

关于盘京盛信 4 期 D 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 4 期 D 私募证券投资基金（以下简称“该基金”），根据《盘京盛信 4 期 D 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占用用的保证金计算,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(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。

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。

3、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。”

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：

“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 6 月 25 日起正式生效。基金管理人指定 2026 年 6 月 24 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 1 日