

关于金鹰优选配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)可投资于公募基金基础设施证券投资基金并修订基金合同、托管协议的公告

根据《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金运作指引第2号—基金中基金指引》(以下简称“《基金中基金指引》”)、《公开募集基础设施证券投资基金指引(试行)》(以下简称“《公募REITs指引》”)等法律法规的规定及金鹰优选配置三个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)(以下简称“本基金”)基金合同的约定,经与基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司协商一致,金鹰基金管理有限公司(以下简称“本公司”)就本基金可参与公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募REITs”)投资事宜修改基金合同、托管协议等法律文件,包括明确投资范围包含公募REITs、增加公募REITs的投资策略等。本次修订将自2023年12月27日起正式生效。现将具体修订情况公告如下:

一、基金合同和托管协议修订内容

1、基金合同具体修订内容包括:

(1)“投资范围”部分明确了“公开募集证券投资基金”包含公开募集基础设施证券投资基金,投资范围修改为:“本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金(以下简称“证券投资基金”),含封闭式基金、开放式基金、上市型开放式基金(LOF)、交易所交易基金(ETF)、香港互认基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)和QDII基金、公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募REITs”)等、债券(含国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债券、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等)、国内依法发行上市的股票(含主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票)、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)、资产支持证券、债券回购、银行存款(含协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)”。

(2)“投资策略”部分增加公募REITs投资策略:“本基金可投资公募REITs。本基金将综合考虑宏观经济运行情况、基金资产配置策略、底层资产运营情况、流动性及估值水平等因素,对公募REITs的投资价值进行深入研究,精选出具有较高投资价值的公募REITs进行投资。本基金根据投资策略需要或市场环境变化,可选择将部分基金资产投资于公募REITs,但本基金并非必然投资公募REITs。”

(3)公募REITs适用基金合同关于封闭式基金所规定的估值方法,并在估值方法部分明确:“除估值方法第1项外,如有充分理由表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值。当基金管理人认为所投资基金按第1项约定的方法进行估值存在不公允时,应与托管人协商一致采用合理的估值技术或估值标准确定其公允价值。”

2、托管协议涉及上述内容的条款一并调整。

3、根据《基金中基金指引》《公募REITs指引》等相关法律法规规定和基金合同约定,公募REITs属于经中国证监会依法注册、公开募集的证券投资基金,本基金的投资范围包含“经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金”,可将公募REITs纳入投资范围。本次修订对基金份额持有人利益无实质性不利影响,并已履行相应程序,符合有关法律法规和基金合同的规定。

二、重要提示

本基金基金合同、托管协议全文将与本公告同日在本公司网站(<http://www.gelund.com.cn>)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)披露,供投资者查阅。基金管理人将在三个工作日内对基金招募说明书、基金产品资料概要进行一并更新。

投资者欲了解基金信息请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书、基金产品资料概要及相关法律文件。投资者可登录基金管理人网站(<http://www.gelund.com.cn>)或拨打本基金管理人的客户服务电话(400-6135-888)获取相关信息。

三、风险提示

公募REITs采用“公募基金+基础设施资产支持证券”的产品结构,主要特点如下:一是公募REITs与投资股票或债券的公募基金具有不同的风险收益特征,80%以上基金资产投资于基础设施资产支持证券,并持有其全部份额,基金通过基础设施资产支持证券持有基础设施项目公司全部股权,穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利;二是公募REITs以获取基础设施项目租金、收费等稳定现金流为主要目的,收益分配比例不低于合并后基金年度可供分配金额的90%;三是公募REITs采取封闭式运作,不开放申购与赎回,在证券交易所上市,场外份额持有人需将基金份额转移至场内才可卖出或申报受要约。投资公募REITs可能面临以下风险,包括但不限于:

(1)基金价格波动风险。

公募REITs大部分资产投资于基础设施项目,具有权益属性,受经济环境、运营管理等因素影响,基础设施项目市场价值及现金流情况可能发生变化,可能引起公募REITs价格波动,甚至存在基础设施项目遭遇极端事件(如地震、台风等)发生较大损失而影响基金价格的风险。

(2)基础设施项目运营风险。

公募REITs投资集中度高,收益率很大程度上依赖基础设施项目运营情况,基础设施项目可能因经济环境变化或运营不善等因素影响,导致实际现金流大幅低于测算现金流,存在基金收益率不佳的风险,基础设施项目运营过程中租金、收费等收入的波动也将影响基金收益分配水平的稳定。此外,公募REITs可直接或间接对外借款,存在基础设施项目经营不达预期,基金无法偿还借款的风险。

(3)流动性风险。

公募REITs采取封闭式运作,不开通申购赎回,只能在二级市场交易,存在流动性不足的风险。

(4)终止上市风险。

公募REITs运作过程中可能因触发法律法规或交易所规定的终止上市情形而终止上市,导致投资者无法在二级市场交易。

(5)税收等政策调整风险。

公募REITs运作过程中可能涉及基金持有人、公募基金、资产支持证券、项目公司等多层税负,如果国家税收等政策发生调整,可能影响投资运作与基金收益。

(6)公募REITs相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件(以下简称法律法规)和交易所业务规则,可能根据市场情况进行修改,或者制定新的法律法规和业务规则,投资者应当及时予以关注和了解。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分,并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书(更新)和基金产品资料概要(更新)等基金法律文件,全面认识基金产品的风险收益特征,在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上,根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标,对基金投资作出独立决策,选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引起的投资风险,由投资者自行负责。

特此公告。

金鹰基金管理有限公司

2023年12月27日