

# 关于北京止于至善投资管理有限公司 旗下私募基金基金合同变更的公告

基金委托人：

关于北京止于至善投资管理有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）管理的私募基金（本公告所涉及的基金管理人旗下的私募基金清单见附件，前述清单中每一个私募基金以下被单独称为“私募基金”），根据私募基金对应的《基金合同》（含各私募基金的合同变更文件，变更文件包括通过补充协议、通知函、公告等法律法规规定或合同约定的方式进行合同变更的文件，私募基金的前述文件以下统称为“《基金合同》”）的约定及法律法规的变化（包括但不限于中基协发〔2024〕5号《私募证券投资基金运作指引》等），拟对前述清单中每一个私募基金的《基金合同》相关条款进行变更。目前，我司已与私募基金托管人就私募基金《基金合同》的变更内容达成一致，现将具体变更内容公告如下。

一、《基金合同》条款具体修改如下：

1、在《基金合同》“基金的投资”章节的“投资限制”条款内容中增加如下约定：

“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。”

**特别的：**如《基金合同》中已载有与上述变更内容相关的条款（包括但不限于相关投资标的的投资限制、投资比例、风控措施等条款，以下简称“原条款”），且原条款较上述变更方案中的约定更为严格（例如，原条款的规模门槛更高、可允许投资的比例限制更低、禁止投资某一具体场外衍生品品种等，符合该情形的原条款以下简称“严格原条款”），则上述变更内容不视为对《基金合同》严格原条款的删除、替代或修改，即使基金管理人已对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，《基金合同》的严格原条款依然有效，仍按照《基金合同》严格原条款执行；反之，如《基金合同》原条款较上述变更方案中的约定更为宽松（例如原条款的规模门槛更低、可允许投资的比例限制更高等），且基

金管理人对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，则按照上述公告变更内容执行。

○【上述变更内容将于【 2024 】年【 7 】月【 22】日起正式生效，若基金委托人不同意本次合同变更条款的，应于【 2024 】年【 7 】月【 22】日前书面反馈管理人，我司配合委托人设置临时开放日供委托人赎回其所有基金份额，否则视为同意前述变更。

二、我司承诺按照私募基金对应的《基金合同》的约定将本公告通知至各私募基金的全体基金委托人，并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。

特此公告。

基金管理人：北京止于至善投资管理有限公司（盖章）



附件：私募基金清单

| 序号 | 产品名称        | 产品代码  |
|----|-------------|-------|
| 1  | XX 私募证券投资基金 | XXXXX |
| 2  | XX 私募证券投资基金 | XXXXX |
| 3  | XX 私募证券投资基金 | XXXXX |