

(上接B77版)

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	15,937,385.60	2.68
B	采矿业	2,203,084.00	0.37
C	制造业	321,648,124.36	54.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,361,487.56	2.41
E	建筑业	28,240,314.29	4.75
F	批发和零售业	9,500,355.00	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	10,812,385.31	1.82
H	住宿和餐饮业	1,027,200.00	0.17
I	信息技术业	30,614,794.97	5.09
J	金融业	4,274,264.00	0.72
K	房地产业	10,252,100.00	1.73
L	租赁和商务服务业	15,252,309.66	2.56
M	科学研究和技术服务业	5,447,380.36	0.92
N	卫生、医药和医疗器械制造业	4,213,767.00	0.71
O	住宿和餐饮业	--	--
P	教育	--	--
Q	互联网行业	--	--
R	文化、体育和娱乐业	11,903,385.00	2.00
S	合计	485,125,558.17	81.54

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

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	600136	当代明诚	429,300	7,207,947.00	1.21
2	600997	耀隆股份	208,400	5,305,864.00	0.89
3	603038	浙江广力	92,800	5,194,944.00	0.87
4	603030	众兴股份	162,990	5,136,098.40	0.86
5	300259	碧天科技	453,720	5,039,668.80	0.84
6	002279	久其软件	288,400	4,981,504.00	0.84
7	002765	蓝盾电子	162,200	4,963,320.00	0.83
8	603098	万泽东	1,314,910	4,959,291.60	0.83
9	002748	碧松生态	216,600	4,499,310.00	0.83
10	890605	瀚海股份	241,800	4,327,800.00	0.83

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	国债债券	--	--
2	央行票据	--	--
3	金融债券	--	--
4	其中:政策性金融债	--	--
5	企业债券	--	--
6	企业短期融资券	--	--
7	中期票据	--	--
8	可转债(可交换债)	2,560,000.00	0.42
9	其他债券	--	--
10	合计	2,560,000.00	0.42

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	111801	光大转债	25,000	2,560,000.00	0.42

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有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓情况和损益明细

9.2 本基金投资股指期货的投资目的、投资策略、风险管理、流动性、交易活跃的情况

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时,将通过证券市场和期货市场运行趋势的研究,并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性、流动性及风险特征,通过资产配置、品种选择,谨慎进行投资,以降低投资组合的整体风险。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平,管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断,对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度内降低基金资产净值波动,力求实现基金资产的长期稳定增值。

10.2 报告期末国债期货持仓情况和损益明细

本基金报告期内未参与国债期货交易。

10.3 本期国债期货投资评价

11 投资组合报告附注

11.1 报告期末,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票范围

11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存保证金	320,030.94
2	应收证券清算款	680,323.79
3	应收股利	--
4	应收利息	30,308.80
5	应收申购款	2,996,077.52
6	其他应收款	--
7	待转资产	--
8	其他	--
9	合计	3,636,915.06

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末受限部分公允价值(元)	占期末资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600136	当代明诚	7,207,947.00	1.21	重大事项

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中涉及四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十四、基金的业绩

本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预示其未来表现,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。

本基金合同生效日为2016年12月13日,基金合同生效以来本基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表(单位:人民币元)

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准增长率	业绩比较基准增长率标准差	①-③	②-④
2016年12月13日至2017年12月31日	0.14%	0.01%	0.09%	0.34%	0.05%	-0.33%
2016年12月31日至2017年12月31日	2.56%	0.56%	1.36%	0.57%	1.20%	-0.01%
自基金合同生效以来至2017年12月31日	2.70%	0.56%	1.45%	0.53%	1.25%	-0.03%

十五、基金的费用

(一)与基金运作有关的费用

1. 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)生效后至与基金相关的信息披露费用;

(4) (基金合同)生效后至与基金运作相关或者为维护基金份额持有人利益支出的会计师费、律师费、诉讼费、仲裁费等费用;

(5) 基金份额持有人大会费用;

(6) 基金的开户费、银行汇兑费用;

(7) 基金的投资顾问费;

(8) 基金的银行汇兑费用;

(9) 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。

农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2017年7月26日

1. 公告基本信息

基金名称	农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	农银汇理策略混合
基金主代码	001471
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年7月26日
基金管理人名称	农银汇理基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规,《农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》,《农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》

2. 基金募集情况

基金募集申请经中国证监会核准的文号	中国证监会证监许可[2017]1430号
基金募集期间	自2017年6月26日至2017年7月21日止
初始募集规模	新华中证中国主题100指数证券投资基金(特设组合)
募集资产投入基金托管专户的日期	2017年7月26日
基金募集期间认购户数(单位:户)	11273
募集期间认购总户数(单位:户)	383,734,383.86
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)	150,390.77
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)	383,734,383.86
募集资产(单位:份)	150,390.77
合计	383,884,744.63
认购的基金份额(单位:份)	--
基金募集管理人运用募集资产认购本基金的情况	--
基金募集管理人的从业人员认购本基金的情况	--
募集期间募集基金是否符合法律法规规定的募集基金条件的条件	是
对中国证监会受理基金募集申请日期到确认日的日期	2017年7月26日

证券代码:002053 证券简称:云南能投 公告编号:2017-061

云南能源投资股份有限公司关于持股5%以上股东减持计划期满暨实施情况的公告

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

云南能源投资股份有限公司(以下简称“公司”)于2017年1月4日在《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)披露了《关于持股5%以上股东减持计划的提示性公告》(公告编号:2017-002),因业务发展的需要,云天化集团有限责任公司(以下简称“云天化集团”)计划在公告之日起15个交易日后的6个月内,以集中竞价方式减持本公司股份不超过1,116.64万股,即不超过公司总股本的2%。公司于2017年7月25日收到云天化集团出具的《股份减持实施情况告知函》,由于未达预期价格,截至2017年7月24日前述减持计划期限届满,云天化集团在计划减持期间内没有减持,现将具体情况公告如下:

一、股东减持情况

股东名称	减持方式	减持期间	减持均价(元/股)	减持股数(万股)	减持比例
云天化集团有限责任公司	集中竞价交易	2017年11月25日至2017年7月24日	--	0	0.00%
合计	--	--	--	0	0.00%

2. 股东本次减持前后持股情况

股东名称	股份性质	持股数量(股)	占股本比例	减持数量(股)	占股本比例
云天化集团有限责任公司	合计持有股份	149,654,728	26.80%	149,654,728	26.80%
	其中:无限售条件股份	149,654,728	26.80%	149,654,728	26.80%
	质押股份	--	--	--	--
	其他	--	--	--	--

二、其他相关说明

1、云天化集团本次减持不存在违反《证券法》、《上市公司收购管理办法》、《上市公司大股东、董监高减持股份的若干规定》等法律法规、部门规章、规范性文件及《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》等规定的情况。

2、云天化集团本次减持与已披露的减持计划一致,云天化集团有关承诺均已履行完毕,云天化集团未在本次减持中做出最低减持价格等承诺,本次减持不存在违反相关承诺的情形。

3、本次减持的股东云天化集团不属于公司控股股东、实际控制人,本次减持后,云天化集团持有公司股份149,654,728股,占公司总股本的26.80%,仍为公司持股5%以上股东。

三、备查文件

1、云天化集团出具的文件减持实施情况告知函;

2、深交所要求的其他文件。

泰信基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在大泰金石基金销售有限公司开通定投业务并参加定投费率优惠活动的公告

经泰信基金管理有限公司与大泰金石基金销售有限公司(以下简称“金石基金”)协商,自2017年7月27日起本公司旗下部分开放式基金在金石基金开通定投业务并参加定投费率优惠的活动,具体业务开通情况如下:

一、适用基金范围及业务开通情况:

基金名称	基金代码	定投(元)	定投费率优惠
泰信天天收益	A类:290001	100	
泰信先行策略	290002		
泰信双利策略	290003		
泰信价值精选	290004		
泰信先锋增长	290005		
泰信蓝筹精选	290006		
泰信新蓝筹	A类:001970	100	
泰信安联定期	290008		
泰信信用驱动	290009		
泰信中证200	290010		
泰信中小盘精选	290011		
泰信中证500	A类:290012	100	
泰信中证800	162807	500	
泰信现代服务	290014		
泰信创新驱动	001569		
泰信鑫选	A类:001970		
泰信互联网+	001978	100	
泰信创新驱动混合	003333		
泰信红利混合	A类:002227,C类:002428		

泰信基金管理有限公司 2017年7月26日

注:1、本基金管理人的高级管理人员、基金经理和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0.00份,本基金的基金经理持有本基金份额总量的区间为0.00份。

2、按照有关规定,本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费等费用由基金管理人承担,不从基金资产中支付。

3、其他需要提示的事项

根据《农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《农银汇理区间策略灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的申购和赎回自基金合同生效后不超过3个月时间开始办理。在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人将在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告申购与赎回的开始时间。

风险提示:本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责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。基金过往业绩并不代表其未来表现,敬请投资者注意投资风险。特此公告。

农银汇理基金管理有限公司 2017年7月26日

农银汇理基金管理有限公司关于旗下基金资产估值方法调整的公告

依据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》(中国证监会公告[2008]138号)的有关规定和《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》的指导意见,经与基金托管人协商一致,农银汇理基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)对旗下部分基金所持有以下停牌股票自2017年7月25日起按照指数收益法进行估值。待以下股票的流动性恢复正常后将恢复按市价估值方法进行估值,届时不再另行公告。若未来市场环境发生变化,本基金管理人也可采用其他合理的估值方法进行估值。

风险提示:本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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,投资风险,敬请投资者认真阅读基金的相关法律文件,并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。特此公告。

农银汇理基金管理有限公司 二〇一七年七月二十六日

证券代码:002053 证券简称:云南能投 公告编号:2017-062

云南能源投资股份有限公司关于向参股公司所提供的委托贷款逾期的进展公告

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

经2013年11月19日召开的公司董事会2013年第七次临时会议审议通过,2013年11月26日,公司与参股公司勐勐天对外经济贸易有限责任公司(以下简称“天勐公司”)及交通银行股份有限公司云南省分行签署了《委托贷款合同》,为缓解天勐公司的资金压力,支持其经营业务的拓展,促进其更好发展,在天勐公司按期归还公司前期委托贷款,天勐公司控股股东勐勐县磨盘山有限公司按股权比例以同等条件向天勐公司提供借款人民币153万元的前提下,公司向天勐公司提供委托贷款人民币147万元。委托贷款的期限自2013年11月26日起,至2015年11月24日止;贷款不计利息,手续费由天勐公司承担。委托贷款资金主要用于补充天勐公司生产经营活动所需的流动资金。《公司董事会2013年第七次临时会议决议公告》(公告编号:2013-054)、《关于向参股公司勐勐天对外经济贸易有限责任公司提供委托贷款的公告》(公告编号2013-055)详见2013年11月21日的《证券时报》、《中国证券报》和巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)。该项委托贷款已逾期,2015年11月26日,公司在《证券时报》、《中国证券报》及巨潮资讯网披露了《关于向参股公司所提供的委托贷款逾期的公告》(公告编号:2015-058)。

受市场竞争激烈等因素影响,天勐公司在老挝投资的子公司马多姆赛盐业有限公司制盐生产装置基本处于停产状态,资金周转速率低,经公司多次催讨,截至本公告披露日,天勐公司仍未能偿还该项委托贷款人民币147万元。以同等条件向其提供的借款。为维护公司的合法权益,公司已与天勐公司其他股东共同商讨有关天勐公司的经营和发展问题,同时公司将采取法律手段在內的一切措施积极追索,有关该事项进展,公司将按规定及时履行信息披露义务,敬请广大投资者注意投资风险。特此公告。

云南能源投资股份有限公司 董事会 2017年7月26日

证券代码:000671 证券简称:阳光城 公告编号:2017-207

债券代码:112260 债券简称:15阳光01

阳光城集团股份有限公司"15阳光01"2017年付息公告

本公司董事会及全体董事保证本公告所载资料真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

特别提示:阳光城集团股份有限公司2015年公司债券(第一期)(简称“本期债券”)2017年付息的债权登记日为2017年7月28日,凡在2017年7月28日(含)前买入并持有本期债券的投资者享有本次派发的利息,2017年7月28日卖出本期债券的投资者不享有本次派发的利息。

阳光城集团股份有限公司(以下简称“本公司”)于2015年7月9日发行的阳光城集团股份有限公司公开发行2015年公司债券(第一期)募集说明书和《公司债券上市公告书》有关条款的规定,在本期债券的计息期限内,每年付息一次。本期债券将于2017年7月30日支付2016年7月30日至2017年7月29日期间(以下简称“本年度”)的利息,现将有关事项公告如下:

一、本期债券的基本情况

1. 债券名称:阳光城集团股份有限公司2015年公司债券(第一期)

2. 债券简称:15阳光01

3. 发行代码:112260