

中航基金管理有限公司关于中航首钢生物质封闭式基础设施证券投资基金份额解除限售的公告

一、公募 REITs 基本信息

公募 REITs 名称	中航首钢生物质封闭式基础设施证券投资基金
公募 REITs 简称	中航首钢绿能 REIT
公募 REITs 代码	180801
公募 REITs 合同生效日	2021-06-07
基金管理人名称	中航基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》等法律法规以及《中航首钢生物质封闭式基础设施证券投资基金基金合同》、《中航首钢生物质封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》

二、解除限售份额基本情况

（一）公募 REITs 场内份额解除限售

1. 本次解除限售的份额情况:

序号	证券账户名称	限售份额（份）	限售类型	限售期（月）
1	泰康人寿保险有限责任公司-分红-个人分红-019L-FH002深	5,500,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
2	深圳市前海建合投资管理有限公司-建合睿驰一号基础设施私募投资基金	5,500,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
3	中国银河证券股份有限公司	3,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
4	北京北咨投资基金管理有限公司	3,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
5	工银瑞信投资-工商银行-工银瑞投-工银理财四海甄选集合资产管理计划	1,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
6	中航证券有限公司	1,000,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12

7	中银理财有限责任公司—(科技创新)中银理财—智富(封闭式)2020年11期	500,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12
8	中银理财有限责任公司—(健康生活)中银理财—智富(封闭式)2020年07期	500,000	其他专业机构投资者战略配售限售	12

注：上述限售份额自2022年6月21日起满足解除限售条件。

2.本次解除限售后剩余的限售份额情况：

序号	证券账户名称	限售份额(份)	限售类型	限售期(个月)
1	首钢环境产业有限公司	20,000,000	原始权益人及其同一控制下关联方战略配售限售	60
2	北京首钢基金有限公司	20,000,000	原始权益人及其同一控制下关联方战略配售限售	36

(二)公募REITs场外份额解除限售

本基金不存在场外份额解除限售的情形。

三、本次限售份额上市后流通份额变化情况

本次战略配售份额上市流通前，可在二级市场直接交易的本基金流通份额为40,000,000份，占本基金全部基金份额的40%。本次战略配售份额解禁后，可流通份额合计为60,000,000份，占本基金全部基金份额的60%。

四、其他需要提示的事项

(一)净现金流分派率说明

基金首次发行时的年化净现金流分派率预测值=预计年度可供分配现金流/基金发行规模，对应到每个投资者的年化净现金流分派率预测值=预计年度可供分配现金流/基金买入成本。二级市场交易价格上涨会导致买入成本上涨，导致投资者实际的净现金流分派率降低。二级市场交易价格下跌会导致买入成本下降，导致投资者实际的净现金流分派率提高。

根据《中航首钢生物质封闭式基础设施证券投资基金2021年年度报告》，中航首钢绿能REIT2021年度可供分配金额为172,761,845.97元，根据《中航首钢生物质封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》，2022年度预测的可供分配金额为102,067,411.78元。基于上述数据，净现金流分派率及内部收益率的计算举例说明如下：

(1)投资人在首次发行时买入本基金，买入价格13.380元/份，该投资者的2021年测算净现金流分派率=12.91%。

(2)投资人在2022年6月13日通过二级市场交易买入本基金，假设买入价格17.248元/份，该投资者的2022年度净现金流分派率预测值=5.92%。

需特别说明的是：

1、以上计算说明中，2022 年度的可供分配金额系根据《中航首钢生物质封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》披露的预测数据予以假设，不代表实际年度的可供分配金额。

2、净现金流分派率不等同于基金的收益率。

（二）全周期内部收益率说明

内部收益率（IRR）为使得投资基金产生的未来现金流折现现值等于买入成本的收益率。本基金存续期内全周期内部收益率预测值，通过合理假设全周期分红现金、投资人收益分配时间等要素计算。二级市场交易价格上涨会导致买入成本上涨，导致投资者实际全周期内部收益率降低。二级市场交易价格下跌会导致买入成本下降，导致投资者实际全周期内部收益率提高。全周期内部收益率的计算举例说明如下：

（1）投资人在首次发行时买入本基金，买入价格 13.380 元/份，预测该投资者存续期内基金全周期内部收益率预测值约 6.60%。

（2）投资人在 2022 年 6 月 13 日通过二级市场交易买入本基金，假设买入价格 17.248 元/份，预测该投资者存续期内基金全周期内部收益率预测值约 3.29%。

（三）本基金在存续期内主要投资于基础设施资产支持证券全部份额，以获取基础设施运营收益并承担标的资产价格波动，因此与股票型基金和债券型基金有不同的风险收益特征，本基金预期风险和收益高于债券型基金和货币型基金，低于股票型基金。

四、相关机构联系方式

1、基金管理人

名称：中航基金管理有限公司

住所：北京市朝阳区天辰东路 1 号院 1 号楼 1 层 101 内 10 层 B1001 号

办公地址：北京市朝阳区天辰东路 1 号北京亚洲金融大厦 B 座 1001、1007、1008 单元

法定代表人：杨彦伟

成立日期：2016 年 06 月 16 日

联系人：蒋莹、张为

电话：010-56716121

2、基金托管人

名称：招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：缪建民

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83 号

电话：0755-83199084

传真：0755-83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

五、风险提示

本基金采取封闭式运作，封闭期为基金合同生效日起 21 年，不开通申购赎回，只能在二级市场交易，公众投资者认购后，在场外渠道购买的份额需要转托管至场内方可交易。本基金为基础设施基金，投资基础设施基金可能面临以下风险：基金价格波动风险、基础设施项目运营风险、流动性风险、终止上市风险、税收等政策调整风险等。基金管理人基于目前的政策、市场环境及项目公司经营

情况对项目公司未来经营产生的现金流进行了预测,但项目公司经营中影响现金流的重要因素存在一定的不确定性,可能导致预测的现金流与实际产生的现金流不一致。现金流分派率不等同于产品收益率,预测现金流分派率并非基金管理人向投资者保证本金不受损失或者保证其取得最低收益的承诺。

本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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩不代表未来表现,投资有风险,敬请投资人认真阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》、《产品资料概要》等相关法律文件,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告。

中航基金管理有限公司

2022年6月14日