

关于盘京盛信 10 期私募证券投资基金

基金合同变更的情况说明

招商证券托管部：

上海盘京投资管理中心（有限合伙）（以下简称“我公司”）作为“盘京盛信 10 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（全体投资人均签署纸板补充协议），征得所有基金份额持有人的同意。我公司承诺**所有 91 位**基金份额持有人均知晓本合同变更事项。

投资人列表如下：

投资人姓名	基金份额持有人意见
蔡莉莉	同意
陈洁	同意
陈金明	同意
陈丽君	同意
陈雪芳	同意
陈异德	同意
陈振华	同意
程光明	同意
戴学军	同意
董忆雯	同意

范坚刚	同意
顾红	同意
顾勤杰	同意
顾雁飞	同意
郭林林	同意
郭鹏	同意
韩钧	同意
贺峰波	同意
洪磊	同意
洪晓霞	同意
洪小燕	同意
胡艳	同意
胡燕	同意
黄建仁	同意
姜晓慧	同意
解慧	同意
金一平	同意
金志强	同意
景振新	同意
来和凤	同意
李爱英	同意
李狄	同意

李建新	同意
梁丽琴	同意
梁文海	同意
刘磊	同意
刘小妹	同意
楼晓红	同意
陆采森	同意
陆昌元	同意
陆持真	同意
陆云华	同意
吕晖	同意
马建琴	同意
梅蓓蕾	同意
倪阿二	同意
倪群	同意
倪喜乐	同意
钱于迁	同意
任健	同意
邵岗	同意
沈加玮	同意
沈军	同意
沈晓东	同意

（中
山
大
学
）

孙文彪	同意
王结义	同意
王磊	同意
王燕飞	同意
王月芳	同意
温凯	同意
闻亮	同意
吴莉华	同意
吴艺楠	同意
吴玉华	同意
熊汉良	同意
徐长根	同意
徐成	同意
徐春香	同意
徐丽明	同意
严波	同意
杨小兰	同意
杨肖军	同意
杨燕娟	同意
杨韵	同意
姚春元	同意
姚燕	同意

于霞	同意
詹乐斌	同意
张铭	同意
张顺芳	同意
张顺利	同意
赵关祥	同意
赵洁	同意
郑祖平	同意
周海滨	同意
周虎根	同意
朱建新	同意
朱靓	同意
诸金富	同意
邬一磊	同意
嵇东	同意
合计投资人总数	91

合同变更条款具体如下：

序号 1

增加条款：
关于本基金投资全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票的特别说明
尊敬的投资者：
本基金可能会投资于全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票，由于全国中小企业股份转让系统本身存在较大的流动性风险，日间交易不活跃，因此

会面临估值不公允且无法及时变现的风险。

本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票按成本计算不得超过本基金资产总值的 20%，投资者的申购申请和赎回申请按照基金单位净值进行确认，因此可能会面临申购和赎回价格偏离实际价格的风险。

（本基金可以以本基金的总资产为限参与全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票发行申购，如因参与获配导致投资比例超出本合同约定的，管理人应在可变现前提下的 10 个交易日内调整至符合合同约定）

1、全国中小企业股份转让系统挂牌的股票估值方法如下：

在全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票，以其估值日的收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，由管理人出具估值意见说明函，调整最近交易市价，确定证券估值价格；挂牌后未交易的股票按持有成本估值。

如果未来监管机构或行业协会等出台关于全国中小企业股份转让系统挂牌上市交易股票的统一的估值标准或方法，则参照新的标准或方法。

2、投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的特定风险如下：

（1）公司风险：全国中小企业股份转让系统挂牌企业具有规模较小，对单一技术依赖度较高，受技术更新换代影响较大；对核心技术人员依赖度较高；客户集中度高，议价能力不强等特点。企业抗市场风险和行业风险的能力较弱，业务收入可能波动较大。同时，每个在全国中小企业股份转让系统挂牌企业获得的相关政策扶持也有一定的差异，政策持续性具有不确定性，对企业中长期发展会有一定程度的影响。

（2）流动性风险：全国中小企业股份转让系统挂牌的股票本身存在较大的流动性风险，特别是基础层、创新层股票日间交易不活跃，变现时间较长。且与上市公司相比，全国中小企业股份转让系统挂牌企业股权相对集中，市场整体流动性低于沪深证券交易所。可能存在建仓时间较长，并在投资后，不能及时变现的风险。

（3）信息风险：全国中小企业股份转让系统挂牌企业信息披露要求和标准低于上市公司，存在无法及时、准确获取全国中小企业股份转让系统挂牌企业最新经营信息和财务信息的风险。

（4）收盘价未能真实反映公允价格以及价格波幅较大的风险：目前全国中小企业股份

转让系统的股票，除精选层采取连续竞价配合开、收盘集合竞价方式以外，基础层、创新层依然采取做市交易方式或集合竞价交易方式之一进行交易，交易量相对于主板市场而言较小，且涨跌幅限制大于沪深证券交易所上市交易的股票，容易导致其价格显著偏离其内在价值，存在收盘价未能真实反映公允价格以及价格波幅较大而导致亏损的风险。

签署本合同投资者同意上述投资安排并知晓相关估值方法、投资风险及流动性风险。

[为充分提示风险，提请投资者将本段抄录在后。]

本人 / 本机构作为投资者已详阅并充分理解本基金合同关于投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的风险及本特别说明，并自愿承担由上述内容引致的全部后果。

投资者抄录：

本人 / 本机构作为投资者已_____本基金合同关于投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的风险及本特别说明，并_____由上述内容引致的全部后果。

基金投资者（自然人）

（签字）

或：基金投资者（机构）

（加盖公章并由法定代表人/负责人或授权代表签字）

日期： 年 月 日

序号 2

十一、基金的投资

原条款:	现条款:
(三) 投资范围: 本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券(包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券、国债、央行票据、中期票据等)、沪深交易所上市交易的存托凭证、优先股、证券回购、存款、货币市场基金、公开募集证券投资基金(包括分级B)、期货、场内期权、在交易所或银行间发行的资产支持证券、证券公司收益凭证。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购,也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司、收益互换(含跨境收益互换)与场外期权(在监管部门允许的前提下,仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手)。	(三) 投资范围: 本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券(包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券、国债、央行票据、中期票据等)、沪深交易所上市交易的存托凭证、优先股、证券回购、存款、货币市场基金、公开募集证券投资基金(包括分级B)、期货、场内期权、在交易所或银行间发行的资产支持证券、证券公司收益凭证。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购,也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司、收益互换(含跨境收益互换)与场外期权(在监管部门允许的前提下,仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手)、全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票。
原条款:	现条款:
(五) 投资限制 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	(五) 投资限制 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 30%； 3、期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 15%； 买入和卖出期权的合约价值（轧差计算）不得超过基金资产净值的 30%； 4、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 20%； 5、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）、场内期权（轧差计算）、融资融券（轧差计算）、权益类（股票和混合型）公募基金市值合计为基金资产净值的-50%~150%； 6、本基金持有的沪港通、深港通，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%； 7、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； 8、本基金参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券发行申购时，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； 9、每个交易日日终，本基金总资产占基金净资产的比例不超过 200%； 10、不得主动投资于 S、ST、*ST、S*ST 及 SST 类股票，如果被动持有，须在可交易的前提下 10 个交易日内调整完毕	一股票的市值，不得超过基金资产净值的 30%； 3、期权合约支付和收取的权利金总额不得超过基金资产净值的 15%； 买入和卖出期权的合约价值（轧差计算）不得超过基金资产净值的 30%； 4、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 20%； 5、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）、场内期权（轧差计算）、融资融券（轧差计算）、权益类（股票和混合型）公募基金市值合计为基金资产净值的-50%~150%； 6、本基金持有的沪港通、深港通，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%； 7、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； 8、本基金参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券发行申购时，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量； 9、每个交易日日终，本基金总资产占基金净资产的比例不超过 200%； 10、不得主动投资于 S、ST、*ST、S*ST 及 SST 类股票，如果被动持有，须在可交易的前提下 10 个交易日内调整完毕
---	---

11、本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-100%。 12、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。	11、本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-100%。 12、本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票按成本计算不得超过本基金资产总值的 20% (本基金可以以本基金的总资产为限参与全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票发行申购，如因参与获配导致投资比例超出本合同约定的，管理人应在可变现前提下的 10 个交易日内调整至符合合同约定)； 13、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。
---	---

序号 3

十五、越权交易

原条款：	现条款：
(三) 基金托管人对基金管理人越权交易的监督 1、基金托管人对基金管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项如下： (1) 本基金的投资范围： 本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券、国债、央行票据、中期票据等）、沪深交易所上市交易的存托凭证、优先股、证券回购、存款、货币市场基金、公开募集证券投资基金（包括分级 B）、期货、场内期权、在交易所或银	(三) 基金托管人对基金管理人越权交易的监督 1、基金托管人对基金管理人的越权交易行使监督权，具体投资监督事项如下： (1) 本基金的投资范围： 本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券、国债、央行票据、中期票据等）、沪深交易所上市交易的存托凭证、优先股、证券回购、存款、货币市场基金、公开募集证券投资基金（包括分级 B）、期货、场内期权、在交易所或银

行间发行的资产支持证券、证券公司收益凭证。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司、收益互换（含跨境收益互换）与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）。 （2）本基金的投资限制： 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30%； 3）期权合约支付和收取的权利金总额不超过基金资产净值的15%；买入和卖出期权的合约价值（轧差计算）不超过基金资产净值的30%； 4）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20%； 5）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）、场内期权（轧差计算）、融资融券（轧差计算）、权益类（股票和混合型）公募基金市值合计为基金资产净值的-50%~150%； 6）本基金持有的沪港通、深港通，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	行间发行的资产支持证券、证券公司收益凭证。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司、收益互换（含跨境收益互换）与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）、全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票。 （2）本基金的投资限制： 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30%； 3）期权合约支付和收取的权利金总额不超过基金资产净值的15%；买入和卖出期权的合约价值（轧差计算）不超过基金资产净值的30%； 4）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20%； 5）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）、场内期权（轧差计算）、融资融券（轧差计算）、权益类（股票和混合型）公募基金市值合计为基金资产净值的-50%~150%； 6）本基金持有的沪港通、深港通，依市价计算，合计不得超过基金资产净值的50%，
---	--

净值的 30%; 7) 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; 8) 本基金参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券发行申购时, 所申报的金额不得超过本基金的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量; 9) 每个交易日日终, 本基金总资产占基金净资产的比例不超过 200%; 10) 不得主动投资于 S、ST、*ST、S*ST 及 SST 类股票, 如果被动持有, 须在可交易的前提下 10 个交易日内调整完毕 11) 本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-100%。 12) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。	且单个标的依市值计算, 不得超过基金资产净值的 30%; 7) 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; 8) 本基金参与股票、债券、可转换公司债券、可交换公司债券发行申购时, 所申报的金额不得超过本基金的总资产, 所申报的数量不得超过拟发行公司本次发行的总量; 9) 每个交易日日终, 本基金总资产占基金净资产的比例不超过 200%; 10) 不得主动投资于 S、ST、*ST、S*ST 及 SST 类股票, 如果被动持有, 须在可交易的前提下 10 个交易日内调整完毕; 11) 本基金投资于沪深交易所上市交易的存托凭证按市值计算占基金资产总值的比例为 0%-100%; 12) 本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票按成本计算不得超过本基金资产总值的 20% (本基金可以以本基金的总资产为限参与全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票发行申购, 如因参与获配导致投资比例超出本合同约定的, 管理人应在可变现前提下的 10 个交易日内调整至符合合同约定); 13) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。
--	---

序号 4

十六、基金财产的估值和会计核算

增加条款：

(12) 在全国中小企业股份转让系统挂牌交易的股票，以其估值日的收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大变化的，以最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后发生了影响公允价值计量的重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，由管理人出具估值意见说明函，调整最近交易市价，确定证券估值价格；挂牌后未交易的股票按持有成本估值。

如果未来监管机构或行业协会等出台关于全国中小企业股份转让系统挂牌上市交易股票的统一的估值标准或方法，则参照新的标准或方法。

序号 5

二十、风险揭示

增加条款：

16、投资全国中小企业股份转让系统挂牌股票的特定风险（如有）

(1) 公司风险：全国中小企业股份转让系统挂牌企业具有规模较小，对单一技术依赖度较高，受技术更新换代影响较大；对核心技术人员依赖度较高；客户集中度高，议价能力不强等特点。企业抗市场风险和行业风险的能力较弱，业务收入可能波动较大。同时，每个在全国中小企业股份转让系统挂牌企业获得的相关政策扶持也有一定的差异，政策持续性具有不确定性，对企业中长期发展会有一定程度的影响。

(2) 流动性风险：全国中小企业股份转让系统挂牌的股票本身存在较大的流动性风险，特别是基础层、创新层股票日间交易不活跃，变现时间较长。且与上市公司相比，全国中小企业股份转让系统挂牌企业股权相对集中，市场整体流动性低于沪深证券交易所。可能存在建仓时间较长，并在投资后，不能及时变现的风险。

(3) 信息风险：全国中小企业股份转让系统挂牌企业信息披露要求和标准低于上市公司，存在无法及时、准确获取全国中小企业股份转让系统挂牌企业最新经营信息和财务信息的风险。

(4) 收盘价未能真实反映公允价格以及价格波幅较大的风险：目前全国中小企业股份转让系统的股票，除精选层采取连续竞价配合开、收盘集合竞价方式以外，基础层、创新层依然采取做市交易方式或集合竞价交易方式之一进行交易，交易量相对于主板市场而言较小，且涨跌幅限制大于沪深证券交易所上市交易的股票，容易导致其价格显著偏离其内在价

值，存在收盘价未能真实反映公允价格以及价格波幅较大而导致亏损的风险。

本次合同变更条款自 2020 年 7 月 30 日生效。

若由于管理人与基金份额持有人就合同变更条款产生法律纠纷，托管人不承担任何责任。

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。

我公司承诺本次合同变更生效后，后续新投资人将签署（202001 版）基金合同，（202001 版）基金合同将会在基金合同中就本次变更条款直接调整；如新投资人签署（202001 版）补充协议变更生效前的基金合同，需另行签订（202001 版）补充协议。

因新投资人签署合同或补充协议版本与实际不符而导致的损失，托管人不承担责任。

特此通知。

上海盘京投资管理中心（有限合伙）

2020 年 7 月 30 日

