

关于盘京盛信 15 期私募证券投资基金 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”）发行管理的盘京盛信 15 期私募证券投资基金（以下简称“该基金”），根据《盘京盛信 15 期私募证券投资基金基金合同》（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》条款具体的变更如下：

1、自变更之日起，《基金合同》风险揭示书第二部分第（九）条删除如下约定，后续条款序号依次变更：

“4、以扣减基金委托人份额方式提取业绩报酬的风险

在固定时点以扣减基金委托人份额的方式计提业绩报酬会导致委托人持有基金份额数的减少。就被扣减的基金份额，原委托人将丧失被扣减份额所代表的权利。被扣减的基金份额所代表的基金财产，将作为业绩报酬支付给业绩报酬收取方。”

2、自变更之日起，《基金合同》风险揭示书第三部分第（五）条删除如下约定：

“5、本基金自成立后每 3 年的对日接受赎回申请，投资者在此期间内面临无法赎回的流动性风险。”

3、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法计算;

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法计算；

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。

”

本条款下未被提及修改或替换的其他约定内容保持不变。

4、《基金合同》第八部分第（二）条第 1 自然段约定如下：

“本基金固定开放日为成立后每 3 年的对日和成立后每年 1、4、7、10 月 15 日，成立后每 3 年的对日接受申购和赎回申请（例如：基金成立日为 2015 年 7 月 30 日，则满 3 年的对日为 2018 年 7 月 30 日，以此类推），成立后每年 1、4、7、10 月 15 日仅接受申购申请，不接受赎回申请，如对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。”

自变更之日起，上述内容变更如下：

“本基金固定开放日为每个自然季度首月（即 1 月、4 月、7 月、10 月）的 15 日，接受申购和赎回申请，如对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。”

5、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前款约定”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）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。

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。

6、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。”

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：

“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。”

8、《基金合同》第十九部分第（三）条第3款约定如下：

“3、基金管理人收取的业绩报酬

本基金业绩报酬计提基准日分为固定计提基准日、除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日（其中固定计提基准日和除息日（若有）统称为“统一计提基

准日”），固定计提基准日为基金成立后每3年的对日（例如：基金成立日为2015年7月30日，则满3年的对日为2018年7月30日，以此类推），如对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。业绩报酬计提日为固定计提确认日、分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。

若某次统一计提基准日与本基金上一个发生业绩报酬计提对应的统一计提基准日间隔期短于【3】个月时，则该次业绩报酬计提基准日及其对应的计提日不计提业绩报酬。

管理人将根据委托人的期间年化收益率（R），对期间年化收益率超过5%以上部分按照20%的比例收取业绩报酬。

（1）业绩报酬计提原则

① 委托人每笔参与份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。在符合业绩报酬计提条件时，在本基金固定计提确认日、分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日计提业绩报酬。

②在固定计提确认日，对基金委托人持有的未赎回基金份额计算业绩报酬，通过强制扣减等值基金份额的方式进行提取，并将扣减的基金份额以现金形式向基金管理人支付业绩报酬。

③基金分红确认日（若有）提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金。在赎回确认日和基金终止确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金或清算资金中扣除。

④在赎回确认日和基金终止确认日，业绩报酬按委托人赎回份额或基金终止时持有份额计算。如赎回份额为一笔认购/申购份额的一部分，则将该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔认购/申购份额的剩余部分不受影响。

（2）业绩报酬计提方法

业绩报酬的计提，以该笔份额上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（简称“上一个业绩报酬计提基准日”）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。上一个业绩报酬计提基准日，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，认购所得的份额，以本基金成立日为准；申购所得的份额，以申购申请对应的开放日为准；分红所得的份额（若有），以红利再投资对应的除息日为准。委托人赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔认购/申购/红利再投资份额（若有）应收的业绩报酬。

①期间年化收益率的计算公式

$$R = [(P1-P0) \div P0x] \times (365 \div T) \times 100\%$$

其中：

R=期间年化收益率

P1=本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

P0 =上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

P0x=上一个业绩报酬计提基准日的份额净值

T=上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

②管理人以超额比例的方式提取业绩报酬，具体计算公式如下：

期间年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
$R \leq 5\%$	0	$E = 0$
$5\% < R$	20%	$E = N \times P0x \times (R - 5\%) \times 20\% \times (T \div 365)$

E=某笔份额对应的业绩报酬

N=委托人该笔认（申）购或红利再投资（若有）在分红权益登记日所持的份额数，或其在本次赎回日赎回的份额数，或其在基金终止时所持的份额数，或其在固定计提确认日的份额数

③将所有笔数的业绩报酬加总，得到总的业绩报酬（ ΣE ）。

$$\Sigma E = E1 + E2 + E3 + \dots + En$$

其中的 n 为所对应的份额笔数。

④在固定计提确认日，对未赎回基金份额计算业绩报酬，按照本次计提基准日的基金份额净值将业绩报酬折算为等值的基金份额，从对应的认购/申购记录中强制扣减相应数量的基金份额。

业绩报酬折算为等值的基金份额的计算公式如下：

$$F = Ex \div P1x$$

F=某笔份额应强制扣减的基金份额数；

Ex=某笔份额在固定计提基准日应计提的业绩报酬；

P1x =本次计提基准日的基金份额净值。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，基金托管人不对计算结果进行复核。

.....”

自本协议的变更执行日起，上述内容变更如下：

“3、基金管理人收取的业绩报酬

本基金业绩报酬计提基准日分为除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日。业绩报酬计提日为分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。若某次分红（若有）对应的除息日与本基金上一个发生业绩报酬计提对应的除息日间隔期短于6个月时，则该次分红的除息日及其对应的分红确认日（若有）不计提业绩报酬。

管理人将根据委托人每笔投资的期间年化收益率（R），对期间年化收益率超过5%以上部分按照20%的比例收取业绩报酬。

（1）业绩报酬计提原则

①按委托人每笔份额分别计算期间年化收益率并计提业绩报酬。

②在符合业绩报酬计提条件时，在本基金的分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日计提业绩报酬。

③基金分红确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从分红资金中扣除且不超过分红资金（若有）；在委托人赎回确认日或本基金终止确认日提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金或清算资金中扣除。

④在委托人赎回确认日或基金终止确认日计提时，业绩报酬按委托人赎回份额或基金终止时持有份额计算。如赎回份额为某笔份额的一部分，则将该赎回份额单独核算业绩报酬，而该笔份额的剩余部分不受影响。

（2）业绩报酬计提方法

业绩报酬的计提，以该笔份额上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提基准日（简称“上一个业绩报酬计提基准日”）至本次业绩报酬计提基准日的期间为基准。上一个业绩报酬计提基准日，如委托人该笔份额未发生业绩报酬计提，认购所得的份额，以本基金成立日为准；申购所得的份额，以申购申请对应的开放日为准；分红所得的份额（若有），以红利再投资对应的除息日为准。委托人赎回时，按照“先进先出”法，分别计算每一笔认购/申购/红利再投资份额（若有）应收的业绩报酬。

①期间年化收益率计算

$$R = [(P1 - P0) / P0] \times (365 \div T) \times 100\%$$

其中：

R=期间年化收益率

$P1$ = 本次业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P0$ = 上一个业绩报酬计提基准日的份额累计净值

$P0x$ = 上一个业绩报酬计提基准日的份额净值

T = 上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（含）到本次业绩报酬计提日（不含）的天数

② 管理人以超额比例的方式提取业绩报酬，具体计算公式如下：

期间年化收益率	收取比例	业绩报酬计算公式
$R \leq 5\%$	0	$E = 0$
$5\% < R$	20%	$E = N \times P0x \times (R - 5\%) \times 20\% \times (T \div 365)$

E = 某笔份额对应的业绩报酬

N = 委托人该笔认（申）购或红利再投资（若有）在分红权益登记日所持的份额数，或其在本次赎回日赎回的份额数，或其在基金终止时所持的份额数

③ 将所有笔数的业绩报酬加总，得到总的业绩报酬（ ΣE ）。

$\Sigma E = E1 + E2 + E3 + \dots + En$

其中的 n 为所对应的份额笔数。

业绩报酬由注册登记机构负责计算，基金托管人不对计算结果进行复核。

.....”

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 16 日起正式生效。基金管理人指定 2026 年 7 月 15 日为临时开放日，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 7 月 3 日

