

中欧基金管理有限公司

关于旗下部分基金中基金可投资于公开募集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运作管理办法》、《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》”）等法律法规规定及相关基金基金合同约定，经与各基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，中欧基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）旗下部分基金中基金就可参与公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”或“基础设施基金”）投资事宜修订基金合同、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、明确公募 REITs 估值方法等。本次修订将自 2023 年 11 月 3 日起正式生效。现将基金合同、托管协议修订情况公告如下：

一、 本次修订的基金范围

本次修订涉及基金管理人旗下 15 只基金中基金，详细名单见本公告的附表。

二、 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“基金”包含公开募集基础设施证券投资基金，以中欧盈选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）为例，投资范围修改为：“本基金投资于依法发行或上市的公开募集证券投资基金、股票、债券等金融工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。具体包括：经中国证监会依法核准或注册的公开募集的基金（含 QDII 基金、香港互认基金、公开募集基础设施证券投资基金（以下简称“公募 REITs”）、股票（包含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、港股通机制下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”）、债券（包

括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、信用衍生品、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款以及其他银行存款)、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,以中欧盈选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)为例,投资策略增加:“对于公募 REITs,本基金将综合考量宏观经济运行情况、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,并结合基金具体情况,在“基金估值方法”部分明确:“当基金管理人认为所投资基金按上述第(1)至第(3)条进行估值存在不公允时,应与基金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已一并调整。

3、同时,根据各基金法律文件具体情况更新基金管理人、基金托管人信息。

三、其他需要提示的事项

1、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,基金管理人旗下基金中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的基金”,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,依据法律法规和基金合同约定,无需召开基金份额持有人大会。变更修订事项已与基金托管人协商一致并报中国证监会备案,符合相关法律法规及基金合同的规定。基金管理人将于本公告同日在官方网站(www.zofund.com)及中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)

上披露经修改后的基金合同和托管协议。

2、基金管理人将在更新的招募说明书和基金产品资料概要等文件中，对涉及上述修订的内容进行相应更新，并揭示风险。

3、投资者欲了解上述基金的详细情况，请仔细阅读刊登于基金管理人网站（www.zofund.com）的基金合同等法律文件。

4、风险提示：

基础设施基金采用“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：一是基础设施基金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；二是基础设施基金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%；三是基础设施基金采取封闭式运作，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托管至场内才可卖出或申报预受要约。

投资基础设施基金可能面临以下风险，包括但不限于：

（1）基金价格波动风险。

基础设施基金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，可能引起基础设施基金价格波动，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。

基础设施基金投资集中度高，收益率很大程度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，基础设施基金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。

基础设施基金采取封闭式运作，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。基础设施基金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。

基础设施基金运作过程中可能涉及基金持有人、公募基金、资产支持证券、项目公司等多层面税负，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）基础设施基金相关法律、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。

投资者可以通过拨打本公司全国统一客户服务电话（400-700-9700）或登录本公司网站（www.zofund.com）获取相关信息。

特此公告。

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。敬请投资人注意投资风险。

附表：本次涉及修改的基金名单

中欧基金管理有限公司

二〇二三年十一月三日

附表：本次涉及修改的基金名单

序号	基金代码	基金名称
1	006321	中欧预见养老目标日期 2035 三年持有期混合型基金中基金(FOF)
2	007241	中欧预见养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
3	008639	中欧预见养老目标日期 2025 一年持有期混合型基金中基金(FOF)
4	012282	中欧睿智精选一年持有期混合型基金中基金(FOF)
5	013763	中欧星耀优选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
6	013761	中欧星选一年持有期混合型基金中基金(FOF)
7	013381	中欧甄选 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
8	501213	中欧汇选混合型基金中基金(FOF-LOF)
9	015352	中欧诚选一年持有期混合型基金中基金(FOF)
10	015999	中欧预见稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金(FOF)
11	014403	中欧预见平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
12	016170	中欧盈选平衡 6 个月持有期混合型基金中基金(FOF)
13	016846	中欧预见养老目标日期 2045 三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
14	017160	中欧颐享平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)
15	017587	中欧盈选稳健 6 个月持有期混合型发起式基金中基金(FOF)