

# 万葵稳健5号私募证券投资基金产品合同变更告知函

尊敬的基金份额持有人：

东莞市万葵资产管理有限公司（以下简称“我司”）作为万葵稳健5号私募证券投资基金（产品编号：S3ZFP1）（以下简称“本产品”）的管理人，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，通过公告形式对本产品基金合同进行变更，特将相关事宜通知如下。

我司承诺，将确保相关私募证券投资基金的投资结构、投资层级符合相关法律法规、部门规章及自律规则的规定。

## 一、具体条款修改内容

### 1、在《基金合同》“释义”章节条款内容中增加如下约定：

#### 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。

**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等资产，以及场外衍生品、私募基金、资管产品等流动性较差的非标准化资产。

**关联方：**《私募证券投资基金运作指引》“同一发行人及其关联方”或者“同

一融资主体及其关联方”，关联方按照《企业会计准则》的规定确定。

**场外衍生品交易文件：**是指私募证券投资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。

**2、在《基金合同》“基金的投资”章节的“投资限制”条款内容中增加如下约定：**

根据《私募证券投资基金运作指引》新增：

1、本基金总资产与净资产的比例不得超过 120%；

2、本基金投资于同一资产的资金（按成本与市值孰低法计算）不得超过本基金净资产的 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、协会认可的投资品种除外；

3、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（按成本与市值孰低法计算），不得超过该资产的 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、协会认可的投资品种除外；

4、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、协会另有规定的除外；

5、本基金投资于同一债券的资金（按成本与市值孰低法计算），不得超过本基金净资产的 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、协会认可的投资品种可以不受本条规定的投资比例限制。

6、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、协会认可的投资品种可以不受本条规定的投资比例限制。

7、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（按成本与市值孰低法计算），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、可交换债券等中国证监会、协会认可的投资品种可以不受本条规定的投资比例限制。

8、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、协会认可的投资品种可以不受本条规定的投资比例限制。

9、本基金参与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（不轧差）不得超过净资产的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、协会认可的投资品种可以不受本条规定的投资比例限制。

以上第【3、4、6、8】条投资限制由管理人自行监控，托管人不承担投资监督职责。

本基金开展债券质押式协议回购业务，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。托管人不对因上述数据缺失、不准确、不及时等原因造成的监督失效结果承担任何责任。

如本基金投资于其他私募资产管理产品，管理人应当协调下层产品管理人、托管人或基金服务机构，在基金份额确认后的2个工作日内提供给本基金托管人，并在本基金持有下层产品份额期间持续提供其估值信息及其他托管人认为需要的信息。托管人不对因上述数据缺失、不准确、不及时等原因造成的后果承担任何责任，同时托管人如认为上述不利情况可能对本基金正常运作产生影响的，有权采取暂停估值、暂停申赎等方式进行相应风险管控。

如本基金投资于其他私募资产管理产品，管理人应当协调下层产品管理人、托管人或基金服务机构，于每季度初十个工作日内将经复核的下层产品的估值表发送至本基金托管人指定邮箱 gztgtzjd@ebscn.com，对于投资比例、投资限制中涉及穿透计算的事项，托管人根据收到的下层产品的估值表作为履行投资监督的依据进行每季度一次的事后监督。若因管理人未按前述要求及时履行相关义务、或下层产品估值表提供方提供估值数据不及时、不完整、不准确导致投资比例、投资限制中相关指标穿透计算结果错误所产生的损失，本基金托管人不承担责任。

3、在《基金合同》“基金的投资”章节的条款内容中增加如下约定：

“基金管理人应当确保本基金的嵌套层级符合如下规定：本基金接受其他私募基金、资产管理产品投资，或者投资于其他私募基金、资产管理产品的，基金管理人应当控制基金整体嵌套层级不得超过一层，法律法规或金融监管部门对私

募基金的投资层级及其豁免情形另有规定的，基金管理人与基金托管人协商一致后可按规定进行相应调整。若基金管理人违反前述约定的，相关责任由基金管理人承担。”

4、在《基金合同》“基金的投资”章节的条款内容中增加如下约定：

“如上述“基金的投资”章节的条款对同一事宜约定不一致的，除基金合同另有明确约定外，本基金按照孰严标准（例如，以可允许的最大投资比例限制更低、可允许的最小投资比例限制更高、禁止投资某一具体品种等为准）执行；如上述相关条款不冲突或无明显孰严标准的，则本基金应同时满足各相关条款的要求。若新增的投资限制包含投资范围未涉及的投资品种，则实际投资范围仍按照投资范围约定执行。”

## 二、条款变更生效时间

上述变更内容自【2026】年【6】月【9】日起生效。

## 三、变更条款的撤销与调整

由于相关整改对基金运作具有实质影响，出于谨慎运作考虑，我司有权在本函件生效之日起的十个交易日（含第十个交易日）的期间内，撤销或调整本合同变更告知函第一条中任何条款的任何修订。

如我司对变更条款进行撤销或调整后，我司将按照相关法律法规和基金合同的约定（如有）向基金份额持有人进行信息披露。根据相关基金的实际情况，如该等撤销或调整可能对基金份额持有人产生影响的，我司可相应设置临时赎回期，并在届时公告中明确临时赎回期的具体安排。基金份额持有人有权在届时公告的临时赎回期内，按照相关公告及基金合同的约定申请赎回或退出。

特此公告。

管理人：东莞市万葵资产管理有限公司

（盖章）

【2026】年【6】月【9】日