

协议编号：40-QB-01176931-01-001

关于上海竹润投资有限公司 旗下私募基金基金合同变更的协商函（20240710）

中信证券股份有限公司：

关于上海竹润投资有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）在中信证券股份有限公司（以下简称“贵司”或“基金托管人”）托管的私募基金（本协商函所涉及的基金管理人旗下的私募基金以基金管理人出具的通知为准，前述通知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），现拟对私募基金的《基金合同》按照如下变更方案之一变更相关条款（具体每个私募基金对应的变更方案以我司向贵司依本协商函约定对贵司的通知为准）。我司特与贵司协商关于私募基金《基金合同》条款变更的意见。

一、《基金合同》条款具体的变更方案如下：

变更方案 1：

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而导致口径及含义存在差异的、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,即使基金管理人已按照本协商函对私募基金的《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),且基金管理人按照本协商函对私募基金的《基金合同》完成合同变更的,则按照本协商函的上述变更内容执行。

变更方案 2:

1、在《基金合同》“基金的投资”章节的“投资范围”中删除以下投资标的(如涉及,具体以《基金合同》的约定为准):

“收益互换、场外期权、收益凭证、利率互换、远期合约、掉期合约。”

二、合同变更流程

我司通过本协商函向贵司征询意见,在收到贵司的《复函》后,我司将负责按照私募基金《基金合同》的约定及时向基金委托人披露《基金合同》的变更事宜,并按监管规定及时向监管机构报备。本协商函自基金管理人收到基金托管人的《复函》之日起生效,但自变更方案通知约定的生效执行日起开始执行。

我司承诺并确保将所管理的每一个私募基金选定的变更方案通过贵司电子服务平台或贵司认可的形式及时通知贵司,如经我司选定的私募基金的变更方案涉及再次调整的,我司承诺在上述变更方案生效执行前(具体生效执行日以私募基金变更方案通知的约定为准)及时通知贵司,贵司以最新的通知内容为准(若涉及我司通知多次调整的,以贵司最晚收到的通知内容为准)。若因我司未按照约定及时告知贵司导致基金托管人无法获悉我司选定的私募基金变更方案或调整后的新的变更方案或导致变更生效时间、执行时间延误,或生效执行日的设定不符合本协商函约定的,由此导致的任何损失或纠纷由我司承担相应责任,贵司不承担任何责任。我司确认,在本协商函取得贵司《复函》且我司按照前述程序和形式完成变更方案选定并将选定的变更方案通知贵司前,基金托管人仍按照原《基金合同》约定履行托管职责。

我司提供的协商函（含托管人《复函》）与私募基金变更方案通知包括纸质文件、扫描件（含传真件，下同）或者电子文件等形式，如扫描件、传真件、电子文件与纸质文件不一致的，以基金托管人留存的扫描件、传真件或电子文件为准。

若私募基金的《基金合同》变更事项涉及法律法规规定要求基金管理人保障基金委托人赎回权利的，我司将设置临时开放日允许不接受该等变更事项的基金委托人进行赎回，该等赎回申请不受《基金合同》关于份额锁定期（若有）、封闭期（若有）的限制。对于是否属于基金管理人应设置或有权设置临时开放日的任何情形，由我司自行负责判断和具体执行，基金托管人及/或行政服务机构不对此负责监督或承担其他任何责任。行政服务机构仅依据基金管理人的指示、通知进行相关配合。

我司承诺将根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求就合同变更事项及时履行报告义务以及向基金委托人披露。对于已按照上述约定确认适用本协商函的私募基金，若有新增基金委托人的，我司将确保其所签署的产品合同或其附件包含本次变更的内容。因新基金委托人签署的合同内容与实际不符而导致的损失，由基金管理人承担相应的责任，基金托管人不承担任何责任。

三、本函一式【两】份，基金管理人、基金托管人各执一份。

基金管理人：上海竹润投资有限公司（盖章）

2024年07月10日



复 函

上海竹润投资有限公司：

贵司发来的《关于上海竹润投资有限公司旗下私募基金基金合同变更的协商函（20240710）》已收悉，我司对贵司在上述协商函中所述的合同条款变更内容无异议。

本复函一式两份，双方各执一份。

中信证券股份有限公司托管部（公章 合同专用章）

2024年07月



附件：《关于上海竹润投资有限公司旗下私募基金基金合同变更的协商函（20240710）》所涉及的私募基金变更方案通知

序号	产品名称	产品代码	选择的变更方案
1	竹润乐在51号私募证券投资基金	SQX051	变更方案1

基金管理人承诺：若上述私募基金的变更选择方案2（删除投资标的）的，我司确保删除对应的投资标的后，该私募基金《基金合同》中不存在相违背或冲突的条款内容（包括但不限于产品名称、投资策略等条款内容并不涉及或包含与被删除投资标的相关的表述）、在该私募基金宣传募集过程中未以被删除标的作为该基金的宣传推销内容且私募基金目前无相关被删除标的的持仓。若因上述原因导致的损失或纠纷由我司承担相应责任。

本私募基金变更方案通知中所涉及的各私募基金《基金合同》的变更内容自2024年07月19日（含）起生效执行，但针对其中截至前述生效执行日（含）尚未成立的私募基金（如有），该等《基金合同》的变更内容自该等基金的成立日（含）起生效执行。

基金管理人： 上海竹润投资有限公司（盖章）

2024年07月10日