

关于勤辰朝阳 1 号 1 期私募证券投资基金 之标的基金根据《私募证券投资基金运作指引》第十七条 整改并修改标的基金基金合同的公告

尊敬的投资者：

上海勤辰私募基金管理合伙企业（有限合伙）（以下简称“管理人”）作为基金管理人发行管理的勤辰朝阳 1 号 1 期私募证券投资基金（以下简称“本基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。

基于中国证券投资基金业协会发布的《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）相关要求，本基金所投资的标的基金【勤辰朝阳 1 号私募证券投资基金】（以下简称“标的基金”）的管理人拟在 2024 年 8 月 1 日前就《运作指引》第十七条的规定，就标的基金涉及场外衍生品交易的条款进行整改并修改标的基金基金合同。根据标的基金的基金合同，标的基金已发布公告明确相应基金合同变更安排，具体变更内容详见附件一标的基金的相关公告，标的基金的该项变更自 2024 年 7 月 22 日起正式生效。

管理人特将标的基金变更事项向本基金份额持有人予以披露。

特此公告。感谢您的支持！

管理人：上海勤辰私募基金管理合伙企业（有限合伙）

2024 年 7 月 12 日

附件一

关于勤辰朝阳 1 号私募证券投资基金 根据《私募证券投资基金运作指引》第十七条整改 并修改基金合同的公告

尊敬的投资者：

上海勤辰私募基金管理合伙企业（有限合伙）（以下简称“管理人”）作为基金管理人发行管理的勤辰朝阳 1 号私募证券投资基金（以下简称“本基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。

基于中国证券投资基金业协会发布的《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）相关要求，管理人拟在 2024 年 8 月 1 日前就《运作指引》第十七条的规定，就本基金涉及场外衍生品交易的条款进行整改并修改基金合同。根据本基金基金合同约定，经与本基金托管人国泰君安证券股份有限公司协商一致，通过公告变更形式增加相关投资限制，具体如下：

一、《基金合同》条款具体修改如下：

修订“私募基金的投资”中“投资限制”小节

新增最后一条表述：

“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、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、合同条款变更生效事宜：

上述合同条款变更自 2024 年 7 月 22 日起正式生效。管理人指定 2024 年 7 月 19 日开放日，允许不接受上述变更事项的基金份额持有人进行赎回，上述指定开放日的赎回不受份额锁定期限制（如有），亦不收取赎回费（如有）。如份额持有人未在上述指定开放日申请赎回其持有本基金全部份额的，即视为同意本基金上述变更事项。

本次变更不会影响本基金合规运作，管理人将按有关规定及时报中国证券投资基金业协会备案。

特此公告。感谢您的支持！



管理人：上海勤辰私募基金管理合伙企业（有限合伙）

2024 年 7 月 12 日

