

关于盛信 6 期私募证券投资基金 2 号基金
所投标的基金变更投资范围及投资限制的通知函
(更新)

尊敬的委托人、中信证券股份有限公司（基金托管人）：

盛信 6 期私募证券投资基金 2 号基金（以下简称本基金）主要投资于盛信 6 期私募证券投资基金（产品代码 SX5016，以下简称“标的基金”），标的基金按照标的基金合同变更程序进行了变更，且相关变更事项已于【2020】年【9】月【4】日生效，现就该次变更相关内容更新如下：

1、标的基金投资范围进行了变更：

变更前标的基金的投资范围内容为：

“本基金主要投资于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）、债券（包括国债、金融债、央行票据、可转换债券等）、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、证券公司发行的收益凭证、公开募集的证券投资基金、货币市场工具、港股通（包括沪港通和深港通）、交易所上市交易股指期货、股票期权，以具有相应业务资格的机构做交易对手的收益互换、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。”

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（包括科创板、中小板、创业板以及其他依法发行上市的股票）、新股申购（包括网上和网下申购）、沪深交易所上市公司非公开发行股票（即定向增发股票）、全国中小企业股份转让系统挂牌的证券品种、沪港通、深港通、存托凭证（DR）、股票型公募基金、混合型公募基金、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、债券、债券逆回购、债券型公募基金、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款和其他银行存款）、同业存单、大额可转让定期存单、货币市场基金、交易所上市交易的衍生品（包括权证、期货和期权），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，利率互换，证券公司发行的收益凭证，法律法规或中国证监会允许基金投资的其他投资品种。”

2、标的基金投资限制进行了变更：

变更前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、本基金持有的单只股票市值占基金资产净值的比例不超过 30%；
- 2、本基金不得投资于 S、ST、*ST、S*ST、SST 股票，如被动持有需在 10 个交易日



内减持完毕；

- 3、本基金持有的单只股票不超过该股票流通股本的 10%，且不超过总股本的 4.9%；
- 4、本基金不得参与定向增发；
- 5、本基金禁止投资于分级基金 B 份额；
- 6、本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过 150%；
- 7、当基金份额净值大于 1.000 元时，期权账户总权益不超过基金资产净值的【10】%；
- 8、当基金份额净值大于 0.900 元，小于等于 1.000 元时，期权账户总权益不超过基金资产净值的【5】%；
- 9、当基金份额净值小于等于 0.900 元时，期权账户总权益不超过基金资产净值的【0】%；
- 10、本基金不得投资于私募投资基金（包括有限合伙），基金公司子公司、期货公司、证券公司及信托公司管理/发行的资管计划、信托计划等；
- 11、本基金投资于债权类资产的投资比例为 0-80%；本基金投资于权益类资产的投资比例为 0-80%；本基金投资于商品及金融衍生品类资产的投资比例为 0-80%；（基金委托人已经知晓且确认：本条投资限制由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责）
- 12、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

基金委托人已经知晓且确认：以上第【7、8、9、11】项投资限制由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。

以上投资限制中，如涉及新股、新债申购的申报金额与数量、盘中监控、交易策略类等监控事项的，由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。

基金管理人自本补充协议执行之日起【6】个月内使本基金的投资组合比例符合上款约定。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。”

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、本基金持有的单只股票市值占基金资产净值的比例不超过 30%；
- 2、本基金禁止投资 S、ST、*ST、SST、S*ST 股票；
- 3、本基金持有的单只股票不超过该股票流通股本的 10%，且不超过总股本的 4.9%；
- 4、本基金投资于沪深交易所的流通受限股票的成本市值孰低占基金资产总值的比

例不超过【30】%

5、本基金投资于全国中小企业股份转让系统挂牌的证券品种的成本市值孰低占基金资产总值的比例不超过【20】%；

6、本基金投资的债券逆回购仅限以下品种:GC001、GC002、GC003、GC007、R-001和R-002；

7、本基金持有的场外衍生品规模（包括收益凭证、场外期权、收益互换及跨境收益互换等）按市值计算不得超过基金资产净值的100%；

8、本基金禁止投资于分级基金B份额；

9、本基金的基金资产总值占基金资产净值的比例不得超过150%；

10、当基金份额净值大于1.000元时，期权账户总权益不超过基金资产净值的【10】%；

11、当基金份额净值大于0.900元，小于等于1.000元时，期权账户总权益不超过基金资产净值的【5】%；

12、当基金份额净值小于等于0.900元时，期权账户总权益不超过基金资产净值的【0】%；

13、本基金不得投资于私募投资基金（包括有限合伙），基金公司子公司、期货公司、证券公司及信托公司管理/发行的资管计划、信托计划；

14、本基金投资于债权类资产的投资比例为0-80%；本基金投资于权益类资产的投资比例为0-100%；本基金投资于商品及金融衍生品类资产的投资比例为0-80%；

15、如被动持有S、ST、*ST、SST、S*ST股票，需在10个交易日内减持完毕；

16、法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

基金委托人已经知晓且确认：以上第【5、6、7、10、11、12、14、15】项投资限制由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。

以上投资限制中，如涉及新股、新债申购的申报金额与数量、盘中监控、交易策略类等监控事项的，由基金管理人自行监控，基金托管人不承担投资监督职责。

基金管理人自《盛信6期私募证券投资基金基金合同之补充协议二》执行之日起【6】个月内使本基金的投资组合比例符合上款约定。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。”

根据盛信6期私募证券投资基金2号基金基金合同以下约定：

“若本合同第十二部分第（十二）条所述【盛信6期私募证券投资基金】合同条款发生变更的，基金管理人应以传真、电话、短信、邮件、信件等任一方式一对一地发送关于【盛信6期私募证券投资基金】合同条款变更通知函（以下简称“通知函”）告知

基金委托人，并以书面形式通知托管人。管理人须在通知函中载明【盛信6期私募证券投资基金】合同条款变更生效日和本基金允许赎回的开放日。基金管理人须在【盛信6期私募证券投资基金】合同条款变更生效日之前为本基金委托人设置临时开放日（通知函发出之日起至变更生效日期间有允许赎回的固定开放日的除外，该等临时开放日不受本合同约定的临时开放日次数的限制），允许本基金委托人赎回本基金份额；未在变更生效日前全部赎回份额的本基金委托人视为接受前述变更。因本条项下事由的赎回申请，不受本基金合同关于份额锁定期（若有）、封闭期（若有）和巨额赎回（若有）的限制，但适用于基金合同关于“暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”的约定，该产品的变更事项自通知函中载明的变更生效日起生效。

若【盛信6期私募证券投资基金】合同条款进行本条第一款约定之外的其他变更，全体委托人特别授权本基金管理人有权代表本基金所有委托人确定是否接受该产品变更或从该产品中赎回全部基金份额。”

标的基金投资范围及投资限制的变更事项已经生效（生效日为【2020】年【9】月【4】日），我司已于生效之前就变更事项履行了上述通知程序（包括但不限于向委托人和托管人发送通知函、设置赎回开放日供不同意变更的委托人进行赎回等）。

为了向基金委托人详细展示标的基金该次变更的内容（包括投资范围和投资限制的变更），我司特向基金委托人和托管人发送本变更通知函。本通知函仅针对标的基金变更后的投资范围和投资限制的相关约定进行了更新。

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）

2021年12月8日

