

关于盘京天道 9 期私募证券投资基金

基金合同变更的情况说明



中国银河证券股份有限公司托管部：

上海盘京投资管理中心（有限合伙）（以下简称“我公司”）作为“盘京天道 9 期私募证券投资基金”（以下简称“本基金”）的管理人，已就合同变更事项与所有基金份额持有人完成补充协议的签署，征得所有基金份额持有人的同意。我公司承诺**所有**基金份额持有人均知晓本合同变更事项。

投资人列表如下：

序号	投资人姓名	基金份额持有人意见
1	朱渭钢	同意
2	李军	同意
3	汤友钱	同意
4	潘慧萍	同意
5	王菊芬	同意
6	施荷凤	同意
7	钱阿兔	同意
8	黄华府	同意
9	王宝花	同意
10	范美珍	同意

11	应鸿峰	同意
12	林杰	同意
13	单晓武	同意
14	QINCHEN	同意
	合计投资人总数	14

备注：上述份额持有人均签约了纸质文档补充协议。

合同变更条款具体如下：

一、盘京天道 9 期私募证券投资基金基金合同修改对照明细表：

序号 1

基金的基本情况-基金投资范围

原条款：	现条款：
“（2）权益类金融产品：沪深 A 股股票（含网上新股申购、科创板股票）、港股通标的范围内的证券、交易所上市的股票型和混合型基金（含交易所上市的封闭式及开放式证券投资基金、LOF、ETF 基金、分级基金）” “（4）金融衍生品：仅限于股指期货、国债期货。”	“（2）权益类金融产品：沪深 A 股股票（含网上新股申购、科创板股票）、港股通标的范围内的证券、交易所上市的股票型和混合型基金（含交易所上市的封闭式及开放式证券投资基金、LOF、ETF 基金、分级基金）、融资融券” “（4）金融衍生品：仅限于股指期货、国债期货、以券商（中信证券、国泰君安、广发证券、海通证券、申万宏源、华泰证券、招商证券、银河证券、中金公司、国信证券、东方证券、中信建投、光大证券、兴业证券、平安证券、中泰证券、方正证券、安信证券）为交易对手的收益互换。”

序号 2

基金的基本情况-业绩报酬计算方式

原条款：	现条款：
------	------

“基金管理人提取全部收益部分的 20% 作为业绩报酬。 本私募基金于开放期内基金委托人基金申购或赎回申请的净值确认日、收益分配日及终止日进行业绩报酬提取（临时开放期不提取业绩报酬）。 业绩报酬的计算公式为： 某一开放期内基金委托人基金申购或赎回申请的净值确认日、收益分配日或本基金终止日当日应计提基金管理人业绩报酬 $= \max \{ (X - Y) \times 20\% \times N, 0 \}$ X 为开放期内基金委托人基金申购或赎回申请的净值确认日、收益分配日或本基金终止日当日未扣除当日应计提基金管理人业绩报酬的基金累计份额净值； Y 为历史业绩报酬提取日最高基金累计份额净值（已扣除应计提各类业绩报酬），首次计提时 Y 为 1。 N 为开放期内基金委托人基金申购或赎回申请的净值确认日、收益分配日或本基金终止日当日因赎回、收益分配、清算等因素导致基金份额变化之前的基金总份数。 基金托管人负责对计算结果进行复核。”	“本基金计提业绩报酬的基准日为基金赎回、分红、终止时（即有委托人赎回时为赎回申请净值确认日、产品分红时为权益登记日、产品清盘时为终止日，以下简称“计提基准日”）；份额登记机构在基金赎回确认日、分红确认日、基金清盘时依据基金计提基准日的份额净值计算业绩报酬。托管人不负责复核，份额登记机构应当保证业绩报酬计算过程及结果的准确性，不得损害投资者利益。 业绩报酬的计算方法：单个基金份额持有人单笔投资基金份额业绩报酬计算公式如下： $E = N \times (P1 - P0) \times 20\%$ P1=本计提基准日基金份额累计净值； P0 =投资者该笔投资上一个已成功计提业绩报酬基准日的份额累计净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额认购/申购时基金份额累计净值； E=该笔投资对应的管理人业绩报酬；赎回时赎回份额对应的业绩报酬从赎回款中扣除；分红时计提的业绩报酬从分红款中扣除且以分红款为限； N=本计提基准日持有人的基金份额（持有人不同时段参与的份额会分时段计算）；分红日提取时表示在权益登记日持有人的基金份额，赎回时或基金终止日提取的，表示赎回份额。 如果 E 为负或零，则本计提日该笔投资提取的业绩报酬为零。某计提日管理人计提的业绩报酬总额为该计提日单个基金份额持有人各笔投资业绩报酬之和。
---	---

序号 3

十一、私募基金的投资”的“（一）基金的投资”的“4、投资限制”增加

原条款:	现条款:
-	“（12）基金份额净值小于等于 1.05 元时，不得开展融资融券交易；基金份额净值大于等于 1.05 元时，融资规模不超过基金资产净值的 40%，融券本金不超过本产品基金资产净值的 30%”

序号 4

风险揭示”的“一、特殊风险揭示”增加条款

原条款:	现条款:
-	“（八）收益互换的投资风险 （1）市场风险 收益互换属于信用交易。当市场走势对投资者极端不利时，投资者的损失总额可能达到甚至超过累计提交的所有履约保障品价值总和。此外，在标的证券出现停牌、涨跌停板、暂停（或终止）上市等极端市场情况下，管理人可能无法进行交易委托。由此导致的全部损失将由投资者自行承担。 （2）流动性风险 由于标的证券流动性不足或停牌、涨跌停板等事件的影响，在初始交易、提前终止和到期终止时，可能面临不能在预计时间内和期望价格上对标的证券进行建仓或变现的风险。 （3）证券公司被暂停或终止收益互换交易权限的风险 当证券公司出现可能导致公司被暂停或终止业务权限的情形时，或被中国证监会或其他监管

	部门暂停或终止收益互换交易时，证券公司可能提前终止所有的收益互换，管理人面临被动提前终止的风险，由此可能影响投资者的投资者计划的投资收益。 （4）交易对手风险 本私募证券投资基金与证券公司开展收益互换交易时，存在交易对手出现破产、违约、拒绝支付到期本金及利息的风险；本私募证券投资基金可能需要通过金融产品份额转让等方式将所投资的金融产品变现，在这一过程中，可能无法找到合适的交易对手或出现交易对手未能履行合约等情形，导致私募证券投资基金面临收益难以兑付甚至本金全部损失等风险。 （九）业绩报酬计算方式修改的风险 业绩报酬计算方式修改可能对新加入的委托人造成不利影响。”
--	---

本次合同变更条款自 2020 年 2 月 25 日生效。

我公司承诺合同变更生效后将根据法律法规、中国证监会和基金业协会的要求及时履行报告义务以及向投资者披露。特此通知。

特此通知。

上海盘京投资管理中心（有限合伙）

2020 年 2 月 24 日

