

广东宏锡基金管理有限公司产品基金合同变更告知函

致：国泰海通证券股份有限公司

根据《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）的过渡期整改要求，我司拟通过公告变更形式，对相关私募证券投资基金的基金合同条款进行批量调整。现就本次合同变更事宜告知如下：

为落实《运作指引》项下过渡期整改要求，并结合不同私募证券投资基金在产品结构、投资策略、投资范围及运作安排等方面的差异，我司拟对相关基金合同条款进行分类整改。根据《运作指引》第十二条、第十三条、第十五条、第十六条及第十九条项下的相关要求，本次整改分为四种方案，并分别对应不同的条款组合。简要总结各方案适用情形如下：

方案一	非联接基金+基金整体杠杆比不超过 200%
方案二	非联接基金+基金整体杠杆比不超过 120%
方案三	联接基金+基金整体杠杆比不超过 200%
方案四	联接基金+基金整体杠杆比不超过 120%

简要总结各方案主要整改内容如下：

《运作指引》 条款	条款主要内容	方案一	方案二	方案三	方案四
第十二条	双 25%组合投资要求	√	√	--	--
第十三条	豁免组合投资要求的联接基金模式	--	--	√	√
第十五条第一款	基金整体杠杆比（总资产/净资产）不超过 200%。同时 AA 级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不高于基金净资产 20%。	√	--	√	--
第十五条第二款	基金整体杠杆比（总资产/净资产）不超过 120%。	--	√	--	√

第十六条	上市公司股票投资要求	√	√	√	√
第十九条	债券投资相关要求	√	√	√	√

我司确认,适用上述四种整改方案的私募证券投资基金产品代码及产品名称,分别详见附件1《本次变更所涉产品清单》;各方案项下具体合同条款的修改内容,以附件2《各方案对应的整改条款》所载内容为准。附件1及附件2构成本告知函不可分割的组成部分。我司承诺将以公告等书面形式向投资者披露本函变更的具体内容。

我司承诺,将确保相关私募证券投资基金的投资结构、投资层级符合相关法律法规、部门规章及自律规则的规定。

如贵司未提出反对意见,本函件及附件自**2026年05月18日**起正式生效。由于相关整改对基金运作具有实质影响,出于谨慎运作考虑,我司有权在本函件生效之日起的十个交易日(含第十个交易日)的期间内,在与贵司协商一致后通过重新向贵司出具盖章函件的方式,撤销或调整本变更告知函附件1《本次变更所涉产品清单》中所列示的部分或全部私募证券投资基金的合同条款修订(具体调整方案、范围以盖章函件的内容为准,贵司代销的私募基金产品除外)。如我司对变更条款进行撤销或调整后,我司将按照相关法律法规和基金合同的约定(如有)向基金份额持有人进行信息披露。

特此告知。

管理人: 广东宏锡基金管理有限公司
(盖章)

2026年05月14日

附件1:《本次变更所涉产品清单》

附件2:《各方案对应的整改条款》

附件 1：《本次变更所涉产品清单》

选用方案一的产品清单：

	产品代码	产品名称
1	SLF619	宏锡创盈量化 CTA30 号五期私募证券投资基金

选用方案二的产品清单：

	产品代码	产品名称
1	无	无

选用方案三的产品清单：

	募集层产 品代码	募集层产品名 称	投资层基金（标 的基金）代码	投资层基金（标的基 金）名称
1	无	无	无	无

选用方案四的产品清单：

	募集层产 品代码	募集层产品名 称	投资层基金（标 的基金）代码	投资层基金（标的基 金）名称
1	无	无	无	无

特别说明：

1、在本公告生效后，私募基金管理人有权直接在按照方案三/方案四整改的私募基金之新用印的基金合同文本中明确列示具体标的基金的名称以及投资范围、投资限制、自有风控措施（如有）等条款，而无需再通过合同变更等程序；

2、前述在新基金合同中列示的标的基金的投资范围、投资限制、自有风控措施（如有）等条款仅供私募基金投资者参考，不得作为直接投资决策依据，最终内容应以实际签署的标的基金之基金合同为准。如列示的标的基金条款与实际签署条款不一致的，投资者不得向私募基金管理人、托管人主张赔偿责任，私募基金管理人存在为销售之目的欺诈、恶意误导投资者等情形的除外；

3、标的基金存续期间，如投资范围、投资限制、自有风控措施（如有）事项发生变更的，本管理人应当及时向投资者进行信息披露，私募基金托管人对此不负有监督义务。

附件 2：《各方案对应的整改条款》

重要提示 若附件 1 中所列的任何私募证券投资基金之基金合同中，已存在与下文条款重复约定的（包括但不限于已经约定“流动性受限资产”定义或“同一资产”定义、添加下文中的投资限制等），则无需再依据本附件添加或修改相关重复条款。

附件 2.1 方案一涉及的私募基金合同条款具体修改内容

（一）修订“释义”

1、新增表述：

“流动性受限资产：指到期日在 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、其他限售股票、战略配售公募 REITs 份额的流动受限部分、停牌或退市的股票和债券、收益互换、场外期权、收益凭证、私募资管产品（含私募基金），私募基金管理人与私募基金托管人可根据法律法规和自律规则的要求协商一致进行调整。

同一资产：

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（如证券公司发行的保本型收益凭证、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：（1）场外期权及证券公司发行的非保本型收益凭证按照同一“交易对手方”视为同一资产；（2）收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产。

如法律法规、自律规则及有关政策发生变化，以最新规则或要求为准。”

（二）修订“私募基金的投资”中“投资限制”小节

新增投资限制，序号相应顺延：

“1、与《私募证券投资基金运作指引》相关投资限制

特别说明：

若本条款与本合同之其他投资限制、自有风控措施（如有）存在冲突的，应当以本条款约定为准。

除非法律法规、自律规则有明确要求的或本条款有明示说明的，本条款的投资限制及其他投资风控指标均为仅对本基金本身及直接投资标的进行的约定，无需穿透（包括但不限于穿透至下层私募投资基金或资产管理产品（如有）及对应底层资产）计算或监督。

如法律法规、自律规则有明确要求的或本条款有明示要求私募基金托管人对投资限制条款进行穿透监督的，私募基金托管人对特定品种（包括但不限于场外衍生品、资产管理产品、质押式协议回购等）的穿透监督，依赖于本私募基金管理人、交易商、相关资产管理产品管理人或托管人、经纪商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监督或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）本基金投资于同一资产的资金，不超过基金资产净值的 25%；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、公开募集基金等中国证监会、基金业协会认可的投资品种除外；

为免疑义，同一资产的计算原则上采用“以买入成本和市值孰低计算”的方式进行，该原则的具体适用情况以法律法规、自律规则的要求为准，法律法规、自律规则未明确的可由托管人与管理人协商一致进行确认。

（2）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】%；且本基金持有主体信用评级在 AA 级及以下的信用债（可转换债券除外）、流动性受限资产，合计不得超过基金净资产 20%。信用债指除利率债（仅包括国债、地方政府债、政策性金融债及央行票据）外的其他债券品种，不含资产证券化产品，不含同业存单；

本条款涉及“流动性受限资产”的监控，私募基金托管人以目前使用的资讯及内部数据为准进行识别及监控，如与管理人认定资产存在不一致的，不一致部分由私募基金管理人及托管人进行协商，仍无法达成一致的，则私募基金托管人的监控以托管人识别数据为准。

（3）本基金投资于同一债券的资金，按买入成本和市值孰低计算，不得超

过基金资产净值的 10%，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除外；

(4) 本基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券资金总额，按买入成本和市值孰低计算，不得超过基金资产净值的 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除外；

为免疑义，本条款以及本基金合同之投资章节项下其他条款中约定的“同一发行人及其关联方”（如有）、“同一实际控制人”（如有）等事项，私募基金托管人仅以其能够获取的资本市场公开资讯数据为准进行识别并对相关投资限制进行监控。

(5) 本基金持有的与单一交易对手方开展质押式协议回购的金额不得超过基金净资产的 10%，且开展质押式协议回购时单一质押债券的金额不得超过基金净资产的 10%，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除外；

若本基金投资质押式协议回购的，私募基金托管人在对上述投资限制进行监督时以私募基金管理人提供的信息、数据（包括但不限于交易对手方信息、质押券信息等）为准（可能以季度或更低的频率对相关指标进行核算、监督），私募基金管理人应当主动及时向私募基金托管人提供相应信息、数据。若因私募基金管理人未提供信息、数据或相关信息、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范围、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。

(6) 本私募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的资金不超过该资产的 25%，法律法规、自律规则另有豁免情况的除外；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、公开募集基金等中国证监会、基金业协会认可的投资品种除外。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务；

(7) 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。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务；

(8) 本基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一债券的数量，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；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

会认可的投资品种不受本条债券投资比例限制。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务；

（9）本基金管理人同一实际控制人控制的私募基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于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债券投资比例限制。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务；

（10）私募证券投资基金开展债券质押式协议回购业务的，质押或者接受质押单一债券的集中度适用需满足法律法规、自律规则的相关要求。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务。”

附件 2.2 方案二涉及的私募基金合同条款具体修改内容

除将修订的私募基金合同“投资限制”小节“1、与《私募证券投资基金运作指引》相关投资限制”中的第（2）项变更为“（2）本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过【120】%；”以外，方案二涉及的其他私募证券投资基金合同条款具体修改内容均与附件 2.1 相同。

附件 2.3 方案三涉及的私募基金合同条款具体修改内容

（一）修订“释义”

1、新增表述：

“流动性受限资产：指到期日在 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、其他限售股票、战略配售公募 REITs 份额的流动受限部分、停牌或退市的股票和债券、收益互换、场外期权、收益凭证，私募基金管理人与私募基金托管人可根据法律法规和自律规则的要求协商一致进行调整。”

（二）修订“私募基金的投资”中“投资限制”小节

新增投资限制，序号相应顺延：

“1、与《私募证券投资基金运作指引》相关投资限制

特别说明：

若本条款与本合同之其他投资限制、自有风控措施（如有）存在冲突的，应当以本条款约定为准。

除非法律法规、自律规则有明确要求的或本条款有明示说明的，本条款的投资限制及其他投资风控指标均为仅对本基金本身及直接投资标的进行的约定，无需穿透（包括但不限于穿透至下层私募投资基金或资产管理产品（如有）及对应底层资产）计算或监督。

如法律法规、自律规则有明确要求的或本条款有明示要求私募基金托管人对投资限制条款进行穿透监督的，私募基金托管人对特定品种（包括但不限于场外衍生品、资产管理产品、质押式协议回购等）的穿透监督，依赖于本私募基金管理人、交易商、相关资产管理产品管理人或托管人、经纪商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监督或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）本基金投资于单只私募证券投资基金（即“标的基金”）的比例，按市值计算，不得低于本基金基金资产净值的 90%；

（2）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】%；且本基金持有主体信用评级在 AA 级及以下的信用债（可转换债券除外）、流动性受限资产，合计不得超过基金净资产 20%。信用债指除利率债（仅包括国债、地方政府债、政策性金融债及央行票据）外的其他债券品种，不含资产证券化产品，不含同业存单；

本条款涉及“流动性受限资产”的监控，私募基金托管人以目前使用的资讯及内部数据为准进行识别及监控，如与管理人认定资产存在不一致的，不一致部分由私募基金管理人及托管人进行协商，仍无法达成一致的，则私募基金托管人的监控以托管人识别数据为准。

（3）本基金投资于同一债券的资金，按买入成本和市值孰低计算，不得超过基金资产净值的 10%，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除外；

（4）本基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券资金总额，按买入成本和市值孰低计算，不得超过基金资产净值的 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除外；

为免疑义，本条款以及本基金合同之投资章节项下其他条款中约定的“同一发行人及其关联方”（如有）、“同一实际控制人”（如有）等事项，私募基金

托管人仅以其能够获取的资本市场公开资讯数据为准进行识别并对相关投资限制进行监控。

(5) 本基金持有的与单一交易对手方开展质押式协议回购的金额不得超过基金净资产的 10%，且开展质押式协议回购时单一质押债券的金额不得超过基金净资产的 10%，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除外；

若本基金投资质押式协议回购的，私募基金托管人在对上述投资限制进行监督时以私募基金管理人提供的信息、数据（包括但不限于交易对手方信息、质押券信息等）为准（可能以季度或更低的频率对相关指标进行核算、监督），私募基金管理人应当主动及时向私募基金托管人提供相应信息、数据。若因私募基金管理人未提供信息、数据或相关信息、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范围、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。

(6) 本基金投资的标的基金符合《私募证券投资基金运作指引》第十二条所列示的组合投资要求。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务；

(7) 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。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务；

(8) 本基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一债券的数量，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；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债券投资比例限制。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务；

(9) 本基金管理人同一实际控制人控制的私募基金管理人管理的所有私募证券投资基金投资于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债券投资比例限制。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务；

(10) 私募证券投资基金开展债券质押式协议回购业务的，质押或者接受质押单一债券的集中度适用需满足法律法规、自律规则的相关要求。本条款由私募基金管理人自行监控，私募基金托管人不负有监督义务。”

附件 2.4 方案四涉及的私募基金合同条款具体修改内容

除将修订的私募基金合同“投资限制”小节“1、与《私募证券投资基金运作指引》相关投资限制”中的第（2）项变更为“（2）本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过【120】%；”以外，方案四涉及的其他私募证券投资基金合同条款具体修改内容均与附件 2.3 相同。



