

《浦信日添月益基金基金合同》变更告知函

尊敬的基金份额持有人：

上海恒基浦业资产管理有限公司（以下简称“我司”）作为浦信日添月益基金（产品代码：SD9445）（以下简称“本产品”）的管理人，基于《私募证券投资基金运作指引》要求在 2024 年 8 月 1 日前针对其第十七条场外衍生品交易的规定完成合同整改，我司拟通过公告变更形式增加相关投资限制，同时增加杠杆比例条款，特此告知相关变更事宜。

一、变更内容

（一）修订“私募基金的投资”中“投资限制”小节

新增最后两条表述，序号相应顺延：

“1、本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过【200】%；

2、自 2024 年 8 月 1 日（含）起，本基金投资应当遵循以下限制。私募基金托管人对以下限制的监督，依赖于本私募基金管理人、交易商、经纪商等机构提供的数据的真实性、准确性、完整性、及时性，监督频率亦受限于私募基金托管人收到数据的频率（可能以季度或更低的频率对相关指标进行核算、监督）。若因收到数据不真实、不准确、不完整、不及时导致私募基金托管人无法准确监督相关投资限制，给基金资产或投资者造成损失的，私募基金托管人不承担赔偿责任。

（1）本基金新增场外期权合约以及存续合约展期的，除仅开展商品类场外期权交易外，基金净资产不低于 5000 万元；本基金参与场外期权交易的，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%；



(2) 本基金新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产不低于1000万元；本基金参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的50%；

(3) 本基金参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证(如雪球结构场外衍生品)的合约名义本金不得超过基金净资产的25%；”

二、变更流程

上述变更内容自2024年07月24日起生效，如基金份额持有人对本次变更持有异议，请于【2024】年【07】月【23】日前申请赎回持有的全部基金份额，如基金份额持有人未在【2024】年【07】月【23】日前申请赎回持有的全部基金份额，视为份额持有人同意本次变更。

特别提示：

1、如《私募证券投资基金运作指引》相关后续监管要求发生变化，我司可通过公告形式变更基金合同，并按照基金合同的约定向基金份额持有人披露基金合同变更的具体内容。

2、私募基金托管人投资监督职责的履行受限于其能够及时、准确、完整获取资本市场公开资讯数据，亦受限于私募基金管理人、证券经纪商、期货经纪商及其他服务机构或交易对手方、相关交易的清算机构等及时提供相关数据和信息的真实性、准确性、完整性和有效性，私募基金托管人无法对前述数据和信息的真实性、准确性、完整性和有效性进行核验。如因相关数据和信息的获取不符合前述要求而导致私募基金托管人对相关投资范围、投资限制无法监督或无法准确进行监督的，可能会对私募基金管理人、基金份额持有人造成相关损失以及可能会对基金运作产生其他不利的影响。

特此公告。

管理人：上海恒基浦业资产管理有限公司



(盖章)

【 2024年 7月 4日 】

