

证券代码：603488

证券简称：展鹏科技

公告编号：2023-003

展鹏科技股份有限公司 关于认购私募基金份额的公告

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

- 私募基金管理人：上海稳博投资管理有限公司
- 投资标的名称：稳博广博中证 1000 量化多头系列 2-8 号私募证券投资基金
- 投资金额：500 万元人民币
- 本次投资不构成关联交易和重大资产重组事项
- 风险提示：目标基金无保本及最低收益承诺。目标基金存续期间，可能受到（包括但不限于）政策法规、经济环境、行业周期、市场变化、投资组合经营情况、研发及商业化不确定性在内的诸多因素影响。本次投资的投资周期较长，可能存在不能实现预期收益、不能及时有效退出等投资风险。

一、本次证券投资概况

（一）证券投资目的：

为提高资金使用效率，合理利用自有资金进行证券投资，获取较好的投资回报。

（二）资金来源：

全部为自有流动资金。

（三）证券投资产品的基本情况：

单位：万元

受托方	产品类型	产品名称	金额	预计年化收益率	预计收益金额	产品期限	收益类型	是否构成关联交易
上海稳博投资管理有限公司	私募基金产品	稳博广博中证 1000 量化多头系列 2-8 号私募证券投资基金	500	-	-	开放日后每月 25 日	浮动收益性	否

（四）公司对证券投资相关风险的内部控制

公司进行证券投资时，遵守审慎原则，选择合适的、过往业绩优良的资金管理人进行投

资。根据公司的审批结果实施具体操作，且保证不影响公司的内部正常运营。同时财务部将及时跟进证券投资资产的运作情况。

（五）本次投资不构成关联交易和重大资产重组事项，本次投资无需提请公司董事会及股东大会批准。

二、本次证券投资的具体情况

（一）证券投资合同主要条款

- 1、基金名称：稳博广博中证 1000 量化多头系列 2-8 号私募证券投资基金
- 2、合同签署日：2023 年 2 月 16 日
- 3、投资目标：本基金通过灵活应用多种投资策略，在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上，追求合理的投资回报，力争实现基金财产的长期稳健增值。

- 4、本次投资规模：500 万元人民币
- 5、投资人：包含公司在内的不超过 200 名投资者
- 6、资金来源：公司自有资金
- 7、出资进度：公司在申购时一次性全额出资
- 8、投资基金的管理模式

（1）管理及决策机制：基金为私募证券投资基金，投资于二级市场股票、债券、期货、现金管理等金融工具。

（2）管理过程中涉及主体和其职责如下：

- a) 基金份额持有人：公司以其拥有合法所有权或处分权的财产投资于基金。
- b) 基金管理人：上海稳博投资管理有限公司按照诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托人义务，管理和运用基金资产。
- c) 基金托管人：广发证券依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管基金财产。

（3）各投资人的合作地位和主要权利义务：

公司为基金投资人之一，对拥有的基金份额，享有包括但不限于以下权利：

- a) 取得委托财产按照国家法律法规规定扣除增值税、附加税等税费及其他费用后的投资净收益；
- b) 取得按照国家法律法规规定扣除增值税、附加税等税费及其他费用后清算的剩余基金财产；
- c) 按照基金合同的约定申购、赎回和转让基金份额；

- d) 按照基金合同的约定, 参加或申请召集基金份额持有人大会, 行使相关职权;
- e) 监督基金管理人、基金托管人履行投资管理和托管义务的情况;
- f) 按照基金合同约定的时间和方式获得基金的信息披露资料;
- g) 因基金管理人、基金托管人违反法律法规或基金合同的约定导致合法权益受到损害的, 有权得到赔偿; 国家有关法律法规、监管机构及基金合同规定的其他权利。

(4) 管理费或业绩报酬及利润分配安排方式:

a) 基金管理费(含托管、服务费): 1.5%, 按日计提。

b) 业绩报酬

①业绩报酬提取的时间

在基金收益分配、基金份额持有人赎回基金或者基金终止时进行业绩报酬的提取。

②基金管理人的业绩报酬

本基金业绩报酬的计算和提取采用单客户高水位法: 针对每个 A 类份额投资者单笔参与份额, 在绩报酬计提日对每笔 A 类份额的份额累计净值超过历史计提日最高份额累计净值部分, 根据一定的比例计提业绩报酬。提取比例为 20%。业绩报酬计入管理费。连续两次计提业绩报酬的间隔期不应短于 3 个月(投资者赎回或基金清算计提的业绩报酬除外)。

本基金的业绩报酬在业绩报酬计提基准日(A 类份额投资者赎回日、收益分配基准日和基金清算基准日)提取, 基金管理人按基金份额持有人的收益部分提取 20%作为业绩报酬。如基金清算时存在多次清算, 则每次清算时对该次清算基准日投资者持有的所有份额计提业绩报酬。

业绩报酬的计算:

$$A \text{ 类份额业绩报酬} = S_i \times (NAV1 - NAV0) \times 20\%$$

其中:

S_i 为基金 A 类份额持有人每笔赎回份额、或基金进行收益分配份额、或基金清算基准日所持有份额; $NAV1$ 为本业绩报酬计提基准日的基金 A 类份额累计净值;

$NAV0$ 为基金 A 类份额持有人赎回基金份额时、或基金进行收益分配时、或基金清算基准日所持有份额在上一次提取业绩报酬时的基金 A 类份额累计净值, 若该笔份额还未提取过业绩报酬, 则为该笔

份额所对应的本产品成立日(认购所得份额)或申购申请日(申购所得份额)或红利再投资基准日(红利再投资所得份额)的基金 A 类份额累计净值。

在收益分配日计提业绩报酬的, 经计算确认的业绩报酬从私募基金投资者分红金额中进

行扣减。

当分红金额不足扣减业绩报酬时，则以分红金额为限计提业绩报酬。赎回业绩报酬和清算业绩报酬分

别从对应的赎回款和清算款中扣减。在产品多次清算时，若当次清算时该笔份额清算金额不足以扣减业绩报酬，则以该笔份额清算款为限计提业绩报酬。

9、盈利模式：投资标的公允价值变动

10、投资后的退出机制：本基金开放日为封闭期后每个自然月 25 日。

（二）证券投资的投资领域

投资领域：本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的股票、债券（包括银行间债券、交易所债券、可转换债券、可交换债券）、优先股、证券回购、存款、公开募集证券投资基金、期货、场内期权、权证、证券公司收益凭证、收益互换与场外期权（在监管部门允许的前提下，仅限于证券公司及其子公司、期货公司子公司作为交易对手）。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股申购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。

本基金可投资于证券公司（含证券公司子公司）资产管理计划、期货公司（含期货子公司）资产管理计划、在基金业协会登记的私募证券投资基金管理人发行并由具有证券投资基金托管资格的机构托管或由具有相关资质的机构提供私募基金综合服务的契约式私募基金。

投资策略：中证 1000 指数增强策略。采取机器学习和多策略因子相结合的量化模型选出股票组合，力求在拟合对标指数风格的基础上，业绩持续跑赢对标的指数，除此以外，通过时间序列上股票的波动交易和横截面日内股票多空交易即 T0 交易获取超额收益。因此超额收益的主要来源是选股带来的超额收益和时序上 T0 交易。基金的最终收益来源由两部分构成，一部分是指数本身的涨跌幅；一部分是超越指数的超额收益。

除此以外，根据基金管理的需要，通过合理投资基金合同所包含的其他投资标的，取得合理的预期回报。

（三）证券投资资金的最终投向情况说明

该基金为私募证券投资基金，投资于二级市场股票、债券、期货、现金管理等金融工具。利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报，同时力求进行有效的风险控制、降低交易成本、优化投资组合。该基金通过量化交易模型进行自动交易，因此无法获得基金的具体持仓情况。

（四）风险控制分析

1、遵守审慎投资原则，严格筛选发行主体，选择信誉好、资金安全保障能力强的发行机构。

2、公司财务部及时分析和跟踪证券投资投向、进展情况，一旦发现存在可能影响公司资金安全的风因素，将及时采取保全措施，控制投资风险。

3、公司独立董事、监事会有权对公司证券投资的情况进行定期或不定期检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

4、公司董事会将根据上海证券交易所的有关规定，及时履行信息披露义务。

三、证券投资受托方的情况

（一）受托方的基本情况

名称	成立时间	法定代表人	注册资本 (万元)	主营业务	主要股东及 实际控制人	是否为 本次交 易专设
上海稳博投资管理 有限公司	2014年10月	钱晓珺	3,000	投资管理、 资产管理	殷陶、郑耀	否

（二）受托方经营情况

1、上海稳博投资管理有限公司，基金业协会登记时间为2014-10，登记编号P1029043，。2020，2021，2022年，主要针对股票期货等标准资产的量化交易，资产管理规模有较大发展。

2、最近一年又一期主要财务指标：

单位：元

项目	2021年1月1日- 2021年12月31日	2022年12月31日
资产总额	14,392,282.77	31,372,459.15
资产净额	10,192,266.31	17,852,388.82
营业收入	71,711,589.01	116,545,735.02
净利润	1,884,160.46	9,228,163.92

3、资信状况及担保情况：企业对外无担保，没有资信不良记录。

（三）以上受托方与公司、公司控股股东及实际控制人之间不存在关联关系。

（四）公司已对以上受托方、资金使用方等交易各方当事人的基本情况、信用情况及其交易履约能力等进行了必要的尽职调查，受托人符合公司证券投资的各项要求。

四、对公司的影响

公司最近一年又一期的财务情况如下：

单位：万元

项目	2021 年 1 月 1 日- 2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日- 2022 年 9 月 30 日
资产总额	116,389	115,297
负债总额	18,385	18,718
资产净额	98,003	96,579
经营活动现金流净额	5,406	4,924

公司使用闲置自有资金进行证券投资，在保证日常经营运作资金需求、有效控制投资风险的前提下进行，不会影响公司日常资金周转。通过适度投资，可以提高资金使用效率，获得一定的投资收益。

公司本次使用闲置自有资金进行证券投资金额为 500 万元，占公司最近一期期末货币资金的比例为 3%。公司最近一期期末资产负债率为 16.23%，流动比率为 4.5，无长期负债与银行贷款，公司目前每月收到的应收账款回款在与公司支出费用相抵后略有盈余，如出现超预期支出的情形，将有不受限的银行存款与承兑可迅速用于补充流动资金，因此，公司使用闲置自有资金进行证券投资对公司未来主营业务、财务状况、经营成果等不会产生重大影响。

根据新金融工具准则，公司将证券投资列示为“交易性金融资产”。

五、风险提示

目标基金无保本及最低收益承诺。目标基金存续期间，可能受到（包括但不限于）政策法规、经济环境、行业周期、市场变化、投资组合经营情况、研发及商业化不确定性在内的诸多因素影响。本次投资的投资周期较长，可能存在不能实现预期收益、不能及时有效退出等投资风险。针对主要的投资风险，公司将及时了解基金管理人的运作情况，关注投资项目实施过程，督促基金管理人防范各方面的投资风险，尽力维护公司投资资金的安全。

特此公告。

展鹏科技股份有限公司董事会

2023 年 2 月 18 日