股票代码:002672 股票简称:东江环保 公告编号:2018-108

东江环保股份有限公司关于放弃参股公司 9.3%股权优先购买权的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

东江环保股份有限公司(以下简称"公司"或"本公司")于 2018 年 12 月 14 日召开第六届董事会第二十五次会议,审议通过了《关于放弃欧晟绿色燃料(揭阳)有限公司 9.3%股权优先购买权的议案》。本公司决定放弃参股公司欧晟绿色燃料(揭阳)有限公司 9.3%股权优先购买权,相关内容公告如下:

一、概述

2018 年 8 月 7 日,经公司第六届董事会第十八次会议审议通过,公司同意通过公开摘牌方式受让欧晟绿色燃料(香港)有限公司(以下简称"香港欧晟")所持的欧晟绿色燃料(揭阳)有限公司(以下简称"揭阳欧晟")37.10%股权,并以挂牌价格人民币 6,232.80 万元取得揭阳欧晟 37.10%股权。2018 年 9 月 21 日,公司与香港欧晟签订了《股权转让协议》及相关补充协议。上述事项详见公司分别于 2018 年 8 月 8 日及 2018 年 9 月 22 日在巨潮资讯网披露的相关公告。截止目前,公司与香港欧晟分别持有揭阳欧晟 62.90%、37.10%股权,揭阳欧晟为公司的参股公司。

近期,香港欧晟拟转让其持有揭阳欧晟 9.3%股权,并拟采用产权交易所公开挂牌交易的方式确定受让方,股权转让底价根据资产评估机构评估确定。结合公司实际经营情况,公司拟放弃揭阳欧晟 9.3%股权优先购买权,并授权公司董事长签署相关补充协议等相关文件及处理其他相关事宜。

鉴于公司控股股东广东省广晟资产经营有限公司(以下简称"广晟公司")控股的下属子公司与另一方股东分别持有香港欧晟 50%股权,香港欧晟为广晟公司间接联营企业,且公司董事邓谦、黄艺明分别担任香港欧晟的董事。根据相关规定,本次放弃优先购买权构成关联交易。关联董事谭侃、邓谦、刘伯仁、黄艺明需回避表决。

公司第六届董事会第二十五次会议以 5 票同意,0 票反对,0 票弃权审议通过了《关于放弃欧晟绿色燃料(揭阳)有限公司 9.3%股权优先购买权的议案》,关联董事谭侃、刘伯仁、邓谦、黄艺明回避表决。本次关联交易已取得公司独立董事的事前认可并发表了独立意见。

上述事项不需经过股东大会批准,亦不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

二、交易标的基本情况

本次交易标的为揭阳欧晟 9.3%股权

揭阳欧晟基本情况如下:

公司名称:欧晟绿色燃料(揭阳)有限公司

企业类型:有限责任公司(台港澳法人独资)

注册地址:揭阳市揭东区玉滘镇桥头村铁路顶地段中德金属生态城一幢 27 号

成立时间:2015 年 12 月 21 日

注册资本:人民币 16800 万元

股东情况:香港欧晟持有 62.90%股权、公司持有 37.10%股权

主营业务:在特许经营期限和特许经营区域范围内,负责揭阳市绿源垃圾综合处理与资源利用厂的设计、建设、运营、维护和移交;生活垃圾、餐厨有机垃圾及城市固体废物的收集、转运、运输与终端处理等。

三、股权转让主要内容

定价原则:根据深圳市鹏信资产评估土地房地产估价有限公司出具的《评估报告》(鹏信资评报字[2017]第 119 号),揭阳欧晟股东全部权益于评估基准日 2017 年 11 月 30 日的评估值为 16,540 万元,揭阳欧晟 9.3%股权评估值为 1,538.22 万元。香港欧晟通过南方联合产权交易中心公开挂牌转让揭阳欧晟 9.3%股权,挂牌底价为 1,562.40 万元。

交易方式及交易合同:

1、合资格意向受让方向南方联合产权交易中心提交产权受让申请,并在取得南方联合产权交易中心出具的书面资格确认意见后,与欧晟香港签订《股权转让合同》,并按《股权转让协议》约定付清全部产权交易价款。

2、股权转让交易需要经揭阳市住建局审批通过后方可生效。

四、放弃优先购买权对公司的影响

公司参股揭阳欧晟参与建设及运营揭阳垃圾 PPP 项目,有利于公司快速进入生活垃圾焚烧发电业务,填补公司在该业务领域的空白,为公司生活垃圾焚烧业务积累丰富的经验,同时基于公司聚焦危废主业的发展战略,经综合考虑,公司董事会同意放弃揭阳欧晟 9.3%股权优先购买权。本次放弃优先购买权不影响公司持有揭阳欧晟的股权,对公司在揭阳欧晟的权益没有影响。公司本次放弃优先购买权对公司主营业务和持续经营能力不会产生不利影响,符合公司及其股东的整体利益,不存在损害公司及其他股东特别是中小股东利益的情形。

五、独立董事意见

本次关联交易已经得到独立董事事前认可,并发表如下独立董事意见:

公司放弃欧晟绿色燃料(揭阳)有限公司 9.3%股权优先购买权是基于聚焦危废主业、控制投资风险等因素而做出的决定。公司本次放弃优先购买权不违反相关法律、法规及规范性文件的规定,不会对公司的生产经营产生重大影响,放弃优先购买权的条款属公平合理,且董事会不行使优先选择权的决定乃按正常商业条款作出,并符合本公司及其股东的整体利益,不存在损害公司及股东特别是中小股东利益的情形。我们同意公司放弃欧晟绿色燃料(揭阳)有限公司 9.3%股权的优先购买权。

董事会对该议案进行审议时,关联董事依法回避表决,董事会通过了此议案,董事会表决程序合法。

六、备查文件

1、本公司第六届董事会第二十五次会议决议;

2、独立董事关于放弃参股公司 9.3%股权优先购买权的事前认可意见;

3、独立董事关于相关事项的独立意见。

特此公告。

东江环保股份有限公司

董事会

2018 年 12 月 15 日

中信证券股份有限公司关于塞力斯医疗科技股份有限公司 2018 年持续督导工作现场检查报告

上海证券交易所:

根据《上海证券交易所上市公司持续督导工作指引》等有关法律、法规的规定,中信证券股份有限公司(以下简称"中信证券"、"保荐人")作为正在履行塞力斯医疗科技股份有限公司(以下简称"塞力斯"、"上市公司"、"公司")持续督导工作的保荐机构,对上市公司 2018 年以来的规范运行情况进行了现场检查,报告如下:

一、本次现场检查的基本情况

(一)保荐机构

中信证券股份有限公司

(二)保荐代表人

程杰、王栋

(三)现场检查时间

2018 年 12 月 10 日

(四)现场检查人员

王栋

(五)现场检查手段

1、与上市公司董事、监事、高级管理人员及有关人员访谈;

2、察看上市公司主要生产经营场所;

3、查看公司公告的定期报告、2018 年召开的历次三会文件;

4、查阅和复印上市公司募集资金使用凭证、募集资金账户余额明细等资料;

5、查阅并复印公司 2018 年以来建立的有关内控制度文件;

6、核查公司 2018 年以来发生的关联交易、对外投资资料。

二、本次现场检查主要事项及意见

(一)公司治理和内部控制情况

经现场检查,保荐人认为:截至现场检查之日,塞力斯公司章程以及股东大会、董事会和监事会的议事规则得到贯彻执行,公司董事、监事和高级管理人员按照有关法律、法规和上海证券交易所相关业务规则的要求履行职责,公司治理机制有效地发挥了作用;公司内部机构设置和权责分配科学合理,对部门或岗位业务的权限范围、审批程序和相应责任等规定明确合规,风险评估和控制措施得到有效执行;公司 2018 年以来历次股东大会、董事会和监事会的召集、召开及表决程序符合有关法规及公司章程之规定,会议记录及其他会议资料保存完整,会议决议经出席会议的董事或监事签名确认。

(二)信息披露情况

根据对公司三会文件、会议记录的检查,并通过与指定网络披露的相关信息进行对比和分析,保荐人认为:截至现场检查之日,塞力斯真实、准确、完整地履行了信息披露义务,信息披露不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏。

(三)公司的独立性以及与控股股东、实际控制人及其他关联方资金往来情况

经核查公司与控股股东、实际控制人及其他关联方的交易及资金往来情况,并与公司高管人员、财务部门负责人等进行访谈,保荐人认为:截至现场检查之日,塞力斯资产完整,人员、机构、业务、财务保持独立,不存在关联方违规占有上市公司资金的情形。

(四)募集资金使用情况

2016 年 10 月 31 日,经中国证券监督管理委员会证监许可[2016]2352 号文核准,公司向社会公众公开发行人民币普通股 12,740,000 股,每股面值为人民币 1 元,发行价格为人民币 26.91 元,募集资金总额为人民币 342,833,400.00 元,扣除券商承销佣金、发行手续费、律师费等发行费用共计人民币 28,842,028.96 元,实际募集资金净额为人民币 313,991,371.04 元。

2018 年 6 月 13 日,经中国证券监督管理委员会《关于核准武汉塞力斯医疗科技股份有限公司非公开发行股票的批复》(证监许可[2017]2322 号)核准,公司采取非公开发行的方式,实际发行人民币普通股 26,853,709 股,募集资金总额为人民币 625,959,956.79 元,扣除承销保荐费用及与本次非公开发行直接相关的其他发行费用(含增值税)共计人民币 18,351,939.99 元,募集资金净额为人民币 607,608,016.80 元。

经核查,塞力斯募集资金已全部存放至募集资金专户,并分别与专户开立银行及保荐人签署了募集资金三方监管协议,保荐人逐月核对了募集资金专户对账单及使用明细台账,保荐人认为:截至现场检查之日,塞力斯主要募集资金已按照既定的规划投入使用。其中,首次公开发行投入的仓储物流供应链项目原定建设期为一年,受限于当前国家行业政策(冷链物流)、市场环境变化、物流软件开发技术升级等诸多不确定因素的影响,公司放缓了实施进度,延期至 2019 年 4 月前完成,已于 2017 年 10 月 31 日披露《武汉塞力斯医疗科技股份有限公司关于公司仓储物流供应链建设项目延期的公告》(公告编号:2017-101),目前募集资金投资项目投入使用情况良好。在募集资金使用过程中,塞力斯制定了募集资金使用的内部管理制度,对募集资金的使用符合相关法规规定,不存在重大违规使用募集资金的情况和变更募集资金用途的情形,亦不存在其他违反《上市公司监管指引第 2 号——上市公司募集资金管理和使用的监管要求》及《上海证券交易所上市公司募集资金管理办法(2013 年修订)》等有关法律规定的情形。

(五)关联交易、对外担保、重大对外投资情况

1、关联交易情况

截至现场检查之日,公司与控股股东、实际控制人及其他关联方发生的关联交易情况如下:

(1)关联方刘文豪、王文彬、万里波、黄咏喜、王军明增持公司股份;

(2)关联方温伟、雷先坤参与认购公司非公开发行股票;

(3)公司控股股东、实际控制人及其他关联方为公司及子公司银行借款提供担保;

(4)向公司董事、监事、高级管理人员支付薪酬;

(5)受让关联方李路宁持有的公司控股子公司少数股权;

(6)公司控股子公司租赁关联方李子熹办公房产。

上述关联交易系公司发生的正常经营活动,履行了必要的内部决策程序,不存在损害上市公司及其他股东利益的情形,不会对公司经营的独立性造成重大不利影响。

2、对外担保情况

经公司确认并经保荐人现场核查,截至现场检查之日,公司不存在违规担保行为。

3、重大对外投资情况

经公司确认并经保荐人现场核查,截至现场检查之日,公司不存在新增重大对外投资。

综上,保荐人认为:截至现场检查之日,公司 2018 年以来发生的关联交易系正常经营活动,履行了必要的内部决策程序,不存在损害上市公司及其他股东利益的情形,亦未对公司经营的独立性造成重大不利影响;公司未发生违规担保行为;公司不存在新增重大对外投资。

(六)经营状况

经查阅公司 2018 年前三季度报告并与财务负责人沟通,保荐人了解到 2018 年 1-9 月,公司保持良好经营态势,营业收入、净利润均较去年同期保持较好增长。

经现场检查,保荐人认为:塞力斯 2018 年前三季度营业收入增长主要系公司销售规模扩大,营业收入与营业成本增长相匹配,未出现业绩出现亏损或营业利润比上年同期下降 50%以上的情形。

(七)保荐人认为应予以现场检查的其他事项。

无。

三、提请上市公司注意的事项及建议

非公开发行股票后,公司营运资金规模得到充实,资产负债结构亦得到优化,公司管理层正在积极推进募投项目的规划和建设。保荐人请公司特别关注营运资金的用途规划及使用效率,对暂时闲置的募集资金可考虑在风险可控的前提下,适度购买符合中国证监会及证券交易所要求的投资产品,但应特别注意产品类型、投资风险和决策程序的规范性。

四、是否存在应当向中国证监会和上海证券交易所报告的事项

本次现场检查未发现塞力斯存在根据《证券发行上市保荐业务管理办法》、《上海证券交易所上市公司持续督导工作指引》等相关规定应当向中国证监会和上海证券交易所报告的事项。

五、上市公司及其他中介机构的配合情况

保荐机构持续督导现场检查工作过程当中,公司给予了积极的配合。

六、本次现场检查的结论

保荐人按照《上海证券交易所上市公司持续督导工作指引》的有关要求,对塞力斯认真履行了持续督导职责,经过本次现场核查工作,保荐人认为:2018 年以来,塞力斯在公司治理、内控制度、三会运作、信息披露、独立性、关联交易、对外担保、重大对外投资等重要方面的运作符合《上海证券交易所上市公司持续督导工作指引》、《上海证券交易所股票上市规则》等的相关要求。

备查报表人:

证券代码:000536 证券简称:华映科技 公告编号:2018-071

华映科技(集团)股份有限公司 第七届董事会第五十二次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

华映科技(集团)股份有限公司(以下简称"公司")第七届董事会第五十二次会议通知于 2018 年 12 月 14 日以电子邮件的形式紧急发出,会议于 2018 年 12 月 14 日在福州市马尾区儒江西路 6 号公司三楼会议室召开,会议采用现场表决和通讯表决相结合的方式进行。本次会议应出席董事 9 人,实际出席会议 7 人(其中,董事长林盛昌先生因其他公务安排无法出席,委托副董事长卢文胜先生召集并主持本次会议;独立董事郑新芝先生委托独立董事陈国伟先生出席并行使表决权)。会议符合《公司法》、《公司章程》的有关规定,监事和其他高级管理人员列席本次会议,会议形成如下决议:

一、以 8 票赞成,0 票反对,0 票弃权(其中林盛昌先生为关联董事予以回避表决),审议通过《关于针对中华映管重整事项的紧急应对措施之议案》。

公司于 2018 年 12 月 13 日晚间从台湾公开资讯观测站(http://mops.twse.com.tw)获悉,公司实际控制人中华映管股份有限公司(以下简称"中华映管")发布重大讯息,中华映管董事会依台湾地区公司法相关规定,决议向法院申请中华映管重整及紧急处分。

针对上述事项,公司董事会同意在职权范围内授权管理层成立应急决策委员会,分析上述事项的影响并适时采取各项应急措施,尽全力挽回公司可能的损失,包括但不限于:

1、聘请法律顾问,根据法律顾问意见,结合公司实际情况,执行一切可采取的法律措施。

2、根据该事项对公司经营等各方面的影响,提出解决相关问题的应急措施。

3、密切关注大股东质押情况,履行信息披露义务。

4、若中华映管进入重整程序,公司应急决策委员会将积极参与债权申报工作,参加关系人会议,协商重整方案。

上述委托事项授权期限自本次董事会决议生效之日起至中华映管重整相关事项结束为止。

后续公司将密切关注中华映管重整的进展情况,积极采取进一步的措施,通过合法途径维护公司权益,争取公司对中华映管的债权得到最大限度清偿。

特此公告

华映科技(集团)股份有限公司

董事会

2018 年 12 月 14 日

证券代码:002605 证券简称:姚记扑克 公告编号:2018-102

上海姚记扑克股份有限公司 关于公司持股 5%以上股东部分股票质押的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

上海姚记扑克股份有限公司(以下简称"公司")于 2018 年 12 月 12 日收到公司持股 5%以上股东李松先生发来的质押登记证明,获悉其对所持有的公司部分股票进行了质押,相关手续已经办理完毕,现将具体情况公告如下:

一、股东股份质押的基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	质押股数	质押开始日期	质押到期日	质权人	本次质押占其所持股份比例	用途
李松	否	1,079,000 股	2018 年 12 月 12 日	2019 年 6 月 12 日	海通证券股份有限公司	51.99%	个人融资

二、股东累计被质押的情况

目前李松先生共持有公司股份 20,752,303 股,占公司股份总数的 5.22%。截止本公告披露日,李松先生共质押其持有公司股份 1,079,000 股,占公司股本总额 2.71%,占其持有公司股份总数的 51.99%。

三、备查文件

1、中国证券登记结算有限责任公司股份冻结明细

2、海通证券股份有限公司营业部相关文件

特此公告

上海姚记扑克股份有限公司

2018 年 12 月 14 日

(上接C55版)

住所:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市福田区时代财富大厦第 49A 单元

法定代表人:周文

客服电话:0755-23946579

102)喜鹊财富基金销售有限公司

住所:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人:陈皓

客服电话:4006997719

103)通华财富(上海)基金销售有限公司

住所:上海市虹口区同丰路 667 弄 107 号 201 室

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路 799 号 3 号楼 9 楼

法定代表人:马刚

客服电话:95156

104)沈阳麟龙投资顾问有限公司

住所:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

办公地址:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

法定代表人:朱荣晖

联系人:陈巧玲

客服电话:400-003-5811

105)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所:厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人:陈洪生

客服电话:400-918-0808

106)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

住所:北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室

办公地址:北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人:钱昊旻

电话:010-59336593

联系人:徐英

客服电话:4008-909-998

107)贵州省贵文文化基金销售有限公司

住所:贵州省贵阳市南明区龙洞堡电子商务港太升国际 A 栋 2 单元 5 层 17 号

办公地址:贵州省贵阳市南明区兴业西路 CCDI 大楼一楼

法定代表人:陈成

电话:0851-85407888

联系人:黄笛

客服电话:0851-85407888

108)济安财富(北京)基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307

法定代表人:杨健

电话:010-65309516

联系人:李海燕

客服电话:400-673-7010

109)嘉实财富管理有限公司

住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元

办公地址:北京市朝阳区建国路 91 号金地中心 A 座 6 层

法定代表人:赵学军

电话:010-85097570

联系人:余永键

客服电话:400-021-8850

110)宜信普泽(北京)基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址:北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 1809

法定代表人:戎辰

电话:010-52858244

联系人:魏晨

客服电话:400-6099-200

111)和耕传承基金销售有限公司

住所:河南自贸试验区郑州片区(郑东)东风东路东、康宁街北 6 号楼 6 楼 602、603 房间

办公地址:北京市朝阳区酒仙桥路 6 号国际电子城 360 大厦 A 座

法定代表人:王旋

联系人:董亚芳

客服电话:4000-555-671

112)民商基金销售(上海)有限公司

办公地址:上海市浦东新区张杨路 707 号生命人寿大厦 32 楼

法定代表人:贲惠琴

联系人:童筱爽

客服电话:021-50206003

113)大河财富基金销售有限公司

住所:贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

法定代表人:王获

客服电话:0851-88235678

114)大连网金基金销售有限公司

住所:辽宁省大连市沙河口区体坛路 22 号诺德大厦 2 层 202 室

法定代表人:樊怀东

客服电话:4000899100

115)中信期货有限公司

住所:深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

办公地址:深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座 13 层 1301-1305 室、14 层

法定代表人:张皓

电话:13718246886/010-60834022

联系人:刘宏莹

客服电话:400-990-8826

116)东海期货有限责任公司

住所:江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号

办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人:陈太康

电话:021-68757102

联系人:李天雨

客服电话:95531/4008888588

117)大有期货有限公司

住所:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼

办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼

法定代表人:颜如意

电话:0731-84409106、0731-84409130

联系人:马科、王霞

客服电话:4006-365-058

基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的其他机构销售本基金,并及时公告。

二、登记机构

名称:中融基金管理有限公司

住所:深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址:北京市朝阳区东风南路 3 号院中融信托北京园区 C 座 4 层、5 层

法定代表人:王瑶

电话:010-56517000

传真:010-56517001

联系人:黎峰

网址:www.zrfunds.com.cn

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人:俞卫锋

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:安冬

经办律师:安冬、陆奇

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:上会会计师事务所

住所:上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼

办公地址:上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 25 楼

执行事务合伙人:张晓荣(首席合伙人)

电话:021-52920000

传真:021-52921369

经办注册会计师:张健、江嘉炜

联系人:杨伟平

第四部分 基金的名称

中融融信双盈债券型证券投资基金

第五部分 基金类型、运作方式与存续期间

1.基金类型:债券型。

2.基金的运作方式:契约型开放式。

3.基金存续期间:不定期。

第六部分 基金的投资目标

在注重资产安全性和流动性的前提下,积极主动调整投资组合,追求基金资产的长期稳定增值,并力争获得超过业绩比较基准的投资业绩。

第七部分 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债、企业债券、公司债券、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换公司债券、中小企业私募债券等)、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、资产支持证券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)。

本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的 80%;权益类品种的比例不高于基金资产的 20%(包括因通过发行、行权、可转债转股等原因形成的股票等权益类资产);现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

第八部分 基金的投资策略

1.债券投资策略

本基金通过综合分析国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素,并结合各种债券类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征,在符合本基金相关投资比例的前提下,决定组合的久期水平、期限结构和类属配置,并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的投资收益。

(1)利率预期策略

债券积极投资策略的关键是对未来利率走向的预测。通过对利率的科学预测和对债券投资组合久期的正确把握,可以提高投资收益。

久期越长,利率变动所引起价格变化越大,久期越短,利率变动所引起的价格变化越小。如果预计利率会下跌,债券价格会上涨,则应该加大长久期债券的比例,以实现收益的最大化。相反,如果预计利率会上涨,债券价格会下跌,则应该增加组合中久期较短债券的比例,以尽可能减少利率上涨带来的损失。

(2)收益率曲线配置策略

收益率曲线配置策略是根据对收益率曲线形状变动的预期建立或改变组合期限结构。要运用收益率曲线配置策略,必须先预测收益率曲线变动的方向,然后根据收益率曲线形状变动的情景分析,构建组合的期限机构。

(3)骑乘策略

骑乘策略是一种基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的债券投资管理策略。该策略是指当收益率曲线比较陡峭时,即相邻期限利差较大时,可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券,也即收益率水平相对较高的债券,随着持有期限的延长,债券的剩余期限将会缩短,此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降,通过债券收益率的下滑来获得资本利得收益。

(4)信用债券投资策略

信用债市场整体的信用利差水平和信用债发行主体自身信用状况的变化都会对信用债券的利差水平产生重要影响,因此,一方面,本基金将从经济周期、国家政策、行业景气度和债券市场的供求状况等多个方面考量信用利差的整体变化趋势;另一方面,本基金还将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅,即采用内外结合的信用研究和评级制度,研究债券发行主体企业的基本面,以确定企业主体债的实际信用状况。具体而言,本基金的信用策略主要包括信用债券趋势判断、信用利差分析、持有期收益情景模拟和信用债券精选策略四个方面。

(5)可转换公司债券及可交换公司债券投资策略

本基金投资可转换公司债券和可交换公司债券将基于以下三个方面的分析:数量为主的价值分析、债股性分析和公司基本面分析。通过以上分析,力求选择债券价值有一定支撑、安全性和流动性较好,并且发行人成长性良好的品种进行投资;对于高溢价率的个券则需谨慎买入、逢高兑现。另外,可交换公司债方面,对于考虑债性因素而投资的可交换债,需重点考察抵押股票的充足度、提前赎回条款等;对于考虑股性因素而投资的可交换债,则需重点考虑转股价、转股价下修条款等因素。

2.股票投资策略

注重趋势研究,发挥市场时机选择能力,充分分享股票市场的收益;重点关注改革方向的行业和个股,通过选择流动性高、风险低、具备中期上涨潜力的股票进行分散化组合投资,控制流动性风险和集中性风险,保证股票组合的稳定性和收益性。

3.中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

4.资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

5.权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,本基金将在控制风险的前提下,以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上适当参与。

第九部分 基金的业绩比较基准

中债总指数(全价)收益率×80%+沪深 300 指数收益率×20%

本基金选择中债总指数(全价)作为业绩比较基准的原因如下:第一,中债总指数由中央国债登记结算公司编制并发布,并发布主体上保证中债总指数比较客观和专业;第二,本基金以中债总指数(全价)为业绩比较基准,是由于全价指数是以债券全价计算的指数值,债券付息后利息不再计入指数之中,比较科学且更切合实际。

本基金选择沪深 300 指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深 300 指数样本覆盖了沪深市场 60%左右的市值,具有良好的市场代表性和可投资性。如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人可与本基金托管人协商一致,并履行适当程序后,调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告。

若未来法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者市场发生变化导致本业绩比较基准不再适用,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后调整业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,属于中等预期风险和预期收益的产品,其长期平均预期风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。

第十一部分 基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,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。

本基金的基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 11 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,024,060.00	3.95
	其中:股票	6,024,060.00	3.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	139,514,469.85	91.43
	其中:债券	139,514,469.85	91.43
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	489,371.43	0.32
8	其他资产	6,557,337.75	4.30
9	合计	152,585,239.03	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,987,168.00	4.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	1,036,892.00	0.84
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,024,060.00	4.91

3、报告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投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603288	海天味业	14,500	1,148,400.00	0.94
2	601601	中国太保	29,200	1,036,892.00	0.84
3	000063	中兴通讯	56,500	1,033,950.00	0.84
4	600585	海螺水泥	26,500	974,935.00	0.79
5	600019	宝钢股份	123,300	967,905.00	0.79
6	002475	立讯精密	55,900	861,978.00	0.70

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	27,385,969.85	22.30
	其中:政策性金融债	17,378,969.85	14.15
4	企业债券	18,989,300.00	15.46
5	企业短期融资券	50,251,500.00	40.92
6	中期票据	42,887,700.00	34.92
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	139,514,469.85	113.60

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011801620	18 晋交投 SCP003	110,000	11,008,800.00	8.96
2	108602	国开 1704	109,009	10,971,755.85	8.93
3	101800578	18 振业集团 MTN001	100,000	10,096,000.00	8.22
4	011800137	18 昆自来水 SCP001	100,000	10,092,000.00	8.22
5	011800331	18 运城城投 SCP001	100,000	10,080,000.00	8.21

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

11.2 基金投资的前十名股票未超过基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,326.18
2	应收证券清算款	4,500,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	2,044,011.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	6,557,337.75

11.4 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处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至 2018 年 9 月 30 日。

本基金合同生效日为 2016 年 11 月 2 日,基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

1. 本报告期基金份额