

《宽德优优中证1000指数增强36号私募证券投资基金基金合同》

合同变更公告

尊敬的基金份额持有人：

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调整。根据《宽德优优中证1000指数增强36号私募证券投资基金基金合同》的相关约定，我司通过公告形式对该基金合同条款进行变更，特此公告变更事宜。本次基金合同调整系根据法律法规及自律规则要求进行，对基金投资运作不构成实质性不利影响。

简要总结本次方案主要整改内容如下：

《运作指引》条款	条款主要内容	方案
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	√

一、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的股票、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。”**

二、合同条款变更生效事宜

上述变更内容自【2026】年【6】月【29】日起生效。我司通过变更告知函形式变更基金合同，并按照产品合同的约定向基金份额持有人披露合同变更的具体内容。本次变更增设临时开放日，不同意本次变更的份额持有人，在满足法律法规、监管要求以及合同约定的前提下，可于【2026】年【6】月【22】日临

时开放日申请赎回所有基金份额（赎回预约期和赎回规则以代销机构为准），本次临时开放日赎回不受持有份额锁定期的限制，不收取赎回费。若逾期未提交申请或未申请赎回全部所持份额的，均视为同意本次合同变更。

特此公告。

管理人：上海宽德私募基金管理中心（有限合伙）

（盖章）

【2026】年【06】月【15】日