

浙江阳光照明电器集团股份有限公司

关于认购私募证券投资基金份额的公告

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。

- 认购基金产品名称：幻方 500 指数增强欣享 18 号私募证券投资基金
- 基金管理人：宁波幻方量化投资管理合伙企业（有限合伙）（以下简称“幻方量化”）
- 认购金额：不超过 3 亿元，在基金存续期内滚动使用
- 基金存续期限：15 年。浙江阳光照明电器集团股份有限公司（以下简称“公司”）委托理财期限自董事会审议之日起不超过 18 个月。

● 履行的审议程序：2021 年 10 月 11 日，公司召开了第九届董事会第十次会议和第九届监事会第七次会议，审议通过《关于公司认购私募证券投资基金份额的议案》，投资金额不超过 3 亿元（根据私募产品实际募集情况决定），在基金存续期内滚动使用。同时，公司独立董事发表了认可本次认购私募证券投资基金的独立意见。

● 风险提示：幻方 500 指数增强欣享 18 号私募证券投资基金于 2021 年 06 月 03 日在中国证券投资基金业协会（以下简称“协会”）完成备案（产品编号：SQC919），协会为私募投资基金办理备案不构成对私募投资基金管理人（以下简称“管理人”）投资能力的认可，亦不构成对管理人和私募投资基金合规情况的认可，不作为对私募投资基金财产安全的保证。

投资者应当自行识别私募投资基金投资风险并承担投资行为可能出现的损失。本次投资可能面临风险，包括但不限于基金运营风险、流动性风险、资金损失风险、募集失败风险、资产管理产品投资风险、市场风险、基金管理人管理风险、净值波动风险。本次投资无保本及最低收益承诺。本次投资的收益存在不确定性，敬请广大投资者理性投资，注意风险。

一、本次委托理财概况

公司在保证正常经营和项目资金运营需求下，借助专业投资机构的力量及资源优势，使用闲置自有资金购买私募产品。投资金额不超过 3 亿元（根据私募产品实际募集情况决定），在基金存续期内滚动使用。本次参与认购私募产品有利于提高闲置自有资金使用效率。

本次投资事项不构成关联交易，也不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。根据《公司章程》的规定，本次投资无需提请公司股东大会批准。

（一）资金来源

本次投资私募证券投资基金的资金为公司闲置自有资金。

（二）委托理财的基本情况

根据公司与幻方量化签订的《幻方 500 指数增强欣享 18 号私募证券投资基金基金合同》，本次购买私募证券投资基金金额为不超过 3 亿元，在基金存续期内滚动使用。基金存续期限为 15 年。公司委托理财期限自董事会审议之日起不超过 18 个月。具体情况如下表：

受托方名称	产品类型	产品名称	金额	预计年化收益率	预计收益金额（万元）
宁波幻方量化投资管理合伙企业（有限合伙）	私募证券投资基金	幻方500指数增强欣享18号私募证券投资基金	不超过3亿元	不适用	不适用
产品期限	收益类型	结构化安排	参考年化收益率	预计收益（如有）	是否构成关联交易
15年	非保本浮动收益	不涉及	不适用	不适用	否

（三）公司对委托理财相关风险的内部控制

公司制定了相关制度，建立了理财业务的分类、分级审批程序，从决策层对理财业务进行把控。公司对理财产品的收益类型、投资类型、流动性等进行尽职调查和评估，选择资信、财务状况良好、盈利能力强的合格专业理财机构作为受托方，总体风险可控。

风险控制：（1）公司董事会授权董事长行使该项投资决策权并签署相关合同文件，包括（但不限于）选择合格专业理财机构作为受托方、明确委托理财金额、期间、选择委托理财产品品种、签署合同及协议等。公司财务负责人负责组织实

施，公司财务部具体操作。公司将及时分析和跟踪银行或其他金融机构发行的理财产品投向、项目进展情况，一旦发现或判断有不利因素，将及时收回资金采取相应的保全措施，控制投资风险。（2）公司内部审计部负责审查理财业务的审批情况、实际操作情况、资金使用情况、盈亏情况等，督促财务部及时进行账务处理，并对账务处理情况进行核实，在每个季度末对所有银行或其他金融机构发行的理财产品投资项目进行全面检查，根据谨慎性原则，合理的预计各项投资可能发生的收益和损失，并向审计委员会报告。（3）独立董事、监事会有权对资金使用情况进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。（4）公司将依据上海证券交易所的相关规定，在定期报告中披露报告期内投资理财以及相应的损益情况。

日常监管：公司独立董事、董事会审计委员会、监事会有权对上述闲置自有资金的使用情况进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

二、本次委托理财的具体情况

（一）委托理财合同主要条款

- 1、认购基金产品名称：幻方 500 指数增强欣享 18 号私募证券投资基金。
- 2、基金管理人：宁波幻方量化投资管理合伙企业（有限合伙）
- 3、基金的运作方式：开放式。
- 4、认购金额：不超过 3 亿元人民币，在基金存续期内可以按照基金合同相关约定认购和/或赎回，资金在上述额度内可滚动使用。
- 5、基金的投资目标：在控制风险的前提下，追求客户资产长期、持续、稳定的增值。
- 6、投资范围：本基金的投资范围包括沪深交易所上市交易的品种（指股票、优先股、权证、存托凭证）、债券（包括交易所债券、可转换债券、可交换债券，但不包括中小企业私募债和非公开发行公司债）、国债逆回购、存款、公开募集证券投资基金、期货、场内期权。本基金可以参与融资融券交易、港股通交易、新股认购，也可以将其持有的证券作为融券标的出借给证券金融公司。本基金可投资于由宁波幻方量化投资管理合伙企业（有限合伙）或浙江九章资产管理有限公司管理的并经基金业协会备案显示由具备证券投资基金托管资格的托管人托管的私募证券投资基金，但不得投资上述产品的劣后级份额。

7、基金的存续期限：本基金自成立之日起计算的 15 年为固定存续期限，15 年后的对应月对应日的前一天即为到期日，如到期日为非工作日的，非工作日后的第 1 个工作日视为到期日。

8、基金份额的初始募集面值：人民币 1.00 元。

9、基金目标规模：初步 10 亿元，随着基金开放日投资者的申赎基金规模发生变化。

10、基金的托管事项：本基金财产由基金托管人进行托管。本基金托管人为招商证券股份有限公司。

11、基金的服务事项：基金管理人委托招商证券股份有限公司作为本基金的服务机构，招商证券股份有限公司在中国基金业协会登记的服务业务登记编码为 A00001。

12、基金止损：为保护基金份额持有人的利益，本基金将基金份额净值为 0.50 元设置为止损线。当基金份额净值低于或等于止损线 0.50 元（该交易日称为“D 日”）时，管理人在 D+2 日开始止损操作，并在十个工作日内将持仓标的或衍生品平仓变现。该平仓操作不可逆，在所持全部非现金类资产变现前不可停止。对于已变现部分，根据本合同第二十五章的清算程序对基金进行清算。如遇因持有流通受限证券等原因导致本基金财产无法及时变现的，则变现时间顺延，待全部变现完成之日，管理人进行二次清算。基金的止损由基金管理人负责执行，如基金管理人：(1) 按照或者未按照基金合同的约定进行止损；(2) 因管理人或其选择的经纪商未能及时提供估值所需相关数据进而导致基金份额净值无法计算而延误止损操作。

13、基金存续期限：15 年。公司委托理财期限自董事会审议之日起不超过 18 个月。

14、基金赎回开放日：认购起每周周三。

15、管理费：年 2%。

16、托管外包费：年 0.05%。

17、业绩报酬：采取“单客户单笔份额高水位法”，业绩报酬提取时点分为固定时点提取、赎回时提取和合同终止时提取，管理人将提取基金份额持有人每一基金份额的收益率（R）超过同期中证 500 指数（000905）收益部分的 25%作

为业绩报酬。固定提取时点为每个自然年度 12 月第二个周三（遇节假日则顺延至下一个工作日），以扣减基金份额持有人份额的方式提取；赎回和合同终止时提取业绩报酬的，业绩报酬从赎回资金中扣除。

18、基金经理：陆政哲，毕业于浙江大学、伦敦政治经济学院。曾就职于招商银行资产管理部衍生产品投资室，从事宏观研究及海外衍生品投资。具备良好的经济理论基础、扎实的证券研究经验和投资管理经验，现任幻方量化投资经理。

19、投资策略：基于大量市场数据，运用人工智能算法构建并不断迭代策略模型，建立一篮子股票组合，并对标标的指数进行风格调整与平衡，同时在统一的策略架构下进行多策略的有机叠加，优化策略组合收益风险比，追求超越指数的投资回报。本基金可以通过持有沪深交易所上市交易的存托凭证间接投资于境外基础证券。本基金的投资策略不属于本基金的投资范围、投资风格、投资比例或投资限制事项，托管人对本基金的投资策略不承担监督职责。

（二）委托理财的资金投向

公司本次委托理财的具体资金投向为证券市场投资，具体产品为幻方 500 指数增强欣享 18 号私募证券投资基金。

（三）其他事项

资金最终投向为证券市场投资，资金最终投向见本公告第二条第一款第 6 点“投资范围”。基金管理人宁波幻方量化投资管理合伙企业（有限合伙）资信状况良好，不属于失信被执行人。

基金管理人宁波幻方量化投资管理合伙企业（有限合伙）与公司、公司股东及其一致行动人、实际控制人之间不存在产权、业务、资产、债权债务、人员等关联关系。本次理财基金管理人并非为本次交易所设。

（四）风险控制分析

针对本次购买幻方 500 指数增强欣享 18 号私募证券投资基金，公司本着严格控制险的原则，对产品的收益类型、投资类型、流动性进行了尽职调查和评估。公司本次运用暂时闲置自有流动资金购买私募证券投资基金，公司第九届董事会第五次审议通过的《关于公司使用闲置自有资金开展理财业务的议案》，总额不超过人民币 11 亿元，本次认购 3 亿元私募证券投资基金份额亦在 11 亿元范围内。本次委托理财在不影响公司正常经营及预计确保资金安全的前提下实施。

三、委托理财受托方的情况

(一) 受托方的基本情况

公司名称	宁波幻方量化投资管理合伙企业（有限合伙）
登记编号	P1032021
注册地址	浙江省宁波市北仑区梅山七星路 88 号 1 幢 401 室 B 区 H0291
办公地址	浙江省杭州市下城区环城北路 169 号汇金国际大厦 A 座 14 层
办公电话	固话：0571-86656960，传真：0571-87561101
成立时间	2016-02-15
企业类型	有限合伙企业
执行事务合伙人	宁波幻方投资管理有限公司（委派代表：徐进）
注册/实缴资本	1000 万
管理人登记时间	2016-06-28
统一社会信用代码	91330206MA281H448F
经营范围	投资管理，资产管理（未经金融等监管部门批准不得从事吸收存款、融资担保、代客理财、向社会众筹（融）资等金融业务）。 （已发须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）

(二) 公司董事会尽职调查情况

公司已对交易对方进行了必要的尽职调查，认为基金管理人的基本情况、信用评级及履约能力良好。

四、决策程序的履行

1、董事会意见

2021 年 10 月 11 日，公司召开了第九届董事会第十次会议，审议通过《关于公司认购私募证券投资基金份额的议案》，投资金额不超过 3 亿元（根据私募产品实际募集情况决定），在基金存续期内滚动使用。

2、独立董事意见

独立董事于 2021 年 10 月 11 日对《关于公司认购私募证券投资基金份额的议案》发表了独立意见，认为：“通过对公司经营情况、财务状况的了解，基于独立判断，我们认为公司目前经营正常，财务状况平稳，公司在保证日常经营发展所需资金的前提下，以自有资金参与认缴投资基金份额，不会对公司财务状

况和经营成果产生重大影响。该事项履行了必要的决策程序，符合法律法规及《公司章程》等相关规定，不存在损害公司及公司股东利益特别是中小股东利益的情形。”

3、监事会意见

2021年10月11日，公司召开了第九届监事会第七次会议，审议通过《关于公司认购私募证券投资基金份额的议案》，监事会认为本次交易决策程序符合有关法律、法规、规范性文件以及《公司章程》的规定，不存在损害公司以及公司股东特别是中小股东利益的情况。

五、截至本公告日，公司最近十二个月使用自有资金委托理财的情况

金额：万元

序号	理财产品类型	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	保本浮动收益型	4,000	4,000	34.48	0
2	保本浮动收益型	4,000	4,000	99.15	0
3	保本浮动收益型	33,000	33,000	227.84	0
4	保本浮动收益型	15,000	15,000	127.40	0
5	保本浮动收益型	33,000	33,000	248.81	0
6	保本浮动收益型	17,000	17,000	157.52	0
7	保本浮动收益型	27,000	27,000	51.26	0
8	保本浮动收益型	10,000	10,000	182.88	0
9	保本浮动收益型	29,000	29,000	295.88	0
10	保本浮动收益型	6,000	6,000	55.04	0
11	保本浮动收益型	20,000	20,000	172.60	0
12	保本浮动收益型	10,000	10,000	27.50	0
13	保本浮动收益型	8,000	8,000	46.97	0

14	保本浮动收益型	17,000	17,000	113.80	0
15	保本浮动收益型	8,000	8,000	53.97	0
16	保本浮动收益型	8,000	8,000	22.36	0
17	保本浮动收益型	17,000	17,000	49.30	0
18	保本浮动收益型	8,000	8,000	19.54	0
19	保本浮动收益型	5,500	5,500	53.37	0
20	保本浮动收益型	15,000	15,000	123.90	0
21	保本浮动收益型	1,500	1,500	10.36	0
22	保本浮动收益型	2,000	2,000	15.08	0
23	保本浮动收益型	2,000	2,000	18.53	0
24	保本浮动收益型	8,000	8,000	52.11	0
25	保本浮动收益型	7,000	7,000	49.79	0
26	保本浮动收益型	7,000	7,000	61.19	0
27	保本浮动收益型	5,000	5,000	43.27	0
28	保本浮动收益型	7,000	7,000	61.19	0
29	保本浮动收益型	5,000	5,000	43.27	0
30	保本浮动收益型	3,000	3,000	26.22	0
31	保本浮动收益型	3,000	3,000	25.96	0
32	保本浮动收益型	1,200	1,200	16.77	0
33	保本浮动收益型	3,000	0	0	3,000
34	保本浮动收益型	1,200	0	0	1,200
35	保本浮动收益型	13,000	0	0	13,000
36	保本浮动收益型	30,000	0	0	30,000
37	保本浮动收益型	5,500	0	0	5,500

38	保本浮动收益型	15,000	0	0	15,000
合计		408,900	334,200	2,482.83	74,700
最近 12 个月内单日最高投入金额				109,700	
最近 12 个月内单日最高投入金额/最近一年净资产 (%)				27.81	
最近 12 个月委托理财累计收益/最近一年净利润 (%)				5.12	
目前已使用的理财额度				74,700	
尚未使用的理财额度				35,300	
总理财额度				110,000	

六、对公司的影响

公司最近一年又一期的财务状况如下：

单位：万元

项目	2020 年 12 月 31 日	2021 年 6 月 30 日
资产总额	647,834.91	621,606.30
负债总额	253,373.05	244,987.24
资产净额	394,461.86	376,619.06
经营活动产生的现金流量净额	70,277.47	4,681.05
货币资金	262,579.36	209,040.96
交易性金融资产-结构性存款	15,012.92	31,796.88

本次投资在保证日常经营所需资金的前提下，使用闲置资金认购私募证券投资基金份额，能更好地提升公司资金使用效率，不会影响公司主营业务的正常开展。本次投资可以借助专业投资机构的专业优势增强公司的投资能力，期望获得一定的投资收益，提升公司整体业绩水平，为公司及股东谋取更多的投资回报。

七、风险提示

本次幻方 500 指数增强欣享 18 号私募证券投资基金于 2021 年 06 月 03 日在协会完成备案（产品编号：SQC919），协会为私募投资基金办理备案不构成对管

理人投资能力的认可，亦不构成对管理人和私募投资基金合规情况的认可，不作为对私募投资基金财产安全的保证。

投资者应当自行识别私募投资基金投资风险并承担投资行为可能出现的损失。本次投资可能面临风险，包括但不限于基金运营风险、流动性风险、资金损失风险、募集失败风险、资产管理产品投资风险、市场风险、基金管理人管理风险、净值波动风险。

本次投资无保本及最低收益承诺。本次投资的收益存在不确定性，公司将及时了解幻方 500 指数增强欣享 18 号的运作情况，督促防范各方面的投资风险，尽力维护公司投资资金的安全。公司将按照法律法规的要求及时履行信息披露义务。敬请广大投资者理性投资，注意风险。

特此公告。

浙江阳光照明电器集团股份有限公司董事会

2021 年 10 月 13 日