规定修改基金合同。我公司作为基金管理人，贵司作为托管人的产品（详见附件列表），根据《运作指引》要求，现将基金合同（含各私募证券投资基金的合同变更文件，变更文件包括通过补充协议、征询函、公告等法律法规规定或合同约定的方式进行合同变更的文件，每一个私募基金的前述文件以下统称为“《基金合同》”）有关条款做出如下变更，具体如下：

## 一、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）。

**二、托管人自 2024 年 8 月 1 日（含）起对上述条款进行监督。**

三、本函一式【两】份，管理人、托管人各执一份。

我司特向贵司征求意见，请贵司对以上变更内容予以确认。本征询函涉及合同变更事项在【2024 年 8 月 1 日】起生效，我司将以本合同约定的方式向投资者披露变更的具体内容并根据基金业协会的规定办理相关变更手续。

我司将根据具体合同约定要求确定是否安排开放日允许不同意该等变更事项的投资者赎回。上述开放日不受本合同中关于基金份额持有期限限制，且赎回的份额不收取赎回费（如有）。对于是否属于管理人应设置或有权设置开放日的任何情形，由管理人自行负责判断和具体执行，托管人及/或基金服务机构不负责监督或承担其他任何责任，基金服务机构仅依据基金管理人提交的开放申请进行相关配合。

因该变更安排导致的任何纠纷，由我司承担。

管理人：深圳市智诚海威资产管理有限公司



2024年6月26日

附件一：变更产品清单

备案编码	产品名称
S25811	智诚 11 期私募证券投资基金
SLH187	智诚 26 期私募证券投资基金

回函

深圳市智诚海威资产管理有限公司：

我司同意贵司所列产品的上述变更，请贵司按照变更后的条款约定进行操作，并按照合同要求履行向投资者披露义务。

托管人：国信证券股份有限公司

2024年6月27日

