

关于兆信飞翔 5 号私募证券投资基金

基金合同增加场外衍生品投资限制的变更公告

尊敬的投资者：

根据中国证券投资基金业协会近期发布的《私募证券投资基金运作指引》第十七条关于私募证券投资基金开展场外衍生品交易的相关要求内容，江苏兆信私募基金管理有限公司作为兆信飞翔 5 号私募证券投资基金（以下简称“本基金”）的管理人（以下简称“本管理人”），已通过书面形式与本基金的基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金《基金合同》的约定对本基金《基金合同》的相关条款进行如下变更：

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。”

上述变更内容自【2024】年【7】月【26】日起开始生效。

本公司承诺严格遵照本基金《基金合同》约定的变更方式、程序完成变更。2024 年 7 月 31 日为产品开放日,允许不接受该等变更事项的基金份额持有人进行赎回。如份额持有人在上述开放日未退出的,即视为接受上述变更事项。本公告自发布之日起自动成为本基金《基金合同》内容的一部分。

江苏兆信私募基金管理有限公司
2024 年 7 月 26 日

