

证券代码：603488

证券简称：展鹏科技

公告编号：2019-060

## 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：上海明沚投资管理有限公司、宁波梅山保税港区臻煜投资管理合伙企业（有限合伙）
- 投资标的名称：明沚增强对冲尊享2期私募证券投资基金，臻煜核心价值3号私募证券投资基金
- 投资金额：明沚增强对冲尊享2期私募证券投资基金1000万元人民币，臻煜核心价值3号私募证券投资基金500万元人民币，合计1500万元人民币
- 履行的审议程序：展鹏科技股份有限公司（以下简称“公司”）于2019年7月12日召开了第三届董事会第三次会议和第三届监事会第三次会议，审议通过了《关于公司使用自有资金进行证券投资的议案》，同意公司使用不超过人民币8,000万元的自有资金进行证券投资，在该额度内用于投资的资金可循环使用。本次投资事项在董事会审议通过额度内，无需股东大会批准。

### 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
上海明泐投资管理有限公司	私募基金产品	明泐增强对冲尊享 2 期私募证券投资基金	1,000	-	-	封闭期后每自然季度末月的倒数第五个交易日	浮动收益性	否
宁波梅山保税港区臻煜投资管理合伙企业（有限合伙）	私募基金产品	臻煜核心价值 3 号私募证券投资基金	500	-	-	封闭期后每自然季度末月的倒数三个交易日	浮动收益性	否

公司于 2019 年 10 月 8 日与上海明泐投资管理有限公司、国泰君安证券股份有限公司签署《明泐增强对冲尊享 2 期私募证券投资基金私募基金合同》，使用自有资金认购 500 万元基金份额，具体内容详见 2019 年 10 月 9 日于指定披露媒体披露的《展鹏科技关于认购私募基金份额的公告》（公告编号：2019-058），本次公司投资明泐增强对冲尊享 2 期私募证券投资基金为以自有资金 1,000 万元进行追加认购。

#### （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。

## 二、本次证券投资的具体情况

### （一）证券投资合同主要条款

#### A. 明泐增强对冲尊享 2 期私募证券投资基金

- 1、基金名称：明泐增强对冲尊享 2 期私募证券投资基金
- 2、合同签署日：2019 年 11 月 21 日
- 3、成立背景：固定收益类资产收益率下滑，权益类资产收益率较高但波动较大，故采用对冲策略，择时策略、低估值策略，追求稳健回报。
- 4、投资规模：本次投资为追加认购 1,000 万元人民币，总投资规模 1,500 万元人民币
- 5、投资人及投资比例：包含公司在内的不超过 200 名投资者。

6、资金来源：展鹏科技自有资金。

7、出资进度：展鹏科技在认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：本基金在深入研究的基础上构建投资组合，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。管理过程中涉及主体和其职责如下：

基金份额持有人：展鹏科技以其拥有合法所有权或处分权的财产投资于本基金。

基金管理人：上海明沅依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本基金财产。

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司。依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则安全保管本基金财产。

(2) 各投资人的合作地位和主要权利义务：

展鹏科技为本基金投资人之一，对拥有的该基金份额，享有包括但不限于以下权利：

1) 取得基金财产收益；

2) 取得清算后的剩余基金财产；

3) 按照本合同的约定申购、赎回和转让基金份额；

4) 按照本合同约定，参加或申请召集基金份额持有人大会，行使相关职权；

5) 监督基金管理人及基金托管人履行投资管理和托管义务的情况；

6) 按照本合同约定的时间和方式获得基金信息披露资料；

7) 因基金管理人、基金托管人违反法律法规或本合同的约定导致合法权益受到损害的，有权得到赔偿；

8) 国家有关法律法规及本合同约定的其他权利

主要义务包括但不限于：

1) 认真阅读基金合同，保证投资资金的来源及用途合法；

2) 接受合格投资者确认程序，如实填写风险识别能力和承担能力调查问卷，如实承诺资产或者收入情况，并对其真实性、准确性和完整性负责，承诺为合格投资者；

3) 以合伙企业、契约等非法人形式汇集多数投资者资金直接或者间接投资于私募基金的，应向私募基金管理人充分披露上述情况及最终投资者的信息，但符合本

合同“募集对象”中的“特殊合格投资者”的除外；

4) 认真阅读并签署风险揭示书；

5) 按照基金合同约定缴纳基金份额的认购、申购款项，承担基金合同约定的管理费、托管费及其他相关费用；

6) 按照基金合同约定承担基金的投资损失；

7) 向私募基金管理人或私募基金募集机构提供法律法规规定的真实、准确、完整、充分的信息资料及身份证明文件，配合私募基金管理人或其募集机构的尽职调查与反洗钱工作；

8) 保守商业秘密，不得泄露私募基金的投资计划或意向等；

9) 不得违反基金合同的约定干涉私募基金管理人的投资行为。

10) 不得从事任何有损基金及其投资者、私募基金管理人管理的其他基金及私募基金托管人托管的其他基金合法权益的活动；

11) 认购、申购、赎回、分配等基金交易过程中因任何原因获得不当得利的，应予返还；

12) 保证其享有签署包括本合同在内的基金相关文件的权利，并就签署行为已履行必要的批准或授权手续，且履行上述文件不会违反任何对其有约束力的法律法规、公司章程、合同协议的约定。

13) 国家有关法律法规、监管机构及本合同规定的其他义务。

(3) 管理费或业绩报酬及利润分配安排方式：

基金管理费(含销售服务费、托管费)：2%每年，按日计提，按季支付。

业绩报酬：

1) 业绩报酬的计提基准日：固定计提日、投资者赎回日、分红权益登记日、基金清算日。其中，固定计提日为基金赎回开放日，即每自然季度末月（3月、6月、9月及12月）的倒数第五个交易日。

本基金在固定提取日计提业绩报酬，业绩报酬以扣减基金份额持有人持有份额的方式（于计提基准日后第2个工作日确认）提取（此种方式会减少基金份额持有人的持有份额，但不会影响基金份额净值的变化）；在赎回日计提业绩报酬，业绩报酬从投资者的赎回资金中扣除；在分红权益登记日计提业绩报酬，业绩报酬从投资者的分红资金中扣除且不超过分红资金；在基金清算日计提业绩报酬，业绩报酬从投资者的清算资金中扣除。

2) 业绩报酬的计算：业绩报酬的计算采用单个投资者单笔高水位净值法，即当业绩报酬计提基准日的基金份额累计净值大于上次成功计提日（首次计提时，则为参与日基金份额累计净值）时，分别计算每笔份额在上一成功计提基准日至本次计提基准日持有期间的基金份额累计净值增长差额，对超过上次成功计提日基金份额净值部分按 20%比例进行计提。

9、盈利模式：投资标的公允价值变动。

10、投资后的退出机制：本基金赎回开放日仅可赎回持有期不低于 180 天（认购取得的份额自本基金成立之日起算，申购取得的份额自份额确认之日起计算）的基金份额。本基金赎回开放日为基金成立后每自然季度末月（3 月、6 月、9 月及 12 月）倒数第五个交易日。

#### B、臻煜核心价值 3 号私募证券投资基金

1、基金名称：臻煜核心价值 3 号私募证券投资基金

2、合同签署日：2019 年 11 月 21 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：公司在认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：臻煜投资按照诚实信用、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：华泰证券依照恪尽职守、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):1.6%,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业绩报酬提取的方法

单个基金份额持有人单笔投资基金份额业绩报酬计算公式如下:

$$PF_{ij} = F_{ij} \times (NAV1' - HWM_{ij}) \times 20.0\%$$

$PF_{ij}$ : 本计提日第  $i$  个基金份额持有人第  $j$  笔投资的业绩报酬;

$F_{ij}$ : 本计提日第  $i$  个基金份额持有人第  $j$  笔投资的基金份额;提取赎回业绩报酬时为份额持有人赎回基金的份额;提取分红业绩报酬时为份额持有人参与分红的基金份额;合同终止时的业绩报酬为份额持有人合同终止时的全部份额;

$NAV1'$ : 本计提日基金份额累计净值;

$HWM_{ij}$ : 第  $i$  个基金份额持有人第  $j$  笔投资的高水位,为该笔份额上一次提取业绩报酬时的基金份额累计净值;若该笔份额还未提取过业绩报酬,则为该笔份额对应的认购价格或申购份额累计净值。

如果上述计算投资人单位基金份额获得的收益为负或者为零，则业绩报酬为零。

赎回业绩报酬从基金份额持有人赎回资金中扣除；分红业绩报酬从份额持有人分红资金中进行扣除（如果份额持有人本次分红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份额持有人的分红资金）；合同终止时业绩报酬直接从基金清算资金中扣除。

上述业绩报酬在收益分配、赎回基金份额及《基金合同》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。

9、盈利模式：投资标的公允价值变动

10、投资后的退出机制：封闭期（基金成立之日起 12 个月）结束后每自然季度（即 3 月、6 月、9 月、12 月）最后三个交易日可赎回

## （二）证券投资的资金投向

### A. 明沚增强对冲尊享 2 期私募证券投资基金

投资领域：沪深交易所发行、上市的股票、沪港通中港股通标的范围内的股票、深港通中港股通标的范围内的股票、优先股、债券、资产支持证券、资产支持票据、证券公司收益凭证、债券回购、商业银行理财产品、现金、银行存款（包括定期存款、协议存款和其他银行存款）、同业存单、融资融券、转融通证券出借交易（即本基金将其持有的证券作为融券标的证券出借给证券金融公司）、股指期货、商品期货、国债期货、证券交易所上市的股票期权、上海期货交易所上市的商品期权、郑州及大连商品交易所上市的商品期权、上海黄金交易所上市的合约品种、权证、公募基金、仅以证券公司及其子公司为交易对手的场外衍生品（包括收益互换及场外期权）、证券公司及其子公司资产管理计划、保险公司及其子公司资产管理计划、期货公司及其子公司资产管理计划、基金公司及其子公司特定客户资产管理计划、于基金业协会官方网站公示已登记的且机构类别为私募证券投资基金管理人发行的私募基金。

投资项目和计划：本基金主要投资于上交所和深交所上市交易的股票以及中金所交易的股票期货合约，结合数学模型和计算机自动交易，基于高智能、成熟的资产管理系统。依托统计金融量化模型挖掘出成功率和出现率高的交易模式，长期通过对海量数据的统计研究寻找获利机会创造回报，坚持分散投资风险、严格执行风控标准本基金将根据宏观经济分析和整体市场估值水平的变化自上而下的进行资产配

置，在降低市场风险的同时追求更高收益。

#### B. 臻煜核心价值 3 号私募证券投资基金

投资领域:股票(A 股、港股通); 债券(国债、地方政府债、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据、金融债、公司债、企业债、可转换债券、可交换债券、可分离债券、非公开定向债务融资工具 (PPN)、债券回购); 基金(封闭式基金、开放式基金、股票型基金、债券型基金、混合基金、货币市场基金、LOF 基金、ETF 基金); 期货期权(商品期货、国债期货、股指期货、场内期权); 其他(银行存款、商业银行理财产品、信托产品、融资融券、转融通、权证、资产支持证券、收益凭证、黄金 T+D、白银 T+D、资产管理计划 (包括但不限于基金及其子公司资管计划、券商及其子公司资管计划、保险及其子公司资管计划、期货公司资管计划等))。

投资策略: 本基金采用灵活资产配置+主动投资策略

对产业、公司的深度研究是创造长期超额投资收益的核心来源，而良好的情绪管理能力将创造长期附加超额收益。在实际的投资研究实践中，坚持逆向思考、证伪态度、长期视角、产业视角的基本原则。在资产配置中，通过以宏观经济及其政策分析为核心的情景分析法来确定组合中股票、债券和现金类资产等的投资范围和比例，并结合对市场估值、资金、投资主体行为和市场信心影响等因素的综合判断进行灵活调整；在股票投资中，采取自上而下和自下而上相结合的方法，自上而下解决投资所处的中周期、短周期部位；这个部位的宏观指标组合和以往周期相比较会有什么不同特征；长周期角度看驱动宏观经济增长引擎的结构性、区域性变化（即主题）；自下而上的核心是寻找优秀企业，包括辨析跟踪核心竞争优势、公司治理、管理团队、企业战略、执行力及企业文化，行业竞争格局及外部颠覆可能性，盈利模式选择的稳定性可持续性。选择有成长性、具有核心竞争力的上市公司为标的，优选价值相对低估的股票构建投资组合，同时将风险管理意识贯穿于投资过程中，对投资标的进行持续严格的跟踪和评估。

#### （三）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险因素，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
上海明泐投资管理有限公司	2014年4月	裘慧明	1000	投资管理、资产管理	裘慧明	否
宁波梅山保税港区臻煜投资管理合伙企业(有限合伙)	2017年8月	王小军	2000	投资管理、资产管理	王小军	否

#### (二) 受托方经营情况

##### A. 上海明泐投资管理有限公司

1、主要业务最近三年发展状况：上海明泐投资成立于2014年4月，注册资本1,000万元，是一家专注量化投资的对冲基金，公司已拥有一支理论造诣深厚、实操经验丰富的投资、研发、交易人才队伍，拥有经验丰富的管理团队，目前投研人员34人，核心成员均有着资深的相关从业经历，以量化为主导，结合宏观研究和事件驱动研究，为客户持续创造超额收益，在国内外金融市场均取得了稳健的业绩表现。目前明泐投资已发行产品数量为236只，资产管理规模约192亿，近三年发展稳健，管理规模逐渐增长，旗下产品各项指标相较三年期金牛多头均处于领先水平。

##### 2、最近一年又一期主要财务指标：

单位：万元

项目	2019年1月1日- 2019年9月30日	2018年1月1日- 2018年12月31日
资产总额	8,978	4,099
资产净额	1,180	3,970
营业收入	9,703	5,544
净利润	-389	13

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。

B. 宁波梅山保税港区臻煜投资管理合伙企业（有限合伙）

1、主要业务最近三年发展状况：臻煜投资成立于 2017 年 8 月，实缴资本 2,000 万元，2018 年 6 月通过中国基金业协会登记备案。经过两年发展，企业目前已建立起体系化的投研团队、销售团队和运营团队。团队坚持基本面驱动的价值投资，同时关注上市公司的预期差，精选性价比高的标的进行投资。目前企业已发行了 2 只基金，代管 1 只基金，资产管理规模(含自有资金)约 1.5 亿，截止目前三支基金和自有资金均取得较好的投资收益

2、最近一年又一期主要财务指标：

单位：万元

项目	2019 年 1 月 1 日- 2019 年 9 月 30 日	2018 年 1 月 1 日- 2018 年 12 月 31 日
资产总额	2,789	2,048
资产净额	2,302	1,044
营业收入	139	0.83
净利润	1,259	-899

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）董事会已对以上受托方、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	2019 年 1 月 1 日- 2019 年 9 月 30 日	2018 年 1 月 1 日- 2018 年 12 月 31 日
资产总额	96,394	93,482
负债总额	10,717	9,928
资产净额	85,677	83,554
经营活动现金流净额	4,761	3,094

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 1,500 万元, 占公司最近一期期末货币资金的比例为 20%, 不会对公司未来主营业务、财务状况、经营成果等造成重大影响。

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

上述基金可能存在风险, 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。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。

## 六、决策程序的履行及监事会、独立董事意见

公司于 2019 年 7 月 12 日召开了第三届董事会第三次会议和第三届监事会第三次会议, 审议通过了《关于公司使用自有资金进行证券投资的议案》, 同意公司使用不超过人民币 8,000 万元的自有资金进行证券投资, 在该额度内用于投资的资金可循环使用。公司独立董事发表了同意的独立意见。

## 七、截至本公告日, 公司最近十二个月使用自有资金进行证券投资的情况

序号	证券投资类型	实际投入金额	实际收回本金	实际收益	尚未收回本金金额
1	私募基金	500	-	-	500
2	私募基金	1,000	-	-	1,000
3	私募基金	500	-	-	500
4	私募基金	500	-	-	500
5	私募基金	500	-	-	500
6	私募基金	1,000	-	-	1,000
7	私募基金	500	-	-	500
合计		4,500		-	4,500
最近12个月内单日最高投入金额				4,500	
最近12个月内单日最高投入金额/最近一年净资产 (%)				5.38	
最近12个月证券投资累计收益/最近一年净利润 (%)				-	

目前已使用的证券投资额度	4,500
尚未使用的证券投资额度	3,500
总证券投资额度	8,000

特此公告

展鹏科技股份有限公司董事会

2019年11月21日