

# 关于祺瑛润财 1 号私募证券投资基金

## 开放期有关事项的公告

尊敬的广大投资者：

感谢您一直以来对祺瑛润财 1 号私募证券投资基金（以下简称“本基金”）的大力支持。自本基金成立至今，管理人一直精心管理，规范运作。

根据《祺瑛润财 1 号私募证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）及《祺瑛润财 1 号私募证券投资基金投资起始运作公告》的有关约定，本基金于 2022 年 1 月 12 日投资起始运作，即 2022 年 1 月 12 日为本基金底层资产投资起始运作日，自投资起始运作日开始满 12 个月首次开放之前称为首个封闭期。当本基金底层资产在某一个敲出观察日挂钩标的收盘价大于或者等于敲出价格（即发生敲出事件），本基金于该事件发生日后的两个工作日以内提前终止；当本基金底层资产在所有敲出观察日挂钩标的收盘价均小于敲出价格，且最后一个敲出观察日（2023 年 1 月 12 日）挂钩标的收盘价大于或者等于期初参考价格，本基金于最后一个敲出观察日（2023 年 1 月 12 日）后的两个工作日以内提前终止；当本基金底层资产在所有的敲出观察日挂钩标的收盘价均小于敲出价格，且最后一个敲出观察日（2023 年 1 月 12 日）挂钩标的收盘价小于期初参考价，本基金开放退出。底层资产期初参考价格为中证 500 指数（代码：000905.SH）在期初观察日（即投资起始运作日）的收盘价，具体为【7196.93】；敲出价格=期初参考价 $\times$ 106%，即【7628.75】；标的证券价格为观察期内每日中证指数有限公司官网发布的中证 500 指数收盘价（按照四舍五入法精确到小数点后 2 位）。若届时中证指数有限公司官网未发布前述价格，将本着公平、公正、公允、诚实信用及商业合理原则，与对手方协商选择市场认可的合理价格水平进行计算。价格参考页面：

<http://www.csindex.com.cn/zh-CN/indices/index-detail/000905>

本基金首个封闭期即将结束，现根据当前市场情况，为更好地服务各位投资者，特将本基金开放期注意事项公告如下：

一、若本基金最后一个敲出观察日（2023 年 1 月 12 日）挂钩标的收盘价小



于期初参考价【7196.93】，本基金开放退出，开放期为2023年1月13日及1月16日，其中1月13日为固定开放日，1月16日为临时开放日，届时本基金首个封闭期结束。

二、本次开放期内，本基金仅接受退出，不接受参与：

1、 申请退出：基金份额持有人持有的基金资产净值高于100万元时，可以选择部分赎回基金份额，基金份额持有人在赎回后持有的基金资产净值不得低于100万元，如基金份额持有人在赎回后持有的基金资产净值低于100万元，则基金管理人与基金份额持有人协商后可采用将剩余份额做全部赎回处理。

三、本次开放期后，本基金将继续存续不超过24个月，并采取指数增强策略进行投资，力求在追踪挂钩标的指数表现基础上（收益或亏损）获得额外的增强回报。

本基金自指数增强策略投资日起至满12个月之日止为第二个运作期，该运作期本基金拟投资于挂钩中证500指数（000905.SH）的收益互换，该笔收益互换交易以符合相应资质的金融机构（以下简称“交易对手方”）为交易对手，交易对手方将按照交易确认书约定的款项支付相关损益，收益互换交易的相关要素详见附件一。

本基金第二个运作期投资起始日拟定为2023年1月18日，即以中证500指数（代码：000905.SH）在2023年1月18日的收盘价格作为期初价格，自该日起追踪中证500指数的表现，且不涉及本基金首个封闭期结束之后至第二个运作期投资起始日（2023年1月13日至2023年1月18日）期间的中证500指数表现。第二个运作期内，本基金将每季度设置一个开放日，仅供投资者赎回基金份额，投资者需提前2个交易日提交赎回申请。

风险提示：本基金为净值型产品，附件一所示的固定增强收益率（年化）不是预期收益率，仅表示标的证券涨跌幅损益基础上的固定增强收益部分，是标的证券指数表现基础上（收益或亏损）获得的额外增强回报，不构成管理人对本基金未来收益的承诺；管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本基金



资产，但不保证本基金资产一定盈利，也不保证最低收益。

特此公告。

上海祺瑛投资管理有限公司

2023年1月6日





附件一：第二个运作期拟投资收益互换要素表（最终要素以管理人公告为准）：

|             |   |
|-------------|---|
| 标的证券        | 中证 500 指数，标的代码：000905.SH  |
| 起始日         | 2023 年 01 月 18 日  |
| 到期日         | 2024 年 01 月 18 日，若到期日为非交易日，则到期日顺延至其后未发生市场中断事件的第一个交易日。若本交易提前终止，则提前终止日为到期日。 |
| 计息期         | 从起始日（含）至到期日或提前终止日（含）的所有自然日天数。   |
| 期初价格        | 起始日标的证券收盘价格或其他约定方式确认的价格   |
| 期末价格        | 到期日或提前终止日收盘价格或其他约定方式确认的价格   |
| 交易日         | 指中华人民共和国境内以及对应标的证券所在地的证券交易所共同的交易日   |
| 固定增强收益率（年化） | 4.5%<br>【固定增强收益率（年化）不是预期收益率，仅表示标的证券涨跌幅损益基础上的固定增强收益部分】                     |

注：

- 1、固定增强收益率（年化）为本基金投向挂钩中证 500 指数（000905.SH）的收益互换时与交易对手方签署的交易协议的约定条款，为税前费前固定增强收益率，根据本基金《基金合同》的相关约定，扣除本基金固定费用后的税前费后年化固定增强收益率为 4.06%。
- 2、固定增强收益率（年化）收益率不是预期收益率，仅表示标的证券自起始日至到期日或提前终止日期间涨跌幅损益基础上的固定增强收益部分，是标的证券指数表现基础上（收益或亏损）获得的额外增强回报，不构成管理人对本基金未来收益的承诺。若标的证券的跌幅超过税前费后年化固定增强收益率，投资者仍有亏损风险。

