

关于变更《竹润乐山 12 号私募证券投资基金基金合同》公告

尊敬的投资者：

上海竹润投资有限公司（以下简称“我司”）所管理的竹润乐山 12 号私募证券投资基金（以下简称“本基金”）目前处于正常存续阶段。鉴于《私募证券投资基金运作指引》第十七条关于场外衍生品的要求，我司根据《竹润乐山 12 号私募证券投资基金基金合同》（简称基金合同）“基金合同的效力、变更、解除及终止”章节“合同的变更”中约定“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。”对合同条款进行变更。具体变更内容如下：

一、拟变更内容

基金合同“私募基金的投资”章节“投资限制”增加：

基金开展场外衍生品交易的，应符合下列要求：

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%，但经管理人核实并确认全部投资者均为符合中国证监会规定的专业投资者且单个投资者投资金额不低于 1000 万元（穿透认定）的封闭式私募证券投资基金除外；

4)、本基金不存在份额分级安排，且经管理人核实并确认本基金投资者均不存在份额分级安排；

5)、管理人不得将场外衍生品交易异化为股票、债券等场内标的的杠杆融资工具，不得为基金销售机构向自然人投资者销售特定结构的场外衍生品提供通道服务，不得为投资者提供规避场外衍生品交易要求的通道服务。

特别申明：

私募证券投资基金参与场外衍生品交易的，私募基金管理人应当在该基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给私募基金托管人。私募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该基金下一估值日前直接向私募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。如因管理人（或交易对手方、相关交易的清算机构等）未提供/未及时向托管人提供前述材料或者向托管人提供虚假或不完整材料，导致托管人无法进行监督的，托管人免责。”

二、我司已通过协商函与托管人达成一致意见，以上合同变更内容自 2024 年 07 月 12 日起生效。

上海竹润投资有限公司（基金管理人）

2024 年 7 月 10 日