

关于新设北交所之涵元天权量化投资基金

合同变更事宜的告知函

致尊敬的投资者：

北京证券交易所（简称北交所）于 2021 年 9 月正式成立，北交所开市后，新三板精选层挂牌公司将整体平移至北交所进行上市，现行精选层各项制度基本平移至北交所，并形成以新三板基础层、创新层与北交所三者统筹协调与制度联动的市场体系。

我司拟根据涵元天权量化投资基金私募基金合同合同变更章节的约定：“2、因法律法规、中国证监会相关规定、行业指引、自律规则及有关政策发生变化需要对本合同进行变更的，私募基金管理人可与私募基金托管人协商一致后直接修改基金合同，并由私募基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容”，通过公告形式对基金合同条款进行变更。

一、具体修改条款如下

修订第十一章“私募基金的投资”第（二）条“投资范围”

原表述：

“（二）投资范围

沪深交易所发行、上市的股票（包括上市公司非公开发行股票、新股申购）、新三板挂牌公司股份、沪港通中港股通标的范围内的股票、深港通（如开通）、债券、资产支持证券、债券回购、商业银行理财产品、银行存款（包括定期存款、协议存款和其他银行存款）、融资融券、股指期货、商品期货、国债期货、上海黄金交易所上市的合约品种、权证、仅以证券公司为交易对手的收益互换、公募基金、信托计划、证券公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、基金公司及其子公司特定客户资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金。如法律法规或中国证监会规定私募基金管理人需取得特定资质后方可投资上述证券或金融衍生产品的，则私募基金管理人投资上述证券或金融衍生产品前应获得相应资质。”

修改为：

“（二）投资范围

沪深交易所发行、上市的股票和北京证券交易所交易的股票（包括上市公司非公开发行股票、新股申购）、新三板挂牌公司股份、沪港通中港股通标的范围内的股票、深港通（如

开通）、债券、资产支持证券、债券回购、商业银行理财产品、银行存款（包括定期存款、协议存款和其他银行存款）、融资融券、股指期货、商品期货、国债期货、上海黄金交易所上市的合约品种、权证、仅以证券公司为交易对手的收益互换、公募基金、信托计划、证券公司资产管理计划、保险公司资产管理计划、期货公司资产管理计划、基金公司及其子公司特定客户资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的私募基金管理人发行的私募基金。

如法律法规或中国证监会规定私募基金管理人需取得特定资质后方可投资上述证券或金融衍生产品的，则私募基金管理人投资上述证券或金融衍生产品前应获得相应资质。”

二、合同条款变更生效事宜

上述相关合同条款变更将自【2021】年【11】月【01】日起正式生效。

管理人：上海涵元资产管理有限公司

