

# 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（基金托管人）：

盛信 1 期私募证券投资基金 9 号主要投资于盛信 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、标的基金**增加**以下投资品种：

“新三板精选层挂牌公司股票”

变更后标的基金的投资范围内容为：

“本基金的投资范围为：国内依法发行上市的股票及其他经中国证监会核准上市的股票、新股申购（包括网上和网下申购）、**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，以中信证券股份有限公司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。”

2、标的基金**增加**以下投资限制：

“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。）”

变更后标的基金的投资限制内容为：

“（四）投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、以市值计算，本基金持有单一公司股票不超过基金资产总值的 30%，持



有一家上市公司所发行的股票合计不得超过该上市公司总股本的 4.99%，同时持有单一上市公司股票不得超过其流通股本的 10%。本基金持有的沪港通和深港通标的范围内的港股，依买入成本与市价孰低计算，不得超过基金资产净值的 30%。

2、本基金可以购买\*ST、ST 公司股票；购买单个\*ST、ST 公司股票，依买入成本计算，不得超过基金资产净值的 5%；持有的所有\*ST、ST 公司股票，依买入成本计算，不得超过基金资产净值的 10%。

3、本基金持有的权益类资产（股票（市值）、股票期货合约价值（轧差计算）、融资融券（轧差计算）、证券投资类基金）合计为基金资产净值的 0~100%。（此指标由基金管理人负责监控，基金托管人不负责监控。）

4、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。

5、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 10%。

6、本基金持有的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%。卖出期权的合约价值不超过基金资产净值。（此指标由基金管理人负责监控，基金托管人不负责监控。）

基金管理人与托管人、行政服务机构需协商一致，并至少在期权实际交易日 5 个工作日前在基金管理人官方网站正式公告，方可进行期权交易，并对基金合同相关条款进行必要的修改。

7、涉及收益互换、跨境收益互换的交易对手仅限中信证券股份有限公司。收益互换、跨境收益互换的合约价值（轧差计算）为基金资产净值的-30%-130%。收益互换、跨境收益互换的名义本金额（按照互换标的买入时的成本）不超过基金资产净值的 30%。初始杠杆比率不超过 2 倍（含）。收益互换、跨境收益互换的单个标的名义本金累计不超过基金净资产的 20%。（此指标由基金管理人负责监控，基金托管人不负责监控。）

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；

10、本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过 200%；

**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。）**

13、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

基金管理人自本基金成立之日起 6 个月内使本基金的投资组合比例符合前款约定。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例的，基金管理人在 10 个交易日内调整完毕。如因证券暂停交易或其他非基金管理人可以控制的原因导致基金管



理人不能履行调整义务的，则不受上款约定之限制，但基金管理人应当自证券恢复交易之日起的 10 个交易日内使本基金的投资组合比例符合上款约定。法律法规另有规定的从其规定。”

我司特向基金委托人和托管人发送本变更通知函。

标的基金投资范围及投资限制变更生效日为【2020】年【09】月【17】日，本次变更允许赎回的开放日为【2020】年【09】月【16】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）

2020年08月31日

有限合伙