

关于深圳市智诚海威资产管理有限公司 基金合同变更（2024 衍）的协商函

恒泰证券股份有限公司（以下简称“贵司”）：

深圳市智诚海威资产管理有限公司（以下简称“我司”）在贵司托管的私募基金（以下简称“该基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。

根据中国证券投资基金业协会发布的《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）第十七条相关规定，私募证券投资基金开展场外衍生品交易的，应当以风险管理、资产配置为目标，以国务院金融管理部门认可的机构为交易对手方，并符合相关要求。

结合我司对该基金的投资目标和投资交易策略，为更好地为该基金投资者提供投资服务，经我司审慎评估，拟根据该基金《基金合同》中关于“基金合同的效力、期限、变更和终止”章节的约定，对该基金基金合同相关条款，按照中国证券投资基金业协会发布的《私募证券投资基金运作指引》要求进行变更。**所涉该基金包括：“智诚价值精选私募证券投资基金”。**

我司特向贵司征询关于该基金《基金合同》相关条款变更的意见。

一、变更内容：

通过协商函+公告的方式增加《智诚价值精选私募证券投资基金基金合同》中投资范围“以证券公司（及其子公司）、期货公司（及其子公司）为交易对手的收益互换、证券公司发行的收益凭证”的相应投资限制，具体变更情形如下：

1、“投资限制”增加：

（1）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该收益互换合约名义本金的 50%；

（2）参与带敲入和敲出结构的收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；

2、“投资禁止行为”增加：

基金净资产低于 1000 万元时，新增收益互换合约以及存续合约展期；

3、“越权交易”章节增加：

特别地，如投资比例和投资限制涉及场外期权、收益互换和带敲入敲出结构的收益凭证等场外衍生品监控的，基金托管人的越权交易监督依赖于基金管理人或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；由于场外期权、收益互换和带敲入敲出结构的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。

二、变更流程

我司通过本函向贵司征询意见，在与贵司书面达成一致意见并收到贵司的《复函》后，我司将根据法律法规、中国证监会、基金业协会以及基金合同约定的要求及时履行作为管理人的报告义务以及向投资者的披露义务，我司知悉并同意贵司不承担对我司上述报告义务、披露义务的复核和监督责任。我司在履行报告和披露后，本次基金合同变更自 2024 年 8 月 1 日生效。

我司确保在基金合同变更生效后新参与该基金的投资者所签署的基金合同或其附件包含本次变更的内容。在变更生效时间前，贵司仍严格按照原基金合同履行托管职责。以上事宜，请贵司确认。

我司承诺严格遵照基金合同约定的变更方式、程序完成变更，基金合同变更内容符合法律法规及自律规则相关规定。我司承诺设置临时开放日或采取基金合同中约定的其他方式保障投资者赎回该基金的权利，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，且开放赎回的份额不收取赎回费（如有）。

本协商函双方盖章后，我司与贵司及基金份额持有人也可以针对某一只或几只基金另行签署补充协议对基金合同内容（包含本协商函变更内容）进行修改，本协商函与补充协议相互独立，以补充协议方式修改的内容与本协商函内容不一



致的，以补充协议为准。

因我司违反上述约定所导致的问题，或因新投资者签署基金合同内容与实际不符而导致的损失，或因未保障投资者赎回该基金权利或因此种方式变更基金合同导致的任何纠纷，由我司承担相应的责任，贵司不承担任何责任。

本函正本一式两份，贵司留存一份，我司执一份。

深圳市智诚海威资产管理有限公司
2024 年 7 月 10 日



复 函

深圳市智诚海威资产管理有限公司：

贵司发来的《关于深圳市智诚海威资产管理有限公司基金合同变更（2024 衍）的协商函》收悉，经研究，对贵司在来函中所述的基金合同条款变更内容不持异议。

本复函一式两份，双方各执一份。

恒泰证券股份有限公司（盖章）

签署日：

2024 年 7 月 18 日

