

关于祺瑛润财1号私募证券投资基金

第三个运作期投资起始的公告

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。

本基金现第二个运作期已结束，第三个运作期投资起始日定于2024年1月23日。第三个运作期本基金投资于挂钩中证500指数（000905.SH）的收益互换，该笔收益互换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期初观察日为2024年1月23日，当日中证500指数的收盘价为【4865.74】。

本基金第三个运作期的开放退出日（T日）为2024年4月19日、2024年7月19日、2024年11月15日，如遇非交易日则顺延至下一交易日；退出预约申请日为T-5日至T-3日，均为交易日。

风险提示：本基金为净值型产品，附件一所示的增强收益率（年化）不是预期收益率，仅为标的证券涨跌幅损益基础上的增强收益，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

2024年1月23日



附件一：第三个运作期投资收益互换要素表：

标的证券	【中证 500 指数】（证券代码：【000905.SH】）
起息日	2024 年 01 月 23 日
到期日	2024 年 11 月 14 日
交易天数	起息日（含）至到期日（含）间的自然日天数，如交易全部提前终止，则为起息日（含）至交易全部提前终止之日（含）间的自然日天数。
期初价格	于起息日，交易所公布的标的资产的收盘价，四舍五入保留 2 位小数
期末价格	于到期日或某一提前终止日，交易所公布的标的资产的收盘价，四舍五入保留 2 位小数
交易日	交易所就标的资产正常交易且正常公布标的资产价格之日
增强收益率（年化）	6.1% 【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增强收益部分】

注：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，为费前税前增强收益率，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年化增强收益率为 5.66%。（受本基金投资收益互换的初始名义金额及重置名义金额的影响，上述提及的收益率在实际运作中存在一定差异。）

增强收益率（年化）不是预期收益率，仅为标的证券自起息日至到期日或提前终止日期间涨跌幅损益基础上的增强收益，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年化增强收益率，投资者仍有亏损风险。

