

关于盘京同魁 2 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、中信证券股份有限公司（代销机构）：

盘京同魁 2 期私募证券投资基金 1 号（基金代码：STN903）、盘京同魁 2 期私募证券投资基金 2 号（基金代码：STN907）、盘京同魁 2 期私募证券投资基金 3 号（基金代码：STN910）、盘京同魁 2 期私募证券投资基金 5 号（基金代码：STN912）、盘京同魁 2 期私募证券投资基金 6 号（基金代码：STN914）、盘京同魁 2 期私募证券投资基金 7 号（基金代码：STN919）、盘京同魁 2 期私募证券投资基金 9 号（基金代码：SALJ99）为我司管理、中信证券股份有限公司代销产品，主要投资于“盘京同魁 2 期私募证券投资基金”（基金代码：STN892，以下简称“标的基金”或“本基金”）。

现根据标的基金的《基金合同》（含该合同变更文件，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》”）的约定及法律法规的变化（包括但不限于中基协发〔2024〕5 号《私募证券投资基金运作指引》（以下简称“《运作指引》”）等），经与本基金的托管人中信证券股份有限公司协商一致（详见附件《协商函》），我司对标的基金的基金合同相关条款进行变更通知。

依据《基金合同》中“基金合同的变更、终止与基金财产清算”章节的“基金合同的变更”相关条款约定：

“2、有下列情形之一的，由基金管理人与基金托管人协商一致后对本合同相关内容进行变更：



(1) 资金划拨指令有关事宜，清算交收业务规则，估值方法及核对的时间和程序，调低从本基金资产列支由托管人、行政服务机构（若有）收取的费用的标准等相关内容的变更；

(2) 因有权机构对法律法规的修订、变更、解释、新增、废止等导致本合同与之存在冲突或不一致的，应当以届时有效的法律法规为准对本合同进行相应变更和调整。”

在符合上述合同变更条款的前提下，按照《运作指引》相关规定，《基金合同》条款具体修改如下：

1、在《基金合同》“释义”章节条款内容中增加如下约定：

“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法孰低计算；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（活期除外）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，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。”

2、自本协议的变更执行日起，《基金合同》第九部分第（二）条第3款新增如下约定，后续序号依次顺延：

“（28）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；”

3、在《基金合同》“基金的投资”章节的“投资限制”条款下“法律法规或监管部门规定的其他投资限制”内容前插入如下内容作为新增的单独一项，相关条款编码按照已有编码规则进行相应调整：

“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；

以上条款中，涉及资产范围、资产分类和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、管理人同一实际控制人信息，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投资比例的，托管人仅按照本管理人管理的且在本托管人处托管的所有私募证券投资基金直接投资标的合并计算；所投资资产为资产管理产品的，除涉及本合同约定的穿透合并计算的情形外，仅当所投资资产管理产品在本托管人处托管的情况下托管人履行监督职责。”

本条款下未被提及修改或替换的其他约定内容保持不变。

特别的：如《基金合同》中已载有与上述变更内容相关的条款（包括但不限于相关投资标的的投资限制、投资比例、风控措施等条款，以下简称“原条款”），且原条款较上述变更方案中的约定更为严格（例如，原条款的规模门槛

更高、可允许投资的比例限制更低、禁止投资某一具体场外衍生品种等，符合该情形的原条款以下简称“严格原条款”），则上述变更内容不视为对《基金合同》严格原条款的删除、替代或修改，即使基金管理人已按照本次协商函对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，《基金合同》的严格原条款依然有效，仍按照《基金合同》严格原条款执行；反之，如《基金合同》原条款较上述变更方案中的约定更为宽松（例如原条款的规模门槛更低、可允许投资的比例限制更高等），且基金管理人按照本次协商函对私募基金的《基金合同》完成合同变更的，则按照本次协商函的上述变更内容执行。

上述变更内容自【2024】年【10】月【28】日起开始生效。本次变更允许赎回的开放日为【2024】年【10】月【25】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。未在变更生效日前全部赎回份额的基金委托人视为同意前述变更。

特此通知。

上海盘京投资管理中心（有限合伙）

2024年10月18日

附件：《关于盘京同魁2期私募证券投资基金基金合同变更的协商函（20241015）》及《复函》（托管用章）

协议编号：21-QB-01212915-01-001

关于盘京同魁 2 期私募证券投资基金基金合同变更的 协商函（20241015）

中信证券股份有限公司：

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”)在中信证券股份有限公司(以下简称“贵司”或“基金托管人”)托管的盘京同魁 2 期私募证券投资基金(产品代码：STN892,以下简称“该基金”),根据《盘京同魁 2 期私募证券投资基金基金合同》(含该合同变更文件,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》”)的约定及法律法规的变化(包括但不限于中基协发〔2024〕5 号《私募证券投资基金运作指引》等),现拟对该《基金合同》相关条款进行变更。我司特与贵司协商关于《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、在《基金合同》“释义”章节条款内容中增加如下约定：

“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法孰低计算；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（活期除外）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，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。”

2、自本协议的变更执行日起，《基金合同》第九部分第（二）条第3款新增如下约定，后续序号依次顺延：

“（28）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；”

3、在《基金合同》“基金的投资”章节的“投资限制”条款下“法律法规或监管部门规定的其他投资限制”内容前插入如下内容作为新增的单独一项，相关条款编码按照已有编码规则进行相应调整：

“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；

以上条款中，涉及资产范围、资产分类和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、管理人同一实际控制人信息，

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投资比例的,托管人仅按照本管理人管理的且在本托管人处托管的所有私募证券投资基金直接投资标的合并计算;所投资资产为资产管理产品的,除涉及本合同约定的穿透合并计算的情形外,仅当所投资资产管理产品在本托管人处托管的情况下托管人履行监督职责。”

本条款下未被提及修改或替换的其他约定内容保持不变。

特别的:如《基金合同》中已载有与上述变更内容相关的条款(包括但不限于相关投资标的的投资限制、投资比例、风控措施等条款,以下简称“原条款”),且原条款较上述变更方案中的约定更为严格(例如,原条款的规模门槛更高、可允许投资的比例限制更低、禁止投资某一具体场外衍生品种等,符合该情形的原条款以下简称“严格原条款”),则上述变更内容不视为对《基金合同》严格原条款的删除、替代或修改,即使基金管理人已按照本协商函对私募基金的《基金合同》完成合同变更的,《基金合同》的严格原条款依然有效,仍按照《基金合同》严格原条款执行;反之,如《基金合同》原条款较上述变更方案中的约定更为宽松(例如原条款的规模门槛更低、可允许投资的比例限制更高等),且基金管理人按照本协商函对私募基金的《基金合同》完成合同变更的,则按照本协商函的上述变更内容执行。

上述变更内容自【2024】年【10】月【28】日起开始生效。

二、合同变更流程

我司通过本协商函向贵司征询意见,在收到贵司的《复函》后,我司将负责按照私募基金《基金合同》的约定及时向基金委托人披露《基金合同》的变更事宜,并按监管规定及时向监管机构报备。

我司提供的协商函(含托管人《复函》)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、传真件、电子文件与纸质文件不一致的,以基金托管人留存的扫描件、传真件或电子文件为准。

若私募基金的《基金合同》变更事项涉及法律法规规定要求基金管理人保障基金委托人赎回权利的,我司将按照《基金合同》的约定设置开放日允许不接受该等变更事项的基金委托人进行赎回。对于是否属于基金管理人应设置或有权设

置临时开放日的任何情形，由我司自行负责判断和具体执行，基金托管人及/或行政服务机构不对此负责监督或承担其他任何责任。行政服务机构仅依据基金管理人的指示、通知进行相关配合。

我司承诺将根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求就合同变更事项及时履行报告义务以及向基金委托人披露。本次合同变更生效后，若有新增基金委托人的，我司将确保其所签署的产品合同或其附件包含本次变更的内容。因新基金委托人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。

三、本函一式【两】份，基金管理人、基金托管人各执一份。

基金管理人：上海盘京投资管理中心(有限合伙) (盖章)

2024年10月18日



复 函

上海盘京投资管理中心(有限合伙):

贵司发来的《关于盘京同魁2期私募证券投资基金基金合同变更的协商函(20241015)》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。

中信证券股份有限公司托管部(公章/合同专用章)

2024年10月18日

