

关于竹润乐天300指数增强1号私募证券投资基金

合同变更的公告

兴业证券股份有限公司、全体基金份额持有人：

竹润乐天300指数增强1号私募证券投资基金（备案代码：SVN500）（以下简称“该基金”）由我司上海竹润投资有限公司（备案编码：P1070287）担任基金管理人，兴业证券股份有限公司担任基金托管人，本基金符合成立条件并已成功成立。

中国证券投资基金业协会已于2024年4月30日发布《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”），并将于2024年8月1日起施行。根据《运作指引》相关规定，私募证券投资基金开展场外衍生品交易的，应当以风险管理、资产配置为目标，以国务院金融管理部门认可的机构为交易对手方，并符合相关要求。

根据《运作指引》的规定及基金合同约定，我司决定对本基金的基金合同条款进行变更。

一、自2024年8月1日（含）起，在投资限制条款中增加如下投资限制及投资场外衍生品的特别说明：

“（一）本基金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%。

（二）本基金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%。

（三）本基金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%，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。

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。

基金管理人承诺本基金开展场外衍生品交易时，在实际投资运作中遵守场外衍生品投资限制的约定，并负责协调交易对手方、相关交易的清算机构及时向基金托管人提供准确、完整的交易文件和估值信息，前述交易文件和估值信息需要具备能够有效识别场外衍生品投资限制的必备信息（包括但不限于合约起始时间、合约类型、合约交易结构、交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约挂钩标的等信息）。交易对手方、相关交易的清算机构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。基金托管人不对交易文件和估值信息的真实性、准确性、完整性和及时性负责。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信息口径及含义的较大差异等情况，导致基金托管人无法监督、未能监督或监督结果与实际不符的，基金托管人不承担任何责任。”

二、释义中增加以下条款：

“场外衍生品交易文件：是指本基金参与场外衍生品交易时，与交易对手方签署的衍生品交易主协议、补充协议、交易确认书以及履约保障协议等文件。”

本公告自2024-07-12起生效，变更内容构成基金合同不可分割的组成部分，与基金合同具有同等的法律效力。

本次变更系因相关法律法规发生变化所致，我司承诺按照法律法规规定及基金合同约定及时向基金份额持有人披露本次变更的具体内容。为保障基金份额持有人赎回基金份额的权利，我司承诺于生效日后的【第三个】交易日设置临时开放日（如当日为固定赎回开放日，则无需另行设置临时开放日）供基金份额持有人赎回基金份额（如需），并承诺至少在临时开放日前二个交易日通知全体基金份额持有人（如设置临时开放日）。在本公告生效后，我司承诺及时向中国证券投资基金业协会报告并履行相应手续。

本公告生效后，如有新投资者申购本基金的，我司承诺确保其充分知悉并同意本公告的变更事项，或者确保其所签署的基金合同文件为已根据本次变更内容调整后的最新有效的基金合同。

因我司未履行上述承诺导致的一切纠纷及责任，由我司自行承担，基金托管人不承担任何责任。

特此公告。

上海竹润投资有限公司

2024-07-08