

关于东方港湾马拉松二号私募投资基金

标的基金基金合同变更生效的告知函

尊敬的投资者：

东方港湾马拉松二号私募投资基金（以下简称“本基金”）由深圳东方港湾投资管理股份有限公司（以下简称“我司”）担任基金管理人，国泰海通证券股份有限公司担任基金托管人（以下简称“托管人”）。根据《东方港湾马拉松二号私募投资基金基金合同》约定，本基金资产主要投资于“东方港湾马拉松一号私募投资基金”（以下简称“标的基金”）。

我司作为标的基金的管理人，已与标的基金的托管人按照《私募证券投资基金运作指引》要求，通过公告的形式对标的基金的基金合同进行了变更，**标的基金基金合同变更自【2026年5月11日】起正式生效**。东方港湾马拉松二号私募投资基金的基金份额持有人如不接受标的基金本次的基金合同变更内容，可在东方港湾马拉松二号私募投资基金【2026年5月14日】的临时开放日赎回。

本次标的基金基金合同具体条款修改内容如下：

（一）修订第二章“释义”

1、新增表述：

“37、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。

38、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）修订第九章“基金的投资”第（四）条“投资限制”

1、新增表述：

“8、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【120】%；

（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

2023年11月10日

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。”**

(三) 为更好地为本基金份额持有人提供管理服务，对合同部分信息更正如下

序号	位置	原条款	现条款
1	附件一“投资监督事项表”第(一)条“投资范围”	国内依法发行上市的股票、上市公司非公开发行股票、交易所债券、新股申购、债券回购、商业银行理财产品、银行存款（含定期存款等）、融资融券、股指期货、商品期货、权证、权益类收益互换、港股通标的范围内的证券。 公募基金、信托计划、证券公司资产管理计划、保险资产管理计划、期货资产管理计划、基金公司特定客户资产管理计划、取得基金业协会颁发的管理人登记证书的私募管理人发行的私募证券投资基金、私募股权投资基金、私募创业投资基金等，以及	详见本合同第九章“基金的投资”第(二)条之“投资范围”



		法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券或金融衍生品。	
	附件一“投资监督事项表”第(二)条“投资限制”	本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配置,在降低市场风险的同时追求更高收益。	详见本合同第九章“基金的投资”第(四)条之“投资限制”

特此公告。

管理人：深圳东方港湾投资管理股份有限公司

【2026】年【05】月【12】日

