

关于北京信复创值投资管理有限公司管理的私募基金基金合同 增加投资限制并临时开放的公告

尊敬的投资者：

鉴于中基协《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）将于2024年8月1日起施行，根据《运作指引》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。

北京信复创值投资管理有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）结合目前运作基金的投资目标、投资策略，经审慎评估，为保护基金份额持有人利益，特此对目前存续的私募基金《基金合同》（含相关补充协议、公告等补充文件）中涉及场外衍生品投资的相关投资限制、投资禁止行为进行变更（所涉私募基金清单见附件）。

一、《基金合同》条款具体修改如下：

1、投资限制、投资禁止行为中增加如下约定：

开展场外衍生品交易的基金产品，自2024年8月1日（含）起应当符合下列要求：

（1）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%；



(2) 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%；

(3) 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。

基金管理人承诺确保本基金在实际投资运作中符合本条投资限制的约定，并负责主动协调交易对手方按时向基金托管人提供准确、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基金管理人负责补充提供，基金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以上投资限制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）。

基金托管人自 2024 年 8 月 1 日（含）起对本条款进行监督。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基金托管人时，基金托管人对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，基金托管人仅根据交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人提供的交易文件和估值信息对本基金是否符合本条要求进行事后监督。基金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基金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基金托管人沟通确认、基金管理人和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，导致基金托管人无法监督、未能监督或所监督内容与实际不符的，基金托管人不承担任何责任。

2、上述变更内容自【2024】年【8】月【1】日起开始生效。

二、合同变更流程

如有份额持有人不接受该等变更事项，可联系我司，我司将根据各基金开放日安排，在固定开放日或增设临时开放日允许不接受该等变更事项的基金委托人进行赎回（所涉私募基金开放日安排见附件）。如份额持有人在上述（临时）开放日未退出的，即视为接受上述变更事项。

我司承诺：将根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求向份额持有人披露合同变更事项，及时履行报告义务。本次合同变更生效后，对于新增基金委托人首次申购本基金的，基金管理人须确保其所签署的产品合同为根据变更内容调整后的最新有效的基金合同。因新投资者签署的合同版本与实际不符而导致的损失，由基金管理人承担相应的责任，基金托管人不承担任何责任。

基金管理人：北京信复创值投资管理有限公司



2024年06月26日

附件：所涉私募基金清单及开放日安排

基金名称	开放日
信复创值2号基金	2024年7月1日
信复创值3号基金	2024年7月1日
信复创值5号基金	2024年7月1日
信复创值立勋进取私募证券投资基金	2024年7月1日
信复创值立勋进取1号私募证券投资基金	2024年7月1日
信复创值新起点私募证券投资基金	2024年7月10日
信复创值灵活配置1号私募证券投资基金	2024年8月1日前的每周第一个交易日
信复创值灵活配置2号私募证券投资基金	2024年6月28日
信复创值行稳致远1号私募证券投资基金	2024年8月1日前的每周第一个交易日
信复创值稳中求进私募证券投资基金	2024年8月1日前的每周第一个交易日
信复创值立勋追梦私募证券投资基金	2024年6月28日、7月31日
信复创值勇进1号私募证券投资基金	2024年7月18日
信复创值价值平衡私募证券投资基金	2024年7月18日

