

关于“中欧瑞博赤兔一期1号私募证券投资基金”及标的基金“中欧瑞博赤兔一期私募证券投资基金”基金合同变更的公告

尊敬的基金份额持有人：

中欧瑞博赤兔一期1号私募证券投资基金（以下简称“本基金”，基金编号：SSF016）成立于2021年7月29日。深圳市中欧瑞博投资管理股份有限公司（以下简称“我司”）为本基金的管理人，招商证券股份有限公司为本基金的托管人。

根据《中欧瑞博赤兔一期1号私募证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，本基金投资于“中欧瑞博赤兔一期私募证券投资基金”（以下简称“标的基金”），并可投资于货币基金、银行理财产品、银行存款。

鉴于标的基金的投资范围、投资策略、投资限制发生变更，为更好地为本基金份额持有人提供投资理财服务，我司根据《中华人民共和国民法典》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《私募投资基金登记备案办法》和《私募投资基金监督管理暂行办法》及其他法律法规的有关规定以及本基金基金合同的约定，向本基金份额持有人披露标的基金相关变更事项，本基金份额持有人不认可该调整事项，应在本基金的下一个开放日（含临时开放日）赎回基金份额。如本基金份额持有人未在开放日申请赎回基金份额则视为同意该调整事项。

标的基金基金合同修改主要章节如下：

1. 修改产品存续期、修改份额分类；
2. 按《私募投资基金监督管理条例》、《关于加强私募投资基金监管的若干规定》、《私募投资基金登记备案办法》、《私募投资基金备案指引第1号——私募证券投资基金》等法规及规定的要求更新合同条款；
3. 修改投资范围、投资限制、关联交易等条款；
4. 修改估值方法，费率、收益分配等内容；
5. 其他。

由于标的基金基金合同变更内容较多，具体变更后的基金合同内容请以附件一“关于中欧瑞博赤兔一期私募证券投资基金基金合同之补充协议（202401）”为准。

标的基金变更生效后，本基金将对本基金基金合同“十一 基金的投资”章节“（八）“中欧瑞博赤兔一期私募证券投资基金”的相关情况如下：”相关条款进行更新。



《中欧瑞博赤兔一期1号私募证券投资基金基金合同》具体拟修改条款如下（最终条款以实际变更生效后的基金合同为准）：

原条款：	现条款：
<p>（八）“中欧瑞博赤兔一期私募证券投资基金”的相关情况如下：</p> <p>1、投资目标</p> <p>在有效控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。</p> <p>2、投资范围</p> <p>本基金的投资范围主要包括国内依法发行的股票（包括港股通股票）、全国中小企业股份转让系统挂牌的品种（包括股票、可转换公司债券及其他证券品种）、权证、基金、各种固定收益类产品（债券、回购、银行存款）、股指期货、证券公司收益凭证、收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）、利率远期等金融监管部门批准或备案发行的金融产品以及中国证监会认可的其他投资品种。本基金可以参与融资融券交易，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。本基金可参与证券回购业务，可参与新股申购业务。</p> <p>3、投资策略</p> <p>在不同市场阶段采取适配策略：熊市末期、牛市初期，精选优秀成长股；牛市中期，坚定持有成长股，择机配置估值洼地的价值股；牛市后期，逐步减仓，回避涨幅大、估值贵、无业绩支撑的品种；熊市阶段，空仓或采用做空工具对冲风险。</p> <p>4、投资限制</p> <p>（1）单只股票按成本计价不超过基金资产净值的20%。</p> <p>（2）本基金投资于全国中小企业股份转</p>	<p>（八）“中欧瑞博赤兔一期私募证券投资基金”的相关情况如下：</p> <p>1、投资目标</p> <p>在有效控制风险的前提下，实现客户资产长期、持续、稳定的增值。</p> <p>2、投资范围</p> <p>本基金的投资范围包括国内证券交易所上市交易的品种（指股票、优先股、存托凭证、权证）、银行间或交易所发行交易的利率债、地方政府债及可转换债券及可交换债券（均不含非公开发行的公司债）、债券通用质押式回购、存款、公开募集证券投资基金、期货、场内期权、在交易所或银行间发行的资产支持证券和资产支持票据（但不包括次级）、证券公司收益凭证、收益互换（含跨境收益互换）与场外期权（在监管部门允许的前提下，以具有相应业务资格的机构作为交易对手）、本基金可以参与新股申购、融资融券交易、将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司，也可以通过港股通及其他交易互联互通机制投资于符合本合同约定的投资范围的品种。</p> <p>3、投资策略</p> <p>在不同市场阶段采取适配策略：熊市末期、牛市初期，精选优秀成长股；牛市中期，坚定持有成长股，择机配置估值洼地的价值股；牛市后期，逐步减仓，回避涨幅大、估值贵、无业绩支撑的品种；熊市阶段，空仓或采用做空工具对冲风险。</p> <p>（1）股票投资策略</p> <p>本基金将精选在市场需求巨大、商业模式领先、产品竞争力较大和公司管理优秀等一个或多</p>

让系统挂牌的品种（包括股票、可转换公司债券及其他证券品种）按成本计算不得超过本基金资产总值的 20%（本基金可以以本基金的总资产为限参与全国中小企业股份转让系统挂牌的品种发行申购，如因参与获配导致投资比例超出本合同约定的，管理人应在可变现前提下的 10 个工作日内调整至符合合同约定）；

(3) 本基金投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。

基金管理人自本合同生效之日起 3 个月内使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标，除法律法规或本合同另有约定外，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 10 个工作日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个工作日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。

在本基金到期日前 10 个工作日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限制可以不符合上述基金配置比例规定。

个方面具备比较优势的企业，力争通过精选优秀企业，持续优化投资组合，为投资者贡献更高价值。

对于存托凭证投资，本基金管理人将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。

(2) 金融衍生品投资策略

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，参与金融衍生品交易。本基金参与金融衍生品投资时机和数量的决策建立在对基础标的市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素，结合定性和定量方法，确定投资时机。

4、投资限制

(1) 本基金不得投资 DMA 多空收益互换。

(2) 本基金存续期内，基金总资产与净资产的比例不得超过 200%。

(3) 本基金投资于国内证券交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-100%。

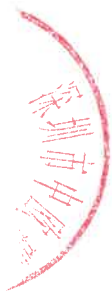
自 2024 年 8 月 1 日起，对场外衍生品及收益凭证执行以下投资比例限制：

(4) 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%；

(5) 参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收益互换合约名义本金的 50%；

(6) 参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；

(7) 本基金投资组合遵循相关法律法规或监管部门对于投资比例限制的规定。



基金管理人自本合同生效之日起 3 个月内使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定。由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标，除法律法规或本合同另有约定外，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 20 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 20 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。

在本基金到期日前 10 个交易日内，因基金财产变现需要，本基金财产的投资比例限制可以不符合上述基金配置比例规定。

此外，本基金参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券发行申购时，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量。

我司现根据本基金基金合同约定，决定增设 2024 年 6 月 24 日为本基金的临时开放日。本次临时开放日只可赎回不可申购，且不受基金份额不允许赎回期限的限制（如有）以及临时开放日赎回的份额不收取赎回费（如有），若本基金份额持有人不认可该调整事项，应在 2024 年 6 月 24 日的临时开放日赎回基金份额。如本基金份额持有人未在本次临时开放日申请赎回基金份额则视为同意该调整事项。

本基金及标的基金本次基金合同变更事项自 2024 年 6 月 25 日生效。

特此公告。

深圳市中欧瑞博投资管理股份有限公司

2024 年 6 月 18 日

附件一“关于中欧瑞博赤兔一期私募证券投资基金基金合同之补充协议（202401）”