

关于竹润乐天1000指数增强1号私募证券投资基金运作指引整改公告

兴业证券股份有限公司、全体基金份额持有人：

竹润乐天1000指数增强1号私募证券投资基金（备案代码：SVG461）（以下简称“本基金”）由我司上海竹润投资有限公司（登记编码：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立。

根据《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）相关规定，《运作指引》施行前已备案私募证券投资基金不符合《运作指引》第十二条、第十三条、第十五条、第十六条、第十九条的，自《运作指引》施行之日起给予24个月过渡期。过渡期结束后仍不符合前述条款要求的，不得新增募集规模，不得新增投资者，不得展期，合同到期后进行清算。

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、基金合同的“基金管理人的声明与承诺”条款（具体标题名称以基金合同实际约定为准）中增加：

“私募基金管理人应当按照法律、行政法规、中国证监会及协会规定的投资层级要求，严格控制本基金整体嵌套层数不超过1层，符合法律法规、部门规章及自律规则等规定豁免要求的除外。”

二、基金合同的“募集对象”条款（具体标题名称以基金合同实际约定为准）中增加：

“私募基金管理人应当按照法律、行政法规、中国证监会及协会规定的投资层级要求，严格控制本基金整体嵌套层数不超过1层，符合法律法规、部门规章及自律规则等规定豁免要求的除外。”

三、基金合同的“释义”章节（具体标题名称以基金合同实际约定为准）中增加：

“流动性受限资产：是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具、全国中小企业股份转让系统挂牌公司股份、场外期权、收益互换、收益凭证、私募基金、私募资产管理产品等资产。

同一资产：（1）标准化股权类资产按照单一上市公司公开发行的股票、存托凭证，视为同一资产；（2）标准化债权类资产按照单



只债券、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，视为同一资产；（3）非标准化债权类资产（如证券公司发行的保本型收益凭证、质押式报价回购、质押式协议回购、标准化票据）按照同一“融资主体”及其关联方视为同一资产；（4）基金类资产按照单只证券投资基金或者资产管理产品视为同一资产；（5）标准化期货和衍生品类资产按照单只期货或者期权合约视为同一资产；

（6）场外衍生品类资产：①场外期权及证券公司发行的非保本型收益凭证按照同一“交易对手方”视为同一资产；②收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产。”

四、基金合同的“投资限制”条款（具体标题名称以基金合同实际约定为准）中增加以下条款：

“1、本基金投向AA级（指债项评级，无债项评级的，参考主体评级）及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不得超过本基金净资产20%。

流动性受限资产包括但不限于到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款（含协议约定有条件提前支取的银行存款）、资产支持证券（票据）、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具、全国中小企业股份转让系统挂牌公司股份、场外期权、收益互换、收益凭证、私募基金、私募资产管理产品等资产。

2、本基金总资产占净资产的比例不得超过200%

3、依买入成本与市值孰低计算，本基金投资于同一资产的资金，不得超过基金净资产的25%，本基金管理人管理的全部私募证券投资基金投资于同一资产的资金，不得超过该资产的25%。符合《运作指引》规定的分散投资要求的私募证券投资基金投资单只私募基金的资金，不受本条后一个25%的比例限制。银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公开募集基金等中国证监会、基金业协会认可的投资品种除外。托管人仅对本基金投资于同一资产的资金不得超过基金净资产的25%承担监督义务。

4、同一实际控制人控制的私募证券投资基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的30%，中国证监会、基金业协会另有规定的除外。托管人仅按照本私募基金管理人托管在托管人处的全部私募证券投资基金的数据进行监控。

5、依买入成本与市值孰低计算，本基金投资于同一债券的资金，不得超过基金净资产的10%；本基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一债券的数量，不得超过该债券存续数量的10%，因

发行人行使赎回选择权或者进行债券购回，以及其他债券持有人行使回售选择权导致的被动超标除外。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条限制。托管人仅对本基金投资于同一债券的资金不得超过基金净资产的10%承担监督义务。

6、依买入成本与市值孰低计算，本基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券资金总额，不得超过基金净资产的25%；同一实际控制人控制的私募基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券的总数量，不得超过相关债券存续数量的25%。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条限制。托管人仅对本基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券资金总额不得超过基金净资产的25%承担监督义务。

7、本基金开展债券质押式协议回购业务的，质押或者接受质押同一债券的市值，不得超过基金净资产的10%；本基金管理人管理的所有私募证券投资基金开展债券质押式协议回购业务的，质押或者接受质押同一债券的数量，不得超过该债券存续数量的10%，因发行人行使赎回选择权或者进行债券购回，以及其他债券持有人行使回售选择权导致的被动超标除外。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条限制。托管人仅对本基金质押或者接受质押同一债券的市值不得超过基金净资产的10%承担监督义务。

8、本基金开展债券质押式协议回购业务的，质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券的市值，不得超过基金净资产的25%；同一实际控制人控制的私募基金管理人管理的所有私募证券投资基金开展债券质押式协议回购业务的，质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券的总数量，不得超过相关债券存续数量的25%。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条限制。托管人仅对质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券的市值不得超过基金净资产的25%承担监督义务。

9、本基金开展债券质押式协议回购业务的，与单一交易对手方开展回购交易的金额不得超过基金净资产的10%。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条限制。”

特别提示：本合同中“同一发行人及其关联方”，基金托管人仅以其能够获取的资本市场公开资讯数据为准进行识别并对相关投资限制进行监控。本基金开展债券质押式协议回购业务的，私募基

金管理人应当在本基金下一估值日前将参与债券质押式协议回购业务的交易文件、交易对手方及质押标的等信息提供给私募基金托管人。因私募基金管理人未提供信息或信息不真实、不准确、不完整、不及时导致基金托管人无法监督的，基金托管人不承担任何责任。

以上投资限制并不构成本基金投资范围的扩大，本基金实际可投资的范围以基金合同约定的“投资范围”为准。若上述投资限制条款与基金合同约定不一致的，本基金按照孰严标准执行。

本公告自2026年06月01日起生效，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。

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，并按照监管规定履行相应报备手续。若本次基金合同变更事项属于法律法规规定需保障投资者退出权利的情形，我司将按照基金合同约定设置临时开放日供投资者办理赎回。对于是否属于应当或有权设置临时开放日的情形，由我司自行负责判断和具体执行，基金托管人及/或外包服务机构不承担前述事项的监督义务，也不承担任何责任。

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

2026年05月27日

