

关于盘京嘉选 1 期私募证券投资基金基金合同变更通知函

尊敬的基金份额持有人、嘉实财富管理有限公司(代销机构):

“盘京嘉选 1 期私募证券投资基金”(基金代码: SY3318, 以下简称“本基金”), 为我司管理、嘉实财富管理有限公司代销产品, 现根据本基金的《基金合同》(含私募基金的合同变更文件, 变更文件包括通过补充协议、通知函、公告等法律法规规定或合同约定的方式进行合同变更的文件, 本基金的前述文件以下统称为“《基金合同》”)的约定以及法律法规的变化(中基协已发布《私募证券投资基金运作指引》(以下简称“《运作指引》”)), 经与本基金的托管人工商银行股份有限公司协商一致(详见附件《协商函》), 对本基金的基金合同相关条款进行变更。

依据《基金合同》中二十三、基金合同的变更、终止与基金财产清算章节的相关条款约定:

“2、有下列情形之一的, 由基金管理人与基金托管人协商一致后对本合同相关内容进行变更:

(1) 资金划拨指令有关事宜、清算交收业务规则、估值方法及核对的时间和程序、调低从本基金资产列支由托管人、行政服务机构(如有)收取的费用的标准等相关内容的变更;

(2) 因有权机构对法律法规的修订、变更、解释、新增、废止等导致本合同与之存在冲突或不一致的, 应当以届时有效的法律法规为准对本合同进行相应变更和调整。”

在符合上述合同变更条款的前提下，按照《运作指引》中第十七条的规定，《基金合同》条款具体修改如下：

一、“投资限制”增加：

1、向全部交易对手方缴纳的场外期权交易保证金和权利金合计不得超过基金净资产的 25%；

2、参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收益互换合约名义本金的 50%；

3、参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；

二、“投资禁止行为”增加：

如涉及投资场外衍生品的，新增场外期权合约以及存续合约展期的，除仅开展商品类场外期权交易外，基金净资产低于 5000 万元；新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产低于 1000 万元；

三、“越权交易”章节增加：

如投资比例和投资限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等监控的，基金托管人的越权交易监督依赖于基金管理人或交易对手方提供的交易信息和行情信息，包括但不限于交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约交易结构、合约挂钩标的等信息；由于场外衍生品和收益凭证等场外衍生品属于非标准化资产，前述交易信息和行情信息可能由于交易对手方的标准不统一，其信息口径或含义可能存在较大差异，进而影响监控结果；基金管理人应按照监管及基金业协会的要求确保相关资产交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性，基金托管人不具体审核交易信息和行情信息，不对交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前

述交易数据可能不真实、不准确、不完整、不及时，或者因前述数据口径不明确等原因导致基金托管人无法监控、未能监控或监控不准确的，基金托管人不承担任何责任。

上述变更内容自【2024】年【8】月【1】日起开始生效。本次变更允许赎回的开放日为【2024】年【7】月【15】日，不同意变更的基金委托人可以在该开放日申请全部赎回（本次赎回不受封闭期（如有）、锁定期（如有）、赎回费（如有）的限制）。未在变更生效日前全部赎回份额的基金委托人视为同意前述变更。

特此通知。

上海盘京投资管理中心（有限合伙）

2024年7月8日

附件：《关于上海盘京投资管理中心（有限合伙）基金合同变更（2024 衍）的协商函》及《复函》（托管用章）

关于上海盘京投资管理中心（有限合伙） 基金合同变更（2024 衍）的协商函

工商银行股份有限公司：

上海盘京投资管理中心（有限合伙）（以下简称“我司”）在贵司托管的盘京嘉选 1 期私募证券投资基金（以下简称“该基金”）自成立以来，一直坚持规范运作，稳健运营。为更好地为该基金投资者提供投资服务，我司拟根据该基金《基金合同》的约定以及法律法规的变化（中基协已发布《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”））对该基金相关条款进行变更（其中该基金具体产品清单以及每个产品对应选择的变更方案以我司在招商证券网上服务平台最终确认的结果为准）。

现依据《基金合同》中二十三、基金合同的变更、终止与基金财产清算章节的相关条款约定：

“2、有下列情形之一的，由基金管理人与基金托管人协商一致后对本合同相关内容进行变更：

（1）资金划拨指令有关事宜、清算交收业务规则、估值方法及核对的时间和程序、调低从本基金资产列支由托管人、行政服务机构（如有）收取的费用的标准等相关内容的变更；

（2）因有权机构对法律法规的修订、变更、解释、新增、废止等导致本合同与之存在冲突或不一致的，应当以届时有效的法律法规为准对本合同进行相应变更和调整。”

在符合上述合同变更条款的前提下，按照《运作指引》中第十七条的规定，我司特向贵司征询关于该基金《基金合同》相关条款变更的意见。

一、该基金《基金合同》具体调整方案：

序号 1

“投资限制”增加：

1、向全部交易对手方缴纳的场外期权交易保证金和权利金合计不得超过基金净资产的 25%；

2、参与挂钩股票、股票指数收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于该收

益互换合约名义本金的 50%；

3、参与带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；

序号 2

“投资禁止行为”增加：

如涉及投资场外衍生品的，新增场外期权合约以及存续合约展期的，除仅开展商品类场外期权交易外，基金净资产低于 5000 万元；新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产低于 1000 万元；

序号 3

“越权交易”章节增加：

特别地，如投资比例和投资限制涉及场外期权和收益互换等场外衍生品、收益凭证等监控的，基金托管人的越权交易监督依赖于基金管理人或交易对手方提供的交易信息和行情信息，包括但不限于交易对手、合约权利金或保证金、合约名义本金、合约交易结构、合约挂钩标的等信息；由于场外衍生品和收益凭证等场外衍生品属于非标准化资产，前述交易信息和行情信息可能由于交易对手方的标准不统一，其信息口径或含义可能存在较大差异，进而影响监控结果；基金管理人应按照监管及基金业协会的要求确保相关资产交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性，基金托管人不具体审核交易信息和行情信息，不对交易数据的真实性、准确性、完整性和及时性负责；由于前述交易数据可能不真实、不准确、不完整、不及时，或者因前述数据口径不明确等原因导致基金托管人无法监控、未能监控或监控不准确的，基金托管人不承担任何责任。

上述变更自【 2024 】年【 8 】月【 1 】日起开始生效。

二、变更流程

我司通过本函向贵司征询意见，在与贵司书面达成一致意见并收到贵司的《复函》后，我司将根据法律法规、中国证监会、基金业协会以及基金合同约定的要求及时履行报告义务以及向投资者披露。

若由于基金管理人未及时书面告知基金托管人而导致托管人无法确定变更生效时间，由此造成的任何形式的纠纷与托管人无关，由管理人承担由此造成

的法律后果。在无充分文件证明变更生效时间前，托管人将严格按照原协议履行其托管职责。

我司承诺严格遵照基金合同约定的变更方式、程序完成变更，合同变更内容符合法律法规及自律规则相关规定。本次合同变更生效后，管理人须确保在合同变更生效后新参与的投资者所签署的合同或其附件包含本次变更的内容。因管理人违反上述约定所导致的问题，或因新投资者签署合同内容与实际不符而导致的损失，由管理人承担相应的责任，托管人不承担任何责任。

本函正本一式两份，贵司留存一份，我司执一份。

上海盘京投资管理中心（有限合伙）
2024 年 06 月 18 日



复 函

上海盘京投资管理中心（有限合伙）：

贵司发来的《关于上海盘京投资管理中心（有限合伙）基金合同变更（2024 衍）的协商函》收悉，经研究，同意贵司在来函中所述的合同条款变更内容。

本复函一式两份，双方各执一份。

中国工商银行股份有限公司四川省分行（盖章）

签署日：2024 年 06 月 18 日