

# 关于《关于鹏华基金稳赢 1 号集合资产管理计划投资限制的确认函》的通告

尊敬的资产委托人：

根据《鹏华基金稳赢 1 号集合资产管理计划资产管理合同》（以下简称“本合同”），我司拟设立鹏华基金稳赢 1 号集合资产管理计划（以下简称“本计划”）。我司已完成本计划的内控审批、发行销售、验资、成立等工作，本计划于 2020 年 9 月 24 日成立。

现根据“关于实施《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》有关问题的通知”，经与资产托管人协商一致，我司确认本计划投资操作过程中，将严格按照法规要求遵守如下投资限制：

“1. 本计划持有同一家银行的存款不得超过本计划净值的 20%。在本计划托管账户的存款可以不受上述限制。

2. 本计划持有同一机构（政府、国际金融组织除外）发行的证券市值不得超过本计划净值的 10%。

3. 本计划持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过本计划资产净值的 10%，其中持有任一国家或地区市场的证券资产不得超过本计划资产净值的 3%。

4. 本计划不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。同一境内机构投资者管理的全部集合计划不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。

前项投资比例限制应当合并计算同一机构境内外上市的总股本，同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券，并假设对持有的股本权证行使转换。

5. 本计划持有非流动性资产市值不得超过本计划净值的 10%。

前项非流动性资产是指法律或集合计划合同规定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

6. 本计划持有境外基金的市值合计不得超过本计划净值的 10%。持有货币市场基金可以不受上述限制。

7. 同一境内机构投资者管理的全部集合计划持有任何一只境外基金，不得超过该境外基金总份额的 20%。

本计划超过上述投资比例限制，应当在超过比例后 30 个工作日内采用合理的商业措施减仓以符合投资比例限制要求。

中国证监会根据证券市场发展情况或基金、集合计划具体个案，可以调整上述投资比例。”

上述投资限制与本合同约定不符的，应以上述投资限制为准；上述投资限制未尽事项，应以本合同的约定为准。

特此通告。

  
鹏华基金管理有限公司  
二〇二〇年十月三日