

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《关于祺瑛润财 1 号私募证券投资基金第二个运作期投资起始的公告》等文件的有关约定，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，现第二个运作期即将结束。

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：

本次开放期后，本基金将封闭运作，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 2024 年 11 月 22 日止为第三个运作期，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。

本基金第三个运作期投资起始日拟定为 2024 年 1 月 23 日，即以中证 500 指数（代码：000905.SH）在 2024 年 1 月 23 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，且不涉及本基金第二个封闭期结束之后至第三个运作期投资起始日（2024 年 1 月 23 日至 2024 年 11 月 22 日）期间的中证 500 指数表现。第三个运作期内，本基金将设置两个开放日，仅供投资者赎回基金份额，投资者需提前 3 个交易日提交赎回申请。



具体指数增强收益、投资日及开放日以管理人公告为准。

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。

上海祺璞投资管理有限公司

2024年1月16日



附件一：第三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	2024 年 01 月 23 日
到期日	2024 年 11 月 22 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）	5% 【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 4.56%。
- 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。

