

关于【宏锡量化 CTA80 号私募证券投资基金】参照《私募证券投资基金运作指引》整改相关合同条款的公告

全体基金份额持有人：

【宏锡量化 CTA80 号私募证券投资基金】（下简称“本基金”）由我司【广东宏锡基金管理有限公司】担任基金管理人，浙商证券股份有限公司担任基金托管人，已在中国证券投资基金业协会备案并成立。

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。根据《关于发布〈私募证券投资基金运作指引〉的公告》，《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，自本指引施行之日起给予 24 个月过渡期。过渡期结束后仍不符合前述条款要求的，不得新增募集规模，不得新增投资者，不得展期，合同到期后进行清算。

基于以上规定，管理人拟进行整改并修改基金合同。根据本基金合同约定，经与本基金托管人协商一致，通过公告变更形式进行变更。变更内容详见附件。

为保障基金份额持有人的权利，如份额持有人不同意本次变更的，我司承诺于本公告发布后及 2026 年 7 月 31 日前设置的固定开放日/临时开放日（如有）供基金份额持有人赎回基金份额。如设置临时开放日的，将至少在临时开放日前二个交易日通知。

本公告发布后，如投资者新增申购本基金的，视为已知悉并同意本公告内容。如有新投资者申购本基金的，我司承诺确保其充分知悉并同意本公告的事项，并提供包含上述合同变更内容的基金合同或其他签署文件，确保投资者有效签署。

特此公告。

【广东宏锡基金管理有限公司】

2026 年 05 月 22 日



附件：

关于【宏锡量化 CTA80 号私募证券投资基金】参照《私募证券投资基金运作指引》整改相关合同条款的协商函

浙商证券股份有限公司托管业务部：

为落实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》”），更好地服务投资者，我司【广东宏锡基金管理有限公司】拟对合同条款作如下变更约定，特向贵部征询关于【宏锡量化 CTA80 号私募证券投资基金】（以下简称“本基金”）相关合同条款变更的意见。

一、合同条款变更内容

1、在本基金的基金合同“二、释义”章节增加：

“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期货按单合约占用保证金计算，场内期权买方按照单期权合约支付的权利金市值计算，场内期权卖方按照单期权合约占用的保证金计算视为同一资产；（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。

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战略配售、非公开发行、大宗交易、协议转让方式投资上市公司股票、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、证券公司收益凭证、场外衍生品（包括但不限于场外期权、收益互换等）、私募证券投资基金、除公募基金以外的资产管理产品等资产。

债券评级：参考境内评级机构公开发布的最新评级结果，银行间市场债券参照银行间市场交易商协会认可的境内评级机构，交易所债券参考在证监会备案的境内评级机构，优先参照债项评级，若无债项评级的参照主体评级。”

2、在本基金的基金合同“五、私募基金的募集”章节的“4、募集对象”条款增加：

“如本产品投资范围包含除公募基金以外的资管产品（或私募基金）的，本基金不得向产品投资者募集。如相关法律法规、部门规章、自律规则等对私募投资证券投资基金嵌套层级要求有新规定或对特定产品投资者参与私募基金投资豁免募集要求的，管理人与托管人协商一致后可以依据相应规定进行调整。”

3、在本基金的基金合同“十一、私募基金的投资”章节的“投资范围”条款增加：

“如本基金投资范围包含除公募基金以外的资管产品或私募基金的特别说明：

若本基金投资资管产品或私募基金的，基金管理人授权本基金的基金服务机构定期将本基金的份额登记信息提供给本基金的基金托管人，合同当事人签署本基金合同即视为同意以上授权。

若本基金投资的资管产品或私募基金的基金管理人或投资顾问（如有）为私募基金管理人的，基金管理人承诺不进行任何利益输送的行为；在持有上述投资标的期间，上述投资标的的交易文件有任何变更的，基金管理人应保证该变更的行为不得损害本基金投资者实际利益；在持有上述投资标的期间，基金管理人对上述投资标的不得进行抵押、质押、非交易过户或其他任何有损本基金投资者利益的行为。

基金管理人应当确保本基金投资嵌套层级符合法律法规、监管机构的相关规定，整体嵌套层数不超过一层；如本基金投资于资管产品或私募基金的，基金管理人应确保所投资的资管产品或私募基金未投资或在本基金存续期内不投资除公募基金以外的资产管理产品。后续法律法规关于投资层级要求有新规定的，管理人与托管人协商一致后可以依据相应规定进行调整。

托管人受限于数据授权,无法对整个运作过程是否符合嵌套层级要求进行核查,仅能根据投资标的合同、估值表以及本基金服务机构提供的基金份额登记信息等辅助材料,在投资时点及持有期间按照季度频率进行监控。

在进行资管产品、私募基金的投资后,基金管理人负责协调被投的资管产品或私募基金的托管人或基金服务机构直接向本基金托管人及时、准确、完整地提供季度估值信息等用于计算的文件(如四级估值表等),在估值表信息范围内,本私募基金托管人根据管理人提供的材料按季度进行穿透监督,因托管人无相关数据导致无法穿透监督的,托管人不承担责任。托管人接受材料的指定邮箱: zszqtgjd@stocke.com.cn。

如本基金投资范围包含场外衍生品的特别说明:

基金管理人承诺,本基金开展场外衍生品交易时,将在投资运作中按照法律、行政法规、中国证监会的规定及本合同的约定主动监控并落实关于场外衍生品投资的投资比例限制等要求。

本基金参与场外衍生品交易的,基金管理人承诺立即将场外衍生品交易文件(包括但不限于本基金参与场外衍生品交易时,与交易对手方签署的衍生品交易主协议、补充协议、交易确认书以及履约保障协议等文件)、交易数据(包括但不限于合约起止日期、合约类型、合约交易结构、交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约挂钩标的等信息)等情况提供给基金托管人,最迟不得晚于发生交易后的下一估值日。基金管理人签订场外衍生品交易文件时,承诺明确授权由交易对手方、相关交易的清算机构直接向基金托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息,并负责协调交易对手方、相关交易的清算机构及时向基金托管人提供真实、准确、完整的场外衍生品交易文件和交易数据,为保证相关交易满足投资限制提供充分的依据。交易对手方、相关交易的清算机构未按时提供或提供不完整、不准确的,由基金管理人负责补充提供。

基金托管人不对场外衍生品交易文件和交易数据的真实性、准确性、完整性负责。若出现交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人未按时提供交易文件和交易数据,或者提供有误、缺失、与约定或行业习惯的统计口径不一致,导致基金托管人未能有效监督的,基金托管人不承担任何责任,相关一切责任均由基金管理人承担。

如本基金投资范围包含债券质押式协议回购的特别说明：

基金管理人承诺，本基金开展债券质押式协议回购时，将在投资运作中按照法律、行政法规、中国证监会的规定及本合同的约定主动监控并落实关于债券质押式协议回购投资的投资比例限制等要求。

基金管理人承诺，在本基金下一估值日前真实、完整、准确地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基金托管人。基金托管人不对相关文件及信息的真实性、准确性、完整性负责。若出现基金管理人未按时发送交易文件和提供信息，或者提供有误、缺失、与约定或行业习惯的统计口径不一致，导致基金托管人未能有效监督的，基金托管人不承担任何责任，相关一切责任均由基金管理人承担。”

4、在本基金的基金合同“十一、私募基金的投资”章节的“投资比例和投资限制”条款增加：

“本基金的可投资品种严格以本合同“基金投资范围”条款的明确约定为准。下方提及的任何投资品类及比例要求，均旨在确保投资运作符合相关法律法规及监管要求，在任何情况下均不构成对前述“基金投资范围”的补充或扩展。下述条款自 2026 年 8 月 1 日起生效：

本基金投向 AA 级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产市值合计不得超过基金净资产 20%，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%。

本基金投资于同一资产的资金（按成本与市值孰低计），不得超过该基金净资产的 25%；其中同一资产不含活期存款、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、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种。如本基金投资除公募基金以外的资管产品或私募基金的，按照季度穿透口径在估值表信息范围内对标准化股权类资产、标准化债权类资产进行计算。

本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（按成本与市值孰低计），不得超过该资产的 25%（符合“单只私募证券投资基金投资于同一资产的资金不超过该基金净资产的 25%”分散投资要求的私募证券投资基金投资单只私募基金的资金，可以不受本条款限制）；其中同一资产不含活期存款、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、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种。合同当事人一致同意特此确认，本

条款由管理人自行监控。如本基金投资除公募基金以外的资管产品或私募基金的，按照季度穿透口径在估值表信息范围内对标准化股权类资产、标准化债权类资产进行计算。

本基金管理人的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、协会另有规定的除外。合同当事人一致同意特此确认，本条款由管理人自行监控。如本基金投资除公募基金以外的资管产品或私募基金的，管理人应至少每季度按照穿透合并原则计算上述比例。

本基金投资于同一债券的资金（按成本与市值孰低计），不得超过该基金净资产的 10%；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（按成本与市值孰低计），不得超过基金净资产的 25%。其中，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、协会认可的投资品种不受本条限制，关联方信息以公开数据为准。如本基金投资除公募基金以外的资管产品或私募基金的，按照季度穿透口径在估值表信息范围内进行计算。

本基金开展债券质押式协议回购业务的，质押或接受质押的同一债券的资金（按面值计算），不得超过基金净资产的 10%；质押或接受质押的同一发行人及其关联方发行的债券资金总额（按面值计算），不得超过本基金资产净值的 25%；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%；上述债券均不含国债、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、协会认可的投资品种，关联方信息以公开数据为准。

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；本基金管理人的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%。其中，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、协会认可的投资品种不受本条限制。合同当事人一致同意特此确认，本条款由管

理人自行监控。如本基金投资除公募基金以外的资管产品或私募基金的，管理人应至少每季度按照穿透合并原则计算上述比例。

本基金管理人管理的所有私募证券投资基金开展债券质押式协议回购业务时，质押或接受质押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；本基金管理人的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开展债券质押式协议回购业务时，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%。其中，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、协会认可的投资品种不受本条限制，关联方信息以公开数据为准。合同当事人一致同意特此确认，本条款由管理人自行监控。”

5、在本基金的基金合同“十一、私募基金的投资”章节的“投资比例和投资限制”条款中，涉及调整期的表述修改为：

“由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标，除法律法规或本合同另有约定外，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 20 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当在相关资产可出售、可转让或者恢复交易之日起的 20 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。在本基金到期日前 10 个交易日内，因基金财产变现需要，可以不符合上述基金投资比例规定。”

6、在本基金的基金合同“十五、越权交易”章节的“（三）基金托管人对基金管理人越权交易的监督”条款中，涉及调整期的表述修改为：

“下列情形不构成越权交易：1、由于基金管理人之外的原因导致的投资比例出现不符合本合同约定的投资政策的情形为被动超标，不属于越权交易，包括但不限于：证券市场波动、上市公司合并、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等。前款情形视投资政策的具

体约定而确定。发生被动超标时，基金管理人应在相关证券可交易之日起 20 个交易日内进行调整，以达到投资政策的要求，因证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因除外。”

7、在本基金的基金合同“十五、越权交易”章节的“（四）越权交易的例外”条款中，以下表述删除：

“基金托管人在本合同约定范围内，对本基金的直接投资履行监督职能，本基金投资于其他资产管理产品、私募基金的，因基金托管人无相关数据信息，基金托管人不对本基金资产的最终投向、资产比例及其他投资风控指标是否符合《投资监督事项表》的约定进行穿透核查。”

8、在本基金的基金合同“附件一：投资监督事项表”的“投资比例及投资限制”事后监督条款增加：

“本基金的可投资品种严格以本合同“基金投资范围”条款的明确约定为准。下方提及的任何投资品类及比例要求，均旨在确保投资运作符合相关法律法规及监管要求，在任何情况下均不构成对前述“基金投资范围”的补充或扩展。下述条款自 2026 年 8 月 1 日起生效：

本基金投向 AA 级及以下信用债（可转债除外）、流动性受限资产市值合计不得超过基金净资产 20%，本基金总资产不得超过基金净资产的 200%。

本基金投资于同一资产的资金（按成本与市值孰低计），不得超过该基金净资产的 25%；其中同一资产不含活期存款、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、公开募集基金等中国证监会、协会认可的投资品种。如本基金投资除公募基金以外的资管产品或私募基金的，按照季度穿透口径在估值表信息范围内对标准化股权类资产、标准化债权类资产进行计算。

本基金投资于同一债券的资金（按成本与市值孰低计），不得超过该基金净资产的 10%；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（按成本与市值孰低计），不得超过基金净资产的 25%。其中，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、协会认可的投资品种不受本条限制，关联方信息以公开数据为准。如本基金投资除公募基金以外的资管产品或私募基金的，按照季度穿透口径在估值表信息范围内进行计算。

本基金开展债券质押式协议回购业务的，质押或接受质押的同一债券的资金（按面值计算），不得超过基金净资产的 10%；质押或接受质押的同一发行人及其关联方发行的债券资金总额（按面值计算），不得超过本基金资产净值的 25%；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%；上述债券均不含国债、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、协会认可的投资品种，关联方信息以公开数据为准。”

9、在本基金的基金合同“附件一：投资监督事项表”的备注中，涉及调整期的表述修改为：

“由于包括但不限于证券、期货市场波动、上市公司合并、组合规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资比例不符合本合同约定的投资限制或投资禁止政策，为被动超标，除法律法规或本合同另有约定外，基金管理人应在发生不符合法律法规或投资政策之日起的 20 个交易日内调整完毕。如发生证券停牌或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则调整期限相应顺延。基金管理人应当在相关资产可出售、可转让或者恢复交易之日起的 20 个交易日内调整完毕，法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。在本基金到期日前 10 个交易日内，因基金财产变现需要，可以不符合上述基金投资比例规定。”

二、合同条款变更生效事宜

本次变更系因相关法律法规、监管规则发生变化所致，取得贵司无异议回函后，本次变更生效。我司承诺按照法律法规规定及基金合同约定及时向基金份额持有人披露本次变更的具体内容，并按合同约定采取设置开放日/临时开放日允许基金份额持有人赎回基金份额或者其他保障投资者赎回本基金权利的措施，上述开放日不受本合同中关于基金份额不允许赎回期限的限制，赎回费的收取应符合基金合同约定。

如本基金存在份额锁定期、赎回封闭期等限制或基金合同未有约定保障投资者赎回本基金权利的相关措施，且有基金份额持有人不同意变更内容的，我司将

印

及时通知基金托管人作废本协商函，并采取符合合同约定的其他方式进行变更。如本基金无法按照《运作指引》如期整改，本基金将不得新增募集规模，不得新增投资者，不得展期，合同到期后进行清算。我司承诺已将未整改的不利影响充分向投资者进行披露。如因未保障投资者赎回本基金权利或无法如期完成整改导致的任何纠纷，由我司承担。本次变更生效后，我司将及时向中国证券投资基金业协会报告并履行相应手续。

本次变更生效后，如有新投资者申购本基金的，我司承诺确保其充分知悉并同意本次合同条款变更事项，并提供包含本次变更内容的基金合同或其他签署文件，确保投资者有效签署。本基金的募集由管理人及其签约的基金销售机构负责，基金托管人不承担任何责任。

【广东宏锡基金管理有限公司】

【2026-5-20】

