

关于盘京盛信 6 期私募证券投资基金 1 号 基金合同变更的通知

尊敬的基金委托人：

关于上海盘京投资管理中心（有限合伙）（以下简称“我司”或“基金管理人”）发行管理的盘京盛信 6 期私募证券投资基金 1 号（以下简称“该基金”），根据《盘京盛信 6 期私募证券投资基金 1 号基金合同》（含各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，以上统称为“《基金合同》”）的约定及《私募证券投资基金运作指引》（中基协发〔2024〕5 号）的规定，现对《基金合同》按如下内容进行变更。

一、《基金合同》条款具体的变更方案如下：

1、在《基金合同》“释义”章节条款内容中增加如下约定：

“本释义部分提及的投资品种仅为对该品种所适用的资产范围、资产分类和计算口径的说明，并不代表本基金实际可以投资该种范围或品种，本基金实际可投资的范围以本合同约定的“投资范围”为准。若因法律法规的制定或修改、金融监管部门更新解释或说明等原因导致下述释义与届时有效的法律法规规定或金融监管部门解释说明不一致的，应当以届时有效的法律法规规定或金融监管部门解释说明为准，由基金管理人按本合同约定的方式之一通知基金委托人和基金托管人即可，无需适用或履行合同变更程序。

同一资产

1、标准化股权类资产按照同一家公司发行或挂牌的股票、存托凭证，视为同一资产，按照成本与市值孰低法计算，不轧差；

2、标准化债权类资产按照单只债券、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，视为同一资产，按照成本与市值孰低法计算，不轧差；

3、非标准化债权类资产（包含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

11、信用风险缓释凭证 CRMW、信用联结票据 CLN、信用保护合约、信用保护凭证，按单个合约代码视为同一资产，按市值计算；

12、银行发行的非保本型结构性存款按照同一“交易对手方”视为同一资产合并计算，按照成本与市值孰低计算；

13、上海黄金交易所上市交易的黄金现货实盘合约，按单个合约视为同一资产，按照成本与市值孰低法计算，不轧差。

债券评级

指参考境内评级机构最新公开发布的评级结果，其中银行间市场债券参考银行间市场交易商协会认可的境内评级机构，交易所债券参考在证监会备案的境内评级机构。

流动性受限资产

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，除公募证券投资基金以外的资产管理产品（包括私募基金等），收益凭证，收益互换，场外期权，银行发行的非保本型结构性存款，信用衍生工具（信用风险缓释合约 CRMA、信用违约互换 CDS、信用风险缓释凭证 CRMW、信用联结票据 CLN、信用保护合约、信用保护凭证），新三板挂牌公司股票，但不包括基金合同约定的投资比例不低于本基金净资产 90%（含）且为本基金管理人管理的私募基金。”

本条款下未被提及修改或替换的其他约定内容保持不变。

的 10%;

②本基金通过债券质押式协议回购接受质押的同一债券的面值不得超过本基金净资产的 10%;

③本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%;

④本管理人管理的所有私募证券投资基金通过债券质押式协议回购接受质押的同一债券的数量不得超过该债券存续数量的 10%;

⑤本基金投资于同一发行人及其关联方发行的债券按成本与市值孰低法计算不得超过基金净资产的 25%;

⑥本基金通过债券质押式协议回购接受质押的同一发行人及其关联方发行的债券按面值计算不得超过基金净资产的 25%;

⑦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%;

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通过债券质押式协议回购接受质押的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%;

⑨本基金与单一交易对手方开展债券质押式协议回购（包括正回购和逆回购）的市值绝对值合计不得超过基金净资产的 10%;

其中，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、资产支持证券、资产支持票据、同业存单不受本条限制;

(5) 本基金若涉及投资资产管理产品（包括私募基金等，下同）的，所投资的资产管理产品不得再投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品;

以上条款中，涉及计算口径等以合同释义部分为准。关于“同一融资主体”关联方、债券发行人关联方等信息，托管人以上海大智慧财汇数据科技有限公司（财汇资讯）等第三方资讯数据中获取到的为准，无法获取相关信息导致托管人无法监督的，托管人不承担任何责任。涉及管理人管理的所有产品、同一实际控制人控制的私募基金管理人的自有资金、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、同一实际控制人控制的私募基金管理人担任投资顾问的资产管理产品等投资限制，本基金管理人应自行控制并满足投资限制要求，托管人不负责监督。若上述某一条投资限制与本基金预警机制条款（如有）

结果不准确的风险。

5、《基金合同》“基金的投资”章节第（五）条“投资限制”最后一个自然段约定如下：

“基金管理人自本基金成立之日起6个月内使本基金的投资组合比例符合前款约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例的，基金管理人在10个交易日内调整完毕。如因证券暂停交易或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管理人不能履行调整义务的，则不受前款约定之限制，但基金管理人应当自证券恢复交易之日起的10个交易日内使本基金的投资组合比例符合前款约定。法律法规另有规定的从其规定。”

自变更之日起，变更为如下约定：

“因证券期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合法律法规规定和基金合同约定限制的，基金管理人应当在20个交易日内调整至符合要求。因资产流动性受限导致无法完成前述调整的，基金管理人应当在相关资产可出售、可转让或恢复交易之日起的20个交易日内调整至符合要求。法律法规另有规定的从其规定。”

6、在《基金合同》中增加或更新引用的【盘京盛信6期私募证券投资基金】的投资范围、投资策略、投资限制、预警平仓等相关条款内容，具体信息与【盘京盛信6期私募证券投资基金】的基金合同保持一致。同时，在上述引用条款部分后增加如下约定：

“若本合同“基金的投资”章节所述的【盘京盛信6期私募证券投资基金】基金合同条款发生变更的，基金管理人应以本合同约定的方式之一及时告知基金委托人和基金托管人，并设置临时开放日允许不同意的基金委托人发起赎回；若相关条款变更是由于法律法规的修订、变更、解释、新增、废止等情形而进行相应变更和调整的，或相关条款变更对基金委托人利益无实质不利影响的，基金管理人可无需设置临时开放日，但仍应以本合同约定的方式之一告知基金委托人和基金托管人。对于【盘京盛信6期私募证券投资基金】其他合同条款的变更事项，若本基金管理人认为可能对基金委托人权益造成重大影响的，也应以本合同约定的方式之一通知本基金委托人。”

基金约定的投资范围的修改或替换，本基金实际可投资的范围以本合同约定的“投资范围”为准；本基金自进入清算程序后无需遵循以下投资比例限制）：

1、根据《运作指引》，本基金应遵循下述投资限制：

(1) 本基金投资于期货和衍生品的持仓合约价值的比例不低于本基金已投资资产 80%且期货和衍生品账户权益超过本基金已投资资产 20%；

(2) 本基金投资于同一资产的资金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、公开募集基金除外）；

(3) 本管理人管理的所有私募证券投资基金投资于同一资产的资金不得超过该资产的 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、公开募集基金除外）；符合投资于同一资产的资金不超过该基金净资产的 25%要求的基金投资单只私募基金的资金可以不满足本条投资限制要求；

(4) 本基金不得投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品（包括私募基金等）；

(5) 本基金的总资产不得超过本基金净资产的 120%；

(6) 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%；

(7) 本基金开展场外衍生品交易的，应当符合下列要求：

①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，基金净资产不低于 5000 万元；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新增收益互换合约以及存续合约展期的，基金净资产不低于 1000 万元；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%；

③参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的合约名义本金不得超过基金净资产的 25%；

本基金新增场外期权合约、收益互换合约及存续合约展期的，在场外投资划款指令到达基金托管人时，基金托管人对基金净资产规模是否符合本条要求进行事中审核。

市公司总股本的 4.99%;

3、本基金投资全部北交所股票的市值不超过基金资产净值的 30%;

4、本基金不得投资于 DMA 多空收益互换;

基金管理人承诺确保本基金在实际投资运作中符合本条投资限制的约定,并负责主动授权并督促交易对手方向基金托管人发送准确、完整的场外衍生品交易文件(包括但不限于收益互换类型以及多空标识等)。在本基金持有收益互换合约期间,基金托管人根据交易对手方提供的场外衍生品交易文件中收益互换合约代码里是否包含“DMA”字样或互换类型是否包含“多空”字样进行监督即视为基金托管人履行了监督义务。若出现交易对手方未及时发送交易文件、交易文件底层数据缺失(如无法体现“DMA”或多空字样)、交易文件内容有误、交易文件因交易对手方的标准不统一而导致口径及含义存在差异、交易文件格式变化且未提前与基金托管人沟通确认、业务类型与实际业务种类不符以及交易对手方的信息确认人未经其公司内部授权等情形导致基金托管人无法监督、未能监督或所监督内容与实际不符的,基金托管人不承担任何责任。

5、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

基金委托人已经知晓且确认:如涉及管理人管理的所有产品,同一实际控制人控制的私募基金管理人的自有资金,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,同一实际控制人控制的私募证券投资基金管理人担任投资顾问的资产管理产品,新股、新债申购的申报金额与数量,盘中监控,交易策略类等监控事项的,由基金管理人自行监控,基金托管人不承担投资监督职责。

因证券期货市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合法律法规规定和基金合同约定限制的,基金管理人应当在 20 个交易日内调整至符合要求。因资产流动性受限导致无法完成前述调整的,基金管理人应当在相关资产可出售、可转让或恢复交易之日起的 20 个交易日内调整至符合要求。法律法规另有规定的从其规定。”

4、标的基金的预警平仓机制:

“本基金不设置预警和平仓机制。”

7、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

调整至符合要求。

2、本合同终止前 20 个交易日内，基金管理人有权对本基金持有的资产进行变现，由此造成投资比例不符合合同约定的。”

基金管理人、基金托管人已就上述变更事项书面达成一致。基金管理人指定 2026 年【6】月【10】日为开放日，若本基金委托人不同意本次合同变更条款的，应于该开放日全部赎回其所有基金份额。上述合同变更条款将于 2026 年【6】月【11】日起正式生效。

若本基金委托人未在本通知函指定的开放日全部赎回本基金的（无论本基金委托人是否向管理人提交过回复，亦无论本基金委托人是否表明过不同意），均视为本基金委托人同意本次变更。

特此公告。

上海盘京投资管理中心（有限合伙）（盖章）

2026年6月2日

