

关于盘京金选盛信 3 号 1 期私募证券投资基金基金合同变更的通知函

尊敬的私募基金份额持有人：

中国中金财富证券有限公司（代销机构）：

盘京金选盛信 3 号 1 期私募证券投资基金（基金代码：SJR301）为本机构管理、中国中金财富证券有限公司代销的产品，主要投资于盘京金选盛信 3 号私募证券投资基金（基金代码：SJN411，以下简称“标的基金”）。现标的基金根据《私募证券投资基金运作指引》的相关规定、基金合同及其任何有效修订（以下统称“《标的基金合同》”，并经本机构与基金托管人中国国际金融股份有限公司协商一致，对《标的基金合同》的相关条款进行变更。

现依据《标的基金合同》中“基金合同的效力、变更、解除与终止”章节的“合同的变更”相关条款约定：

“2、因法律、法规、中国证监会、基金业协会的相关规定出台或发生变化而需要对本合同进行变更的，基金管理人可与基金托管人协商后修改基金合同，并由基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。”

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

1、《标的基金合同》“基金的投资”章节中“投资限制”增加如下条款：

“如本基金投资场外衍生品的，自 2024 年 8 月 1 日起，对场外衍生品执行以下投资比例限制：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%；参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的 50%；参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%。”

2、《标的基金合同》“基金的投资”章节中“投资禁止行为”增加如下条款：

“如本基金投资场外衍生品的，自 2024 年 8 月 1 日起，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；”

3、《标的基金合同》“越权交易”章节“越权交易的例外”第 1 款变更为：

“（四）越权交易的例外

下列情形不构成越权交易：

1、自2024年8月1日起按以下约定执行：由于基金管理人之外的原因导致的投资限制出现不符合本合同约定的情形为被动超标，不属于越权交易，包括但不限于：证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等。发生被动超标时，基金管理人应在【20】个交易日内调整完毕，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，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。”。

4、除《标的基金合同》“越权交易”章节“越权交易的例外”第1款外，若《标的基金合同》其他章节对被动超标情形以及发生被动超标时管理人调整要求有约定的，则同步修改。

5、《标的基金合同》附件部分“投资监督事项表”中“投资限制”增加如下条款：

“如本基金投资场外衍生品的，自2024年8月1日起，对场外衍生品执行以下投资比例限制：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%；参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的50%；参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的25%。”

6、若上述内容与《标的基金合同》原约定的相关内容有冲突的，则以本函的约定为准。

上述变更内容自【2024】年【8】月【1】日起开始生效。本次变更允许基金份额持有人赎回的开放日为【2024】年【7】月【31】日，不同意变更的基金份额持有人可以在该开放日申请全部赎回。未在变更生效日前全部赎回份额的基金份额持有人视为同意前述变更。

特此通知。

基金管理人：上海盘京投资管理中心（有限合伙）（盖章）

2024年7月8日

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

关于上海盘京投资管理中心（有限合伙） 旗下私募基金基金合同变更的协商函

编号：202406-衍

中国国际金融股份有限公司：

对于上海盘京投资管理中心（有限合伙）（简称“本机构”）作为基金管理人、贵司作为基金托管人的私募基金（具体私募基金清单见附件，前述清单中每一个私募基金以下被单独称为“私募基金”），本机构拟根据《私募证券投资基金运作指引》的相关规定、基金合同及其任何有效修订（以下统称“《基金合同》”），对《基金合同》相关条款进行变更。

现依据《基金合同》中“基金合同的效力、变更、解除与终止”章节的“合同的变更”相关条款约定：

“2、因法律、法规、中国证监会、基金业协会的相关规定出台或发生变化而需要对本合同进行变更的，基金管理人可与基金托管人协商后修改基金合同，并由基金管理人按照本合同的约定向基金份额持有人披露变更的具体内容。”

在符合上述合同变更条款的前提下，按照《私募证券投资基金运作指引》中第十七条的规定，本机构特与贵司协商关于每一个私募基金《基金合同》的如下条款变更的意见。

一、《基金合同》条款具体修改如下：

1、《基金合同》“基金的投资”章节中“投资限制”增加如下条款：

“如本基金投资场外衍生品的，自 2024 年 8 月 1 日起，对场外衍生品执行以下投资比例限制：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%；参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的 50%；参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%。”

2、《基金合同》“基金的投资”章节中“投资禁止行为”增加如下条款：

“如本基金投资场外衍生品的，自 2024 年 8 月 1 日起，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；”

3、《基金合同》“越权交易”章节“越权交易的例外”第 1 款变更为：

“（四）越权交易的例外

下列情形不构成越权交易：

1、自 2024 年 8 月 1 日起按以下约定执行：由于基金管理人之外的原因导致的投资限制出现不符合本合同约定的情形为被动超标，不属于越权交易，包括但不限于：证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动、已投资持有的证券在持有期间信用评级下降、上市公司受到金融监管部门处罚或谴责、上市公司股票被特别处理、上市公司年度财务审计报告未被出具标准无保留意见等。发生被动超标时，基金管理人应在【20】个交易日内调整完毕，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，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。”。

4、除《基金合同》“越权交易”章节“越权交易的例外”第 1 款外，若《基金合同》其他章节对被动超标情形以及发生被动超标时管理人调整要求有约定的，则同步修改。

5、《基金合同》附件部分“投资监督事项表”中“投资限制”增加如下条款：

“如本基金投资场外衍生品的，自2024年8月1日起，对场外衍生品执行以下投资比例限制：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%；参与挂钩股票、股票指数等权益类收益互换的，向交易对手方缴纳的保证金比例不低于合约名义本金的50%；参与证券公司等机构发行带敲入和敲出结构的场外期权或者收益凭证（如雪球结构衍生品）的合约名义本金不得超过基金净资产的25%。”

6、若上述内容与《基金合同》原约定的相关内容有冲突的，则以本函的约定为准。

上述变更内容自【2024】年【8】月【1】日起开始生效。

二、 变更流程

本函应加盖本机构公章（或合同专用章）并发送贵司征询意见，在与贵司书面达成一致意见并收到贵司加盖公章的《复函》后本协商函生效。为避免歧义，上述“书面”形式包括纸质文件、扫描件（含传真件，下同）或者电子文件等形式，如扫描件与纸质文件不一致的，以贵司留存的扫描件为准。

本函生效后，本机构将负责根据《基金合同》约定将该等变更事项及时通知基金份额持有人，并按照《基金合同》的约定进行后续操作。如因以上调整事项未及时告知所有基金份额持有人或未按基金合同约定进行相关操作（如需）造成任何一方损失的，本机构将承担全部责任。

若《基金合同》变更事项涉及法律法规、中国证监会和中国证券投资基金业协会的监管

规定、自律规则或其他规范性文件的相关规定，要求本机构保障基金份额持有人赎回权利的，本机构将设置临时开放日允许不接受该等变更事项的基金份额持有人进行赎回。对于是否属于本机构应设置或有权设置临时开放日的任何情形，由本机构自行负责判断和具体执行，贵司和/或基金服务机构（也称行政服务机构、外包服务机构等，具体称谓以基金合同约定为准，下同）不对此负责监督或承担其他任何责任。基金服务机构仅依据本机构的指示、通知进行相关配合。

本次合同变更生效后，本机构须确保在合同变更生效后新申购的投资者所签署的合同或其附件包含本次变更的内容。因本机构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，由本机构承担相应的责任，贵司不承担任何责任。

本函正本一式两份，贵司留存一份，本机构执一份。

基金管理人：上海盘京投资管理中心（有限合伙）（盖章）



2024年7月4日

附件 1：私募基金清单

产品名称	产品代码
盘京金选盛信 1 号私募证券投资基金	SGV058
盘京金选盛信 2 号私募证券投资基金	SJD231
盘京金选盛信 3 号私募证券投资基金	SJN411

附件 2:

复 函

上海盘京投资管理中心（有限合伙）:

贵司发来的编号为 202406-衍的《关于上海盘京投资管理中心（有限合伙）旗下私募基金基金合同变更的协商函》已收悉,我司同意贵司在上述协商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。

中国国际金融股份有限公司（公章）

