

关于天道 15 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、广发证券股份有限公司（代销机构）：

基金投资者、基金管理人和基金托管人已签订《盘京天道 15 期私募证券投资基金基金合同》及其合同变更文件（如有，包括补充协议、征询意见函等法律法规规定或基金合同约定的方式进行合同变更的文件）（以下简称“《基金合同》”）。中国证券投资基金业协会发布的《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）将于 2024 年 8 月 1 日起施行，根据盘京天道 15 期私募证券投资基金（以下简称“本基金”）《基金合同》第二十三部分“因法律法规、监管政策的相关规定发生变化需要对本基金合同进行变更的，经由基金管理人提请、基金托管人确认后可直接对本基金合同的相关内容进行修订或补充，无需另行取得份额持有人的同意，但基金管理人应按照本基金合同约定的方式将变更内容通知基金份额持有人。基金管理人通过网站公告（网站地址：www.panjinginvest.com）、信函、电子邮件、传真、录音电话或短信等任何一种留痕方式通知份额持有人即视为履行了通知义务。”经与基金托管人确认，上海盘京投资管理中心（有限合伙）就《运作指引》要求变更本基金相关投资条款，现将《基金合同》变更情况向基金份额持有人公告如下：

一、《基金合同》变更内容

1、投资比例相关条款增加以下内容：

本基金开展场外衍生品交易的，自 2024 年 8 月 1 日起应当符合下列要求：

（1）本基金新增场外期权合约以及存续合约展期（商品类场外期权除外）时，最新经估值核对的基金净资产不低于 5000 万元。

（2）本基金投资的场外期权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%。

（3）本基金新增投资收益互换合约或存续合约展期时，最新经估值核对的基金净资产不低于 1000 万元。

（4）本基金参与挂钩股票、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%。

(5) 本基金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、新增投资场外衍生品的特别说明

本基金参与场外衍生品交易的,基金管理人应当在本基金下一估值日前将场外衍生品交易情况、交易文件等提供给基金托管人。基金管理人签订场外衍生品交易文件时,应当明确授权由交易对手方、相关交易的清算机构在本基金下一估值日前直接向基金托管人提供场外衍生品交易文件并持续提供估值信息。基金管理人应主动协调交易对手方按时向基金托管人提供准确、完整的估值信息,前述交易文件和估值信息需覆盖以上投资限制所需的各种类型标识和金额数据(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)。

基金托管人的投资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;由于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及时或准确进行投资监督的,基金托管人不承担任何责任。

3、基金管理人的声明与承诺新增:

如本基金开展场外衍生品交易的,本基金及本基金投资者均不存在份额分级安排。私募管理人不得将场外衍生品交易异化为股票、债券等场内标的的杠杆融资工具,不得为基金销售机构向自然人投资者销售特定结构的场外衍生品提供通道服务,不得为投资者提供规避场外衍生品交易要求的通道服务。

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临时开放日为【2024】年【7】月【22】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。上述临时开放日不受本基金合同中关于基金份额不允许赎回期限的限制(如有)。对于未在上述临时开放日全部赎回的份额持有人,视为同意本次变更。

特此通知。



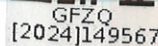
上海盘京投资管理中心（有限合伙）

2024年7月12日



附件：《关于盘京天道 15 期私募证券投资基金变更基金合同的协商函》及《回函》（托管用章）





理人应主动协调交易对手方按时向基金托管人提供准确、完整的估值信息，前述交易文件和估值信息需覆盖以上投资限制所需的各种类型标识和金额数据（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）。

基金托管人的投资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；由于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及时或准确进行投资监督的，基金托管人不承担任何责任。

3、基金管理人的声明与承诺新增：

如本基金开展场外衍生品交易的，本基金及本基金投资者均不存在份额分级安排。私募基金管理人不得将场外衍生品交易异化为股票、债券等场内标的的杠杆融资工具，不得为基金销售机构向自然人投资者销售特定结构的场外衍生品提供通道服务，不得为投资者提供规避场外衍生品交易要求的通道服务。

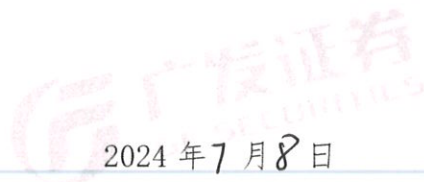
上述变更内容自 2024 年 8 月 1 日起正式生效。

二、合同变更流程

我司就本次《基金合同》变更事项向贵司征询意见，在与贵司达成一致意见并收到贵司的回函后，我司将向基金份额持有人披露本协商函变更内容并按照基金业协会相关要求履行变更手续。我司承诺将设置 2024 年 8 月 1 日（不含）前的临时开放日允许不同意变更的基金投资者进行赎回。本次合同变更生效后，如有新增投资者申购的，基金管理人须确保投资者所签署的合同或其附件包含本次变更的内容。因新投资者签署的合同内容与实际不符而导致的损失，由基金管理人承担相应的责任，基金托管人不承担任何责任。

本协商函一式两份，贵司留存一份，我司执一份。

基金管理人：上海盛京投资管理中心（有限合伙）



2024 年 7 月 8 日

家



分

管
用
章
1462

回 函

上海盘京投资管理中心（有限合伙）：

本基金托管人向基金管理人确认已收悉《关于盘京天道 15 期私募证券投资
基金变更基金合同的协商函》，经确认，同意上述协商函中的合同变更内容。

广发证券股份有限公司（签章）

年 月 日

2024 -07- 08

