

因诺中证 500 指数增强 1 号私募证券投资基金

关于签署基金合同补充协议一的特别说明

尊敬的投资者：

因诺中证 500 指数增强 1 号私募证券投资基金成立于 2019 年 7 月 10 日，我司作为管理人勤勉尽责，按照基金合同的约定管理基金资产，截至目前基金业绩良好、回撤稳定。

为了使产品合同的内容更加符合相关法律法规、自律规则的合规要求，同时也为更好地保障投资者的合法权益，管理人与托管机构及投资者在三方平等、自愿的基础上商议，对产品合同的内容进行如下修改：

一、补充协议主要的内容

（一）修订第二章“释义”

1、原表述：

“证券交易所：指上海证券交易所、深圳证券交易所、香港联合交易所。”

修改为：

“证券交易所：指上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所、香港联合交易所，以及其他经国务院同意设立的证券交易所。”

2、原表述：

“期货交易所：指中国金融期货交易所、郑州商品交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、上海国际能源交易中心。”

修改为：

“期货交易所：指中国金融期货交易所、郑州商品交易所、上海期货交易所、大连商品交易所、广州期货交易所、上海国际能源交易中心，以及其他经国务院或其期货监督管理机构同意设立的期货交易所。”

（二）修订第十一章“私募基金的投资”第（二）条“投资范围”

原表述：

“沪深交易所发行及上市的股票（包含新股申购）、港股通标的范围内的股票、沪深交易所发行及上市的存托凭证、证券交易所发行及上市的优先股、沪深



交易所或银行间市场发行及交易的债券和资产支持证券、银行间市场发行及交易的资产支持票据、证券公司收益凭证、债券逆回购、沪深交易所质押式报价回购、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、同业存单、融资融券、转融通证券出借交易（即本基金将其持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司）、股指期货、商品期货、国债期货、证券交易所及期货交易所上市的股票期权及商品期权、证券交易所上市的权证、上海黄金交易所上市的合约品种、公募基金、银行理财产品、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划。”

修改为：

“证券交易所交易的股票（包括但不限于新股申购、优先股等）、境内与境外证券市场互联互通机制下允许投资的证券（包括但不限于股票、债券、存托凭证等）、证券交易所交易的存托凭证、证券交易所或银行间市场交易的债券和资产支持证券、银行间市场交易的资产支持票据和标准化票据、证券公司收益凭证、债券逆回购、证券交易所质押式报价回购、现金、银行存款（包括但不限于定期存款、活期存款、协议存款、结构性存款及其他银行存款）、同业存单、融资融券交易、转融通证券出借交易（即本基金将其持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司）、证券交易所及期货交易所交易的衍生品（包括但不限于期货、期权、权证等）、上海黄金交易所上市的合约品种、公募基金、银行理财产品、证券公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划。”

（三）修订第十一章“私募基金的投资”第（十）条“投资经理”第1款“投资经理简介”

新增表述：

“李爽先生，因诺（上海）资产管理有限公司合伙人，研究总监。中国科学技术大学博士，研究方向为人工智能的应用。博士毕业后加入，对因诺人工智能模型体系做出了杰出贡献。2020年晋升为因诺（上海）资产管理有限公司合伙人、研究总监。”

（四）修订第十五章“私募基金财产的估值和会计核算”第（一）条“基金财产的估值”第9款“汇率”

原表述：

“基金港股通投资持有外币证券资产的估值涉及到港币对人民币汇率的，可参考估值日当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价，或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。”

修改为：

“基金投资持有外币证券资产的估值涉及到其他货币对人民币汇率的，可参考估值日当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率中间价。”

（五）修订第十九章“风险揭示”第（三）条“基金投资风险揭示”第4款“基金资产所投资的特定投资对象可能引起的特定风险”，风险揭示书同步修订

原表述：

“4.1 港股通标的范围内的证券投资风险（如有）

（1）交易标的风险。可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整，基金可能面临因标的证券被调出港股通标的的范围而无法继续买入的风险。

（2）交易额度风险。港股通业务试点期间存在每日额度限制。当日额度使用完毕的，基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

（3）交易时间风险。只有沪、深、港三地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，具体以上交所、深交所证券交易服务公司在其指定网站公布的日期为准，基金可能面临如上交所、深交所开市但联交所休市而无法及时交易造成的损失风险。

（4）汇率风险。作为港股通标的的联交所上市公司股票以港币报价，以人民币交收，因港股通相关结算换汇处理在交易日日终而非交易日间实时进行，基金将面临人民币兑港币在不同交易时间结算可能产生的汇率风险。

（5）交易规则差异风险。港股通股票交收方式、涨跌幅限制、订单申报的最小交易价差、每手股数、申报最大限制、股票报价价位、权益分派、转换、行权、退市等诸多方面与内地证券市场存在诸多差异；同时，港股通交易的交收可能因香港出现台风或黑色暴雨等发生延迟交收。基金可能面临由于私募基金管理人了解交易规则的差异而导致的风险。

（6）交易通讯故障风险。港股通交易中如联交所与上交所、深交所证券交



易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，基金可能面临不能申报和撤销申报的风险。

(7) 分级结算风险。港股通交收可能发生因结算参与者未完成与中国结算的集中交收，导致基金应收资金或证券被暂不交付或处置；结算参与人对基金出现交收违约导致基金未能取得应收证券或资金；结算参与者向中国结算发送的有关基金的证券划付指令有误导致基金权益受损等；基金可能面临由于结算参与者未遵守相关业务规则导致基金利益受到损害的风险。

4.2 上市公司公开发行股票投资风险（如有）

(1) 上市公司经营风险：上市公司的经营状况受多种因素影响，如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如私募基金所投资的上市公司经营不善，与其相关的证券价格可能下跌，或者能够用于分配的利润减少，从而使私募基金投资的收益下降。

(2) 流动性风险：证券市场受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响，某些时期成交活跃、流动性好；而在另一些时期，可能成交稀少，流动性差。在市场流动性相对不足时，交易变现有可能增加变现成本或出现变现困难，对私募基金投资造成不利影响。

(3) 退市风险：根据相关法律法规和交易规则，上市公司股票可能面临退市风险。启动退市程序后可能出现股票价值大幅度下跌、流动性大幅度降低等状况，从而造成基金投资出现亏损。”

修改为：

“4.1 境内与境外证券市场互联互通机制下允许投资的证券投资风险（如有）

(1) 境外市场风险

境内与境外证券市场互联互通机制下允许投资的证券在社会政治环境、法律法规、市场状况、经济发展趋势、市场敏感度等各个方面都存在较大的差异，可能会对本基金的业绩产生影响：

1) 政治风险与政府管制风险

境外国家或地区出现大的变化，如政府更迭、政策调整、制度变革、国内出现动乱、对外政治关系发生危机等，可能对本基金投资标的所在投资市场产生直接或间接的负面冲击。

2) 汇率风险

境内与境外证券市场互联互通机制下允许投资的证券以外币报价，以人民币交收，因相关结算换汇处理在交易日日终而非交易日间实时进行，基金将面临人民币兑外币在不同交易时间结算可能产生的汇率风险。

(2) 港股通标的范围内的证券（以下简称“港股通股票”）的特殊投资风险（如有）

1) 交易价格风险。港股通股票可能出现因公司基本面变化、第三方研究分析报告的观点、异常交易情形、做空机制等原因而引起股价较大波动的情形，尤其是考虑到香港联合交易所有限公司（以下简称联交所）市场交易不设置涨跌幅限制，投资者应关注可能产生的风险。

2) 交易标的风险。可以通过港股通买卖的股票存在一定的范围限制，且港股通股票名单会动态调整，基金可能面临因标的证券被调出港股通标的的范围而无法继续买入的风险。部分港股通股票可能存在大比例折价供股或配股、频繁分拆合并股份的行为，投资者持有的股份数量、股票面值可能发生大幅变化，投资者应关注可能产生的风险。

3) 交易额度风险。港股通业务试点期间存在每日额度限制。当日额度使用完毕的，基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

4) 交易时间风险。只有沪、深、港三地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，具体以上交所、深交所证券交易服务公司在其指定网站公布的日期为准，基金可能面临如上交所、深交所开市但联交所休市而无法及时交易造成的损失风险。

5) 交易规则差异风险。港股通股票交收方式、涨跌幅限制、订单申报的最小交易价差、每手股数、申报最大限制、股票报价价位、权益分派、转换、行权、退市等诸多方面与内地证券市场存在诸多差异；同时，港股通交易的交收可能因香港出现台风或黑色暴雨等发生延迟交收。基金可能面临由于私募基金管理人不了解交易规则的差异而导致的风险。

6) 交易通讯故障风险。港股通交易中如联交所与上交所、深交所证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，基金可能面临不能申报和撤销申报的风险。



7) 分级结算风险。港股通交收可能发生因结算参与者未完成与中国结算的集中交收,导致基金应收资金或证券被暂不交付或处置;结算参与人对基金出现交收违约导致基金未能取得应收证券或资金;结算参与者向中国结算发送的有关基金的证券划付指令有误导致基金权益受损等;基金可能面临由于结算参与者未遵守相关业务规则导致基金利益受到损害的风险。

4.2 上市公司公开发行股票投资风险(如有)

(1) 上市公司经营风险:上市公司的经营状况受多种因素影响,如市场、技术、竞争、管理、财务等都会导致公司盈利状况发生变化。如私募基金所投资的上市公司经营不善,与其相关的证券价格可能下跌,或者能够用于分配的利润减少,从而使私募基金投资的收益下降。

(2) 流动性风险:证券市场受到市场行情、投资群体等诸多因素的影响,某些时期成交活跃、流动性好;而在另一些时期,可能成交稀少,流动性差。在市场流动性相对不足时,交易变现有可能增加变现成本或出现变现困难,对私募基金投资造成不利影响。特别的,由于科创板等部分A股板块投资门槛高,且机构投资者占比较大,整体板块活跃度可能偏弱,板块股票存在一致性预期的可能性偏高,在特殊时期存在股票交易成交等待时间较长或无法成交的可能。

(3) 注册制股票投资风险(如有)

本基金可投资国内上市的科创板、创业板等注册制股票,会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于如下特殊风险:

1) 上市公司股价波动较大的风险,科创板、创业板等注册制股票设置较宽的涨跌幅限制,股价可能表现出更为剧烈的波动;

2) 上市公司退市的风险。科创板、创业板等注册制股票执行更为严格的退市标准,因此上市公司退市风险更大,可能会对基金净值产生不利影响。”

请投资者配合在2022年1月17日前完成签署,以便本基金能尽快完成合同修订。如果投资者不同意此次变更,我司可以为该持有人安排临开赎回基金份额。感谢您的支持和配合!

特此说明。

管理人:因诺(上海)资产管理有限公司

