

深圳市凡得基金管理有限公司基金合同变更函

(2024 衍)

致中泰证券股份有限公司：

为有效落实《私募证券投资基金运作指引》第十七条关于场外衍生品交易的有关规定及整改要求，我司（深圳市凡得基金管理有限公司）拟按照以下方案对由我司发行管理、贵司提供托管服务的私募证券投资基金（指本函件第四部分所列示的全部产品）进行基金合同变更，并通过变更公告形式向基金投资者进行信息披露，特此函告相关变更事宜。

一、基金合同条款变更方案

方案一

基金的投资章节投资范围及投资限制条款中删除涉及“场外期权、收益互换、收益凭证”（如有，具体以基金合同实际表述为准）的相关表述。

方案二

1. 基金的投资章节投资限制条款中新增如下条款：

“自 2024 年 8 月 1 日（含）起，本基金应当遵循以下投资限制：

（1）本基金参与场外期权交易的，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）本基金参与挂钩股票、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)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%。”

2. 基金的投资章节投资禁止行为条款中新增如下本基金财产禁止从事的行为：

“基金净资产低于 5000 万元时，除仅开展商品类场外期权交易外，新增场外期权合约以及存续合约展期；

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；

投资 DMA 多空收益互换。”

3. 越权交易及投资监督章节投资监督条款新增如下条款：

“特别地，如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、交易文件等交易信息提供给基金托管人。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交易信息并持续提供估值信息。基金管理人应当督促交易对手方、相关交易的清算机构及时向基金托管人提供场外衍生品交易文件交易信息并持续提供估值信息，基金托管人认为必要的情况下，有权要求私募基金管理人及相关机构补充提供其他交易信息或估值信息。如投资范围和投资比例及限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等监控的，基金托管人的投资监督依赖于基金托管人收到的基金管理人或交易对手方提供的交易信息和估值信息，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，基金托管人的投资监督频率亦受限于基金托管人收到的基金管理人或交易对手方提供的交易信息和估值信息频率；由于场外衍生品、收益凭证属于非标准化资产，前述交易信息和估值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机构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，基金托管人不负责审核交易信息和估值信息，不对交易信息和估值信息的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前述交易信息和估值信

息可能不真实、不准确、不完整、不及时，或者因前述信息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、不及时，基金托管人不承担任何责任。”

特别的，如基金合同投资范围中仅涉及“场外期权、收益互换、收益凭证”其中一项或两项，则投资限制条款和投资禁止行为条款可仅增加相关内容，无关内容可不增加，具体以基金合同约定投资范围为准。

二、基金合同条款变更生效及信息披露事宜

如贵司未提出书面反馈意见，上述相关基金合同条款变更自【2024】年【07】月【12】日起正式生效，我司承诺将通过变更公告形式向基金投资者进行信息披露，并可设置临时开放日或者其他保障投资者赎回权利的措施，变更公告内容包括但不限于基金合同变更内容、生效时间、临时开放安排等内容。

三、基金管理人声明与承诺

我司作为基金管理人将严格按照法律法规、监管规定、自律规则相关规定及基金合同的约定，勤勉尽责履行基金管理人职责，及时向基金投资者披露变更的具体内容，确保全体基金投资者充分知悉本次基金合同的变更内容，并根据法律法规、监管规定、自律规则相关规定及基金合同的约定，及时履行向中国基金业协会的报告义务。

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，合同变更内容符合法律法规、监管规定及自律规则相关规定。本次基金合同变更生效后，我司须确保在合同变更生效后新参与的基金投资者所签署的基金合同或其附件包含本次变更的内容。因我司违反上述约定所导致的问题，或因新参与的基金投资者所签署的基金合同或其附件内容与实际不符而导致的后果，均由我司承担，贵司不承担任何责任。

四、本次基金合同变更所涉产品清单

产品名称	变更方案
凡得好多福私募证券投资基金	方案二

管理人：深圳市凡得基金管理有限公司



【2024年07月02日】