

关于【广东宏锡基金管理有限公司】变更旗下基金合同的 征询函

国信证券股份有限公司：

中国证券投资基金业协会（以下简称协会）发布《私募证券投资基金运作指引》（以下简称《运作指引》），并于2024年8月1日正式实施。已备案私募证券投资基金基金合同不符合《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，应在《运作指引》施行之日起24个月内按《运作指引》要求及协会规定修改基金合同。我公司作为基金管理人，贵司作为托管人的产品（详见附件列表），根据《运作指引》要求，现将基金合同（含各私募证券投资基金的合同变更文件，变更文件包括通过补充协议、征询函、公告等法律法规规定或合同约定的方式进行合同变更的文件，每一个私募基金的前述文件以下统称为“《基金合同》”）有关条款做出如下变更，具体如下：

一、根据《运作指引》修改以下内容：

（一）“释义”章节新增以下内容：

流动性受限资产：是指由于法律法规、监管、合同或操作障碍等原因无法以合理价格予以变现的资产，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、非本金保障型收益凭证、资产管理产品、私募基金等流动性较差的非标准化资产。

现金管理工具：是指银行活期存款、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。

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：（a）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；（b）收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产。

（二）“基金的投资”章节的“投资限制”、“投资监督事项表”条款新增以下内容：

本基金存续期内，基金总资产与净资产的比例不得超过 200%，本基金投向 AA 级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产合计不超过基金净资产 20%。

本基金投资资产管理产品及私募基金的，投资大类资产及同一资产的比例按照穿透原则合并计算。

按【成本与市值孰低法】计算，本基金投资于同一资产的资金，不得超过基金净资产的 25%，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、公开募集基金不受前述比例限制；

按【成本与市值孰低法】计算，本基金投资于单一债券的比例不得超过基金资产净值的 10%；投资于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%。本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本条集中度的规定。投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券不受前述比例限制。

（三）对于因管理人之外的因素影响导致投资比例不符合要求的调整时间，修改为以下表述：

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及自律组织规定或者基金合同约定的，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。

（四）“基金的投资”章节“风险控制”条款增加以下内容

以下相关约定为管理人为更好地控制风险所指定，由管理人负责实施并监控：

1. 按【成本与市值孰低法】计算，同一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，不得超过该资产的 25%，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、公开募集基金的，不受前述比例限制。符合《运作指引》第十二条第（一）项分散投资的要求的私募证券投资基金投资于单只私募基金的资金，不受前述比例限制。

2.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%。

3.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）；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%；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本条集中度的规定。本基金开展债券质押式协议回购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%。投资于国债、中央银行票据、政策性金融债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券不受前述比例限制。

以上风险控制措施不属于托管人应履行的投资监督义务的监督范围，托管人不承担监控、复核及风险提示义务。如管理人未按照基金合同的约定进行风险控制，由此对基金财产或基金份额持有人造成的损失，托管人不承担任何责任。

（五）“托管人的投资监督职责”新增以下内容：

本基金开展债券质押式协议回购业务的，管理人应当在本基金下一估值日前将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信息提供给托管人。托管人依据管理人提供的数据进行监控。管理人应确保所提供数据的真实性、准确性以及完整性。

涉及嵌套、穿透或合并计算指标监督

本合同涉及对拟投资标的有穿透约定的，以该投资标的的交易/法定文件的具体约定为准，管理人应确保本合同中穿透约定内容的真实性、准确性。管理人负责审查本合同穿透约定与该投资标的的交易/法定文件的具体约定是否一致，如不一致但仍向托管人发出投资划款指令的，管理人保证该不一致不损害基金份额持有人的利益。托管人仅根据投资划款指令进行划款，不负有审核上述事项的义务，不承担由此导致的损失。

管理人将所投资涉及穿透或合并计算指标监控的标的的数据按托管人和管理人协商共同认可的方式和频率提供给托管人，托管人依据管理人提供的数据进行监控。管理人应确保所提供数据的真实性、准确性以及完整性。

如本基金由托管资金账户直接投资于其他私募资管产品（含私募基金）时，基金托管人按照本基金投资限制条款核查投资层级的，仅能依赖本基金管理人提供的投资标的合同、标的估值表等辅助材料以及本基金服务机构提供的基金份额登记信息在投资时点进行判断，无法对投资标的整个运作过程是否符合本基金整体嵌套层级进行核查和管控。如管理人提供标的合同或估值表不准确、非最新合同或估值表等其他规避或误导基金托管人核查投资层级情形导致基金托管人核查本基金整体嵌套层级不准确的，由此造成的后果与基金托管人无关。

托管人对于特定品种（包括但不限于场外衍生品、标的金融产品、质押式协议回购等）的投资范围、投资限制进行穿透监督的，依赖于管理人、交易商、相关标的金融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，监督频率亦受限于托管人收到数据的频率。若因收到数据不真实、不准确、不完整、不及时导致托管人无法监督或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。

二、本函一式【两】份，管理人、托管人各执一份。

我司特向贵司征求意见，请贵司对以上变更内容予以确认。本征询函两方签署后，由我司确认本征询函涉及的产品实际投资运作是否已符合《运作指引》的相关规定，对于实际投资运作已符合《运作指引》相关规定的产品，由我司在贵司“鑫管家服务平台”提交具体产品的生效申请，于双方确认的生效日起生效。我司将以本合同约定的方式向投资者披露变更的具体内容并根据基金业协会的规定办理相关变更手续。

若由于管理人未及时将生效信息告知托管人而导致托管人无法确定变更生效时间，由此造成的任何形式的纠纷与托管人无关，在双方确认变更生效时间前，托管人按照原基金合同履行托管职责，在双方确定生效时间后按照生效后内容履行托管职责。

我司将根据具体合同约定要求确定是否安排开放日允许不同意该等变更事项的投资者赎回。上述开放日不受本合同中关于基金份额持有期限限制，且赎回的份额不收取赎回费（如有）。对于是否属于管理人应设置或有权设置开放日的任何情形，由管理人自行负责判断和具体执行，托管人及/或基金服务机构不负责监督或承担其他任何责任，基金服务机构仅依据基金管理人提交的开放申请进行相关配合。

因管理人违反本函约定所导致的任何纠纷和损失由我司承担，托管人不承担任何责任。

管理人：【广东宏锡基金管理有限公司】

2026年 月 日

附件一：变更产品清单

备案编码	产品名称
SXY247	宏锡量化 CTA7 号六期私募证券投资基金

回函

【广东宏锡基金管理有限公司】：

我司同意贵司所列产品的上述变更，请贵司按照变更后的条款约定进行操作，并按照合同要求履行向投资者披露义务。

托管人：国信证券股份有限公司

2026年 月 日