

关于宏锡天明量化CTA2号私募证券投资基金基金合同投资条款变更的公告

尊敬的投资者、华泰证券股份有限公司：

鉴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》”）已于2024年8月1日起施行，对《运作指引》施行前已备案私募证券投资基金不符合《运作指引》第十二条、第十三条、第十五条、第十六条、第十九条的，自《运作指引》施行之日起给予24个月的过渡期。为满足《运作指引》规定，广东宏锡基金管理有限公司（以下简称“我司”或“基金管理人”）特此对在华泰证券股份有限公司（以下简称“基金托管人”）托管的宏锡天明量化CTA2号私募证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同（含相关补充协议、公告等补充文件，以下合并简称《基金合同》）中相关条款进行变更。

一、《基金合同》条款具体修改如下：

1、在《基金合同》“释义”章节末增加如下内容（序号根据实际上文序号调整）：

“1、现金管理工具：指银行活期存款、国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、货币市场基金等中国证监会认可的现金管理工具。

2、同一资产：本合同所称同一资产按照以下口径计算：

（1）标准化股权类资产按照单一上市公司公开发行的股票、存托凭证，视为同一资产；

（2）标准化债权类资产按照单只债券、中央银行票据、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，视为同一资产；

（3）非标准化债权类资产（如证券公司发行的本金保障型收益凭证、质押式报价回购、质押式协议回购、标准化票据）按照同一“融资主体”及其关联方视为同一资产；

（4）基金类资产按照单只证券投资基金或者资产管理产品视为同一资产；

（5）标准化期货和衍生品类资产按照单只期货或者期权合约视为同一资产；

（6）场外衍生品类资产：场外期权及证券公司发行的非本金保障型收益凭



证按照同一“交易对手方”视为同一资产；收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产。”

2、在《基金合同》“私募基金的投资”章节的“投资比例及限制”条款内容中增加如下约定（序号根据实际上文序号调整）：

“（1）本基金存续期内，基金总资产不得超过基金净资产的 120%。如需按照穿透原则合并计算投资标的的资产负债情况，由管理人自行监控，托管人不承担任何责任。

（2）本基金投资于宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金（备案代码：SQA336）的比例高于基金净资产的 90%，管理人应确保宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金符合《私募证券投资基金运作指引》第十二条组合投资的要求。

宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金投资范围及投资限制摘要见合同附件，最终条款以实际生效的标的基金基金合同为准。宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金发生变更基金名称情形的，以变更后的名称为准。

（3）同一实际控制人控制的私募证券投资基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%，中国证监会、基金业协会另有规定的除外。本条由管理人自行监控，托管人不承担任何责任。

（4）本基金开展债券投资或债券质押式协议回购业务的，按买入成本与市值孰低计算，本基金投资、质押或者接受质押单一债券的资金不得超过基金净资产的 10%；管理人管理的所有私募证券投资基金投资、质押或者接受质押单一债券的数量，不得超过该债券存续数量的 10%。因发行人行使赎回选择权或者进行债券购回，以及其他持有人行使回售选择权导致的被动超标除外。

本基金投资、质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券资金总额，不得超过基金净资产的 25%；管理人管理的所有私募证券投资基金投资、质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券的总数量，不得超过相关债券存续数量的 25%。

国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条前两款规定的投资比例

限制。

(5) 本基金开展债券质押式协议回购业务的，与单一交易对手方开展回购交易的金额不得超过基金净资产的10%（与资产管理产品（含私募基金）开展债券质押式协议回购业务的，将其管理人视为交易对手方）。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条限制。

基金管理人应当在本基金下一估值日前向基金托管人提供参与债券质押式协议回购业务的交易文件、交易对手方及质押标的等托管人要求的信息。托管人仅根据管理人提供的数据进行事后监督，管理人应对提供数据的准确性、完整性和及时性负责，因管理人未及时提供相关数据或提供数据不真实、不准确、不完整导致托管人未能有效履行投资监督职责，托管人不承担任何责任。

上述投资比例及限制中，涉及同一发行人及其关联方的，基金托管人仅对“同一发行人”维度进行监控；涉及管理人管理的所有产品的，由基金管理人自行监控，基金托管人不承担任何责任。

（下文序号同步调整）

.....

受证券期货市场波动、证券发行人合并、私募证券投资基金规模变动等基金管理人之外的因素影响，导致本基金的投资比例不符合法律法规规定或本合同约定的，基金管理人应当在20个交易日内调整至符合要求。因资产流动性受限导致无法完成前述调整的，应当在相关资产可出售、可转让或者恢复交易后的20个交易日内调整至符合要求。”

3、在《基金合同》中增加以下合同附件（如《基金合同》已列示标的基金投资要素，则按照下列内容更新）：

“附件：标的基金“宏锡量化CTA进取型A期私募证券投资基金”投资范围及投资限制

【重要提示】下列关于“宏锡量化CTA进取型A期私募证券投资基金”（以下简称“标的基金”）投资范围及投资限制仅供本基金投资者参考使用，最终条款以实际生效的标的基金基金合同为准，如本摘要内容与标的基金基金合同不一致的，以标的基金基金合同约定为准。



<p>标的基金投资范围</p>	<p>(1) 股票(A股);</p> <p>(2) 债券(可转换债券、可交换债券);</p> <p>(3) 公募基金(封闭式基金、开放式基金、股票型基金、债券型基金、货币市场型基金、混合型基金);</p> <p>(4) 回购(债券正回购、债券逆回购);</p> <p>(5) 期货(商品期货、股指期货、利率期货);</p> <p>(6) 期权(场内期权);</p> <p>(7) 资产管理产品(银行理财产品、信托计划、证券公司及其子公司资产管理产品、基金公司及其子公司资产管理产品、期货公司及其子公司资产管理产品、保险公司及其子公司资产管理产品、私募证券投资基金);</p> <p>(8) 其他(银行存款、中国存托凭证、资产支持证券、收益互换、收益凭证、融资融券、转融通)。</p> <p>如本基金投资资产管理产品,基金管理人应确保所投资的资产管理产品未投资或在本基金持有期内不投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品。</p>
<p>标的基金投资比例及投资限制</p>	<p>(1) 本基金存续期内,基金总资产不得超过基金净资产的200%。如需按照穿透原则合并计算投资标的的资产负债情况,由管理人自行监控,托管人不承担任何责任。</p> <p>(2) 本基金投向AA级及以下信用债(可转债除外)、流动性受限资产的金额,合计不得超过基金净资产的20%(场外衍生品按照本基金估值表中场外衍生品保证金(预付金)、合约净值之和计算,其他投资品种按照市值计算)。</p> <p>本条所称流动性受限资产,包括到期日在10个交易日以上的逆回购与银行定期存款(含协议约定有条件提前支取的银行存款)、资产支持证券(票据)、流动受限的新股以及非公开发行股票、停牌股票、因发行人债务违约无法进行转让或交易的债券和非金融企业债务融资工具、场外衍生品、私募资管产品(含私募基金)。</p>

(3) 本基金采用资产组合的方式进行投资并符合下列要求（投资于银行活期存款、国债、债券通用质押式回购、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、公募基金等中国证监会、基金业协会认可的投资品种除外）：

① 按买入成本与市值孰低计算，本基金投资于同一资产的资金不得超过本基金净资产的 25%；

② 按买入成本与市值孰低计算，本基金管理人管理的全部私募证券投资基金投资于同一资产（不含本基金管理人管理的产品遵照上述第①条投资的单只私募基金）的资金不得超过该资产的 25%。本条由管理人自行监控，托管人不承担任何责任。

(4) 同一实际控制人控制的私募证券投资基金管理人的自有资金、管理的所有私募证券投资基金、担任投资顾问的资产管理产品合计持有单一上市公司发行的股票不得超过该上市公司可流通股票的 30%，中国证监会、基金业协会另有规定的除外。本条由管理人自行监控，托管人不承担任何责任。

(5) 本基金开展债券投资或债券质押式协议回购业务的，按买入成本与市值孰低计算，本基金投资、质押或者接受质押单一债券的资金不得超过基金净资产的 10%；管理人管理的所有私募证券投资基金投资、质押或者接受质押单一债券的数量，不得超过该债券存续数量的 10%。因发行人行使赎回选择权或者进行债券购回，以及其他持有人行使回售选择权导致的被动超标除外。

本基金投资、质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券资金总额，不得超过基金净资产的 25%；管理人管理的所有私募证券投资基金投资、质押或者接受质押同一发行人及其关联方发行的债券的总数量，不得超过相关债券存续数量的 25%。

	<p>国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条前两款规定的投资比例限制。</p> <p>(6) 本基金开展债券质押式协议回购业务的，与单一交易对手方开展回购交易的金额不得超过基金净资产的 10% (与资产管理产品 (含私募基金) 开展债券质押式协议回购业务的，将其管理人视为交易对手方)。国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等中国证监会、基金业协会认可的投资品种不受本条限制。</p>
--	---

”

二、风险揭示

1、基金特定投资架构及底层标的风险

本基金采取的特定投资架构导致本基金投资收益主要取决于宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金项下的投资情况，并由此可能存在本基金收益不能达到投资目标或本金损失的风险。本基金主要投资于宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金，宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金面临的所有风险都是本基金的风险。

2、双重收费的风险

本基金主要投资于宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金，该基金将会产生费用，虽然该等费用可能并非直接在本基金项下列支，但相比较于基金投资者直接对宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金进行投资的情况，基金投资者通过投资于本基金间接投资于宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金的，实质上同时承担了本基金及宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金的费用。

三、上述变更事项自 2026 年 5 月 11 日起生效。如有份额持有人不接受上述变更事项，应在生效日前及时联系我司或销售机构，我司将指定固定开放日或设置临时开放日允许不接受上述变更事项的份额持有人赎回基金份额；如份

额持有人在本公告生效日前的开放日未赎回全部份额的，即视为同意上述变更事项。相关变更事项的信息披露、开放日的指定或设置、份额持有人的赎回均由我司作为基金管理人全权负责；基金托管人及基金服务机构仅依据基金管理人的申请和通知进行配合，不负责监督和审核，不承担任何责任。

我司承诺：将根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求向份额持有人及时披露合同变更事项，履行监管报告义务，并将宏锡量化 CTA 进取型 A 期私募证券投资基金的基金合同或对投资者利益有重大影响的关键产品要素作为本基金合同的备查文件。

基金管理人：广东宏锡基金管理有限公司

2026年5月8日



