

关于均成 CTA 增强 5 号私募证券投资基金基金合同按 运作指引变更的征询公告

尊敬的份额持有人：

您好，我司作为基金管理人发行的“均成 CTA 增强 5 号私募证券投资基金”（以下简称“本基金”），根据《私募证券投资基金运作指引》，如过渡期结束后仍不符合第十二条、第十三条、第十五条、第十六条、第十九条的相关要求的，自 2026 年 8 月 1 日开始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。

为了避免本基金转入被动存续，我司基于保护投资人利益原则，结合相关监管文件要求以及基金合同约定，拟对本基金合同按以下内容进行变更。

序号 1

“基金的募集”增加：

特别地，如本基金投资于私募资管产品（含私募基金）的，则本基金不再接受私募资管产品（含私募基金）作为投资者购买本基金；如本基金接受私募资管产品（含私募基金）作为投资者购买本基金，本基金整体嵌套层级不得超过一层，法律法规、中国证监会另有规定的，经基金管理人和基金托管人协商一致后可根据相关规定依法调整。

序号 2

“基金的投资”中增加：

基金管理人层面的投资集中度控制与穿透监控

1、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的资金，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）；

2、本基金管理人及其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）；本基金管理人及其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、中国基金业协会认可的投资品种可以不受本条款限制；

4、对于本基金的投资比例和投资限制明确需穿透监控计算的，如所投标的均为本基金管理人管理的其他私募基金，基金管理人应当在每个交易日核查本基金投资行为是否符合穿透监控投资限制；如所投标的涉及非本基金管理人管理的其他私募资管产品（含私募基金），基金管理人应当按照所投标的披露频率核查本基金投资行为是否符合穿透监控投资限制。

本基金管理人应对以上情形自行进行控制并满足上述管理人层面的投资集中度控制与穿透监控要求，法律法规、中国证监会、中国基金业协会另有规定的，从其规定。如因基金管理人未按照法律法规、中国证监会、中国基金业协会的规定及本合同的约定进行基金管理人层面的投资集中度控制与穿透监控，对基金财产或基金份额持有人造成的损失，由基金管理人承担责任。

序号 3

“基金的投资”中“投资禁止行为”增加：

本基金接受其他私募资管产品（含私募基金）投资，或者投资于私募资管产品（含私募基金）的，本基金整体嵌套层级超过一层，法律法规、中国证监会另有规定

的，经基金管理人和基金托管人协商一致后可根据相关规定依法调整。

序号 4

“越权交易”中增加：

特别地，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，如所投标的非本基金托管人托管，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，由此造成的后果由基金管理人承担。

特别地，如本基金的投资比例和投资限制明确需穿透监控计算的，本基金投资于其他私募资产管理产品（含私募基金）时，投资标的的投资组合数据由本基金管理人负责协调维护，基金托管人穿透监控计算的准确性等依赖本基金管理人协调维护的投资标的资产组合的数据情况，基金管理人应确保数据的及时性、真实性、准确性以及完整性。因本基金管理人沟通维护投资标的投资组合数据的时效、频率、完整性、脱敏处理、披露程度等原因影响托管人穿透监控计算的，由此造成的后果由基金管理人承担。

序号 5

“投资限制”增加：

①、④按照穿透监控计算，穿透监控仅针对标准化股权类资产、标准化债权类资产，按成本与市值孰低计算，如法律、行政法规、自律规则或中国证监会对私募证券投资基金穿透监控另有规定的，从其规定：

①本基金投资于同一资产的资金（期货按单个期货合约占用保证金计算；场内期权买方按照单个期权合约支付的权利金市值计算；场内期权卖方按照单个期权合约占用的保证金计算；场外期权按缴纳的保证金及权利金计算；收益互换按保证金计算；其他资产按成本与市值孰低计算），不得超过本基金净资产的 25%；

②本基金的总资产不得超过净资产的 120%；

③本基金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%；

④按成本与市值孰低计算，投资于同一债券的金额，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、可交换债券除外）；按成本与市值孰低计算，投资于同一发行人及其关联方发行的债券的金额，不得超过基金净资产的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、可交换债券除外；关联方信息以公开数据为准）；

⑤开展债券质押式协议回购，质押或者接受质押单一债券，按【面值】计算，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、可交换债券除外）；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%；开展债券质押式协议回购，质押或者接受质押同一发行人及其关联方（关联方信息以公开数据为准）发行的债券（按【面值】计算），不得超过基金净资产的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、可交换债券除外）；

⑥本基金由托管账户直接投资于其他私募资管产品（含私募基金）时（如有）：本基金投资者不得存在其他私募资管产品（含私募基金），所投资其他私募资管产品（含私募基金）不得再投资除公募基金以外的其他资产管理产品（含私募基金），法律法规、中国证监会另有规定的，经基金管理人和基金托管人协商一致后可根据相关规定依法调整。

上述投资限制中“同一资产”“流动性受限资产”的定义如下：

同一资产：指本基金应当按照《私募证券投资基金运作指引》要求采用资产组合的方式进行投资的资产，不包括银行活期存款、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、中国基金业协会认可的投资品种。

流动性受限资产：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、收益凭证、场外衍生品（指收益互换、场外期权）、

私募资管产品（含私募基金）等中国证监会或中国基金业协会认可的流动性受限资产。

（如越权交易章节涉及相关引述，则引述内容同步更新）

关于被动超限的相关内容替换为：

基金管理人自本合同生效之日起使本基金的投资组合比例符合本合同的有关约定，受证券期货市场波动、证券发行人合并、本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，基金管理人应当在 20 个交易日内调整至符合要求。如因资产流动性受限或其他非基金管理人可以控制的原因导致无法完成前述调整的，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后的 20 个交易日内调整至符合要求。法律、行政法规、金融监管部门另有规定的，从其规定。

我司将于 2026 年 5 月 27 日至 2026 年 5 月 29 日向基金份额持有人进行本次合同变更的征询意见。基金份额持有人应于 2026 年 5 月 29 日之前书面回复意见。若基金份额持有人不同意合同变更条款，管理人将设置 2026 年 5 月 29 日为临时开放日，赎回其所有基金份额（在满足监管要求以及合同约定的前提下）。若基金份额持有人未在指定日期内回复意见或未在指定的日期内赎回本基金的，视为基金份额持有人同意合同变更。

特此公告！

广东横琴均成私募基金管理有限公司（公章）

复 函

广东横琴均成私募基金管理有限公司：

贵司发来的《关于均成 CTA 增强 5 号私募证券投资基金基金合同按运作指引变更的征询公告》收悉。经研究，与基金管理人确认以下结果：

本人_____（同意）合同变更条款。

本人_____（不同意）合同变更条款，提出赎回基金份额申请。

基金投资者：

自然人（签字）：

或

法人或其他组织（盖章）：

法定代表人或授权代表（签字）：

签署日期： 年 月 日

签署日期： 年 月 日