

上海竹润投资有限公司产品合同变更告知函

致国泰君安证券股份有限公司：

为更好地为产品（指本函件第四部分所列示的全部产品，下同）投资者提供投资理财服务，基于《私募证券投资基金运作指引》要求在 2024 年 8 月 1 日前针对其第十七条场外衍生品交易的规定完成合同整改，我司拟通过公告变更形式增加相关投资限制，特此告知相关变更事宜。

一、产品合同条款具体修改内容

（一）修订“私募基金的投资”中“投资限制”小节

新增最后一条表述：

“自 2024 年 8 月 1 日（含）起，本基金投资应当遵循以下限制。私募基金托管人对以下限制的监督，依赖于本私募基金管理人、交易商、经纪商等机构提供的数据的真实性、准确性、完整性、及时性，监督频率亦受限于私募基金托管人收到数据的频率（可能以季度或更低的频率对相关指标进行核算、监督）。若因收到数据不真实、不准确、不完整、不及时导致私募基金托管人无法准确监督相关投资限制，给基金资产或投资者造成损失的，私募基金托管人不承担赔偿责任。

（1）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；本基金参与场外期权交易的，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）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；本基金参与挂钩股票、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）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（如雪球结构场外衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；”

二、合同条款变更生效事宜

如贵司未提出书面反馈意见的，上述相关合同条款变更将自【2024】年【07】月【12】日起正式生效，我司承诺将以公告等形式确保投资者知悉本函变更的具体内容，并可设置临时开放日或者其他保障投资者赎回私募证券基金权利的措施。

如《私募证券投资基金运作指引》相关后续监管要求发生变化，我司可通过公告形式变更基金合同，并按照产品合同的约定向基金份额持有人披露合同变更的具体内容。

三、特别提示

私募基金托管人投资监督职责的履行受限于其能够及时、准确、完整获取资本市场公开资讯数据，亦受限于私募基金管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他服务机构或交易对手方、相关交易的清算机构等及时提供相关数据和信息的真实性、准确性、完整性和有效性，私募基金托管人无法对前述数据和信息的真实性、准确性、完整性和有效性进行核验。如因相关数据和信息的获取不符合前述要求而导致私募基金托管人对相关投资范围、投资限制无法监督或无法准确进行监督的，可能会对私募基金管理人、基金份额持有人造成相关损失以及可能会对基金运作产生其他不利的影响。

四、本次变更所涉产品清单

	产品代码	产品名称
1	SJN091	竹润乐在 5 号私募证券投资基金
2	SQE736	竹润彩云 2 号私募证券投资基金
3	SLF368	竹润乐在 18 号私募证券投资基金
4	SQE734	竹润彩云 1 号私募证券投资基金
5	SXR423	竹润鑫鑫 5 号私募证券投资基金
6	SQB583	竹润乐在 35 号私募证券投资基金

7	SSL018	竹润城债鲁信 1 号私募证券投资基金
8	SNN573	竹润乐其 6 号私募证券投资基金
9	SSW873	竹润联选牛市价差 2 号私募证券投资基金
10	SQJ406	竹润乐在 36 号私募证券投资基金
11	SVB648	竹润乐天 500 指数增强进取 1 号私募证券投资基金
12	STJ999	竹润金樽 2 号私募证券投资基金
13	SXA611	竹润金樽 3 号私募证券投资基金
14	SSW803	竹润乐山 10 号私募证券投资基金
15	SNW293	竹润乐城 1 号私募证券投资基金
16	STQ149	竹润乐山 17 号私募证券投资基金
17	STF164	竹润金光玉 2 号私募证券投资基金
18	SLZ117	竹润乐天 1000 指数增强 2 号私募证券投资基金
19	SJM760	竹润乐在 2 号私募证券投资基金
20	SJH319	竹润乐其 1 号私募证券投资基金
21	SSL630	竹润金樽 1 号私募证券投资基金
22	SNV651	竹润乐在 29 号私募证券投资基金
23	SXD705	竹润稳健配置 2 号私募证券投资基金
24	SQQ872	竹润乐顺 1 号私募证券投资基金
25	SLJ364	竹润乐在 19 号私募证券投资基金

26	SVZ976	竹润乐其联选 8 号二期私募证券投资基金
27	SNJ111	竹润鑫鑫 1 号私募证券投资基金
28	SJQ875	竹润乐在 6 号私募证券投资基金
29	SXL554	竹润乐城价值 2 号私募证券投资基金
30	SQU969	竹润稳健添利 1 号私募证券投资基金
31	SVQ062	竹润盈梓 2 号私募证券投资基金
32	SSL013	竹润乐山 5 号私募证券投资基金
33	SQK075	竹润中隆 2 号私募证券投资基金
34	STQ144	竹润乐山 16 号私募证券投资基金
35	SQA102	竹润乐在 33 号私募证券投资基金
36	SSK106	竹润乐佳私募证券投资基金
37	SSW799	竹润乐选多策略私募证券投资基金
38	SNE044	竹润乐其 5 号私募证券投资基金
39	SJW149	竹润乐在 9 号私募证券投资基金
40	SSS999	竹润乐山 8 号私募证券投资基金
41	SQW622	竹润乐保 1 号私募证券投资基金
42	STE165	竹润鑫鑫 3 号私募证券投资基金
43	SJK040	竹润乐在 1 号私募证券投资基金
44	SNR871	竹润鑫鑫 2 号私募证券投资基金
45	SXD687	竹润稳健配置 1 号私募证券投资基金

46	STT378	竹润乐在 37 号私募证券投资基金
47	SXP064	竹润联选牛市价差 1 号私募证券投资基金
48	SLX086	竹润乐享股票精选 2 号私募证券投资基金
49	SNY803	竹润乐在 32 号私募证券投资基金
50	SNR540	竹润乐在 27 号私募证券投资基金
51	SJK643	竹润乐其 2 号私募证券投资基金
52	SQD439	竹润乐山 1 号私募证券投资基金
53	SQJ410	竹润中隆 1 号私募证券投资基金
54	SVB670	竹润乐山 21 号私募证券投资基金
55	STV277	竹润乐在 39 号私募证券投资基金
56	SNW840	竹润乐在 30 号私募证券投资基金
57	SSK003	竹润乐山 3 号私募证券投资基金
58	SQA243	竹润稳健配置 9 号私募证券投资基金

管理人：上海竹润投资有限公司

（盖章）

【 2024 年 7 月 9 日】