

关于盛信 1 期私募证券投资基金主基金变更投资范围及投资限制的通知函

尊敬的委托人、中信证券股份有限公司：

盛信 1 期私募证券投资基金 1 号（产品代码：SN8266）、盛信 1 期私募证券投资基金 2 号（产品代码：SN8271）、盛信 1 期私募证券投资基金 3 号（产品代码：SN8309）、盛信 1 期私募证券投资基金 4 号（产品代码：SN8310）、盛信 1 期私募证券投资基金 5 号（产品代码：SN8311）、盛信 1 期私募证券投资基金 6 号（产品代码：SN8312）主要投资于“盛信 1 期私募证券投资基金主基金”（产品代码：SN8444，以下简称“标的基金”），标的基金按照标的基金合同变更程序拟进行如下变更：

1、自本次标的基金合同变更执行日起，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（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、自本次标的基金合同变更执行日起，《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：

“（23）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、《基金合同》第十二部分第（二）条第一自然段约定如下：

“本基金的投资范围为：证券交易所交易的股票、新股申购（包括网上和网下申购）、存托凭证（DR）、新三板精选层挂牌公司股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债券等）、中信证券股份有限公司发行的收益凭证、公募基金（含公募专户）、由证券公司、基金公司、保险、期货公司发行的资产管理计划、债券回购、货币市场工具、参与融资融券、将持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司、沪港通、深港通、金融衍生工具（包括但不限于股指期货、商品期货，个股期权、股指期权，以具有相应业务资格的机构做交易对手的收益互换、跨境收益互换、场外期权、间接投资境内境外二级市场股票等）、金融监管部门批准的跨境投资金融工具、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。”

自本次标的基金合同变更执行日起，上述内容变更如下：

“本基金的投资范围为：证券交易所交易的股票、新股申购（包括网上和网下申购）、存托凭证（DR）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债券等）、中信证券股份有限公司发行的收益凭证、公募基金、债券回购、货币市场工具、参与融资融券、将持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司、沪港通、深港通、金融衍生工具（包括但不限于股指期货、商品期货，个股期权、股指期权，以具有相应业务资格的机构做交易对手的收益互换、跨境收益互换、场外期权、间接投资境内境外二级市场股票等）、金融监管部门批准的跨境投资金融工具、以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。”

4、《基金合同》第十二部分第（四）条第 8、9、11、12 款约定如下：

“8、本基金持有的单个由证券、公募基金（含专户）、保险、期货公司发行的资产管理计划不超过本基金资产净值的 50%；本基金持有的单个公募专户以及单个公募基金规模不超过本基金资产净值的 50%。（此指标由基金管理人负责监控，基金托管人不负责监控。）

9、本基金投资的私募投资基金（包括有限合伙）必须有托管机构；

11、本基金投资新三板精选层挂牌公司股票的【市值】不超过基金资产净值的【10】%；

12、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家新三板精选层挂牌公司发行的股票，不超过该新三板精选层挂牌公司股票总股本的【10】%。（此指标由基金管理人负责监控，基金托管人不负责监控。）；”

自本次标的基金合同变更执行日起，上述内容变更如下，所有序号依次顺延：

“9、本基金投资全部北交所股票的【市值】不超过基金资产净值的【10】%；

10、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一只北交所的股票，不超过该股票总股本的【10】%。（此指标由基金管理人负责监控，基金托管人不负责监控。）；”

5、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。

6、自本次标的基金合同变更执行日起，在《基金合同》中第二十七部分增加如下约定：

“或有事件：基金托管人获得监管机构批复或核准可以独资或者控股的具有独立法人资格的子公司（“托管子公司”）从事托管业务。

基金管理人、基金委托人皆同意，如果或有事件发生，基金托管人有权单方在基金托管人网站以公告通知的方式将本合同中应由基金托管人享有的权利和承担的义务概括转让给托管子公司。自该等公告通知载明的指定时间（含）起，上述概括转让被视为自动完成，本合同项下托管人变更为托管子公司，各方无须就此另行签订协议。

基金托管人保证托管子公司具备开展此项业务的相关资格和能力。”

7、自本次标的基金合同变更执行日起，在《基金合同》中第二十三部分第（一）条第 4 款约定中增加：

“若本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，基金管理人应设置临时开放日允许不接受该等变更事项的基金委托人进行赎回。对于是否属于管理人应设置或有权设置临时开放日的任何情形，由管理人自行负责判断和具体执行，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。”

我司特向基金委托人、托管人和从基金代销机构发送本变更通知函。

标的基金投资范围及投资限制变更生效日为【2024】年【09】月【19】日，本次变更允许赎回的开放日为【2024】年【09】月【18】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。

我司承诺本投资范围及投资限制变更通知函将按照合同的约定通知至基金委托人；产品的实际投向不违反合同约定，并履行登记备案等法律法规以及金融监督管理部门规定的程序。

上述内容，敬请知悉。

上海盘京投资管理中心（有限合伙）
2024年9月11日



三