

上海市天宸股份有限公司

以自有资金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：**百济价值成长私募证券投资基金
- **投资金额：**5,000 万人民币
- **风险提示：**

- 1、基金在运营过程中可能存在程度不同的风险，包括但不限于市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、预期投资收益不能实现风险及其他风险。
- 2、因基金管理人未履行备案手续或者私募基金不符合备案要求等原因致使基金备案失败，则将导致私募基金不能投资运作的风险。

一、对外投资概述

为充分利用公司闲置自有资金，提高公司投资收益，公司以自有资金人民币 5,000 万元认购上海百济投资管理有限公司（以下简称“百济投资”或“基金管理人”）发行的百济价值成长私募证券投资基金（以下简称“本基金”或“私募基金”）的份额。该基金尚未最终成立，基金管理人将在基金募集完毕后 20 个工作日内，按照基金

业协会相关规定履行基金备案手续。

二、投资主体的基本情况

1、基金管理人基本情况

公司名称：上海百济投资管理有限公司

注册地址：上海市崇明区长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 4503 室

注册资本：人民币 1200 万元

成立日期：2014 年 3 月 28 日

公司类型：有限责任公司(自然人投资或控股)

法定代表人：杨君谋

经营范围：投资管理，资产管理。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

持股比例：胡务持股 75%，陈文彬持股 25%。

公司近一年经营情况：总资产 11,736,901.76 元、净资产 11,449,952.93 元、营业收入 112,980.72 元、净利润-95,145.10 元。

私募基金管理人备案号：P1015108

2、基金托管人

公司名称：华泰证券股份有限公司

法定代表人：张伟

注册地址：南京市建邺区江东中路 228 号

注册资本：907,665 万(元)

成立日期：1991 年 4 月 9 日

公司类型：股份有限公司(上市)

经营范围：证券经纪业务，证券自营，证券承销业务（限承销国债、非金融企业债务融资工具、金融债（含政策性金融债）），证券投资咨询，为期货公司提供中间介绍业务，融资融券业务，代销金融产

品业务，证券投资基金代销，证券投资基金托管，黄金等贵金属现货合约代理和黄金现货合约自营业务，股票期权做市业务，中国证监会批准的其他业务。【依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动】

3、关联关系及其他利益关系说明：

百济投资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、实际控制人未在百济投资任职，不存在相关利益安排。

三、基金的基本情况

1、基金名称：百济价值成长私募证券投资基金

2、私募基金的存续期限：本基金存续期为 3 年，如本基金存续期届满最后一日为非工作日，则本基金存续期顺延至下一工作日。

3、私募基金份额的初始募集面值：本基金份额的初始发售面值为人民币 1.00 元。

4、私募基金的结构化安排

本基金设定为均等份额。除基金合同另有约定外，每份基金份额具有同等的合法权益。

5、私募基金的类型：权益类证券投资基金。

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 5,500 万元，具体以实际募集金额为准。

8、投资目标：通过灵活应用多种投资策略，在充分控制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。

9、投资方式：本基金采用直接投资方式进行投资

10、投资范围：

(1) 股票(A股、港股通)；(2) 债券(国债、地方政府债、央行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、非公开定向债务融资工具(PPN)、中小企业私募债、可转换债券、短期融资券、超短期融资券、可交换债券)；(3) 公募基金(封闭式基金、开放式基金、股票型基金、债券型基金、货币市场型基金、混合型基金)；(4) 回购(债券正回购、债券逆回购)；(5) 资产管理产品(银行理财产品、信托计划、证券公司及其子公司资产管理产品、基金公司及其子公司资产管理产品、期货公司及其子公司资产管理产品、保险公司及其子公司资产管理产品、私募证券投资基金)；(6) 其他(银行存款、权证、中国存托凭证、资产支持证券、收益互换、收益凭证、融资融券、转融通)。如本基金投资资产管理产品，基金管理人应确保所投资的资产管理产品未投资或在本基金持有期内不投资除公募证券投资基金以外的资产管理产品。

11、本基金投资经理由基金管理人负责指定。

本基金投资经理：陈文彬先生，毕业于华东政法学院香港城市大学国际经济法法学学士。2009年07月-2011年08月，任国华人寿保险股份有限公司权益投资部总经理助理；2011年08月-2013年07月，任安盛天平财产保险股份有限公司高级投资经理；2013年07月-2019年9月，国华人寿保险股份有限公司权益投资部总经理；2019年9月-至今，任上海百济投资管理有限公司首席投资官。

四、协议的主要情况

天宸股份(作为基金份额持有人)与百济投资(作为基金管理人)签署关于《百济价值成长私募证券投资基金合同》(以下简称“基金

合同”)，主要内容如下：

1、基金管理人：上海百济投资管理有限公司

2、基金托管人：华泰证券股份有限公司

3、投资策略

股票多头+策略：股票多头，高仓位，重视配置和选股，淡化择时。通过“+”三大子策略增厚收益。(1)宏观定仓位，根据大类资产配置模型设定股票仓位，变动频率低；(2)中观定行业，行业分散，但聚焦具有较大发展潜力的领域，比如金融、消费、科技、医药等。

(3)微观定股票，自下而上精选股票，个股集中。三大子策略分别是：打新策略、量化增强、FOF策略。

4、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为固定业绩比较基准 6%。特别提示：该业绩比较基准仅用于本基金投资业绩的比较，并非本基金的最终收益率，更非基金管理人、基金托管人或销售机构向基金投资者保证其投资于本基金的认购资金本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。本基金的收益率以实际运作情况为准。

5、投资比例及限制

(1)本基金存续期内，基金总资产不得超过基金净资产的 200%。基金投资于其他资产管理产品时，该条投资限制由基金管理人负责监控，并承担全部责任。

6、投资禁止行为

基金管理人不得利用基金财产从事下列行为或进行如下投资运作，若由此造成基金财产、合同当事人及第三方损失的，所有责任由基金管理人承担：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或提供担保，或变相从事金融机构信（存）贷业务的，或直接投向金融机构信贷资产；

(3) 从事经常性、经营性民间借贷活动，包括但不限于通过委托贷款、信托贷款等方式从事上述活动；

(4) 从事承担无限责任的投资；

(5) 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动；

(6) 直接或者间接投资法律法规和国家政策禁止进行债权或股权投资行业和领域；

(7) 与关联方进行不正当交易、利益输送、内幕交易和操纵市场，包括但不限于投资于关联方虚假项目、与关联方共同收购上市公司、向基金管理人注资等；

(8) 法律法规、中国证监会以及本基金合同约定禁止从事的其他行为。

7、基金托管人对基金管理人投资运作的监督

除相关法律法规另有规定外，基金托管人仅在其可监测的范围内对所托管基金的投资范围、投资限制承担投资监督职责。基金托管人对基金管理人进行本基金投资的监督自本基金成立之日起开始。

基金托管人投资监督的真实性、准确性、及时性和完整性受限于基金管理人及其他中介机构提供的数据和信息，合规投资的责任在基金管理人。基金托管人对上述机构提供信息的真实性、准确性、及时性和完整性不做任何担保、暗示或表示，并对上述机构提供信息的错误、遗漏或延迟所引起的损失不承担任何责任。

对于基金管理人的任何投资行为、投资策略、投资决定或由于基金产品设计缺陷或违规交易行为造成的任何损失，由基金管理人承担

全部责任。

8、关联交易及处理方式

(1) 基金管理人可运用基金财产与基金管理人、基金投资者、基金管理人管理的私募基金、同一实际控制人下的其他基金管理人管理的私募基金、或者与上述主体有其他重大利害关系的关联方进行交易（下称“关联交易”），但应当符合本基金的投资目标和投资策略，遵循投资者利益优先原则和平等自愿、等价有偿的原则，防范利益冲突，建立有效的关联交易风险控制机制及健全内部审批机制与评估机制，按照市场公平合理价格执行。

(2) 基金管理人运用基金财产进行关联交易的，应建立关联交易决策机制，并采取必要的回避措施，关联方不得以任何方式干预基金管理人投资决策；基金管理人审议关联交易事项时，有利害关系的人员应当回避表决，不得代理其他人员行使表决权。

(3) 基金管理人不得隐瞒关联关系或者将关联交易非关联化，不得以私募投资基金的财产与关联方进行利益输送、内幕交易和操纵市场等违法违规活动。

(4) 基金管理人运用基金财产进行关联交易前，应当将关联交易内容、关联方、处理方式等内容向基金份额持有人及基金托管人披露；在关联交易过程中，如出现可能损害投资者利益情形，应及时向基金份额持有人及基金托管人披露。基金管理人应当每季度将本基金关联交易事项向基金份额持有人及基金托管人披露。

(5) 基金投资者签署本基金合同即表明其已经知晓并认可本基金可能将进行上述关联交易事项。

9、基金的预警及止损

为保护全体基金份额持有人的利益，本基金设置预警线和止损

线。

(1) 预警线

本基金预警线为基金份额净值 0.9 元。

若 T 日基金份额净值高于止损线且不高于预警线(以基金管理人同基金托管人核对后的净值为准),基金管理人应在 T 日后的 2 个工作日内以电话、短信、传真或邮件等通讯方式向全体基金份额持有人提示风险。

(2) 止损线

本基金止损线为基金份额净值 0.85 元。

若 T 日基金份额净值不高于止损线(以基金管理人同基金托管人核对后的净值为准),无论 T+1 日及之后的基金份额净值是否高于止损线,基金管理人应告知基金投资者并立即开始将本基金的全部资产进行不可逆的变现,基金管理人发布清盘公告,进入清算程序。如遇因持有流通受限证券、资产被司法查封扣押冻结及其他无法处置的原因导致本基金资产无法及时变现的,待资产可变现时,进行二次清算。为避免疑义,本基金根据本条款提前终止无需基金份额持有人大会决定。

基金止损机制由基金管理人负责监控并执行,基金管理人应当在规定期限内根据合同约定执行后续操作。基金托管人对基金管理人进行提示即为基金托管人履行了监督义务,如基金管理人未按照基金合同约定进行止损操作,基金托管人有权向监管机构和基金业协会报告并向基金份额持有人公告。因基金管理人未严格依照合同约定的止损机制进行止损操作,给基金财产或基金份额持有人造成损失的,由基金管理人承担全部责任。

基金管理人特别提示:本基金设置止损线,并不代表基金管理人

完成止损后基金份额净值不低于止损线，根据基金管理人变现操作的交易执行情况，本基金终止日基金份额净值可能低于止损线。

11、投资事项的变更

遵循基金份额持有人利益优先的原则下，经本基金合同当事人协商一致可对投资事项进行变更，变更投资事项应以本基金合同约定的方式进行，投资事项变更应为调整投资组合留出必要的时间。

12、费用计提方法、计提标准和支付方式

(1) 基金管理费

基金管理费按前一日基金资产净值 1.95% 的年费率计提。

(2) 业绩报酬

① 业绩报酬提取的时间

在固定时点、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。

固定时点是指基金成立后每年 12 月最后一个交易日。本基金连续两次计提业绩报酬的间隔期不应短于 3 个月，基金管理人在基金份额持有人赎回基金份额时或在本基金清盘日计提业绩报酬的，可不受上述间隔期的限制。

② 业绩报酬提取的方法

业绩报酬 (R) 的计提方法:

如果 $r < 6\%$ ，则 $R = 0$

如果 $r \geq 6\%$ ，则 $R = F \times C \times (r - 6\%) \times 20\% \times T / 365$

$$r = \frac{C_T - C_0}{C} \times \frac{365}{T} \times 100\%$$

$$\Delta S_{ij} = R / \text{NAV}$$

C_T = 本次业绩报酬计提日的份额累计单位净值

C_0 = 上一次业绩报酬计提日的份额累计单位净值；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为该笔份额对应的认购价格或申购时的份额累计净值

C = 上一次业绩报酬计提日的份额净值

F = 提取业绩报酬的份额

r = 客户每笔份额年化收益率

T = 上一次业绩报酬计提日至本次业绩报酬计提日的自然日天数；若该笔份额还未提取过业绩报酬，则为成立日或申购确认日至本次业绩报酬计提日的自然日天数

ΔS_{ij} : 固定时点提取业绩报酬时，第 i 个基金份额持有人第 j 笔投资提取的业绩报酬对应的应调减份额

NAV: 本计提日基金份额单位净值

如果上述计算基金投资者单位基金份额获得的收益为负或者为零，则业绩报酬为零。

在业绩报酬固定提取时点提取业绩报酬的，业绩报酬以扣减基金份额持有人份额的方式提取，同时将扣减的基金份额以现金的形式支付给基金管理人；赎回业绩报酬从基金份额持有人赎回资金中扣除；收益分配业绩报酬从基金份额持有人收益分配资金中进行扣除（如果基金份额持有人本次收益分配的金额小于应计提的业绩报酬时，则本次计提的业绩报酬为该基金份额持有人的收益分配资金）；合同终止时业绩报酬直接从基金清算资金中扣除。上述业绩报酬在赎回基金份额、收益分配、合同约定固定时点及基金终止清算后 10 个工作日内，由基金托管人根据基金管理人出具的划款指令支付给基金管理人。

注：单个基金份额持有人单笔投资业绩报酬保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位四舍五入。

（3）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值 0.025%的年费率计提。

（4）基金服务机构的服务费

基金服务费按前一日基金资产净值 0.025%的年费率计提。

（5）其他费用的计提方法

基金财产托管账户发生的银行结算费用等银行费用，由基金托管人直接从托管账户中扣划，无须基金管理人出具指令。

基金存续期间投资所发生的交易手续费、印花税等有关证券交易税费，作为交易成本直接扣除。

基金证券账户等开户费用，由基金托管人直接从托管账户中扣划，无须基金管理人出具指令。

13、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、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额。

（2）基金收益分配原则

① 基金管理人有权决定在符合有关基金收益分配条件的前提下是否对基金进行收益分配以及收益分配的基准、分配比例、分配次数、分配时间等内容。

② 本基金默认分红方式为现金分红，本基金允许变更分红方式。

基金份额持有人如需变更默认收益分配方式的，应当通过募集机构提交申请，经基金管理人确认后，由份额登记机构进行处理。

③ 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

- ④ 每一基金份额享有同等分配权。
- ⑤ 法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

（3）收益分配方案

基金收益分配方案以基金管理人发布的公告为准，收益分配方案中应载明截止收益分配基准日的可供分配利润、基金收益分配对象、分配方式、分配时间、分配数额及比例等内容。

（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

基金的收益分配可以采取现金分红或红利再投资等方式。红利再投资是将现金红利按照基金分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额。

在基金管理人就收益分配方案进行公告后，基金管理人依据具体方案的规定就支付的现金红利向基金托管人发送划款指令，基金托管人按照基金管理人的指令及时进行分红资金的划付。

14、申购及赎回

（1）本基金无封闭期，按下列规则开放：本基金的开放日为每月的第1个自然日，遇非工作日顺延。

（2）基金份额持有人赎回基金时，按照“先进先出”的原则，依据基金份额持有人认购、申购和红利再投资基金份额的先后次序进行顺序赎回。

（3）申购费用和赎回费用：本基金无申购费和赎回费。

15、基金管理人在基金募集完毕后20个工作日内向中国基金业协会办理基金备案手续。如因基金管理人未履行备案手续或者私募基

金不符合备案要求等原因致使基金备案失败，则将导致私募基金不能投资运作的风险。

五、决策程序的履行

该事项已经公司第十届董事会第二次会议审议通过，无需提交股东大会审议。

六、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、本次交易无本金或收益担保；私募基金在运营过程中存在运营风险及资金损失风险、流动性风险、技术风险、操作风险、法律与政策风险、发生不可抗力事件的风险等风险。

特此公告。

上海市天宸股份有限公司董事会

2020年7月22日