中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金份额询价公告

基金管理人：中金基金管理有限公司
基金管理人财务顾问：中国国际金融股份有限公司

特别提示

中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金（“本基金”）由中金基金管理有限公司（“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）颁布的《公开募集基础设施证券投资基金指引（试行）》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《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》，上海证券交易所（“上交所”）颁布的《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）》（“《发售指引》”）、《上海证券交易所上市开放式基金业务指引（2019年修订）》，中国证券业协会（“证券业协会”）颁布的《公开募集基础设施证券投资基金网下投资者管理细则》（“《网下投资者管理细则》”）等适用法律法规、监管规定及自律规则等相关规定，以及上交所有关基金发售上市规则和最新操作指引等组织实施发售工作。

中国国际金融股份有限公司（“中金公司”）担任本基金管理人财务顾问。

本次网下询价及网下发售通过上交所的“REITs询价与认购系统”实施，请网下投资者认真阅读本公告。

敬请投资者重点关注本次发售的网下询价、投资者认购和缴款等方面内容：

1、本基金将通过向战略投资者定向配售（“战略配售”）、向符合条件的网下投资者询价发售（“网下发售”）及向公众投资者公开发售（“公众发售”）相结合的方式进行发售。

本次战略配售、网下发售及公众发售由基金管理人和财务顾问负责组织。战略配售通过基金管理人和财务顾问实施；网下发售通过上交所的“REITs询价与认购系统”实施；公众发售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（“场内证券经营机构”）、基金管理人及其委托的场外基金销售机构实施。

2、基金管理人和财务顾问协商确定本次询价区间为7.463元/份–7.836元/份，并将通过网下询价最终确定基金份额的认购价格。

3、询价时间：本次发售的询价时间为2023年9月25日的9:00–15:00。

4、网下发售对象：网下投资者指参与网下询价和认购业务的专业机构投资者，包括证券公司、基金管理公司、信托公司、财务公司、保险公司及保险资产管理公司、合格境外机构投资者、商业银行及银行理财子公司、政策性银行、符合规定的私募基金管理人以及其他符合中国证监会及上交所投资者适当性规定的专业机构投资者。全国社会保障基金、基本养老保险基金、年金基金等可根据有关规定参与网下询价。

5、同一投资者多档报价：本次询价采取拟认购价格与拟认购份额数量同时申报的方式进行，网下投资者及其管理的配售对象的报价应当包含拟认购价格和该价格对应的拟认购份额数量。参与询价的网下投资者需在询价区间范围内进行报价，可为其管理的不同配售对象账户分别填报一个报价，报价应当包含每份价格和该价格对应的拟认购份额数量，且同一网下投资者全部报价中的不同拟认购价格不得超过3个。网下投资者为拟参与报价的全部配售对象录入报价记录后，应当一次性提交。网下投资者可以多次提交报价记录，但以最后一次提交的全部报价记录为准。

本次网下发行每个配售对象的认购份额数量上限为6,440万份。

网下投资者及其管理的配售对象应严格遵守行业监管要求，加强风险控制和合规管理，审慎合理确定拟认购价格和拟认购份额数量。参与询价时，请特别留意拟认购价格和拟认购份额数量对应的拟认购金额是否超过其提供给基金管理人及财务顾问的资产规模或资金规模。基金管理人及财务顾问发现配售对象不遵守行业监管要求、超过其向基金管理人及财务顾问提交资产证明材料中相应资产规模或资金规模认购的，则该配售对象的认购无效。

参加网下询价的投资者应在2023年9月22日中午12:00前将资产证明材料通过中金公司公募REITs项目投资者平台（网址：http://reits.cicc.com.cn）提交给基金管理人和财务顾问。如投资者拒绝配合核查、未能完整提交相关材料或者提交的材料不足以排除其存在法律、法规、规范性文件禁止参与网下发售情形的，基金管理人和财务顾问将拒绝其参与本次网下发售、将其报价作为无效报价处理或不予配售，并在《中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金份额发售公告》（“《发售公告》”）中予以披露。网下投资者违反规定参与本基金网下发售的，应自行承担由此产生的全部责任。

6、延迟发售安排：若本次认购份额超出剔除不符合条件的报价后网下投资者报价的中位数和加权平均数的孰低值，基金管理人和财务顾问将在基金份额认购首日（募集期首日）前5个工作日发布投资风险特别公告，本基金发售期将相应延迟。

7、限售期安排：公众发售部分的基金份额无流通限制及锁定期安排。

战略投资者认购基金的限售期安排详见“二、（四）限售期限”。

网下投资者管理的每一配售对象自本基金上市之日起前三个交易日（含上市首日）内可交易的份额不超过其获配份额的20%；自本基金上市后的第四个交易日起，网下投资者的全部获配份额可自由流通。网下投资者及其管理的配售对象一旦报价即视为接受本询价公告所披露的上述安排，承诺遵守上述期间的交易要求。监管机构有权对网下投资者在上述期间的交易情况进行监督管理。

8、网下投资者认购及缴款：本次网下发售中，网下认购与缴款同时进行。《发售公告》中公布的全部有效报价配售对象必须参与网下认购，同时在网下认购期间缴纳对应认购资金及认购费用。在网下认购阶段，配售对象应使用在证券业协会备案的资金账户，向基金管理人足额缴纳认购资金及认购费用。

9、认购费用：投资者认购本基金基金份额的认购费率安排详见“五、（三）认购费用”。

10、回拨机制：基金管理人和财务顾问在网下及公众发售结束后，根据战略投资者缴款、网下发售及公众发售认购情况决定是否启用回拨机制，对战略配售、网下发售和公众发售数量进行调整。回拨机制的具体安排请参见本公告中的“六、本次发售回拨机制”。

11、中止发售情况：中止条款请见“九、中止发售情况”。

本基金为公开募集基础设施证券投资基金，发售方式与普通公开募集证券投资基金有所区别，请投资者特别关注。本基金与投资股票、债券、其他证券及衍生品种的常规公募基金具有不同的风险收益特征。本基金成立后主要投资于以高速公路类基础设施项目为最终投资标的的基础设施资产支持证券，并持有其全部份额。通过资产支持证券和项目公司等载体取得基础设施项目完全所有权或经营权利，以获取基础设施项目运营收益的同时承担基础设施项目资产价格波动。本基金在投资运作、交易等环节的主要风险包括基础设施基金的特有风险及基金投资的其他风险。其中，（1）基础设施基金的特有风险，包括但不限于高速公路行业的风险（宏观经济环境变化可能导致的行业风险、周边区域交通网络、城市规划等发生变化的风险、相关政策法规发生变化的风险、资产收购及处置需经过主管部门同意的风险、土地使用政策风险、房屋所有权风险等），基础设施基金的投资管理风险（基金首次投资的交易风险、基础设施项目运营风险、估值与现金流预测的风险、基础设施项目直接或间接对外融资的风险、基础设施项目收购与出售的相关风险、关联交易风险、利益冲突风险等），以及其他与基础设施基金相关的特别风险（集中投资风险、流动性风险、募集失败风险、基金管理人的管理风险、外部管理机构的尽职履约风险、计划管理人、托管人尽职履约风险、税收政策调整可能影响基金份额持有人收益的风险、专项计划等特殊目的载体提前终止风险、原始权益人的或有财务风险、不可抗力风险等）；（2）其他一般性风险因素，包括但不限于基金价格波动风险、终止上市风险、相关参与机构的操作及技术风险、基金运作的合规性风险、证券市场风险等。具体请见本基金招募说明书“风险揭示”章节。

投资者需充分了解有关基础设施证券投资基金发售的相关法律法规，认真阅读本基金基金合同、招募说明书等法律文件及本公告的各项内容，充分考虑本基金相关风险因素，知悉本次发售的定价原则和配售原则，审慎参与本次基金的报价和发售，在提交报价前应确保不属于禁止参与网下询价的情形，并确保其认购数量和未来持有基金份额情况符合相关法律法规及监管机构的规定。投资者一旦提交报价，基金管理人和财务顾问视为该投资者承诺：投资者参与本次报价符合法律法规和本公告的规定，由此产生的一切违法违规行为及相应后果由投资者自行承担。

有关本询价公告和本次发售的相关问题由基金管理人和财务顾问保留最终解释权。

重要提示

1、中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金由中金基金管理有限公司依照有关法律法规及约定发起，并经中国证监会2023年4月25日证监许可（2023）979号文《关于准予中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金注册的批复》准予注册。中国证监会对本基金的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金的场内简称为“山东高速”，扩位简称为“中金山东高速REIT”，基金代码为“508007”，该代码同时用于本次发售的询价、网下认购及公众认购。

2、中国证监会准予本基金募集的基金份额总额为400,000,000份。本基金战略配售初始发售份额为308,000,000份，为本次基金份额发售总量的77.00%，战略配售最终发售份额与战略配售初始发售份额的差额（如有）将根据回拨机制规定的原则进行回拨。

网下发售初始发售份额为64,400,000份，占扣除战略配售初始发售份额数量后发售份额的70.00%；公众发售初始发售份额为27,600,000份，占扣除战略配售初始发售份额数量后发售份额的30.00%。最终网下发售、公众发售合计份额为本次发售总份额扣除战略配售最终发售份额，最终网下发售份额、公众发售份额将根据回拨情况（如有）确定。

3、本公告所称“网下投资者”指参与网下询价和认购的专业机构投资者。本公告所称“配售对象”是指参与网下发售的投资者或其管理的资管产品。网下投资者应当于2023年9月22日中午12:00前在证券业协会完成配售对象的注册工作。

基金管理人和财务顾问已根据相关法律法规制定了网下投资者的标准。具体标准及安排请见本公告“三、网下询价安排”。只有符合基金管理人和财务顾问确定的网下投资者标准要求的投资者方能参与本次发售询价。不符合相关标准而参与本次发售询价的，须自行承担一切由该行为引发的后果，基金管理人及财务顾问将其报价设定为无效，并在《发售公告》中披露相关情况。

参与本次网下发售的所有投资者均需通过中金公司公募REITs项目投资者平台（网址：http://reits.cicc.com.cn）在线提交承诺函及相关核查材料。

提请投资者注意，基金管理人和财务顾问将在询价及配售前对网下投资者是否存在禁止性情形进行核查，并要求网下投资者提供符合资质要求的承诺和证明材料。如网下投资者拒绝配合核查或其提供的材料不足以排除其存在禁止性情形的，或经核查不符合配售资格的，基金管理人和财务顾问将拒绝其参与询价及配售。

4、本次发售将进行面向网下投资者的网下路演及面向公众投资者的公开推介。具体安排请见“一、（五）2、本次发售的路演推介安排”。

5、网下投资者拟认购价格的最小变动单位为0.001元；单个配售对象最低拟认购份额数量为100万份，拟认购份额数量最小变动单位为10万份，即网下投资者指定的配售对象的拟认购份额数量超过100万份的部分必须是10万份的整数倍，每个配售对象的拟认购份额数量不得超过6,440万份。

一、本次发售的基本情况

（一）发售方式

本次发售由基金管理人和财务顾问负责组织实施，采用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。其中：

1、战略投资者需根据事先签订的《中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金战略投资者配售协议》（“《战略配售协议》”）进行认购。

2、对网下投资者进行询价发售，并对所有网下投资者按照同比例配售原则进行配售。

3、对于公众投资者，待网下询价结束后，基金份额通过各销售机构以询价确定的认购价格公开发售。公众投资者可通过场内认购和场外认购两种方式认购本基金。

（二）发售数量

中国证监会准予本基金募集的基金份额总额为400,000,000份。

本基金战略配售初始发售份额为308,000,000份，为本次基金份额发售总量的77.00%，战略配售最终发售份额与战略配售初始发售份额的差额（如有）将根据“六、本次发售回拨机制”的原则进行回拨。

本基金网下发售初始发售份额为64,400,000份，占扣除战略配售初始发售份额数量后发售份额的70.00%。

本基金公众发售初始发售份额为27,600,000份，占扣除战略配售初始发售份额数量后发售份额的30.00%。

最终网下发售、公众发售合计发售份额为本次发售总份额扣除战略配售最终发售份额，最终网下发售份额、公众发售份额将根据回拨情况确定（如有）。

（三）定价方式

基金管理人和财务顾问协商确定本次询价区间为7.463元/份–7.836元/份，并将通过网下询价最终确定本基金基金份额的认购价格。

基金管理人和财务顾问将根据剔除不符合条件报价后所有网下投资者报价的中位数和加权平均数，并结合公募证券投资基金、公募理财产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者资金等配售对象的报价情况，审慎合理确定本基金基金份额的认购价格。

（四）限售期安排

公众发售部分的基金份额无流通限制及锁定期安排，自本次发售的基金份额在上交所上市之日起即可流通。

战略投资者认购基金的限售期安排详见“二、（四）限售期限”。

网下投资者管理的每一配售对象自本基金上市之日起前三个交易日（含上市首日）内可交易的份额不超过其获配份额的20%；自本基金上市后的第四个交易日起，网下投资者的全部获配份额可自由流通。网下投资者及其管理的配售对象一旦报价即视为接受本询价公告所披露的上述安排，承诺遵守上述期间的交易要求。监管机构有权对网下投资者在上述期间的交易情况进行监督管理。

（五）本次发售重要时间安排

1、发售时间安排

日期	发售安排
X–4日（2023年9月19日）周二	披露《询价公告》《基金合同》《托管协议》《招募说明书》《基金产品资料概要》等相关公告和文件 网下路演
X–3日（2023年9月20日）周三	网下投资者提交核查文件 网下路演
X–2日（2023年9月21日）周四	网下投资者提交核查文件 网下路演
X–1日（2023年9月22日）周五	网下投资者提交核查文件（当日中午12:00前） 网友路演青岛证券投资协会深圳证券期货业协会 财务顾问开展网下投资者核查 网下路演
X日 询价日（2023年9月25日）周一	询价日，网下投资者询价时间为9:00–15:00
X+1日（2023年9月26日）周二	确定基金份额认购价格 确定有效报价网下投资者及配售对象 确定战略投资者最终获配金额
T–3日（2023年9月27日，预计）周三	披露《发售公告》、关于战略投资者配售资格的专项核查报告、律师事务所关于战略投资者核查事项的法律意见
T日募集期首日（2023年10月10日，预计）周一	网下认购日（9:00–15:00）及缴款日 公众认购日及缴款日（场内15:00认购截止，场外认购时间以销售机构规定为准）
LB募集期结束日（2023年10月11日，预计）周二	网下认购日（9:00–15:00）及缴款截止日（17:00截止） 公众认购及缴款截止日（场内15:00认购截止，场外认购时间以销售机构规定为准） 战略投资者缴款截止日（17:00截止）
L+1日（2023年10月12日，预计）周四	决定是否回拨，确定最终战略配售、网下发售、公众发售的基金份额数量及配售比例
L+1日后	会计师事务所验资、中国证监会募集结果备案后，披露《基金合同生效公告》，在符合相关法律法规和基金上市条件后尽快办理

注：

1. X日为询价日，T日为募集期首日，L日为募集期结束日；询价日后的具体时间安排以基金管理人和财务顾问发布的《发售公告》及后续公告公示的日期为准；

2. 上述日期为交易日，因特别事项影响本次发售的，基金管理人、财务顾问将及时公告，修改发售日程；

3. 若本次认购价格超出剔除不符合条件的报价后网下投资者报价的中位数和加权平均数的孰低值，基金管理人、财务顾问将在基金份额募集期首日前5个工作日发布投资风险特别公告，本次发售基金份额发售期将相应延迟；

4. 如因上交所“REITs询价与认购系统”故障或非可控因素导致网下投资者无法正常使用其“REITs询价与认购系统”进行询价或网下认购工作，请及时与财务顾问联系。

2、本次发售的路演推介安排

本次发售将进行面向网下投资者的网下路演及面向公众投资者的公开推介。基金管理人和财务顾问将于2023年9月19日至2023年9月22日期间，向符合要求的网下投资者通过线上或线下的方式进行网下推介。基金管理人和财务顾问将于本基金募集申请获得中国证监会注册后至2023年10月11日（预计），向公众投资者通过线上或线下等方式进行推介。

二、战略配售

（一）参与对象

本次发售的战略配售投资者的选择在考虑投资者资质以及市场情况后综合确定。本次发售的战略投资者包括基础设施项目原始权益人或其同一控制下的关联方，以及其他专业机构投资者。其中，参与本基金战略配售的专业机构投资者，应当具备良好的市场声誉和影响力，具有较强资金实力，认可基础设施基金长期投资价值。

本基金从如下范围选择其他专业机构投资者：证券公司、基金管理公司、信托公司、财务公司、保险公司及保险资产管理公司、合格境外机构投资者、商业银行及银行理财子公司、政策性银行、符合规定的私募基金管理人以及其他符合中国证监会及上交所投资者适当性规定的专业机构投资者。

战略投资者不得接受他人委托或者委托他人参与战略配售，但依法设立并符合特定投资目的的证券投资基金、公募理财产品等资管产品，以及全国社会保障基金、基本养老保险基金、年金基金等除外。

参与本次战略配售的投资者不得参与本次基础设施基金份额网下询价，但依法设立且未参与本次战略配售的证券投资基金、理财产品和其他资产管理产品除外。

（二）配售数量

本基金战略配售初始发售份额数量为308,000,000份，占基金份额发售总量的77.00%。其中，原始权益人及其同一控制下的关联方承诺认购数量为211,720,000份，占基金份额发售总量52.93%；符合中国证监会及上交所投资者适当性规定的其他专业机构战略投资者承诺认购数量为96,280,000份，占基金份额发售总量的24.07%。

（三）配售条件

参加本次战略配售的投资者已与基金管理人签署《战略配售协议》，不参加本次发售询价，并承诺按照网下询价确定的认购价格认购其承诺认购的基金份额。参与本次战略配售的投资者确认其符合战略投资者的资格及条件，认可本基金的长期投资价值，符合本基金战略投资者的选取标准和配售资格。

2023年9月27日（预计）公布的《发售公告》将披露战略投资者名称、承诺认购的基金份额数量以及限售期安排等。2023年10月11日（预计）17:00前，战略投资者应向基金管理人足额缴纳认购资金及认购费用。《中金山高集团高速公路封闭式基础设施证券投资基金基金合同生效公告》将披露最终获配的战略投资者名称、基金份额数量以及限售期安排等。

（四）限售期限

原始权益人参与本基金战略配售的比例为发售总份额的51.00%，其中基金份额发售总量的20%持有期自上市之日起不少于60个月，超过20%部分持有期自上市之日起不少于36个月。原始权益人同一控制下的关联方参与本基金战略配售的比例为发售总份额的1.93%，持有期自上市之日起不少于36个月。

其他战略配售投资者获得配售的本基金基金份额持有期自基金上市之日起不少于12个月。

（五）核查情况

基金管理人、财务顾问和北京德恒律师事务所已对战略投资者的选取标准、配售资格及是否存在《发售指引》第三十条、第三十一条规定的禁止性情形进行核查，并要求战略投资者就核查事项出具承诺函。相关核查文件及法律意见书将与《发售公告》一并披露。

（六）认购款项缴纳及验资安排

2023年10月11日（预计）17:00前，战略投资者将向基金管理人足额缴纳认购资金及认购费用。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）将对战略投资者认购资金进行验资并出具验资报告。

（七）相关承诺

战略投资者承诺按照适用法律法规、本基金法律文件及《战略配售协议》认购本基金基金份额，遵守法律法规和有权监管部门关于战略投资者的相关规定，包括但不限于认购资金来源合法，遵守获配份额限售期要求等。

基金管理人、财务顾问向战略投资者配售基金份额的，不得存在承诺基金上市后价格上涨、聘请关联人员任职等直接或间接利益输送行为。基金管理人、财务顾问应当对是否存在此种禁止性情形进行核查，并在后续公告中承诺声明。

三、网下询价安排

（一）参与网下询价的投资者标准及条件

1、网下投资者为证券公司、基金管理公司、信托公司、财务公司、保险公司及保险资产管理公司、合格境外机构投资者、商业银行及银行理财子公司、政策性银行、符合规定的私募基金管理人以及其他符合中国证监会及上交所投资者适当性规定的专业机构投资者，在证券业协会注册后，可以参与本基金网下询价。全国社会保障基金、基本养老保险基金、年金基金等可根据有关规定参与本基金网下询价。

2、网下投资者需完成在证券业协会注册，注册应当具备必要的定价能力和良好的信用记录，最近十二个月未因证券投资、资产管理等相关业务重大违法违规受到相关监管部门的行政处罚、行政监管措施或相关自律组织的纪律处分，并符合监管部门、证券业协会要求的其他条件。

私募基金管理人申请注册为本基金网下投资者的，还应当符合以下适当性要求：

（1）已在中国证券投资基金业协会完成登记；

（2）具备一定的投资经验。依法设立并持续经营时间达到两年（含）以上，从事证券交易或基础设施项目投资时间达到两年（含）以上；

（3）具备一定的资产管理实力。私募基金管理人管理的在中国证券投资基金业协会备案的产品总规模最近两个季度均为10亿元（含）以上，且近三年管理的产品中至少有一只存续期两年（含）以上的产品；申请注册的私募基金产品规模应为6,000万元（含）以上、已在中国证券投资基金业协会完成备案，且委托第三方托管人独立托管基金资产。其中，私募基金产品规模是指基金产品资产净值；

（4）符合监管部门、证券业协会要求的其他条件。

网下投资者在证券业协会完成注册后，可将其所属或直接管理的、拟参与网下询价和认购且符合《网下投资者管理细则》规定的自营投资账户或资产管理产品注册为配售对象。

网下投资者应对所注册的配售对象切实履行主动管理职责，不得为其他机构、个人或产品规避监管规定提供通道服务。

网下投资者及其配售对象参与网下询价和认购的，还应当符合监管规定和其他相关自律组织的要求，遵守相关规定。

3、本次发售询价通过上交所“REITs询价与认购系统”进行，投资者应当办理完成上交所“REITs询价与认购系统”CA证书后方可参与本次发售。

4、拟参与本次网下发售的所有网下投资者，应于2023年9月22日中午12:00前通过中金公司公募REITs项目投资者平台（网址：http://reits.cicc.com.cn）在线完成注册并提交相关核查材料和资产证明文件。

5、禁止参加本次询价和网下发售的投资者范围

网下投资者属于以下情形之一的，不得参与本次网下发售：

（1）原始权益人、基金管理人、财务顾问、战略投资者以及其他与定价存在利益冲突的主体；

（2）原始权益人的关联自然人，包括1）直接或间接持有原始权益人5%以上股份的自然人；2）原始权益人的董事、监事和高级管理人员；3）直接或间接控制原始权益人的法人或其他组织的董事、监事和高级管理人员；4）上述1）及2）中所述人士的关系密切的家庭成员，包括配偶、年满18周岁的子女及其配偶、父母及配偶的父母、兄弟姐妹及其配偶、配偶的兄弟姐妹、子女配偶的父母；5）证监会、上交所或原始权益人根据实质重于形式原则认定的其他与原始权益人有特殊关系，可能导致原始权益人利益对其倾斜的自然人；

（3）原始权益人的关联法人，包括：1）直接或间接控制原始权益人的法人或其他组织；2）上述主体直接或者间接控制的除原始权益人及其控股子公司以外的法人或其他组织；3）关联自然人直接或者间接控制的，或者由关联自然人担任董事、高级管理人员的除原始权益人及其控股子公司以外的法人或其他组织；4）持有原始权益人5%以上股份的法人或其他组织；5）证监会、上交所或原始权益人根据实质重于形式原则认定的其他与原始权益人有特殊关系，可能导致原始权益人利益对其倾斜的法人或其他组织；

（4）在证券业协会公布的基础设施基金网下投资者黑名单中的机构；

（5）通过配售可能导致不当行为或不正当利益的其他自然人、法人和组织；

上述第（1）项中基金管理人或财务顾问管理的公募证券投资基金、全国社会保障基金、基本养老保险基金和年金基金除外。上述第（1）项中的战略投资者管理的依法设立且未参与本次战略配售的证券投资基金、理财产品和其他资产管理产品除外。

6、网下投资者及其管理的配售对象应遵守行业监管要求，加强风险控制和合规管理，合理确定拟认购价格和拟认购份额数量。参与询价时，请特别留意拟认购价格和拟认购份额数量对应的拟认购金额是否超过其提供的资产规模或资金规模。

基金管理人和财务顾问发现配售对象不遵守行业监管要求、超过其向基金管理人和财务顾问提交资产证明材料中相应资产规模或资金规模认购的，则该配售对象的认购无效。

7、参与本次战略配售的投资者不得参与网下发售，但依法设立且未参与本次战略配售的证券投资基金、理财产品和其他资产管理产品除外。

基金管理人和财务顾问将在询价及配售前履行核查义务，对投资者是否存在上述禁止性情形进行核查，投资者应按基金管理人和财务顾问的要求进行相应的配合（包括但不限于提供公司章程等工商登记资料、安排实际控制人访谈、如实提供相关自然人主要社会关系名单、配合其它关联关系调查等），如拒绝配合核查或其提供的材料不足以排除其存在上述禁止性情形的，或经核查不符合配售资格的，基金管理人和财务顾问将拒绝接受其询价或者向其进行配售。网下投资者参与本基金询价即视为向基金管理人和财务顾问承诺其不存在法律法规禁止参与网下询价及配售的情形。如因投资者原因导致关联方参与询价或发生关联方配售等情况，投资者应承担由此产生的全部责任。

（二）网下投资者备案核查及相关材料的提交方式

所有拟参与本次询价的网下投资者须符合上述投资者条件，并按要求在2023年9月22日中午12:00前通过中金公司公募REITs项目投资者平台（网址：http://reits.cicc.com.cn）注册并提交相关核查材料（请使用Chrome浏览器）。如网下投资者核查系统无法上传，投资者可与财务顾问协商确定核查资料的其他传送方式。

1、需提交的资料：网下投资者承诺函（机构投资者）；网下投资者关联方信息表（机构投资者）；营业执照复印件；配售对象资产证明材料。此外，除公募证券投资基金、公募理财产品、养老金、社保基金、企业年金基金、保险资金、QFII投资账户、机构自营投资账户、机构自营投资账户的其他配售对象需提供《配售对象出资方基本信息表》；需要向中国证券投资基金业协会登记备案的私募投资基金管理人或私募基金需提供产品备案证明文件。

2、系统提交方式

（1）注册及信息报备

登录中金公司公募REITs项目投资者平台（网址：http://reits.cicc.com.cn），在2023年9月22日中午12:00前完成用户动态密码登录及信息报备。登录过程中需提供有效的手机号码，一个手机号码只能注册一个用户。由于基金管理人及财务顾问将会在投资者材料核查过程中第一时间以短信或者电话反馈进展，请务必在本次发售过程中全程保持手机畅通。

提供有效手机号码、接收到手机验证码并登录成功后，请按如下步骤在2023年9月22日中午12:00前进行平台注册并提交相关核查材料；

第一步：点击“项目列表——中金山东高速REIT——进入询价”链接进入投资者信息填报页面；

第二步：提交投资者基本信息，包括输入并选择正确的投资者全称，输入正确的营业执照号码和正确的协会编码，以及联系人姓名、邮箱和办公电话。点击“保存及下一步”；

第三步：选择拟参与询价的配售对象，并点击“保存及下一步”；

第四步：阅读《网下投资者承诺函》，点击“确认”进入下一步。一旦点击确认，视同为同意并承诺《网下投资者承诺函》的全文内容；

第五步：根据不同配售对象的具体要求，提交相应的材料（所需提交的材料模板均在页面右侧的“模板下载”处）。

（2）提交投资者报备材料

1）有意参与本次询价且符合网下投资者标准的投资者均需提交《网下投资者承诺函》。提交的方式为点击确认自动生成的电子版《网下投资者承诺函》，一旦点击确认，视同为同意并承诺《网下投资者承诺函》的全文内容，并承诺如实提供了本次网下发售所需的全部文件，并保证对提供的所有文件资料的真实性、准确性、完整性和及时性负责，确认没有任何遗漏或误导。

2）所有投资者均须提交营业执照复印件（加盖公章）。

3）所有投资者均须提交《网下投资者关联方信息表》。投资者需在“模板下载”中下载模板，填写完整并上传。提交《网下投资者关联方信息表》时需上传EXCEL版及盖章版PDF。

4）若配售对象属于公募证券投资基金、公募理财产品、基本养老保险基金、社保基金组合、企业年金基金、保险资金投资账户、QFII投资账户、机构自营投资账户，则无需提交《配售对象出资方基本信息表》。

除此之外的其他配售对象均需在“模板下载”中下载《配售对象出资方基本信息表》，填写完整并上传。提交《配售对象出资方基本信息表》时需上传EXCEL版及盖章版PDF。

5）所有拟参与本次发售的私募基金网下投资者，均应提交私募投资基金备案核查材料，包括但不限于备案函、备案系统截屏。本款所称私募基金，系指在中华人民共和国境内以非公开方式向合格投资者募集资金设立的投资基金，包括资产由基金管理人或者普通合伙人管理的以投资活动为目的设立的公司或者合伙企业。在证券业协会备案的配售对象中，证券公司、基金管理公司、保险公司、期货公司及其子公司成立的私募资产管理产品亦需提供上述备案核查材料，上述私募资产管理产品包括但不限于：基金公司及其资产管理子公司、证券公司及其资产管理子公司发行的单一资产管理计划或集合资产管理计划、保险机构资产管理产品等。

6）提供配售对象的资产证明材料，具体如下：

配售对象资产规模汇总表EXCEL电子版：机构投资者须在投资者资料上传页面上传其拟参与本次认购全部配售对象的EXCEL电子版《配售对象资产规模汇总表》。模版下载路径：http://reits.cicc.com.cn——中金山东高速REIT——模版下载。投资者在《配售对象资产规模汇总表》中填写的各配售对象资产规模将作为基金管理人判断配售对象是否超资产规模认购的依据。

机构投资者自有资金或管理的每个产品参与网下询价的拟认购金额不超过其资产规模（总资产）或资金规模的资产证明文件扫描件：其中，公募证券投资基金、公募理财产品、基金专户、资产管理计划、私募基金等产品原则上应提供询价日前第5个工作日的产品总资产有效证明材料（加盖公司公章或外部证明机构章）；自营投资账户应提供公司出具的自营账户资金规模说明材料（加盖公司公章）。证明材料中载明的资产规模需与EXCEL电子版《配售对象资产规模汇总表》中填写的资产规模一致。

如投资者拒绝配合核查、未能完整提交相关材料或者提交的材料不足以排除其存在法律、法规、规范性文件禁止参与网下发售情形的，基金管理人和财务顾问将拒绝其参与本次网下发售、将其报价作为无效报价处理或不予配售，并在《发售公告》中予以披露。网下投资者违反规定参与本基金网下发售的，应自行承担由此产生的全部责任。

7）以上步骤完成后，点击提交并等待审核通过的短信提示（请保持手机畅通）。

3、提交时间：2023年9月22日中午12:00之前，投资者可修改已提交的项目申请信息；在2023年9月22日中午12:00之后，投资者将无法对已提交的信息进行修改。

4、投资者注意事项：

所有的电子文件（《配售对象资产规模汇总表》除外）提交后还需下载打印，并在规定的时间内签章后扫描上传方能完成本次备案。需下载签章后并上传的文件包括：《网下投资者关联方信息表》、《配售对象出资方基本信息表》（如有）；

投资者须对其填写的信息的准确真实性、提交资料的准确完整性负责。投资者未按要求在2023年9月22日中午12:00之前完成材料提交，或虽完成材料提交但存在不真实、不准确、不完整情形的，则将无法参加询价配售或者报价将被界定为无效报价。

请投资者认真阅读报备页面中的填写注意事项。财务顾问将安排专人在2023年9月20日、2023年9月21日的9:00–12:00，13:00–17:00及2023年9月22日的9:00–12:00接听咨询电话，号码为010–89620591。

（三）询价

本次发售的询价通过上交所“REITs询价与认购系统”进行。询价期间为2023年9月25日的9:00–15:00。在上述时间内，投资者可通过上交所“REITs询价与认购系统”填写、提交拟认购价格和拟认购份额数量。

参与询价的网下投资者及其管理的配售对象应于2023年9月22日中午12:00前在证券业协会完成网下投资者注册且已开通上交所“REITs询价与认购系统”CA证书，方能参与本次发售的询价。

只有符合基金管理人及财务顾问确定的条件的网下投资者及其管理的配售对象才能参与询价。基金管理人及财务顾问提醒网下投资者在参与询价前应自行核查是否符合本公告“三、（一）参与网下询价的投资者标准及条件”的相关要求。同时，网下投资者应于2023年9月22日中午12:00前，按照相关要求及时提交网下投资者资格核查资料。

本次询价采取拟认购价格与拟认购份额数量同时申报的方式进行，网下投资者报价应当包含拟认购价格和该价格对应的拟认购数量。

参与询价的网下投资者需在询价区间范围内进行报价，可为其管理的不同配售对象账户分别填报一个报价，报价应当包含每份价格和该价格对应的拟认购份额数量，且同一网下投资者全部报价中的不同拟认购价格不得超过3个。

网下投资者为拟参与报价的全部配售对象录入报价记录后，应当一次性提交。网下投资者可以多次提交报价记录，但以最后一次提交的全部报价记录为准。

网下投资者拟认购价格的最小单位为0.001元。基金管理人及财务顾问将本次发售中每个配售对象最低拟认购份额数量设定为100万份，拟认购份额数量最小变动单位设定为10万份，即每个配售对象的拟认购份额数量超过100万份的部分必须是10万份的整数倍，每个配售对象的拟认购份额数量不得超过6,440万份。

网下投资者申报的以下情形将被视为无效：

1、单个配售对象的拟认购份额数量超过6,440万份的部分为无效申报；

2、单个配售对象拟认购份额数量不符合100万份的最低数量要求，或者拟认购数量不符合10万份的整数倍，则该配售对象的申报无效；

3、经审查不符合本公告“三、（一）参与网下询价的投资者标准及条件”所列网下投资者条件的；

4、基金管理人及财务顾问发现投资者不遵守行业监管要求、超过其提交的资产证明材料中相应资产规模或资金规模认购的，则该配售对象的认购无效；

5、被证券业协会列入基础设施基金网下投资者黑名单的网下投资者；

6、其他网下投资者无效申报的情况。

（四）网下投资者的违规行为及处理

如发现网下投资者或其工作人员存在下列情形的，基金管理人及财务顾问将及时向证券业协会报告。

1、使用他人账户、多个账户或委托他人报价；

2、与其他投资者、原始权益人、基金管理人或其财务顾问等利益相关方串通报价；

3、利用内幕信息、未公开信息报价；

4、无定价依据、未在充分研究的基础上理性报价，未严格履行报价决策程序审慎报价或故意压低、抬高价格；

5、未合理确定拟认购数量，拟认购金额超过配售对象总资产或资金规模；

6、提供有效报价但未参与认购或未足额认购；

7、未按时足额缴付认购资金；

8、参与网下询价的配售对象及其关联账户通过面向公众投资者发售部分认购基金份额；

9、获配后未恪守相关承诺；

10、接受原始权益人、基金管理人或其财务顾问以及其他利益相关方提供的财务资助、补偿、回扣等；

11、其他不独立、不客观、不诚信、不廉洁的情形或其他影响发行秩序的情形。

（五）其他要求

参与网下询价的配售对象及其关联账户不得再通过面向公众投资者发售部分认购基金份额。配售对象关联账户是指与配售对象场内证券账户或场外基金账户注册资料中的“账户持有人名称”、“有效身份证明文件号码”均相同的账户。证券公司客户定向资产管理专用账户以及企业年金账户注册资料中“账户持有人名称”、“有效身份证明文件号码”均相同的，不受上述限制。

四、确定有效报价投资者和认购价格

在询价结束后，基金管理人和财务顾问将对网下投资者的报价资格进行核查，剔除不符合“三、（一）参与网下询价的投资者标准及条件”要求的投资者报价。

剔除不符合条件的报价后，基金管理人和财务顾问将根据所有网下投资者报价的中位数和加权平均数，并结合公募证券投资基金、公募理财产品、社保基金、养老金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者资金等配售对象的报价情况，审慎合理确定认购价格。

询价时，网下投资者管理的配售对象拟认购价格不低于认购价格，且未超过询价区间上限即为有效报价投资者。在确定认购价格后，提供有效报价的配售对象方可且必须作为有效报价投资者参与认购。认购价格及其确定过程，以及可参与网下认购的配售对象及其有效拟认购份额数量信息将在《发售公告》中披露。

同时，基金管理人和财务顾问将确定本次发售份额、募集资金总额，并在《发售公告》中披露如下信息：

1、剔除不符合条件的报价后，所有网下投资者剩余报价的中位数和加权平均数；

2、网下投资者详细报价情况，具体包括投资者名称、配售对象信息、拟认购价格及对应的拟认购份额数量，以及认购价格所对应的网下投资者超额认购倍数。

若本次认购价格超出剔除不符合条件的报价后网下投资者报价的中位数和加权平均数的孰低值，基金管理人、财务顾问将在基金份额认购首日（募集期首日）前5个工作日发布投资风险特别公告，本次发售基金份额发售期将顺延。

有效报价