

# 信复创值立勋进取私募证券投资基金基金合同 补充协议（一）

合同编号：000-B01-2020

版本号：BCXY01-201706

甲方（基金委托人）：

乙方（基金管理人）：北京信复创值投资管理有限公司

丙方（基金托管人）：国信证券股份有限公司

鉴于基金委托人、基金管理人和基金托管人三方已签署《信复创值立勋进取私募证券投资基金基金合同》（以下简称“原合同”）。经三方友好协商，一致同意签署此补充协议，对原合同做如下调整：

本补充协议将修改原合同的投资范围和投资限制，因投资范围和投资限制的变化可能导致基金净值波动，从而影响投资人的投资收益，投资人将承担因此造成的未知风险。

## 第一条

### 1.修改“第七节 基金的投资”章节（二）以下表述

原合同表述为：

#### （二）投资范围

本基金投资范围为：

- 1.在上海证券交易所、深圳证券交易所、全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票（包含网上及网下新股申购）、期权、债券（包括可转债）及其它金融产品；
- 2.沪港通、深港通股票交易；
- 3.在上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所、上海国际能源交易中心等挂牌交易的期货、期权及其它金融产品；
- 4.在银行间市场挂牌交易的金融产品；
- 5.央行票据；
- 6.在上海黄金交易所挂牌交易的金融产品；
- 7.融资融券；
- 8.股票质押回购；

9. 证券转融通出借；

10. 证券公司柜台交易的产品，以及以证券公司为交易对手方的衍生品，包括收益互换、收益权凭证、场外期权等；

11. 期货公司及其子公司（风险管理公司）作为交易对手方的衍生品交易；

12. 银行理财产品、银行存款、现金；

13. 公募证券投资基金。

基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作。

#### （四）投资限制

本基金存续期内，基金总资产与净资产的比例不得超过 200%。

#### 修改后的表述为：

#### （二）投资范围

本基金投资范围为：

1. 在上海证券交易所、深圳证券交易所、全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票（包含网上及网下新股申购）、期权、债券（包括可转债）及其它金融产品；

2. 沪港通、深港通股票交易；

3. 在上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所、上海国际能源交易中心等挂牌交易的期货、期权及其它金融产品；

4. 在银行间市场挂牌交易的金融产品；

5. 央行票据；

6. 在上海黄金交易所挂牌交易的金融产品；

7. 融资融券；

8. 证券转融通出借；

9. 证券公司柜台交易的产品，以及以证券公司为交易对手方的衍生品，包括收益互换（含跨境收益互换）、收益权凭证、场外期权等；

10. 期货公司及其子公司（风险管理公司）作为交易对手方的衍生品交易；

11. 银行理财产品、银行存款、现金；

12. 公募证券投资基金。

基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作。

#### （四）投资限制

1. 本基金存续期内，基金总资产与净资产的比例不得超过 200%。

2. 本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票的基金资产不得超过基金总资产的 20%。

## 2.删除“第二十一节 风险揭示”章节以下表述

### 11.股票质押式回购风险

(1) 市场风险。待购回期间，质押标的证券市值下跌，须按约定提前购回、补充质押标的证券或采取其他约定方式提高履约保障比例。标的证券处于质押状态，融入方无法卖出或另作他用，融入方可能承担因证券价格波动而产生的风险。质押标的证券发生跨市场吸收合并等情形，融入方面临提前购回的风险。

(2) 信用风险。融入方违约，根据约定质押标的证券可能被处置的风险；因处置价格、数量、时间等的不确定，可能会给融入方造成损失的风险。

(3) 利益冲突的风险。在股票质押回购中，证券公司既可以是融出方或融出方管理人，又根据融入方委托办理交易指令申报以及其他与股票质押回购有关的事项，可能存在利益冲突的风险。

(4) 异常情况。融入方进行股票质押回购时应关注各类异常情况及由此可能引发的风险，包括质押标的证券或证券账户、资金账户被司法等机关冻结或强制执行；质押标的证券被作出终止上市决定；集合资产管理计划提前终止；证券公司被暂停或终止股票质押回购权限；证券公司进入风险处置或破产程序等等。

(5) 标的证券范围调整。标的证券可能被上交所暂停用于股票质押回购或被证券公司调整出范围，导致初始交易或补充质押无法成交的风险。

此外，股票质押回购业务还面临着操作风险、政策风险、不可抗力风险等等，同时，投资者要需要特别注意特殊类型标的证券、交易期限等问题。

## 3.在“第二十一节 风险揭示”章节增加以下表述，序号相应调整

### 1.跨境收益互换的特殊风险

若基金参与跨境收益互换，将可能面对交易对手的信用违约风险，同时，收益互换的方式可能间接增加基金的杠杆比例，收益互换交易具有较高收益和较高风险的特征，在提供投资者预期收益的同时也承担杠杆带来的风险。

此外，若基金通过收益互换间接投资于境内外二级市场股票，境外市场股票可能不设涨跌幅限制，存在股票价格波动较大的风险。此外，若基金间接投资于境外证券市场，投资收益以外汇形式体现，受人民币与外汇间汇率变动的较大影响。如果本基金存续期间内出现人民币汇率较大波动，投资者可能会因此而遭受损失。同时，境内外市场交易日不完全一致可能导致基金投资标的止损无法操作的风险。

## 4.修改附件一：投资运作监督事项表

原合同表述为：

| 序号 | 监督项目 | 监督内容  |
|----|------|---|
| 一  | 投资范围 | <p>1.在上海证券交易所、深圳证券交易所、全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票（包含网上及网下新股申购）、期权、债券（包括可转债）及其它金融产品；</p> <p>2.沪港通、深港通股票交易；</p> <p>3.在上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所、上海国际能源交易中心等挂牌交易的期货、期权及其它金融产品；</p> <p>4.在银行间市场挂牌交易的金融产品；</p> <p>5.央行票据；</p> <p>6.在上海黄金交易所挂牌交易的金融产品；</p> <p>7.融资融券；</p> <p>8.股票质押回购；</p> <p>9.证券转融通出借；</p> <p>10.证券公司柜台交易的产品，以及以证券公司为交易对手方的衍生品，包括收益互换、收益权凭证、场外期权等；</p> <p>11.以期货公司及其子公司（风险管理公司）作为交易对手方的衍生品交易；</p> <p>12.银行理财产品、银行存款、现金；</p> <p>13.公募证券投资基金。</p> |
| 二  | 投资限制 | <p>1.本基金存续期内，基金总资产与净资产的比例不得超过 200%。</p>   |

修改后的表述为：

| 序号 | 监督项目 | 监督内容   |
|----|------|--|
| 一  | 投资范围 | <p>本基金投资范围为：</p> <p>1.在上海证券交易所、深圳证券交易所、全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票（包含网上及网下新股申购）、期权、债券（包括可转债）及其它金融产品；</p> <p>2.沪港通、深港通股票交易；</p> |

|          |                  |  |
|----------|------------------|--|
|          |                  | <p>3.在上海期货交易所、大连商品交易所、郑州商品交易所、中国金融期货交易所、上海国际能源交易中心等挂牌交易的期货、期权及其它金融产品；</p> <p>4.在银行间市场挂牌交易的金融产品；</p> <p>5.央行票据；</p> <p>6.在上海黄金交易所挂牌交易的金融产品；</p> <p>7.融资融券；</p> <p>8.证券转融通出借；</p> <p>9.证券公司柜台交易的产品，以及以证券公司为交易对手方的衍生品，包括收益互换（含跨境收益互换）、收益权凭证、场外期权等；</p> <p>10.以期货公司及其子公司（风险管理公司）作为交易对手方的衍生品交易；</p> <p>11.银行理财产品、银行存款、现金；</p> <p>12.公募证券投资基金。</p> <p>基金在中国基金业协会完成备案后方可进行投资运作。</p> |
| <p>二</p> | <p>投资<br/>限制</p> | <p>1.本基金存续期内，基金总资产与净资产的比例不得超过 200%。</p> <p>2. 本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票的基金资产不得超过基金总资产的 20%。</p>  |

**第二条** 本补充协议应满足以下全部条件后生效：

- 1、全体基金委托人、基金管理人及基金托管人均已签署；
- 2、管理人已妥当履行本协议第四条约定的义务；
- 3、本补充协议约定的其他生效条件（如有）。

**第三条** 本补充协议生效日由基金管理人确定，但生效日不得早于全体基金委托人、基金管理人及基金托管人签署的最晚日期（该日以下简称“补充协议签署日”），也不应晚于补充协议签署日起【10】个工作日届满之日。

**第四条** 基金管理人与所有投资者签署完毕补充协议后，应向基金托管人发送生效函，生效函中应载明本补充协议生效日期，该生效日期应符合本补充协议第三条的约定，同时，基金管理人应将所有已签署完毕的补充协议（归托管人保管的一份）交付至基金托管人。生效函或补充协议未全部送达基金托管人的，补充协议不生效。

第五条 因基金管理人未妥当履行本协议第四条的约定，造成补充协议无法生效，从而导致基金运营出现差错的或造成任何损失的，由基金管理人承担全部责任。

第六条 基金管理人应以【网站公告/邮件/电话或者其他与投资者约定】方式就本补充协议生效日通知全体基金委托人，基金托管人不承担该通知责任，也不承担监督管理人是否通知的责任。

第七条 基金管理人应当保证提供给托管人的各方签署的本补充协议的真实性和完整性，并对本补充协议具体生效日期的准确性负责，基金托管人不承担由此造成的任何责任。

第八条 本补充协议与原合同中约定不一致的条款，以本补充协议内容为准，本补充协议未作约定的，仍以原合同内容为准。

第九条 本补充协议一式叁份，甲、乙、丙三方各执一份，每份具有同等的法律效力。

（以下无正文）

本页无正文，为《信复创值立勋进取私募证券投资基金基金合同补充协议（一）》的签署页：

甲方：

法定代表人或被授权人：

签署日期：20 年 月 日

乙方：

法定代表人或被授权人：

签署日期：20 年 月 日

丙方：国信证券股份有限公司

法定代表人或被授权人：

签署日期：20 年 月 日