

# 关于国恩回报 19 号私募证券投资基金按运作指引十七条修 改合同内容的公告暨新版合同启用通知

尊敬的投资者：

您好，感谢持有我司作为基金管理人发行的“国恩回报 19 号私募证券投资基金”（以下简称“本基金”）。根据《私募证券投资基金运作指引》，如私募证券投资基金不符合第十七条相关要求的，自 2024 年 8 月 1 日开始不得新增投资者，不得展期，除因追加保证金需要募集外不得新增募集规模，合同到期后进行清算。

为避免本基金转入被动存续，我司基于保护投资人利益原则，结合相关监管文件要求以及基金合同约定，与本基金托管人（中信证券股份有限公司）协商一致，对本基金场外衍生品内容（收益凭证/收益互换/场外期权）增加投资限制如下：

“本基金开展场外衍生品交易的，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/或所载内容的专业性、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/或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。”

上述变更自 2024 年 7 月 1 日起生效，本次变更不会影响本基金合规运作，我司将继续专业合规运作本基金，并按有关规定及时报中国证券投资基金业协会备案。

本次变更生效后，原基金合同将与上述变更内容进行合并，合并后合同版本更新为《国恩回报 19 号私募证券投资基金基金合同(2024-1)》，自 2024 年 7 月 3 日起，新增投资者不再签署原基金合同，统一签署新版本合同。

感谢您一直以来对我司的支持。

特此公告！

深圳前海国恩资本管理有限公司

2024 年 7 月 1 日