

浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式  
基础设施证券投资基金  
上市交易公告书

基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

上市地点：上海证券交易所

上市时间：2021年6月21日

公告日期：2021年6月16日

## 目录

第一部分 重要声明与提示.....	1
第二部分 基金概览.....	2
第三部分 基金的募集与上市交易.....	7
第四部分 持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	11
第五部分 基金主要当事人简介.....	12
第六部分 基金合同摘要.....	15
第七部分 基金财务状况.....	16
第八部分 基金投资组合.....	17
第九部分 重大事件揭示.....	19
第十部分 基金管理人承诺.....	20
第十一部分 基金托管人承诺.....	21
第十二部分 基金上市推荐人意见.....	22
第十三部分 备查文件目录.....	23
附件：基金合同内容摘要.....	24

## 第一部分 重要声明与提示

浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金(以下简称“本基金”)上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 1 号〈上市交易公告书的内容与格式〉》、《上海证券交易所公开募集基础设施证券投资基金( REITs) 业务办法(试行)》、《上海证券交易所公开募集基础设施证券投资基金(REITs)业务指南第 1 号——发售上市业务办理》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,浙江浙商证券资产管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、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。本基金托管人招商银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本上市交易公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅 2021 年 5 月 18 日在浙江浙商证券资产管理有限公司网站([www.stocke.com.cn](http://www.stocke.com.cn))及中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)上披露的《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)、《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金托管协议》(以下简称“托管协议”)、《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》、《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金基金产品资料概要》(以下简称“基金产品资料概要”),以及 2021 年 5 月 26 日披露的《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金招募说明书(更新)》(以下简称“招募说明书”)。

本上市交易公告书第七节“基金财务状况”未经审计。

## 第二部分 基金概览

### （一）本基金基本情况

- 1、基金名称：浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金。
- 2、基金类型：基础设施证券投资基金
- 3、运作方式：契约型、封闭式基金
- 4、基金存续期限：自基金合同生效之日起 20 年
- 5、基金简称：浙江杭徽
- 6、基金扩位简称：浙商沪杭甬 REIT<sup>1</sup>
- 7、基金二级市场交易简称及交易代码：浙江杭徽，交易代码：508001。
- 8、基金份额总额：截至公告前两个工作日即 2021 年 6 月 10 日，本基金的基金份额总额为 500,000,000.00 份。
- 9、本次上市交易份额：截至公告前两个工作日即 2021 年 6 月 10 日，本次基金上市份额为 125,438,351 份。
- 10、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 11、上市交易日期：2021 年 6 月 21 日。
- 12、基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司。
- 13、基金托管人：招商银行股份有限公司。
- 14、财务顾问：中国国际金融股份有限公司
- 15、上市推荐人：浙商证券股份有限公司
- 16、本次上市交易的基金份额注册登记机构：中国证券登记结算有限责任公司。

### （二）本基金投资运作、交易等环节的主要风险

1、本基金采用“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：一是本基金 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；二是本基金以获取基础设施项目运营

<sup>1</sup>本基金原扩位简称为“沪杭甬杭徽 REIT”，已于 2021 年 6 月 2 日变更为“浙商沪杭甬 REIT”，与《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金基金份额发售公告》不一致的，以《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金上市交易公告书》为准。

过程中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%；三是本基金采取封闭式运作，不开放申购与赎回业务，在上海证券交易所上市，场外份额持有人需将基金份额转托管至场内方可卖出。

2、本基金未来实际收益情况由所投资的杭徽高速公路（浙江段）及扩募基础设施项目（如有）未来经营情况决定。本基金分派现金流非永续现金流，每年度分派之后基金净值将相应下降，基金分派年限以所投资的底层基础设施项目高速公路收费期限为限，目前本基金初始投资的杭徽高速公路（浙江段）收费期限最长至 2031 年 12 月 25 日，该时间点之后，如收费权未展期，所投资的杭徽高速公路将不再有稳定的现金流流入。

3、本基金支付的标的股权转让价款已考虑到了截至股权转让基准日原始权益人在项目公司中与标的股权相关的全部和任何利益和负债，包括但不限于截至股权转让基准日为止的项目公司的任何应分配和支付予原始权益人的应分配红利（如有）以及原始权益人就标的股权在中国法律下享有的任何权益和负债。标的股权转让价款不包括主管部门因新冠肺炎疫情防控期间高速公路免费通行政策日后可能延长标的公路收费期限所产生的新增权益（如有）。

4、本基金存续期内通过资产支持证券、项目公司等特殊目的载体投资于高速公路基础设施项目，包括但不限于与基金相关的各项风险因素：市场风险、基金价格波动风险、流动性风险、发售失败风险、交易失败风险、集中投资风险、终止上市风险、管理风险、关联交易与利益冲突风险、基金净值变化风险、对外借款风险、税收政策调整风险及其他风险；与基础设施项目相关的风险因素：基础设施项目运营风险（包括车流量波动风险、市场替代风险、安全管理风险、日常运营养护风险和人员剥离风险）、政策风险、合规风险、基础设施估值无法体现公允价值的风险、现金流预测风险及其他风险等。

5、以上揭示事项仅为列举事项，未能详尽列明本基金的所有风险。投资者在参与基础设施基金相关业务前，应认真阅读基金合同、招募说明书及其更新、基金产品资料概要及其更新要等法律文件，熟悉基础设施基金相关规则，自主判断基金投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

（三）本基金认购基础设施资产支持证券以及本基金所投资专项计划投资基础资产的情况

本基金主要投资于由浙江浙商证券资产管理有限公司设立的杭徽高速资产支持专项计划资产支持证券。

(1) 资产支持证券的基本情况

1、资产支持证券名称

杭徽高速资产支持专项计划资产支持证券。

2、资产支持证券管理人

浙江浙商证券资产管理有限公司。

3、规模

43.6 亿元。

4、发行方式

面值发行。

5、资产支持证券面值

每份资产支持证券的面值为 100 元。

6、产品期限

自资产支持证券设立日（含该日）起至资产支持证券终止日止（含该日）（如该日为非工作日则顺延至该日后第一个工作日）。

7、预期到期日

资产支持证券的预期到期日为 2031 年 12 月 31 日，经资产支持证券持有人大会决议，资产支持证券可能提前或延后终止。

8、认购

基础设施基金根据其签署的《杭徽高速资产支持专项计划资产支持证券认购协议》所支付的认购资金取得资产支持证券的全部份额。

9、资产支持证券的登记、托管

资产支持证券管理人委托中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理资产支持证券的登记托管业务。

10、证券挂牌情况

上海证券交易所为资产支持证券提供挂牌服务，资产支持证券可在该平台转让流通。

(2) 专项计划投资基础资产的基本情况

本基金所投资专项计划最终投资的基础设施项目资产范围为杭徽高速公路浙江段及其相关构筑物资产组的收费权，其中杭徽高速公路(浙江段)包含三段，分别为杭徽高速公路昌化至昱岭关段、杭徽高速公路汪家埠至昌化段和杭徽高速公路留下至汪家埠段。

<b>杭徽高速公路（浙江段）昌昱段</b>	
项目（资产）名称	杭徽高速公路（浙江段）昌昱段
所在地	杭州市临安区
产权证书号	临国用（2008）第 04726 号
起止地点	起自临安区昌化镇，终于浙皖两省交界昱岭关
建设内容和规模	高速公路，36.537 公里
用地性质	公路用地
开竣工时间	于 2002 年 9 月 29 日开工，至 2004 年 12 月 25 日完工
决算总投资	98,718.10 万元
运营开始时间	2004 年 12 月 26 日
特许经营年限	浙江省人民政府批复收费期限为 25 年，从 2004 年 12 月 26 日至 2029 年 12 月 25 日
<b>杭徽高速公路（浙江段）汪昌段</b>	
项目（资产）名称	杭徽高速公路（浙江段）汪昌段
所在地	杭州市临安区
产权证书号	临国用（2010）第 05464 号
起止地点	起自临安区汪家埠，终于临安区昌化镇
建设内容和规模	高速公路 67.41 公里
用地性质	公路用地
开竣工时间	于 2004 年 12 月 1 日开工，至 2006 年 12 月 23 日完工
决算总投资	285,690.01 万元
运营开始时间	2006 年 12 月 26 日
特许经营年限	浙江省人民政府批复收费期限为 25 年，从 2006 年 12 月 26 日至 2031 年 12 月 25 日；
<b>杭徽高速公路（浙江段）留汪段</b>	
项目（资产）名称	杭徽高速公路（浙江段）留汪段
所在地	杭州市余杭区
产权证书号	杭余国用（2013）第 116-62 号、杭余国用（2013）第 116-949 号、杭余国用（2013）第 119-18 号、杭余国用（2013）第 120-16 号、杭余国用（2013）第 120-17 号、杭余国用（2013）第 120-19 号、杭余国用（2013）第 120-20 号、杭余国用（2013）第 120-61 号、杭余国用（2013）第 120-950 号、杭余国用（2014）第 119-987 号
起止地点	起自杭州市留下镇境内的杭州绕城高速，终于余杭区与临安区交界的汪家埠

建设内容和规模	高速公路 18.298 公里
用地性质	公路用地
开竣工时间	于 2004 年 9 月 1 日开工，至 2006 年 12 月 22 日完工
决算总投资	143,071.14 万元
运营开始时间	2006 年 12 月 26 日
特许经营年限	浙江省人民政府批复收费期限为 25 年，从 2006 年 12 月 26 日至 2031 年 12 月 25 日；

基础设施项目的主要收入来源于高速公路通行费收入。



### 第三部分 基金的募集与上市交易

#### （一）本基金上市前基金募集情况

1、基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会、证监许可[2021]1665号文。

2、基金合同生效日：2021年6月7日。

3、基金运作方式：契约型、封闭式基金。

4、基金合同期限：自基金合同生效之日起20年。

5、发售日期：本基金通过向战略投资者定向配售（以下简称“战略配售”）、向符合条件的网下投资者询价发售（以下简称“网下发售”）及向公众投资者公开发售（以下简称“公众发售”）相结合的方式进行发售。本次发售的询价期间为2021年5月24日的9:00-15:00，战略投资者缴款时间为2021年5月31日至2021年6月1日，网下发售及公众发售认购时间为2021年5月31日至2021年6月2日。根据《关于浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金公众基金份额提前结束募集的公告》，本基金公众发售认购及缴款截止日提前至2021年5月31日。

6、发售价格：本次发售价格为询价确定，询价区间为8.270元/份-9.511元/份，网下询价最终确定基金份额的认购价格为8.720元/份。

7、发售期限：网下询价为1个工作日，战略投资者缴款时间为2个工作日，网下发售及公众发售认购时间为3个工作日。根据《关于浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金公众基金份额提前结束募集的公告》，本基金公众发售认购时间缩短为1个工作日。

#### 8、发售方式及发售机构

本基金通过向战略投资者定向配售、向符合条件的网下投资者询价发售及向公众投资者公开发售相结合的方式进行发售。

（1）战略配售、网下发售由基金管理人及财务顾问负责组织；

（2）网下发售通过上交所“REITs 询价与认购系统”（“投资者系统”）认购；

（3）公众投资者可通过具有基金销售业务资格并经上交所和中国证券登记

结算有限责任公司认可的上交所会员单位进行场内认购(“场内证券经营机构”);

(4) 公众投资者亦可通过基金管理人及委托的场外基金销售机构进行认购, 场外发售机构包括:

- 1) 浙商证券股份有限公司
- 2) 招商银行股份有限公司
- 3) 浙江同花顺基金销售有限公司
- 4) 上海天天基金销售有限公司
- 5) 上海基煜基金销售有限公司
- 6) 诺亚正行基金销售有限公司
- 7) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
- 8) 中信建投证券股份有限公司
- 9) 浙江浙商证券资产管理有限公司直销柜台
- 9、验资机构: 北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)杭州分所。

#### (二) 基金的验资及合同生效情况

本基金自 2021 年 5 月 31 日起公开募集, 截至 2021 年 6 月 2 日募集工作已顺利结束。经北京兴华会计师事务所(特殊普通合伙)杭州分所验资, 此次募集的有效净募集资金总额为人民币 4,360,000,000.00 元, 认购资金在基金募集期间产生的银行利息共计人民币 380,525.66 元, 计入基金资产, 不折算为投资人基金份额。; 其中战略投资者有效净认购资金金额为 3,239,341,901.36 元人民币, 网下投资者获配有效净认购资金金额为 952,559,379.92 元人民币, 公众投资者获配有效净认购资金金额为 168,098,718.72 元人民币。本次募集认购资金已于 2021 年 6 月 4 日全额划入本基金在基金托管人招商银行股份有限公司开立的基金托管专户。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金合同》(以下简称“基金合同”)、《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》的有关规定, 本基金募集符合有关条件, 本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续, 基金合同自 2021 年 6 月 7 日起正式生效。

#### (三) 原始权益人或同一控制下的关联方、其他战略投资者参与本次基金战

略配售的具体情况以及限售安排：

本基金战略投资者的募集期已于 2021 年 6 月 1 日结束。经核查确认，《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金基金份额发售公告》中披露的 13 家战略投资者均已根据战略配售协议，按照网下询价确定的认购价格 8.720 元认购其承诺的基金份额并全额缴纳认购款，对应的有效认购基金份额数量为 371,484,163 份，认购规模为 32.3934 亿元（四舍五入保留四位小数），占本次基金份额发售总量的 74.30%；其中原始权益人及其同一控制下的关联方有效认购资金为人民币 2,570,018,637.76 元，折合份额为 294,726,908 份，占该基金发售份额总额的 58.95%。

本次发行战略投资者配售及限售结果如下：

序号	证券账户名称	认购份额总量（份）	认购份额占比（%）	限售期（月）
1	浙江沪杭甬高速公路股份有限公司	255,000,000	51.00%	份额 20%限售期为 60 个月，其余份额限售期为 36 个月
2	杭州市临安区交通投资有限公司	20,072,500	4.01%	36
3	杭州余杭交通集团有限公司	9,139,700	1.83%	36
4	浙江浙商金控有限公司	10,514,708	2.10%	36
5	光大证券资管—光大银行—光证资管诚享 7 号集合资产管理计划	10,514,708	2.10%	12
6	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	5,257,303	1.05%	12
7	招商财富资管—招商银行—招商财富—招银基础设施 1 号集合资产管理计划	5,257,303	1.05%	12
8	上海机场投资有限公司	8,411,806	1.68%	12
9	中国人寿再保险有限责任公	10,514,708	2.10%	12

	司			
10	中保投资有限责任公司—中国保险投资基金(有限合伙)	10,514,708	2.10%	12
11	中国东方资产管理股份有限公司	10,514,708	2.10%	12
12	中国中金财富证券有限公司	10,514,708	2.10%	12
13	北京首源投资有限公司	5,257,303	1.05%	12

#### (四) 基金上市交易

1、基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书〔2021〕256号

2、上市交易日期（以下简称“T”日）：2021年6月21日。

3、上市交易的证券交易所：上海证券交易所。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

4、基金二级市场交易简称：浙江杭徽。

5、基金二级市场交易代码：508001。

6、本次上市交易的基金份额总额：125,438,351份。

7、未上市交易份额的流通规定：未上市交易的基金份额托管在场外，持有人将其转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。本基金向上海证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司申请，自2021年6月8日起开通场外转托管至场内业务。本基金2021年6月17日暂停办理场外转托管至场内业务一日，次日起重新恢复办理。

8、锁定期份额的情况：

序号	限售期(月)	限售份额总量(份)	本次基金发售总份额的占比(%)
1	60	100,000,000	20.00%
2	36	194,726,908.00	38.95%
3	12	76,757,255.00	15.35%

9、本基金将以8.720元作为上市首日（即2021年6月21日）的开盘参考价。

## 第四部分 持有人户数、持有人结构及前十名持有人

### （一）持有人户数

截至 2021 年 6 月 7 日，本基金份额持有人户数为 209,939 户，平均每户持有的基金份额为 2381.64 份(四舍五入保留两位小数)。

### （二）持有人结构

2021 年 6 月 7 日，本基金份额持有人结构如下：

机构投资者持有的基金份额为 483,409,792 份，占基金总份额的 96.68%(四舍五入保留两位小数)；个人投资者持有的基金份额为 16,590,208 份，占基金总份额的 3.32%(四舍五入保留两位小数)。

### （三）前十名基金份额持有人的情况

截至 2021 年 6 月 7 日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（全称）	持有基金份额 （份）	占总份额比 例（%）
1	浙江沪杭甬高速公路股份有限公司	255000000	51.00%
2	杭州市临安区交通投资有限公司	20072500	4.01%
3	中国银河证券股份有限公司	16464004	3.29%
4	招商财富资管—建设银行—招商财富—鑫善 1 号集合资产管理计划	15126275	3.03%
5	东兴证券股份有限公司	14405976	2.88%
6	申万宏源证券有限公司	12347979	2.47%
7	光大证券资管—光大银行—光证资管诚享 7 号集合资产管理计划	10514708	2.10%
8	中国人寿再保险有限责任公司	10514708	2.10%
9	中保投资有限责任公司—中国保险投资基金（有限合伙）	10514708	2.10%
10	中国东方资产管理股份有限公司	10514708	2.10%
11	中国中金财富证券有限公司	10514708	2.10%
12	浙江浙商金控有限公司	10514708	2.10%

## 第五部分 基金主要当事人简介

### （一）基金管理人

- 1、名称：浙江浙商证券资产管理有限公司
- 2、法定代表人：盛建龙
- 3、总经理：盛建龙
- 4、注册资本：12 亿元人民币
- 5、住所：浙江省杭州市下城区天水巷 25 号
- 6、批准设立机关及设立批准文号：中国证监会证监基字[2012]1431 号
- 7、工商登记注册的法人营业执照文号：91330000066913005R
- 8、经营范围：证券资产管理业务，公开募集证券投资基金管理业务。（依法须经批准的项目，经相关部门批准后方可开展经营活动）。

### 9、股权结构

持股单位	持股占总股本比例
浙商证券股份有限公司	100%

### 10、信息披露负责人：方斌

### 11、本基金基金经理

侯显夫，男，浙江大学工商管理硕士，高级经济师，现任浙江浙商证券资产管理有限公司公募资产配置部业务董事，曾任职杭州市经济与信息化委员会中小企业服务中心，浙江省交通集团高速公路杭州北管理中心，自 2011 年 12 月起至今从事高速公路运营管理工作，具有 5 年以上基础设施运营管理经验。

王侃，男，浙江财经学院会计学专业，现任浙江浙商证券资产管理有限公司公募资产配置部高级经理，曾任职浙江省交通集团高速公路湖州管理中心、浙江杭宁高速公路有限责任公司，核工业井巷建设集团公司及浙江省疏浚工程有限公司，自 2011 年 12 月起从事基础设施运营管理工作，自 2018 年 6 月起从事高速公路运营管理工作，具有 5 年以上基础设施运营管理经验。

周建鉴，男，上海财经大学管理学与经济学双学士，浙江大学工商管理硕士，现任浙江浙商证券资产管理有限公司公募资产配置部业务副总监，2014 年 2 月起历任浙江浙商证券资产管理有限公司私募投行总部、结构与另类融资部经理、

高级经理、业务副总监，从事基础设施项目投融资，具有 5 年以上基础设施类项目投资及投后管理经验。

(二) 基金托管人

- 1、名称：招商银行股份有限公司(简称：招商银行)
- 2、住所：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
- 3、办公地址：深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
- 4、法定代表人：缪建民
- 5、成立时间：1987 年 4 月 8 日
- 6、组织形式：股份有限公司
- 7、注册资本：252.20 亿元
- 8、存续期间：持续经营
- 9、基金托管资格批文及文号：证监基金字[2002]83 号
- 10、信息披露负责人：张燕
- 11、联系电话：95555
- 12、基金托管业务经营情况：

截至 2020 年 12 月 31 日，招商银行股份有限公司累计托管 760 支证券投资基金。招商银行最近一年向中国证监会提交的注册基金申请材料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

(三) 财务顾问：

- 1、名称：中国国际金融股份有限公司
- 2、注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层
- 3、办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 33 层
- 4、法定代表人：沈如军
- 5、联系人：汪诚、张璐
- 6、联系电话：010-65051166
- 7、传真：010-65069092

(四) 基金上市推荐人

浙商证券股份有限公司

- 1、办公地址：浙江省杭州市五星路 201 号浙商证券大楼

- 2、注册地址：浙江省杭州市五星路 201 号浙商证券大楼
- 3、法定代表人：吴承根
- 4、联系电话：（0571）87901963
- 5、传真：（0571）87901955
- 6、网址：www.stocke.com.cn

（五）验资机构

- 1、北京兴华会计师事务所（特殊普通合伙）杭州分所
- 2、住所：杭州市拱墅区上塘街道舟山东路 198 号宸创大厦 14 楼
- 3、办公地址：杭州市拱墅区上塘街道舟山东路 198 号宸创大厦 14 楼
- 4、执行事务合伙人：陈树华
- 5、电话：0571-85450286
- 6、传真：0571-85450286
- 7、签章注册会计师：陈树华、朱佳明



## 第六部分 基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件：基金合同摘要。

## 第七部分 基金财务状况

### （一）基金募集期间费用

本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金管理人承担，不从基金资产中列支。

### （二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

### （三）基金资产负债表

本基金截至 2021 年 6 月 11 日的资产负债表如下（未经审计）：

资产	期末余额	负债与持有人权益	期末余额
<b>资产：</b>		<b>负债：</b>	
银行存款	0.00	短期借款	0.00
结算备付金	0.00	交易性金融负债	0.00
存出保证金	0.00	衍生金融负债	0.00
交易性金融资产	0.00	卖出回购金融资产款	0.00
其中：股票投资	0.00	应付证券清算款	0.00
债券投资	0.00	应付赎回款	0.00
基金投资	0.00	应付管理人报酬	74,657.55
权证投资	0.00	应付托管费	5,972.60
资产支持证券投资	0.00	应付销售服务费	0.00
衍生金融工具	0.00	应付交易费用	0.00
买入返售金融资产	0.00	应交税费	0.00
长期股权投资	4,360,000,000.00	应付利息	0.00
应收证券清算款	0.00	应付利润	0.00
应收利息	169,555.56	其他负债	4,086.55
应收股利	0.00	<b>负债合计</b>	84,716.70
应收申购款	0.00		
其他资产	0.00	<b>所有者权益：</b>	
		实收基金	500,000,000.00
		资本公积	3,860,000,000.00
		未分配利润	84,838.86
		<b>所有者权益合计</b>	4,360,084,838.86
<b>资产合计</b>	4,360,169,555.56	<b>负债和所有者权益总计</b>	4,360,169,555.56

注：报告截止日 2021 年 6 月 11 日，基金份额总额 500,000,000.00 份。

## 第八部分 基金投资组合

截至 2021 年 6 月 11 日，本基金的投资组合情况如下：

### （一）基金资产组合情况

资产类别	市值（元）	占总资产的比例(%)
股票	0.00	0.00
基金	0.00	0.00
债券	0.00	0.00
其中：央票	0.00	0.00
国债	0.00	0.00
政策性金融债	0.00	0.00
金融债（商业银行次级债、商业银行普通债券、证券公司短期融资券、其他金融债券）	0.00	0.00
企业债	0.00	0.00
企业短期融资券	0.00	0.00
可转债	0.00	0.00
银行间中期票据	0.00	0.00
同业存单	0.00	0.00
私募债	0.00	0.00
权证	0.00	0.00
资产支持证券	0.00	0.00
长期股权投资	4,360,000,000.00	100.00
理财产品投资	0.00	0.00
货币市场工具（票据、CD）	0.00	0.00
现金（银行存款及清算备付金）	0.00	0.00
银行定期存款（定期存款、通知存款、大额存单）	0.00	0.00
其他资产（交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、买入返售证券等）	169,555.56	0.00
其中：买入返售证券		
资产合计	4,360,169,555.56	100.00

注：基础设施项目资产情况详见本基金招募说明书。

### （二）期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

### （三）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

本基金本报告期末未持有股票投资组合。

(四) 期末按券种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

(五) 期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

本基金本报告期末未持有债券投资组合。

(六) 投资组合报告附注

1、其他各项资产构成

名称	金额
交易保证金	0.00
应收证券清算款	0.00
应收股利	0.00
应收基金红利	0.00
应收利息	169,555.56
应收申购款	0.00
其他应收款	0.00
待摊费用	0.00
其他	0.00
合计	169,555.56

2、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

3、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## 第九部分 重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

## 第十部分 基金管理人承诺

基金管理人就本基金上市交易后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、证券交易所的监督管理；

（三）在知悉可能对基金份额价格产生误导性影响或者引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

## 第十一部分 基金托管人承诺

上海证券交易所：

在贵所的大力支持下，由浙江浙商证券资产管理有限公司（以下简称“浙商资管”）管理，并由招商银行股份有限公司（以下简称“我行”）托管的浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金（以下简称“本基金”）已于2021年6月7日成立运作。

在本基金上市后，我行承诺严格遵照《基金法》等相关法规以及《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金基金合同》、《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金托管协议》的约定履行相应职责。

## 第十二部分 基金上市推荐人意见

上海证券交易所：

浙商证券股份有限公司作为基金上市推荐人，就浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金上市交易事宜出具意见如下：

（一）本基金上市符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《上海证券交易所交易规则》、《上海证券交易所证券投资基金上市规则》、《上海证券交易所公开募集基础设施证券投资基金（REITs）业务办法（试行）》、《上海证券交易所公开募集基础设施证券投资基金（REITs）规则适用指引第2号——发售业务（试行）》、《上海证券交易所上市开放式基金业务指引（2019年修订）》规定的相关条件；

（二）本基金上市文件真实、准确、完整，符合法律法规规定。



## 第十三部分 备查文件目录

(一)中国证监会准予浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金注册的文件

(二)《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金基金合同》

(三)《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金托管协议》

(四)《华浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金招募说明书》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

(八)中国证监会要求的其他文件

备查文件存放地点为基金管理人、基金托管人的住所；投资者如需了解详细的信息，可向基金管理人、基金托管人申请查阅。

## 附件：基金合同内容摘要

### 一、基金管理人、基金托管人、基金份额持有人的权利、义务

#### （一）基金管理人的权利与义务

1、根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》（简称“《基金指引》”）《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称“《运作办法》”）及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：

- （1）运用基金财产；
- （2）按照有关规定运营管理基础设施项目；
- （3）设立专门的子公司或委托符合条件的运营管理机构运营管理基础设施项目（包括日常运营管理、公路养护管理、安全管理等事宜）；委托运营管理机构运营管理基础设施项目的，派员负责基础设施项目公司财务管理，监督、检查运营管理机构履职情况；
- （4）发生法定解聘情形的，解聘运营管理机构；
- （5）依照有关规定，为基金和基金份额持有人的利益行使因基金财产投资于基础设施资产支持证券所产生的权利；
- （6）担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）约定的费用；
- （7）在符合有关法律、法规的前提下，制订和调整有关基金认购、非交易过户等业务规则；
- （8）选择、更换基金销售机构，对基金销售机构的相关行为进行监督和处理；
- （9）对基金份额进行销售；
- （10）召集基金份额持有人大会；
- （11）获得基金管理人报酬；
- （12）对基金托管人进行监督；
- （13）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

(14) 在运营管理机构更换时，提名新的运营管理机构；

(15) 依据《基金合同》及有关法律的规定决定基金收益的分配方案；

(16) 选择、更换律师事务所、会计师事务所、车流量预测机构、评估机构或其他为基金提供服务的外部机构；

(17) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；

(18) 审议金额（连续 12 个月累计发生金额）不足净资产 20% 的基础设施项目的购入或出售事项（不包括扩募）；

(19) 审议基础设施基金直接或间接的新增对外借款；

(20) 决定针对运营管理机构年度经营绩效目标以及年度绩效考核办法（首年度绩效考核办法除外）；

(21) 决定标准条款项下应由基础设施资产支持证券持有人审批决定的事宜，包括下述事宜：决定基础设施资产支持证券延期；决定是否终止基础设施资产支持证券；决定扩募方案；根据标准条款的约定，在资产支持证券清算时，审批决定资产支持证券清算方案；决定修改基础设施资产支持证券法律文件的重要内容；发生资产支持证券管理人解任事件，需要更换资产支持证券管理人的；发生资产支持证券托管人解任事件，需要更换资产支持证券托管人的；其他与基础设施资产支持证券相关的重要事项。

(22) 决定项目公司章程项下应由股东审批决定的事宜，包括下述事宜：决定项目公司的经营方针和投资计划；审议批准项目公司执行董事的报告；审议批准项目公司的年度财务预算方案和决算方案；其他项目公司章程所规定的应由项目公司股东审批决定的事宜；

(23) 在本基金所持有的基础设施资产支持证券在《基金合同》生效之日起 6 个月内未成功设立的情况下，与基金托管人协商后，决定终止基金合同；

(24) 收取法律法规要求增加的基金费用和其他由基金承担的费用；

(25) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。。

2、根据《基金法》、《基金指引》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：

(1) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产；

(2) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账；

(3) 专业审慎运营管理基础设施项目，主动履行《基金指引》第三十八条规定基础设施项目运营管理职责，包括：

- a)及时办理基础设施项目、印章证照、账册合同、账户管理权限交割等；
- b)建立账户和现金流管理机制，有效管理基础设施项目租赁、运营等产生的现金流，防止现金流流失、挪用等；
- c)建立印章管理、使用机制，妥善管理基础设施项目各种印章；
- d)为基础设施项目购买足够的财产保险和公众责任保险；
- e)制定及落实基础设施项目运营策略；
- f)签署并执行基础设施项目运营的相关协议；
- g)收取基础设施项目租赁、运营等产生的收益，追收欠缴款项等；
- h)执行日常运营服务，如安保、消防、通讯及紧急事故管理等；
- i)实施基础设施项目维修、改造等；
- j)基础设施项目档案归集管理等；
- k)按照《基金指引》要求聘请评估机构、审计机构进行评估与审计；
- l)依法披露基础设施项目运营情况；
- m)提供公共产品和服务的基础设施资产的运营管理，应符合国家有关监管要求，严格履行运营管理义务，保障公共利益；
- n)建立相关机制防范运营管理机构的履约风险、基础设施项目经营风险、关联交易及利益冲突风险、利益输送和内部人控制风险等基础设施项目运营过程中的风险；
- o)按照基金合同约定和基金份额持有人利益优先的原则，专业审慎处置资产；
- p)中国证监会规定的其他职责。

基金管理人可以设立专门的子公司或委托运营管理机构负责上述第d)至i)项运营管理职责；如基金管理人设立专门的子公司或委托运营管理机构运营管理基础设施项目，基金管理人依法应当承担的责任不因委托而免除；

(4) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；

(5) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金

财产为自身及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

(6) 依法接受基金托管人的监督；

(7) 严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

(8) 编制基础设施基金定期报告与临时报告，编制基金中期与年度合并及单独财务报表；

(9) 对基础设施项目权属证书及相关文件的真实性和完整性进行验证，向基金托管人移交基础设施项目权属证书及相关文件；

(10) 保守基金商业秘密，不泄漏基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄漏，但向监管机构、司法机关或因审计、法律等外部专业顾问提供服务而向其提供的情况除外；

(11) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定的要求召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(12) 依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售和登记事宜；

(13) 组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

(14) 基金清算涉及基础设施项目处置的，应遵循基金份额持有人利益优先的原则，按照法律法规规定进行资产处置，并尽快完成剩余财产的分配；

(15) 因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(16) 根据规定监督基金托管人按法律法规和《基金合同》履行自身的义务，如基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定，应呈报中国证监会和其他监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

(17) 基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

(18) 及时办理基金备案和基金上市相关手续；

(19) 按《基金合同》的要求确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配基金收益；

(20) 按《基金合同》的要求，为基金和基金份额持有人的权益，执行基金

份额持有人大会的决议；

(21) 基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后 30 日内退还基金认购人；

(22) 按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料 15 年以上；

(23) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件；

(24) 保存基金份额持有人名册；

(25) 制定扩募方案，提交基金份额持有人大会审议；审议通过后执行基金份额持有人有关扩募的相关决议；

(26) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二) 基金托管人的权利与义务

1、根据《基金法》、《基金指引》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

(1) 依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用；

(2) 监督基础设施基金资金账户、基础设施项目运营收支账户等重要资金账户及资金流向，确保符合法律法规规定和基金合同约定，保证基金资产在监督账户内封闭运行；

(3) 监督基金管理人对本基金的投资运作；

(4) 监督基金管理人为基础设施项目购买足够的保险；

(5) 提议召开或召集基金份额持有人大会；

(6) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

2、根据《基金法》、《基金指引》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

(1) 设立专门的基金托管部门，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员及高级管理人员，负责基金财产托管事宜；

(2) 除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外，不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

(3) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

(4) 制定相关保管制度，接管基金管理人移交的基础设施项目权属证书及相关文件原件，并安全保管基础设施基金财产、权属证书及相关文件；

(5) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

(6) 监督基础设施项目公司借入款项安排，确保符合法律法规规定及约定用途；

(7) 保守基金商业秘密，除《基金法》、《基金合同》及其他有关法律法规规定或监管机构另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄漏，因审计、法律等向外部专业顾问提供的情况除外；

(8) 对基金财务会计报告、中期报告和年度报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

(9) 监督、复核基金管理人按照法律法规规定和基金合同约定进行投资运作、收益分配、信息披露等；

(10) 保存基金份额持有人名册；

(11) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

(12) 依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益款项；

(13) 依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定，召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

(14) 因违反《基金合同》导致基金财产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

(15) 根据规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规行为，对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时，应

为基金向基金管理人追偿；

(16) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

(17) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

### (三) 基金份额持有人

基金投资者持有本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受，基金投资者自依据《基金合同》取得的基金份额，即成为本基金份额持有人和《基金合同》的当事人，直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

1、根据《基金法》、《基金指引》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

- (1) 分享基金财产收益；
- (2) 参与分配清算后的剩余基金财产；
- (3) 依法转让其持有的基金份额；
- (4) 按照规定要求召开基金份额持有人大会或者召集基金份额持有人大会；
- (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
- (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
- (7) 监督基金管理人的投资运作；
- (8) 对基金管理人、基金托管人、基金服务机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼或仲裁；
- (9) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。

每份基金份额具有同等的合法权益。

2、根据《基金法》、《基金指引》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

- (1) 认真阅读并遵守《基金合同》、招募说明书等信息披露文件；
- (2) 缴纳基金认购款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用；



(3) 在其持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；

(4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人合法权益的活动；

(5) 拥有权益的基金份额达到特定比例时，按照《基金合同》第六节第五部分的约定履行份额权益变动相应的程序或者义务；

(6) 拥有权益的基金份额达到 50%时，继续增持基础设施基金份额的，按照规定履行基础设施基金收购的程序或义务；

(7) 了解所投资基金产品，了解自身风险承受能力，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险；

(8) 关注基金信息披露，及时行使权利和履行义务；

(9) 执行生效的基金份额持有人大会的决议；

(10) 返还在基金交易过程中因任何原因获得的不当得利；

(11) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

3、投资者及其一致行动人同意在拥有基金份额时即视为承诺，如投资者及其一致行动人违反《业务办法》第五十五条第一款、第二款的规定买入在基础设施基金汇总拥有权益的基金份额的，在买入后 36 个月内对该超过规定比例部分的基金份额不行使表决权。

4、作为战略投资者的原始权益人或其同一控制下的关联方的义务，包括以下内容：

(1) 不得侵占、损害基础设施基金所持有的基础设施项目；

(2) 配合基金管理人、基金托管人以及其他为基础设施基金提供服务的专业机构履行职责；

(3) 确保基础设施项目真实、合法，确保向基金管理人等机构提供的文件资料真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏；

(4) 依据法律法规、基金合同及相关协议约定及时移交基础设施项目及相关印章证照、账册合同、账户管理权限等；

(5) 主要原始权益人及其控股股东、实际控制人提供的文件资料存在隐瞒重要事实或者编造重大虚假内容等重大违法违规行为的，应当购回全部基金份额或基础设施项目权益；

(6) 法律法规及基金相关协议约定的其他义务。

## 二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

本基金份额持有人大会不设日常机构。

### (一) 召开事由

1、除法律法规、中国证监会和《基金合同》另有规定之外，当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：

- (1) 变更基金类别；
- (2) 对基础设施基金的投资目标、投资策略和投资范围等作出重大调整；
- (3) 变更基金份额持有人大会程序；
- (4) 决定基金扩募；
- (5) 延长基金存续期限，包括基础设施项目所有权或经营权期限延长的，导致的存续期限变更；
- (6) 决定修改基金合同的重要内容；
- (7) 提前终止《基金合同》；
- (8) 在出现基金管理人和/或基金托管人解任事件的情形下，决定更换基金管理人和/或基金托管人；
- (9) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；
- (10) 决定金额（连续 12 个月内累计发生金额）超过基金净资产 20% 的基础设施项目购入或出售；
- (11) 基础设施基金成立后发生的交易金额（连续 12 个月内累计发生金额）超过基金净资产 5% 以上的关联交易；
- (12) 转换基金运作方式；
- (13) 本基金与其他基金的合并；
- (14) 除基金合同约定的法定解聘情形外拟解聘运营管理机构、决定更换运营管理机构；
- (15) 提前终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被上海证券交易所

终止上市的除外；

(16) 变更基金可供分配金额相关计算调整项；

(17) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他应当召开基金份额持有人大会的事项。

(二) 会议提案人

基金管理人、基金托管人、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人，可以向基金份额持有人大会提出议案。

(三) 会议召集人及召集方式

1、除法律法规规定或基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。

2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集。

3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。

基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集，并自出具书面决定之日起 60 日内召开并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

4、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额 10%以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起 10 日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面决定之日起 60 日内召开。并告知基金管理人，基金管理人应当配合。

5、代表基金份额 10%以上的基金份额持有人就同一事项要求召开基金份额持有人大会，而基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额 10%以上的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前 30 日报中国证监会备案。

基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会的，基金管理人、基金托管人应当配合，不得阻碍、干扰。

6、基金份额持有人大会的召集人负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

（四）召开基金份额持有人大会的通知时间、通知内容、通知方式

1、召开基金份额持有人大会，召集人应于会议召开前 30 日，在指定媒介公告。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：

- （1）会议召开的时间、地点和会议形式；
- （2）会议拟审议的事项、议事程序和表决方式；
- （3）有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权益登记日；
- （4）授权委托证明的内容要求（包括但不限于代理人身份，代理权限和代理有效期限等）、送达时间和地点；
- （5）会务常设联系人姓名及联系电话；
- （6）出席会议者必须准备的文件和必须履行的手续；
- （7）按照相关法律法规召集人需要通知的其他事项。

2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由会议召集人决定在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的见证律师的联系方式、表决意见寄交的截止时间和收取方式。

3、如召集人为基金管理人，还应另行书面通知基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金托管人，则应另行书面通知基金管理人到指定地点对表决意见的计票进行监督；如召集人为基金份额持有人，则应另行书面通知基金管理人和基金托管人到指定地点对表决意见的计票进行监督。基金管理人或基金托管人拒不派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响表决意见的计票效力。

（五）基金份额持有人出席会议的方式

基金份额持有人大会可通过现场开会方式、通讯开会方式或法律法规、监管机构允许的其他方式召开，会议的召开方式由会议召集人确定。召集人应当提供网络投票和其他合法方式为基金份额持有人行使投票权提供便利。

1、现场开会。由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托证明委派

代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会，基金管理人或基金托管人不派代表列席的，不影响表决效力。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：

（1）亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并且持有基金份额的凭证与基金管理人持有的登记资料相符；

（2）经核对，汇总到会者出示的在权益登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）。

若到会者在权益登记日代表的有效的基金份额少于本基金在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会到会者在权益登记日代表的有效的基金份额应不少于本基金在权益登记日基金总份额的三分之一（含三分之一）。

2、通讯开会。通讯开会系指基金份额持有人将其对表决事项的投票以书面形式或大会公告载明的其他方式在表决截止日以前送达至召集人指定的地址或系统。通讯开会应以书面方式或大会公告载明的其他方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

（1）会议召集人按《基金合同》约定公布会议通知后，在2个工作日内连续公布相关提示性公告；

（2）召集人按基金合同约定通知基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）到指定地点对表决意见的计票进行监督。会议召集人在基金托管人（如果基金托管人为召集人，则为基金管理人）和见证律师的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的表决意见；基金托管人或基金管理人经通知不参加收取表决意见的，不影响表决效力；

（3）本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一）；若本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见基金份额持有人所

持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一，召集人可以在原公告的基金份额持有人大会召开时间的3个月以后、6个月以内，就原定审议事项重新召集基金份额持有人大会。重新召集的基金份额持有人大会应当有代表三分之一以上基金份额的持有人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见；

(4) 上述第(3)项中直接出具表决意见的基金份额持有人或受托代表他人出具表决意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具表决意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托证明符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定，并与基金登记机构记录相符；

3、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人大会可通过网络、电话或其他方式召开，基金份额持有人可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式进行表决，具体方式由会议召集人确定并在会议通知中列明。在会议召开方式上，本基金亦可采用网络、电话、短信等其他非现场方式或者以非现场方式与现场方式结合的方式召开基金份额持有人大会，会议程序比照现场开会和通讯方式开会的程序进行。

4、在不与法律法规冲突的前提下，基金份额持有人授权他人代为出席会议并表决的，授权方式可以采用书面、网络、电话、短信或其他方式，具体方式在会议通知中列明。

## (六) 议事内容与程序

### 1、议事内容

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及会议召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金份额持有人大会的召集人发出召集会议的通知后，对原有提案的修改应当在基金份额持有人大会召开前及时公告。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

### 2、议事程序

#### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列约定程序确定和公布监票

人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人和代理人所持表决权的二分之一以上选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。基金管理人和基金托管人拒不出席或主持基金份额持有人大会，不影响基金份额持有人大会作出的决议的效力。

会议召集人应当制作出席会议人员的签名册。签名册载明参加会议人员姓名（或单位名称）、身份证明文件号码、持有或代表有表决权的基金份额、委托人姓名（或单位名称）和联系方式等事项。

#### （2）通讯开会

在通讯开会的情况下，首先由召集人提前 30 日公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内在见证律师监督下由召集人统计全部有效表决，在见证律师监督下形成决议。

#### （3）其他开会方式

召集人应当提供网络投票和其他法律法规、监管机构允许的方式召开会议，并为基金份额持有人行使投票权提供便利。

#### （七）表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。基金份额持有人与表决事项存在关联关系时，应当回避表决，其所持份额不计入有表决权的基金份额总数。但与运营管理机构存在关联关系的基金份额持有人就解聘、更换运营管理机构事项无需回避表决，中国证监会认可的特殊情形除外。

基金份额持有人大会决议分为特别决议和一般决议：

1、特别决议，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的三分之二以上通过方可做出；发生下列情形的，以特别决议通过方为有效：

（1）除法律法规另有规定外，变更基金类别、转换基金运作方式、更换基金管理人或者基金托管人、提前终止《基金合同》、本基金与其他基金合并；

（2）对基础设施基金的投资目标、投资策略和投资范围等作出重大调整；

(3) 金额（连续 12 个月内累计发生金额）占基金净资产 50%以上的扩募；

(4) 金额（连续 12 个月内累计发生金额）占基金净资产 50%以上的基础设施项目购入或出售；

(5) 基础设施基金成立后发生的金额（连续 12 个月内累计发生金额）占基金净资产 20%以上关联交易。

2、一般决议，一般决议须经参加大会的基金份额持有人或其代理人所持表决权的二分之一以上通过方为有效；发生下列情形的，以一般决议的方式通过：

(1) 金额（连续 12 个月内累计发生金额）超过基金净资产 20%且低于基金净资产 50%的基础设施项目购入或出售；

(2) 金额（连续 12 个月内累计发生金额）低于基金净资产 50%的基金扩募；

(3) 基础设施基金成立后发生的金额（连续 12 个月内累计发生金额）超过基金净资产 5%且低于基金净资产 20%的关联交易；

(4) 除基金合同约定的法定解聘情形外拟解聘运营管理机构、决定更换运营管理机构；

(5) 调整基金管理人、基金托管人的报酬标准；

(6) 除基金合同约定的必须以特别决议形式进行审议决策以外的其他事由。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认投资者身份文件的表决视为有效出席的投资者，表面符合会议通知规定的表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

(八) 计票

1、现场开会

(1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人和代理人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如基金份额持有人大会由基金份额持有人自行召集或大会虽然由基金管理



人或基金托管人召集，但是基金管理人或基金托管人未出席大会的，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。基金管理人或基金托管人不出席大会的，不影响计票的效力。

(2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。

(3) 如果会议主持人或基金份额持有人或代理人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由见证律师予以见证，基金管理人或基金托管人拒不出席大会的，不影响计票的效力。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监督员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由见证律师对其计票过程予以见证。基金管理人或基金托管人拒派代表对表决意见的计票进行监督的，不影响计票和表决结果。

## 3、其他开会方式

以网络投票和其他法律法规、监管机构允许的方式召开会议的，基金管理人或基金托管人应严格按照法律法规、监管机构规定的方式对表决意见的计票进行监督，不影响计票和表决结果。

### (九) 生效与公告

基金份额持有人大会的决议，召集人应当自通过之日起 5 日内报中国证监会备案。

基金份额持有人大会的决议自表决通过之日起生效。

基金份额持有人大会决议自生效之日后依照《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》（以下简称“《信息披露办法》”）的有关规定在规定媒介上公告。如果采用通讯方式进行表决，在公告基金份额持有人大会决议时，必须将见证书全文、见证律师所在律师事务所、见证律师姓名等一同公告。

基金管理人、基金托管人和基金份额持有人应当执行生效的基金份额持有人大会的决议。生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人、基金托管人均有约束力。基金管理人、基金托管人依据基金份额持有人大会生效决议行事的结果由全体基金份额持有人承担。

(十) 基金管理人和基金托管人可协商确定的事项

1、在法律法规规定和《基金合同》约定的范围内且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后确定，不需召开基金份额持有人大会：

(1) 本基金所持有的基础设施资产支持证券在《基金合同》生效之日起 6 个月内未成功设立，从而终止《基金合同》；

(2) 按照法律法规和《基金合同》规定不需召开基金份额持有人大会也无需提交基金管理人的运营管理委员会审议的其他情形。

(十一) 本部分关于基金份额持有人大会召开事由、召开条件、议事程序、表决条件等规定，凡是直接引用法律法规或监管规则的部分，如将来法律法规或监管规则修改导致相关内容被取消或变更的，基金管理人与基金托管人根据新颁布的法律法规或监管规则协商一致并提前公告后，可直接对本部分内容进行修改和调整，无需召开基金份额持有人大会审议。

三、基金收益分配原则、执行方式

基金管理人与基金托管人按照《基金合同》的约定处理基金收益分配。

根据《基金指引》、《公开募集基础设施证券投资基金运营操作指引（试行）》和其他有关规定，订明基金收益分配方案的制定、复核、公告及实施程序

1、基金收益分配的金额及频率：应当将 90%以上合并后基金年度可供分配金额以现金形式分配给投资者。基础设施基金的收益分配在符合分配条件的情况下每年不得少于 1 次。

2、可供分配金额计算：在净利润基础上进行调整后的金额，相关计算调整项目至少包括基础设施项目资产的公允价值变动损益、折旧与摊销，同时应当综合考虑项目公司持续发展，偿债能力和经营现金流等因素。

基金收益分配的程序：基础设施基金进行分配的，应当至少在权益登记日前 2 个交易日公告权益登记日、收益分配基准日、现金红利发放日、可供分配金额

(含净利润、调整项目及调整原因)、按照《基金合同》约定应分配金额等事项。

#### 四、与基金财产管理、运用有关费用的提取、支付方式与比例

##### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、资产评估费、车流量评估费、税务咨询、财务顾问费、诉讼费和仲裁费等；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的账户开户费用、账户维护费用；
- 9、基金上市费和年费；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

##### (二) 不得从基金财产中列支的基金费用下列费用不列入基金费用

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基础设施基金募集期间产生的评估费、财务顾问费（如有）、会计师费、律师费等各项费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

在基金募集失败时，上述相关费用不得从投资者认购款项中支付。

##### (三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### 1、基金管理人的管理费

基金管理人的管理费由固定管理费和浮动管理费两部分构成，核算方式具体如下：

###### (1) 固定管理费

本基金固定管理费按最近一期经审计的基金净资产的 0.125%年费率计提，

未有经审计的基金净资产数据的，按照募集规模的 0.125%年费率计提。该部分管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.125\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为最近一期经审计的基金净资产或募集规模

基金管理费每日计算，逐日累计至每季季末，按季支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次季首月月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。固定管理费自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

## (2) 浮动管理费

每一个会计年度结束后，基金管理人计算年度基金可供分配金额。基金管理人在此基础上，测算当年净现金流分派率（净现金流分派率=当年年度可供分配金额/基金设施基金募集资金金额），书面提交给基金托管人复核

浮动管理费应当按照如下标准确定：

- 1) 如测算结果显示的基础设施基金净现金流分派率高于 10%(含)的，浮动管理费为考核年度当年运营收入的 1.2%；
- 2) 如测算结果显示的基础设施基金净现金流分派率高于 9%(含)的且不足 10%的，浮动管理费为考核年度当年运营收入的 1%；
- 3) 如测算结果显示的基础设施基金净现金流分派率不足 9%的，浮动管理费为考核年度当年运营收入的 0.8%；

当年运营收入为当年审计报告中的营业收入。基金管理人测算应收取的浮动管理费，并书面提交给基金托管人复核。

基金托管人对基金管理人测算的浮动管理费数额有异议的，应于收到测算结果之日起 3 个工作日内反馈，并明确列明需要进一步调整和核算的内容和数额；基金管理人应于收到反馈之日起 2 个工作日内提供书面意见，并提交更新后的测算结果；基金管理人和基金托管人应就浮动管理费的计算依据和测算结果进行充分沟通，直至双方均书面确认无异议。

浮动管理费按年支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，

自动在当年审计报告出具后第 30 日前按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。浮动管理费自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

基金管理人应在收到相应浮动管理费数额后 5 个工作日内开具发票或收据。

## 2、基金托管人的托管费

本基金的基金托管人的托管费按最近一期经审计的基金净资产的 0.01% 年费率计提，未有经审计的基金净资产数据的，按照募集规模的 0.01% 年费率计提。该部分托管费的计算方式如下：

$$H = E \times 0.01\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的托管费

E 为最近一期经审计的基金净资产或募集规模

基金托管人的托管费按照基金托管协议的约定进行支付。

### （四）基金税收

本基金支付给基金管理人、基金托管人的各项费用均为含税价格，具体税率适用中国税务主管机关的规定。

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

## 五、基金财产的投资方向和投资限制

### （一）投资目标

基金的主要资产投资于基础设施资产支持证券，并持有其全部份额，通过投资基础设施资产支持证券穿透取得基础设施项目完全所有权或经营权利，基金管理人主动运营管理基础设施项目，以获取基础设施项目运管过程中稳定现金流为主要目的。

### （二）投资范围

本基金所募集的资金只能根据《基金合同》的约定，主要投资于基础设施资产支持证券全部份额，本基金的其他基金资产应当依法投资于利率债、AAA 级信用债，或货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:投资于基础设施资产支持证券的比例不低于基金资产的 80%,但因基础设施项目出售、按照扩募方案实施扩募收购时收到扩募资金但尚未完成基础设施项目购入及中国证监会认可的其他因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的不属于违反投资比例限制。

如果法律法规对该比例要求有变更的,基金管理人在履行适当程序后,本基金的投资范围会做相应调整。

### (三) 投资策略

基金合同生效后,本基金将根据与资产支持证券管理人签署的认购协议等相关协议约定,以基金资产认购并全额持有基础设施资产支持证券份额,从而向下穿透取得杭徽高速基础设施项目,力争获取稳定的车辆通行费等稳定现金流收益。

本基金其余基金资产将投资于利率债、信用等级在 AAA(含)的债券及货币市场工具,以有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

#### 1、基础设施基金运营管理策略

基金管理人将主动履行基础设施项目运营管理职责,通过与运营管理机构签订基础设施项目运营管理服务协议的方式委托运营管理机构依约负责委托职责和协助职责,并自行派员负责基础设施项目公司财务管理,以求确保基础设施项目的正常运转,力争基础设施基金的稳定收益。

#### 2、扩募收购策略

本基金将积极寻求符合扩募条件的扩募基础设施项目,根据《基金指引》等相关规定开展扩募相关工作,力争将优质的扩募基础设施项目装入本基金,以进一步确保基础设施基金的稳定、持续收益。

#### 3、资产出售及处置策略

本基金将积极拓宽与各类市场参与主体的多方位沟通,捕捉资产出售及处置的适当机会,从维护基金份额持有人的权益出发,灵活安排并推进资产出售及处置相关事宜。

#### 4、基础设施资产支持证券及基础设施项目投资策略

本基金将积极运营管理所投资的基础设施项目资产,力争获取车辆通行费等

稳定现金流收益。

## 5、债券投资策略

### (1) 资产配置策略

本基金将通过对宏观经济运行情况、国家货币及财政政策、资本市场资金环境等重要因素的研究和预测，结合投资时钟理论并利用公司研究开发的多因子模型等数量工具，优化基金资产在利率债、信用债以及货币市场工具等各类固定收益类金融工具之间的配置比例。

### (2) 利率类品种投资策略

本基金对国债等利率品种的投资，是在对国内外宏观经济运行状况及政策环境等进行分析和预测基础上，研究利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化趋势，深入分析利率品种的收益和风险，预测调整债券组合的平均久期，并通过运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略。在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

### (3) 信用债投资策略

本基金将在深入的宏观研究基础上，综合分析各类信用债发行主体所处行业环境、发行人所处的市场地位、财务状况、管理水平等因素后，结合具体发行契约，对债券进行信用评级。在此基础上，建立信用类债券池，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资。

## 6、融资策略

本基金直接或间接对外借入款项，应当遵循基金份额持有人利益优先原则，不得依赖外部增信，借款用途限于基础设施项目日常运营、维修改造、项目收购等，且基金总资产不得超过基金净资产的 140%。其中，用于基础设施项目收购的借款应当符合下列条件：

- 1) 借款金额不得超过基金净资产的 20%；
- 2) 基础设施基金运作稳健，未发生重大法律、财务、经营等风险；
- 3) 基础设施基金已持基础设施和拟收购基础设施相关资产变现能力较强且可以分拆转让以满足偿还借款要求，偿付安排不影响基金持续稳定运作；
- 4) 基础设施基金可支配现金流足以支付已借款和拟借款本息支出，并能保障基金分红稳定性；

5) 基础设施基金具有完善的融资安排及风险应对预案;

6) 中国证监会规定的其他要求。

基金总资产被动超过基金净资产 140%的, 基金不得新增借款, 基金管理人应当及时向中国证监会报告相关情况及拟采取的措施等。

#### (四) 投资限制

##### 1、组合限制

本基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 投资于基础设施资产支持证券的比例不低于基金资产的 80%, 但因基础设施项目出售、按照扩募方案实施扩募收购时收到扩募资金但尚未完成基础设施项目购入及中国证监会认可的其他因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的不属于违反投资比例限制。

(2) 除基础设施资产支持证券外, 本基金所持有家公司发行的证券, 其市值不超过基金资产净值的 10%;

(3) 除基础设施资产支持证券外, 本基金管理人管理的全部基金持有家公司发行的证券, 不超过该证券的 10%;

(4) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%, 进入全国银行间同业市场进行债券回购的最长期限为 1 年, 债券回购到期后不得展期;

(5) 本基金资产总值不超过基金资产净值的 140%;

(6) 本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的, 可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(7) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

除上述 (1)、(6) 情形之外, 因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的, 基金管理人应当在 60 个工作日内进行调整, 但法律法规或中国证监会规定的特殊情形除外。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内, 本基金的投资范围、投资策略应当符合



基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

本基金不主动投资于信用级别评级为 AAA 级（不含）以下的信用债，基金持有信用债期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，基金管理人原则上应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

如果法律法规或监管部门对上述投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消或调整上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制或以调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- （1）承销证券；
- （2）违反规定向他人贷款或者提供担保；
- （3）从事承担无限责任的投资；
- （4）买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- （5）向其基金管理人、基金托管人出资；
- （6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；
- （7）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产收购基础设施项目后从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循基金份额持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制等相关制度，按照市场公平合理价格执行，履行适当程序外，还应当按法律法规规定的程序召开基金份额持有人大会。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。

基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或变更上述禁止性规定，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，本基金可不受上述规定的限制或以变更后的规定为准，不需经基金份额持有人大会审议。

## 六、基金资产净值的计算方法和核算及估值程序

### （一）基金资产

基金资产指基金合并财务报表层面计量的总资产，指拥有的基础设施资产支

持证券、有价证券、银行存款本息和基金应收款项以及其他投资所形成的价值总和。

## （二）基金资产净值

基金净资产指基金合并财务报表层面计量的净资产，指基金资产总值减去基金负债后的价值。

## （三）核算及估值程序

1、基金份额净值按照估值日闭市后，基础设施基金合并财务报表的净资产除以当日基金份额的余额数量计算，精确到 0.0001 元，小数点后第 5 位四舍五入，由此产生的误差计入基金财产。国家另有规定的，从其规定。

2、基金管理人应计算每个中期报告和年度报告的基础设施基金合并财务报表的净资产和基金份额净值。

3、根据基金指引的有关规定，基础设施基金存续期间，基金管理人应当聘请评估机构对基础设施项目资产每年进行 1 次评估，并在基础设施基金年度报告中披露评估报告。对于采用成本计量的基础设施项目资产，上述评估结果不影响基础设施基金合并财务报表的净资产及基金份额净值。

4、基金管理人应至少每半年度、每年度对基金资产进行核算及估值，但基金管理人根据法律法规或本基金合同的规定暂停估值时除外，基金管理人每半年，每年度对基金资产核算及估值后，将基金净资产和基金份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由管理人按照监管机构要求在定期报告中对外公布。

## 七、基金合同的变更、终止与基金财产的清算

### （一）《基金合同》的变更

1、变更《基金合同》涉及法律法规规定或基金合同约定应经基金份额持有人大会决议通过的事项的，应召开基金份额持有人大会决议通过。对于法律法规规定和《基金合同》约定可不经基金份额持有人大会决议通过的事项，由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告，并报中国证监会备案。

2、关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议须报中国证监会备案，并自表决通过之日起生效，决议生效后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介公告。

(二) 《基金合同》的终止事由

有下列情形之一的，经履行相关程序后，《基金合同》应当终止：

- 1、本基金存续期限届满，且未延长基金合同存续期限；
- 2、本基金所持有的基础设施资产支持证券已全部变现或提前终止清算；
- 3、基金份额持有人大会决定终止的；
- 4、基金管理人、基金托管人职责终止，在 6 个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的；
- 5、基础设施项目无法维持正常、持续运营，或基础设施项目难以再产生持续、稳定现金流，导致本基金无法继续存续的，经基金份额持有人大会审议批准终止的；
- 6、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三) 基金财产的清算

1、基金财产清算小组：自出现《基金合同》终止事由之日起 30 个工作日内成立清算小组，基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。

2、基金财产清算小组组成：基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。

3、基金财产清算小组职责：基金财产清算小组负责基金财产的保管、清理、估价、变现和分配，并按照法律法规规定和基金合同约定履行信息披露义务。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4、基金财产清算程序：

- (1) 《基金合同》终止情形出现时，由基金财产清算小组统一接管基金；
- (2) 对基金财产和债权债务进行清理和确认；
- (3) 对基金财产进行估值和变现；
- (4) 制作清算报告；
- (5) 聘请经备案的会计师事务所对清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书；
- (6) 将清算报告报中国证监会备案并公告；

(7) 对基金剩余财产进行分配。

5、基金财产清算的期限为 6 个月，但因本基金所持证券及或底层资产的流动性受到限制而不能及时变现的，清算期限相应顺延。

(四) 清算费用

清算费用是指基金财产清算小组在进行基金清算过程中发生的所有合理费用，清算费用由基金财产清算小组优先从基金财产中支付。

(五) 基金财产清算剩余资产的分配

依据基金财产清算的分配方案，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

(六) 基金财产清算的公告

清算过程中的有关重大事项须及时公告；基金财产清算报告经符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所审计并由律师事务所出具法律意见书后报中国证监会备案并公告。基金财产清算公告于基金财产清算报告报中国证监会备案后 5 个工作日内由基金财产清算小组进行公告，基金财产清算小组应当将清算报告登载在规定网站上，并将清算报告提示性公告登载在规定报刊上。

(七) 基金财产清算账册及文件的保存

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存 20 年以上。

八、争议的处理和适用的法律

(一) 基金合同当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议可以通过协商或者调解解决。基金合同当事人如经友好协商未能解决的，或自一方书面提出协商解决争议之日起 60 日内争议未能以协商方式解决的，任何一方均有权将争议提交杭州仲裁委员会，按照其时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁地点为杭州。仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，除非仲裁裁决另有规定，仲裁费及律师费由败诉方承担。

争议处理期间，基金合同当事人应恪守各自的职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行基金合同规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

(二) 《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资人取得基金合同的方式

基金合同存放在基金管理人、基金托管人和基金销售机构的住所，投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

（本页无正文，为《浙商证券沪杭甬杭徽高速封闭式基础设施证券投资基金上市交易公告书》之盖章页）

基金管理人：浙江浙商证券资产管理有限公司

2021年6月16日