

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”）发行管理的私募基金（具体涉及的私募基金以本通知附件产品清单为准），根据私募基金对应的《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，私募基金的前述文件以下统称为“《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，现对相关私募基金的《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



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,按照成本与市值孰低法合并后计算;

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,按照成本与市值孰低法计算;

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,期货按单一合约占用保证金计算,期权买方按照同一品种不同月份期权合约支付的权利金市值计算,期权卖方按照同一品种不同月份期权合约占用的保证金计算,均不轧差;

6、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”视为同一资产合并计算,场外期权按照同一“交易对手方”占用的保证金及权利金总额进行计算(不轧差),非保本型收益凭证按照成本与市值孰低计算;

7、收益互换按照合约挂钩具体标的视为同一资产,按照占用的保证金总规模计算合约挂钩标的金额,不轧差;

8、银行存款(包括定期存款、协议存款、保本型结构性存款和其他银行存款,不含活期存款)按同一家银行(非分支行)视为同一资产,按成本与市值孰低法计算;

9、上海黄金交易所上市交易的现货延期交收合约品种,按单个品种视为同一资产,按单个品种占用保证金计算,不轧差;

10、利率互换、远期合约、掉期合约、信用风险缓释合约 CRMA、信用违约互换 CDS,按单个合约代码视为同一资产,按单个合约损益计算,不轧差;

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。

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（为免疑义，如基金合同中载明“基金管理人自本基金成立之日使本基金的投资组合比例符合上款约定”或其他与此含义相同或类似的条款，下述投资限制仍自本条款的生效执行日起执行）：

“本基金应遵循下述投资限制（为免疑义，本条款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”和禁止投资的品种为准）：

（1）以市值计，本基金投资于【盘京盛信 17 期私募证券投资基金】的比例不低于基金净资产的 90%（含）；

（2）本基金的总资产不得超过本基金净资产的 120%；

（3）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%；

（4）本基金开展债券和回购交易的，应当符合下列要求：

①本基金投资于同一债券按成本与市值孰低法计算不得超过本基金净资产的 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证券投资基金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）约定的投资比例有冲突且本基金触发了预警机制的情形的，则以预警机制条款的约定为准。当本基金出现触发预警机制的情形时，基金管理人应及时告知基金托管人。

本基金直接投资于除公募基金以外的资产管理产品（资产管理产品亦包括私募基金等产品，下同）的，基金管理人对本条有关《运作指引》约定的本基金投资于同一资产的比例限制，本基金投资于同一债券的比例限制，以及本基金嵌套层级，应原则上至少每个季度进行一次穿透合并计算。所投资资产管理产品为私募证券投资基金的，基金管理人负责协调所投私募基金的管理人授权其托管人直接向本基金托管人提供该私募基金的四级估值表；投资除公募基金和私募基金以外的资产管理产品的，基金管理人负责协调该资产管理产品的管理人直接向本基金托管人提供该资产管理产品的四级估值表。基金托管人在完整地接收本基金所投资资产管理产品同一交易日的四级估值表后进行穿透合并计算，计算时仅以该估值表中的信息为准。如果法律法规或金融监管部门对前述需向基金托管人提供并作为穿透合并计算依据的估值信息（如四级估值表）、相关数据信息的提供方式、穿透合并计算频率等事项另有要求的，从其规定。

本基金参与协议回购交易的，基金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私募基金托管人，由于管理人未提供信息导致托管人无法监督的，托管人不承担任何责任。

本基金持有资产管理产品期间，基金托管人仅根据资产管理产品托管人或管理人提供的资产管理产品估值信息（如四级估值表），对本基金是否符合本条要求进行事后监督。基金托管人不对估值信息进行任何实质性判断，也不对其真实性、准确性、完整性、及时性和/或所载内容的专业性、正确性负责。若出现估值信息的提供方未按时发送估值信息、估值信息底层数据缺失、估值信息内容有误、估值信息因交易对手方的标准不统一而导致口径及含义存在差异的、估值信息格式变化且未提前与基金托管人沟通确认、估值信息提供方的信息发送人、其所发送的信息未经其公司内部授权或确认等情形，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。”

特别的：若私募基金涉及穿透合并计算持仓比例的，计算频率及结果依赖于所投资的底层资产管理产品的估值数据，如因客观原因无法及时获取底层估值数据的，私募基金将面临无法及时、准确穿透计算持仓比例，以及最终的计算结果不准确的风险。

3、在《基金合同》中增加或更新引用的【盘京盛信 17 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 17 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 17 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 17 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。”

特别的，上述标的基金投资范围、投资策略、投资限制、预警平仓等相关条款变更(如涉及)后的内容如下：

1、标的基金的投资范围：

“本基金的投资范围为：

1、权益类：国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他依法发行上市的股票）、新三板挂牌公司股票、优先股、新股申购（包括网上和网下申购）、沪深交易所上市公司非公开发行股票（即定向增发股票）、北交所股票、沪港通、深港通、存托凭证（DR）、股票型公募基金、混合型公募基金、参与融资融券、将持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司；

2、固定收益类：债券、债券回购（包括债券正回购和债券逆回购）、债券型公募基金；

3、现金管理类：现金、银行存款（包括定期存款、协议存款和其他银行存款）、同业存单、大额可转让定期存单、货币市场基金；

4、场内衍生品：交易所上市交易的衍生品（包括权证、期货和期权）；

5、场外衍生品：以具有相应业务资格的机构做交易对手的收益互换和场外期权，利率互换；

6、上海黄金交易所上市交易的现货延期交收合约品种；

7、其他：资产支持证券、银行理财、中信证券股份有限公司发行的收益凭证，法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。

如法律法规规定基金管理人需取得特定资质后方可投资某产品，则基金管理人须在获得相应资质后开展此项业务。

如法律法规规定基金管理人需取得特定资质后方可投资某产品，则基金管理人须在获得相应资质后开展此项业务。

在本基金投资范围允许并符合相关法律法规的规定的的前提下，参与银行间债券、场外期权、收益互换及未列示的其它品种，管理人需提前与托管人就清算交收、核算估值等事项达成一致意见。若管理人擅自参与上述业务的，产生的估值核算等问题，由管理人承担相关责任。”

2、标的基金的投资策略：

“本基金除了坚持以成长优选策略构建 A 股二级市场核心组合外，将增加以下的资产配置与策略：

1、通过股指做空对冲组合风险；

2、通过沪港通、深港通、跨境收益互换等形式投资海外市场。

上述内容仅为基金管理人针对本基金全部或部分投资标的对应投资策略的说明，不构成对本基金投资范围、投资比例及限制或其他投资风控措施的解释、限缩或补充，也不代表本基金仅投资、必然投资或持续投资于上述内容中提及的特定投向和/或标的品种，基金管理人有权在符合本合同约定的投资范围、投资比例及限制的范围内选择投资任意一个或多个标的品种。”

3、标的基金的投资限制：

“本基金的投资组合将遵循以下限制（本基金自进入清算程序后无需遵循以下投资比例限制）：

1、本基金投资于一家上市公司所发行的股票数量占该公司总股本的比例不得超过5%，同时不能超过该上市公司流通股本的10%；

2、本基金持有一家上市公司所发行的单一股票的市值，不得超过基金资产净值的25%；

3、本基金所持有的权益类资产（股票（市值）、股指期货合约价值（轧差计算）、期权（轧差计算）、融资融券（轧差计算）、权益类基金、通过收益互换方式持有的股票合约价值（轧差计算））合计为基金资产净值的-50%~150%；

4、收益互换的名义本金额（按照互换标的买入时的成本）不超过基金资产净值的50%；初始杠杆比率不超过2倍（含）；收益互换的单个标的名义本金累计不超过基金净资产的30%；

5、本基金持有的沪港通、深港通以及跨境收益互换方式标的范围内的证券，依市价计算，合计不得超过基金资产净值的50%，且单个标的依市值计算，不得超过基金资产净值的30%；

6、期权合约支付和收取的权利金总额不超过净资产的15%，买入和卖出期权的合约价值不超过基金资产净值的30%；

7、本基金持有的单只债券按成本计算不得超过前一日基金资产净值的10%，单只信用债按成本计算不得超过前一日基金资产净值的5%，所持有的全部债券按成本计算不得超过前一日基金资产净值的20%。本基金所投资的短期融资券以外的债券的债项信用评级在AAA级（含）以上、短期融资券的债项评级需在A-1（含）以上；本基金所投资的债券的主体评级在AAA级（含）以上；

8、本基金参与申购新股，申报的金额不得超过本基金的总资产，申报的数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

9、本基金购买单个 ST、*ST、SST 公司股票市值，依买入成本计算，不得超过基金资产净值的 5%；持有的所有 ST、*ST、SST 公司股票市值，依买入成本计算，不得超过基金资产净值的 10%；

10、按市值计算，本基金持有的单个公募基金（不含专户）、收益凭证不超过本基金资产净值的 8%；

11、本基金为私募证券投资基金，不得投资于未上市股权、非标债权、房地产及艺术品等非标资产及投资上述资产的相关金融产品；

12、本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过 200%；

13、本基金投资于债权类资产的投资比例为 0-100%；本基金投资于权益类资产的投资比例为 0-100%；本基金投资于商品及金融衍生品类资产的投资比例为 0-100%；

14、本基金投资于沪深交易所的流通受限股票的市值占基金资产总值的比例不超过 30%；

15、本基金投资于北交所股票的市值占基金资产总值不超过 20%；

16、本基金不得投资私募投资基金（包括有限合伙）；

17、按市值计算，投资沪深交易所上市公司非公开发行股票（即定向增发股票）比例不超过基金资产净值的 20%；

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

（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（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%；

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，交易对手方未按时提供或提供不完整的由基金管理人负责补充提供，基金管理人需确保交易文件和估值信息的真实性、准确性、完整性和及时性。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)。

基金托管人自 2024 年 8 月 1 日(含)起对本条款进行监督。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；本基金持有场外衍生品合约期间，基金托管人仅根据交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人提供的交易文件和估值信息对本基金是否符合本条要求进行事后监督。基金托管人不对交易文件和估值信息进行任何实质性判断，也不对其真实性、准确性、完整性、及时性和/或所载内容的专业性、正确性负责。若出现交易对手方、相关交易的清算机构或基金管理人未按时发送交易文件和估值信息、交易文件和估值信息底层数据缺失、交易文件和估值信息内容有误、交易文件和估值信息因交易对手方的标准不统一产生口径及含义而导致存在差异的、交易文件和估值信息格式变化且未提前与基金托管人沟通确认、基金管理人和/或交易对手方的信息发送人、其所发送的信息未经其公司内部授权或确认等情形，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。

19、本基金应遵循下述投资限制(为免疑义，本条款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”和禁止投资的品种为准)：

(1) 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)；

(2) 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；

(3) 本基金的总资产不得超过本基金净资产的 120%；

(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%；

(5) 本基金开展债券和回购交易的，应当符合下列要求：

① 本基金投资于同一债券按成本与市值孰低法计算不得超过本基金净资产的 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；

(6) 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证券投资基金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。

本基金直接投资于除公募基金以外的资产管理产品（资产管理产品亦包括私募基金等产品，下同）的，基金管理人对本条有关《运作指引》约定的本基金投资于同一资产的比例限制，本基金投资于同一债券的比例限制，以及本基金嵌套层级，应原则上至少每个季度进行一次穿透合并计算。所投资资产管理产品为私募证券投资基金的，基金管理人负责协调所投私募基金的管理人授权其托管人直接向本基金托管人提供该私募基金的四级估值表；投资除公募基金和私募基金以外的资产管理产品的，基金管理人负责协调该资产管理产品的管理人直接向本基金托管人提供该资产管理产品的四级估值表。基金托管人在完整地接收本基金所投资资产管理产品同一交易日的四级估值表后进行穿透合并计算，计算时仅以该估值表中的信息为准。如果法律法规或金融监管部门对前述需向基金托管人提供并作为穿透合并计算依据的估值信息（如四级估值表）、相关数据信息的提供方式、穿透合并计算频率等事项另有要求的，从其规定。

本基金参与协议回购交易的，基金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私募基金托管人，由于管理人未提供信息导致托管人无法监督的，托管人不承担任何责任。

本基金持有资产管理产品期间，基金托管人仅根据资产管理产品托管人或管理人提供的资产管理产品估值信息（如四级估值表），对本基金是否符合本条要求进行事后监督。基金托管人不对估值信息进行任何实质性判断，也不对其真实性、准确性、完整性、及时性和/或所载内容的专业性、正确性负责。若出现估值信息的提供方未按时发送估值信息、估值信息底层数据缺失、估值信息内容有误、估值信息因交易对手方的标准不统一而导致口径及含义存在差异的、估值信息格式变化且未提前与基金托管人沟通确认、估值信息提供方的信息发送人、其

所发送的信息未经其公司内部授权或确认等情形，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。

20、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：以上第 3、4、5、6、8、11、13 项投资限制由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。

以上投资限制中，如涉及新股、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，则不受上款约定之限制，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上款约定。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。”

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：

“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。”

5、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。”

基金管理人、基金托管人已就上述变更事项书面达成一致。上述合同变更条款将于 2026 年 7 月 13 日起正式生效。基金管理人指定 2026 年 7 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。

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）

2026 年 6 月 17 日



附件产品清单：

- 1、盘京盛信 17 期私募证券投资基金 1 号
- 2、盘京盛信 17 期私募证券投资基金 2 号
- 3、盘京盛信 17 期私募证券投资基金 3 号
- 4、盘京盛信 17 期私募证券投资基金 5 号
- 5、盘京盛信 17 期私募证券投资基金 6 号
- 6、盘京盛信 17 期私募证券投资基金 7 号
- 7、盘京盛信 17 期私募证券投资基金 9 号