

上海市天宸股份有限公司 关于认购私募基金份额的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

重要内容提示：

- 投资标的名称：诚正远景 1 号私募证券投资基金
- 投资金额：2,000 万人民币
- 风险提示：

1、标的基金在运营过程中可能存在程度不等的风险，包括但不限于资金损失风险、运营风险、流动性风险、投资风险及其他风险。

2、标的基金已于 2022 年 3 月 29 日在中国证券投资基金业协会完成备案，备案编码：STW514。

一、本次投资概述

近日，上海市天宸股份有限公司（以下简称“公司”或“基金委托人”）拟以自有资金人民币 2,000 万元认购上海诚正私募基金管理有限公司（以下简称“诚正公司”或“基金管理人”）发行的诚正远景 1 号私募证券投资基金（以下简称“本基金”或“私募基金”）的份额，并与其签订了相关合同。

该私募基金已于 2022 年 3 月 29 日在中国证券投资基金业协会完成备案，备案编码：STW514。

本次认购事项属于《公司总经理工作细则》中的公司总经理审批权限范围内，无需提交公司董事会或股东大会审议。本次认购事项不

涉及关联交易，也不构成《上市公司重大资产重组管理办法》所规定的重大资产重组。

二、投资主体的基本情况

（一）基金管理人基本情况

- 1、公司名称：上海诚正私募基金管理有限公司
- 2、注册地址：上海市金山区漕泾镇中一西路 12-2 号三层 2225 室
- 3、注册资本：人民币 1000 万元
- 4、成立日期：2021 年 10 月 13 日
- 5、公司类型：有限责任公司(自然人投资或控股)
- 6、法定代表人：王昕晨
- 7、经营范围：一般项目：私募证券投资基金管理服务（须在中国证券投资基金业协会完成登记备案后方可从事经营活动）（除依法须经批准的项目外，凭营业执照依法自主开展经营活动）。
- 8、股权结构：王昕晨持股 70%，王晓华持股 30%。
- 9、主要财务数据：总资产 2,197,175.42 元、净资产 2,039,522.14 元、营业收入 0 元、净利润-460,477.86 元。（上述为 2021 年度未经审计数据）
- 10、私募基金管理人备案号：P1073036

（二）基金托管人

- 公司名称：中信证券股份有限公司
- 法定代表人：张佑君
- 注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座
- 注册资本：1,292,677.6029 万(元)

成立日期：1995 年 10 月 25 日

公司类型：股份有限公司(上市)

经营范围：一般经营项目是：，许可经营项目是：证券经纪（限山东省、河南省、浙江省天台县、浙江省苍南县以外区域）；证券投资咨询；与证券交易、证券投资活动有关的财务顾问；证券承销与保荐；证券自营；证券资产管理；融资融券；证券投资基金代销；为期货公司提供中间介绍业务；代销金融产品；股票期权做市。

3、关联关系及其他利益关系说明：

诚正公司及其股东与天宸股份不存在关联关系，不存在一致行动人关系，无直接或间接持有本公司股份，亦无增持天宸股份的计划。天宸股份的董事、监事及高级管理人员、持有公司 5%以上股份的股东、控股股东、实际控制人未在诚正公司任职，不存在相关利益安排。

三、标的基金的概况

1、基金名称：诚正远景 1 号私募证券投资基金

2、私募基金的存续期限：基金存续期限为基金成立之日起 240 个月（及延长期（若有））结束并清算完毕为止。

3、私募基金份额的初始募集面值：人民币 1.00 元。

4、私募基金的份额分类：本基金根据不同类型的委托人，分为 A 类份额和 B 类份额。管理人及其从业人员、管理人指定的投资者等特定投资者为 B 类份额的委托人，特定投资者之外的其他投资者为 A 类份额的委托人。

5、私募基金的类别：契约型非公开募集投资基金。

6、私募基金的运作方式：开放式。

7、私募基金的计划募集总额：本基金计划募集 6,000 万元，管理人有权根据实际募集情况予以调整，基金管理人应将调整情况以本

《基金合同》约定的方式之一通知已签署合同的委托人和托管人，自通知之日起本基金的计划募集总额以管理人通知的金额为准。

8、投资目标：在深入研究的基础上构建投资组合，力争实现基金资产的持续稳健增值。

9、投资范围：国内依法发行上市的股票、沪港通、深港通、存托凭证（DR）、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、债券回购（包括债券正回购和债券逆回购）、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、上海黄金交易所上市交易的现货延期交收合约品种，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、场外期权，利率互换，公开募集证券投资基金、基金公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、证券公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、信托计划、私募投资基金、资产支持证券、银行理财、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。

10、本基金投资经理由基金管理人负责指定，本基金的投资经理由王晓华先生担任。其简历如下：

王晓华，男，2003 年-2007 年 中国科学技术大学工学学士；2007 年-2012 年 中国科学院工学博士。2012 年 8 月至 2021 年 10 月就职于上海重阳投资管理股份有限公司，先后担任行业分析师、基金经理等岗位。现任管理人总经理职位。

四、协议的主要内容

公司（作为基金 A 类份额持有人）与诚正公司（作为基金管理人）签署关于《诚正远景 1 号私募证券投资基金之基金合同》（以下简称

“《基金合同》”), 主要内容如下:

1、基金管理人: 上海诚正私募基金管理有限公司

2、基金托管人: 中信证券股份有限公司

3、投资策略: 本基金使用阿尔法对冲策略, 基于对股票市场的中期波动性呈现系统性收敛和结构性发散的判断, 通过自上而下的资产配置与自下而上的权益类及固定收益类证券相结合的策略, 同时审慎、适时、灵活地运用股指期货等工具进行系统性风险的对冲操作, 以降低投资组合的波动性并获得阿尔法收益。

4、投资限制

本基金的投资组合将遵循以下限制(本基金自进入清算程序后无需遵循以下投资比例限制): (1) 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; (2) 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%; (3) 本基金不得投资非证券类私募基金管理人发行的私募投资基金(包括有限合伙); (4) 法律法规或监管部门规定的其他投资限制。

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。

5、禁止行为

为维护基金委托人的合法权益, 本基金的基金管理人、基金托管人、基金销售机构及其他服务机构及其从业人员禁止从事下列行为:

(1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事投资活动; (2) 不公平地对待其管理的不同基金财产; (3) 利用基金财产或者职务之便, 为本人或者委托人以外的人牟取利益, 进行利益输送; (4) 侵占、挪用基金财产; (5) 泄露因职务便利获取的未公开信息, 利用该信息

从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；(6) 从事损害基金财产和委托人利益的投资活动；(7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；(8) 从事内幕交易、操纵交易价格及其他不正当交易活动；(9) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

6、基金托管人对基金管理人投资运作的监督

本基金托管人投资监督范围并不涵盖基金管理人全部投资管理行为，基金托管人仅根据《基金合同》第十二节“基金的投资”中对投资范围、投资限制的约定进行事后监督，其中对于投资范围和投资限制中明确由基金管理人负责监督（或控制）的条款托管人不承担监督职责，除《基金合同》明确约定由基金托管人对上述事项进行监督外，基金托管人对于其他事项不予监督，基金管理人违反相关投资目标、投资策略、投资禁止行为、风险控制、增信措施、关联交易、投资限制、预警平仓控制及嵌套层级等约定或要求的，相关责任和损失由基金管理人承担，基金托管人不承担相关责任和损失。

7、关联交易风险

若基金管理人运用基金财产进行关联交易，应当建立防范利益输送和利益冲突等风险控制机制，并应进行充分信息披露，但仍可能存在未能完全遵循以基金份额持有人利益优先、未能完全杜绝关联方之间的利益输送、未能完全避免关联方与基金委托人之间的利益冲突、未能充分履行相关信息披露义务等相关风险。基金委托人签署本基金合同即表明其已经知晓且认可本基金可能进行上述关联交易。

8、基金的预警平仓机制

本基金预警线为 0.85 元，平仓线为 0.70 元。

当基金管理人与基金托管人核对一致的基金份额净值小于或等于预警线时，本基金触发预警机制。自该核对一致之日的下一交易日

起的三个交易日内，基金管理人以本基金合同约定方式之一通知全体委托人，提示本基金触及预警线及相关风险。当基金管理人与基金托管人核对一致的基金份额净值小于或等于平仓线时，本基金触发平仓机制。无论该核对一致之日之后的基金份额净值是否高于平仓线，基金管理人须自该核对一致之日的下一交易日起 10 个交易日内，完成对本基金持有的全部资产的不可逆变现，并按照《基金合同》约定的基金清算程序进行清算。若因本基金所持有标的流通受限或其他非基金管理人可以控制的原因导致无法变现的，变现期限可相应合理延长，但基金管理人需在前述限制情形解除后及时完成变现并进行清算。

基金预警和平仓机制的启动及操作由基金管理人负责执行，对于基金管理人按照或者未按照基金合同的约定执行，由此对基金财产或基金委托人造成的损失，基金托管人不承担任何责任。

9、费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理费

本基金的管理费从基金财产中列支，支付给基金管理人。本基金的年管理费率为 2%。

（2）业绩报酬

本基金仅针对 A 类份额计提业绩报酬，B 类份额不计提业绩报酬。

本基金 A 类份额业绩报酬按照以下方式计提：本基金业绩报酬计提基准日分为固定计提基准日、该类份额的除息日（若有）、赎回申请日和基金终止日（其中固定计提基准日和除息日（若有）统称为“统一计提基准日”），固定计提基准日为基金成立后每年 6 月、12 月的 28 号（如对应日为非工作日则顺延至下一工作日）。业绩报酬计提日

为固定计提确认日、分红确认日（若有）、赎回确认日和基金终止确认日。若某次统一计提基准日与该类份额上一个发生业绩报酬计提对应的统一计提基准日间隔期短于 3 个月时，则该次业绩报酬计提基准日及其对应的计提日不计提业绩报酬。管理人将根据委托人每笔投资的期间年化收益率（R），对期间年化收益率超过 6%以上部分按照 20% 的比例收取业绩报酬。

（3）基金托管人的托管费

本基金的年托管费率为 0.025%。

（4）基金行政服务机构的行政服务费

本基金的年行政服务费率为 0.025%。

10、收益分配

（1）基金利润的构成

基金利润指基金利息收入、投资收益、公允价值变动损益和其他收入扣除相关费用后的余额，基金已实现收益指基金利润减去公允价值变动损益后的余额。

（2）基金收益分配原则

① 在本基金存在可供分配利润的前提下，基金管理人有权决定是否对基金进行收益分配，收益分配的比例亦由基金管理人决定；

② 收益分配分为采取现金分红或红利再投资等两种方式。红利再投资是将某类份额的现金红利按照基金分红除息日的该类基金份额净值自动转为该类基金份额；

本基金默认采用红利再投资；

③ 本基金允许变更分红方式；允许变更收益分配方式的，基金委托人应当通过基金销售机构提交申请，由注册登记机构进行处理；当次分红确认的方式按照委托人在权益登记日之前最后一次选择的

分红方式为准，若未选择则按照本基金默认的分红方式执行。委托人如需修改分红方式，应于权益登记日前一工作日的交易时间结束前（即交易日 15:00 前）办理变更手续，委托人在权益登记日前一个工作日超过交易时间提交的修改分红方式的申请对本次收益分配无效，自下一次收益分配起生效；

④ 某类份额基金收益分配后对应的该类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的某类基金份额净值减去每单位该类份额收益分配金额后不能低于面值；

⑤ 同一份额类别的每一基金份额享有同等分配权；

⑥ 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 4 次；

⑦ 法律法规另有规定的，从其规定。

（3）收益分配方案

基金收益分配方案中应载明截至收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

（4）收益分配方案的确定、通知

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，由基金管理人以约定的方式告知基金份额持有人。

（5）收益分配的执行方式

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，由基金管理人以约定的方式告知基金委托人。

11、申购及赎回

（1）本基金每个自然月的 15 号和 28 号开放，接受申购和赎回申请，如对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

(2) 申购费用和赎回费用：本基金无申购费和赎回费。

五、对公司的影响及风险

1、公司在保证正常经营所需流动资金的情况下，使用自有资金认购基金份额，有利于提高自有资金的使用效益。该项投资不会影响公司主营业务的正常开展。

2、私募基金在运营过程中可能存在程度不等的风险，包括但不限于资金损失风险、运营风险、流动性风险、投资风险及其他风险。后续公司将按照上海证券交易所《股票上市规则》等有关规定，及时履行信息披露义务，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

上海市天宸股份有限公司董事会

2022年4月26日