中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金更新招募说明书(摘要)

(2017年第2号)

基金管理人:中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司

二零一七年八月

重要提示

本基金根据2015年11月20日中国证券监督管理委员会《关于准予中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的批复》(证监许可[2015]2683号)的注册进行募集。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对认购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人在获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。

本基金以绝对收益策略为主要投资策略,运用股指期货对冲股票投资组合的系统性风险,通过同时构建多头和空头的方式实现绝对收益策略,因此除面临一般混合型基金风险外还包括本基金所特有的风险。首先,本基金的绝对收益策略是否能实现剥离多头股票系统性风险具有不确定性;其次,本基金的主要投资工具股指期货还可能引发的基差风险、杠杆风险、对手方风险、盯市结算风险等;此外,在本基金的封闭运作期间,基金份额持有人还面临不能赎回基金份额的风险。

本基金同时为发起式基金,在基金募集时,基金管理人及基金经理将运用公司固有资金及基金经理自有资金认购本基金的金额不低于1000万元,认购的基金份额持有期限不低于三年。基金管理人认购的基金份额持有期限满三年后,基金管理人及基金经理将根据自身情况决定是否继续持有,届时,基金管理人及基金经理有可能赎回认购的本基金份额。另外,在基金成立满三年之日,如果本基金的资产规模低于2亿元,基金合同将自动终止,投资者将面临基金合同可能终止的不确定性风险。

本基金的特定风险详见招募说明书"风险揭示"章节。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买基金。

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。

本更新招募说明书所载内容截止日为2017年6月30日,有关财务数据和净值表现数据截止日为2017年6月30日。本更新招募说明书已经基金托管人复核。

一、基金管理人

(一)基金管理人基本情况

名 称:中邮创业基金管理股份有限公司

成立时间:2006年5月8日

住 所:北京市东城区和平里中街乙16号

办公地址:北京市东城区和平里中街乙16号

法定代表人:曹均

注册资本:3.041亿元人民币

股权结构:

股东名称	出资比例
首创证券有限责任公司	46.37%
中国邮政集团公司	28.61%
三井住友银行股份有限公司	23.67%
华创证券有限责任公司	0.60%
财富证券有限责任公司	0.31%
天风证券股份有限公司	0.23%
国金证券股份有限公司	0.07%
恒泰证券股份有限公司	0.07%
华金证券股份有限公司	0.07%
总 计	100%

公司客服电话:400-880-1618

公司联系电话:010-82295160

联系人:李晓蕾

(二)主要人员情况

1. 董事会成员

曹均先生,董事长,中共党员,经济学硕士。曾任中央财政金融学院教师、北京京广中心有限公司中方财务总监、日本大和证券北京代表处代表、北京利达行房地产集团副总经理、北京永事达投资顾问有限责任公司总经理、首创证券经纪有限责任公司财务总监、首创证券有限责任公司副总经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司董事长。

周克先生,董事,中共党员。曾任中信实业银行北京分行制度科科长、中信实业银行总行开发部副总经理、中信实业银行总行阜成门支行行长、首创证券有限公司副总经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司总经理、首誉光控资产管理有限公司董事长。

王洪亮先生,董事,中共党员,经济学硕士。曾任深圳外汇经纪中心业务经理、中国新技术创业投资公司深圳证券部部门经理、首创证券经纪有限责任公司深圳证券营业部总经理、首创证券有限责任公司深圳证券营业部总经理、首创证券有限责任公司经纪业务总部总经理、首创证券有限责任公司总经理助理、经纪业务总部总经理,现担任首创证券有限责任公司副总经理。

张志名先生,董事,中共党员,经济学硕士。曾任首创证券有限责任公司固定收益部交易员、首创证券有限责任公司固定收益部总经理助理、首创证券有限责任公司固定收益部副总经理、首创证券有限责任公司固定收益总部总经理,现担任首创证券有限责任公司固定收益事业部、事业部总裁兼销售交易部总经理。

马敏先生,董事,中共党员,大学本科学历,会计师。曾任广西壮族自治区财政厅商财处干部、广西壮族自治区财政厅商财处副主任科员、广西财政厅商财处主任科员、财政部商贸司内贸二处主任科员、财政部经贸司粮食处主任科员、财政部经建司粮食处副处长、财政部经建司粮食处处长、财政部经建司交通处处长、财政部经建司粮食处处长、财政部经建司粮食处调研员、中国邮政集团公司财务部干部、中国邮政集团公司财务部总经理助理。现任中国邮政集团公司财务部副总经理。

金昌雪先生,董事,大学本科。曾任职于北京煤炭管理干部学院(期间曾赴日本东丽大学任教、赴日本埼玉大学研究生院进修);日本住友银行北京代表处职员、代表;日本三井住友银行北京代表处副代表见北京分行筹备组副组长;2008年3月至今,任三井住友银行(中国)有限公司北京分行副行长、总行行长助理。

王忠林先生,董事,曾在中国人民银行总行办公厅任职;在中国证券监督管理委员会任职,历任法律部稽查处负责人;稽查局信访处副处长、处长;办公厅信访办主任;2009年3月,自中国证监会退休。

刘桓先生,董事,大学本科。曾就职于北京市朝阳区服务公司;1978年至1982年,就读于中央财经金融学院;1982年7月至今,就职于中央财经大学,现任中央财经大学税务学院副院长。期间于2004年4月至2005年6月,在北京市地方税务局挂职锻炼,任职局长助理。

戴昌久先生,董事,法学硕士。曾在财政部条法司工作(1993年美国波士顿大学访问学者);曾任职于中洲会计师事务所;1996年2月至今,任北京市昌久律师事务所(主任 / 支部书记)。期间任北京市律师协会五届、六届理事会理事;北京市律师协会预算委员会副主任、主任;北京市律师协会税务专业委员会副主任;全国律师协会财务委员会委员;曾任南方基金管理公司、(香港) 裕田中国发展有限公司 独立董事;现任深圳天源迪科信息技术股份有限公司、信达金融租赁有限公司独立董事。

2. 监事会成员

赵永祥先生,监事长,中共党员,硕士研究生,高级经济师。曾任河北省邮电管理局计财处干部、河北省邮电管理局经营财务处干部、石家庄市邮政局副局长、借调国家邮政局计财部任副处长、石家庄市邮政局党委副书记及副局长(主持工作)、石家庄市邮政局局长及党委书记、河北省邮政局助理巡视员、中国邮政集团公司财务部副总经理及河北省邮政公司助理巡视员、中国邮政集团公司财务部副总经理。现任中国邮政集团公司审计局局长。

周桂岩先生,监事,法学硕士。曾任中国信息信托投资公司证券部经理助理兼北京营业部总经理;北京凯源律师事务所律师;航空信托投资有限责任公司证券部总经理;首创证券有限责任公司资产管理总部总经理;现任首创证券有限责任公司合规总监兼合规部经理,首创京都期货有限公司董事长;有二十多年证券从业经历。

张钧涛先生,监事,大学学历。曾任西南证券北京营业部客户经理;中国民族证券北京知春路营业部副总经理;中邮创业基金管理股份有限公司综合管理部副总经理、营销部副总经理、营销部总经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司营销总监。

刘桓先生,监事,大学学历。曾任真维斯国际香港有限公司北京分公司行政人事部主任;北京国声文化艺术有限公司副总经理;北京时代泛洋广告有限公司总经理;北京尚世先锋广告有限公司总经理;中邮创业基金管理股份有限公司客户服务部部门总经理助理,营销部副总经理、人力资源部总经理;现任公司基金运营总监。

潘丽女士,监事,大学学历。先后就职于英国3移动通讯公司、武汉城投房产集团有限公司、雀巢(中国)有限公司、华宝兴业基金管理有限公司、中邮创业基金管理股份有限公司,现任中邮创业基金管理股份有限公司营销总部副总经理。

3. 公司高级管理人员

周克先生,董事,中共党员。曾任中信实业银行北京分行制度科科长、中信实业银行总行开发部副总经理、中信实业银行总行阜成门支行行长、首创证券有限公司副总经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司总经理、首誉光控资产管理有限公司董事长。

张静女士,经济学硕士,中共党员,曾任中国旅行社总社集团证券部、人力资源部职员;中国国际技术智力合作公司人力资源部副经理;中邮创业基金管理股份有限公司人力资源部总经理、公司人力资源总监、总经理助理,现任中邮创业基金管理股份有限公司副总经理、中邮创业国际资产管理有限公司董事长。

李小丽女士,大学本科,中共党员,曾任邮电部邮政运输局财务处会计师;国家邮政局邮政储汇局(中国邮政储蓄银行前身)资金调度中心主任;中国邮政集团公司财务部资深经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司副总经理。

唐亚明先生,本科,经济学学士,曾任职于联合证券赛格科技园营业部、深圳赛格财务公司、中信实业银行、首创证券有限责任公司、中邮创业基金管理有限公司、首誉光控资产管理有限公司,现任中邮创业基金管理股份有限公司副总经理。

郭建华先生,工学硕士,曾任长城证券有限公司研发中心总经理助理、长城证券有限公司海口营业部总经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司督察长。

4、本基金基金经理

任泽松先生:理学硕士,曾任毕马威华振会计师事务所审计员、北京源乐晟资产管理有限公司行业研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理助理、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理助理、投资部总经理助理、投资部副总经理、投资部总经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司任泽松投资工作室总负责人、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理、中邮双动力混合型证券投资基金基金经理、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、中邮增力债券型证券投资基金基金经理。

俞科进先生:经济学硕士,曾任安徽省池州市殷汇中学教师、中国人保寿险有限公司职员、长江证券股份有限公司金融工程分析师、中邮创业基金管理股份有限公司金融工程研究员、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、量化投资部员工,现任中邮创业基金管理股份有限公司量化投资部副总经理、中邮上证380指数增强型证券投资基金基金经理、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

本公司投资决策委员会成员包括:

委员会主席:

周克先生,见公司高级管理人员介绍。

委员:

张萌女士:商学、经济学硕士,曾任中信银行总行营业部国际业务部主管、日本瑞穗银行悉尼分行资金部助理、澳大利亚康联首域全球资产管理公司全球固定收益与信用投资部基金交易经理、中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部负责人、固定收益部总经理,现任固定收益部副总监、张萌投资工作室总负责人、中邮稳定收益债券型证券投资基金基金经理、中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理、中邮双动力混合型证券投资基金基金经理、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮纯债聚利债券型证券投资基金基金经理、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮增力债券型证券投资基金基金经理、中邮睿信增强债券型证券投资基金基金经理、中邮稳健合赢债券型证券投资基金基金经理、中邮纯债恒利债券型证券投资基金基金经理。

刘涛先生:工商管理硕士,中共党员,曾任中国民族国际信托投资公司职员、安信证券股份有限公司研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心主题混合型证券投资基金基金经理助理、研究部副总经理、研究部总经理、中邮核心优选混合型证券投资基金基金经理、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

任泽松先生:理学硕士,曾任毕马威华振会计师事务所审计员、北京源乐晟资产管理有限公司行业研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理助理、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理助理、投资部总经理助理、投资部副总经理、投资部总经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司任泽松投资工作室总负责人、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理、中邮双动力混合型证券投资基金基金经理、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理、中邮增力债券型证券投资基金基金经理。

陈梁先生:经济学硕士,曾任大连实德集团市场专员、华夏基金管理有限公司行业研究员、中信产业投资基金管理有限公司高级研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部副总经理、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司投资部副总经理、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮核心主题混合型证券投资基金基金经理。

黄礴先生:理学硕士,曾任新时代证券有限公司研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、银华基金管理有限公司研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部新兴产业研究组组长,现任中邮创业基金管理股份有限公司研究部总经理、固定收益部负责人、专户理财二部负责人。

俞科进先生:经济学硕士,曾任安徽省池州市殷汇中学教师、中国人保寿险有限公司职员、长江证券股份有限公司金融工程分析师、中邮创业基金管理股份有限公司金融工程研究员、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、量化投资部员工,现任中邮创业基金管理股份有限公司量化投资部副总经理兼中邮上证380指数增强型证券投资基金基金经理、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。

许进财先生:经济学硕士,曾任安信证券股份有限公司投资经理助理、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,现任中邮创业基金管理股份有限公司许进财投资工作室负责人、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮睿信增强债券型证券投资基金基金经理、中邮稳健合赢债券型证券投资基金基金经理。

聂璐女士:硕士研究生,曾任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、首誉光控资产管理有限公司投资经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司投资经理。

刘田先生:经济学硕士,曾任中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理助理,现担任中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

张腾先生:工学硕士,曾任申银万国证券研究所研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,现任中邮创业基金管理股份有限公司中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

曹思女士:经济学硕士,曾任中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任中邮创业基金管理股份有限公司中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

周楠先生:工商管理硕士,曾任大唐微电子技术有限公司工程师、大唐电信科技股份有限公司产品工程师、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理助理、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,现任中邮创业基金管理股份有限公司中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

杨欢先生:经济学硕士,曾任中国银河证券股份有限公司研究部研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理,现任中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理兼中邮趋势精选灵活配置混合型基金基金经理。

吴昊先生:理学硕士,曾任宏源证券股份有限公司固定收益研究员、中邮创业基金管理股份有限公司固定收益研究员、中邮双动力混合型证券投资基金基金经理助理,现任中邮创业基金管理股份有限公司中邮稳定收益债券型基金基金经理、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

李晓博先生:经济学硕士,曾任中邮创业基金管理股份有限公司中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理助理,现任中邮创业基金管理股份有限公司固定收益研究员。

许忠海先生:理学硕士,曾任贝迪中国区研发中心工程师、方正证券股份有限公司行业研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理,现任中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

(一)基金托管人情况

名称:兴业银行股份有限公司

住所:福州市湖东路154号

办公地址:福州市湖东路154号

法定代表人:高建平

注册日期:1988年7月20日

注册资本:207.74亿元人民币

托管部门联系人:刘峰

电话:021-62677777-212017

传真:021-62159217

(二) 发展概况及财务状况

兴业银行成立于1988年8月,是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一,总行设在福建省福州市,2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市(股票代码:601166),注册资本207.74亿元。开业二十多年来,兴业银行始终坚持"真诚服务,相伴成长"的经营理念,致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。

截至 2016年12月31日,兴业银行资产总额达6.09万亿元,实现营业收入1570.60亿元,全年实现归属于母公司股东的净利润538.50亿元。

(三) 托管业务的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理及产品研发处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室,共有员工100余人,业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构

(1)中邮创业基金管理股份有限公司直销中心
住所:北京市东城区和平里中街乙16号
办公地址:北京市东城区和平里中街乙16号
法定代表人:曹均
联系人:杨帆
电话:010-82290840
传真:010-82294138
网址:www.postfund.com.cn

(2)中邮基金官方微信平台——中邮基金服务号

(3)中邮创业基金网上直销平台:https://i.postfund.com.cn/

2、代销机构:

(1)兴业银行股份有限公司
注册地址:福州市湖东路154号
办公地址:上海市江宁路168号
法定代表人:高建平
联系人:李博
客服电话:95561
网址:www.cib.com.cn

(2)交通银行股份有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
联系人:张宏革
电话:021-58781234
客服电话:95559
网址:www.bankcomm.com

(3)中国民生银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区西绒线胡同28号天安国际办公大楼
法定代表人:洪崎
客户服务电话:95568
网址:www.cmbc.com.cn

(4)平安银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号
法定代表人:孙建一
联系人:张莉
电话:0755-25879756 、021-38637673
客服热线:95511-3
网址: www.bank.pingan.com

(5)晋商银行股份有限公司
注册地址:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦
办公地址:山西省太原市万柏林区长风西街1号丽华大厦
法定代表人:阎俊生
客服电话:95105588
网址:www.jshbank.com

(6)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:杨德红
联系人:芮敏祺
客服电话:95521
网址: www.gtja.com

(7)中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳区朝阳门内大街2号凯恒大厦B座18层
法定代表人:王常青
联系人:权唐
客服电话:4008-888-108
网址:www.csc108.com

(8)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
客服电话:95565、4008-888-111
网址:www.newone.com.cn

(9)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
客服电话:(020) 95575或致电各地营业网点
网址:www.gf.com.cn

(10)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层
法定代表人:陈共炎
联系人:邓颜
联系电话:010-66568292
客服电话:4008-888-888
网址:www.chinastock.com.cn

(11)安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:王连志
联系人:陈剑虹
客户服务电话:95517
网址:www.essence.com.cn

(12)湘财证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼
法定代表人:林俊波
联系人:李欣
客服电话:400-888-1551
网址:www.xcsc.com

(13)华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路228号
办公地址:南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场
法定代表人:周易
联系人:庞晓芸
联系电话:0755-82492193
客服电话:95597
网址:www.htsc.com.cn

(14)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:何耀
客服电话:95525
网址:www.ebscn.com

(15)平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址:深圳市福田区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人:曹实凡
联系人:周一涵
全国免费业务咨询电话:95511-8
开放式基金业务传真:021-58991896
全国统一总机:95511
网址: stock.pingan.com

(16)华西证券股份有限公司
注册地址:四川省成都市高新区天府二街198号华西证券大厦
法定代表人:杨炯洋
联系人:谢国梅
电话:010-52723273
服务热线:95584
公司网址:www.hx168.com.cn

(17)华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号招商银行大厦18、19层
法定代表人:黄金琳
联系人:王虹
联系电话:021-20655183
业务传真:021-20655196
客服电话:96326(福建)400-88-96326(全国)
网址:www.hfzq.com.cn

(18)中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第04、18-21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
客服电话:95532、400 600 8008
网址:www.china-invs.cn

(19)华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区金融大街8号A座3层
办公地址:北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人保寿险大厦12层
法定代表人:祝献忠
联系人:李慧灵
电话:010-85556100
传真:010- 85556153
客服电话:400-898-9999
网址:www.hrsec.com.cn

(20)首创证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区德胜门外大街115号
办公地址:北京市西城区德胜门外大街115号
法定代表人:毕劲松
联系人:刘宇
客服电话:400 620 0620
网址:www.sczq.com.cn

(21)深圳前海微众银行股份有限公司
地址:广东省深圳市南山区田夏国际中心36楼、37楼
法定代表人:顾敏
联系人:何钐
联系电话:0755-84354755
客服电话:400-999-8800
公司网址:www.webank.com

(22)中国国际金融股份有限公司
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
办公地址: 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
法定代表人: 丁学东
电话:010-65051166
传真:010-65058065
联 系 人: 任敏、陈曦
客服电话:010-65051166
网址:www.cicc.com.cn

(二)注册登记机构
名称:中邮创业基金管理股份有限公司
住所:北京市东城区和平里中街乙16号
办公地址:北京市东城区和平里中街乙16号
法定代表人:曹均
联系人:李焱
电话:010-82295160
传真:010-82292422

(三) 出具法律意见书的律师事务所
名称:北京市瑞天律师事务所
住所:北京市西城区莲花池东路甲5号院1号楼2单元15层1507室
负责人:李飒
联系人:李飒
电话:010—62116298
传真:010—62216298
经办律师:刘敬华 李飒

(四) 审计基金财产的会计师事务所
名称:致同会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市朝阳区建国门外大街22号赛特广场五层
执行事务合伙人:徐华
联系人:卫俏嫔
联系电话:010-85665232
传真电话:010-85665320
经办注册会计师:卫俏嫔 李惠琦

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

四、基金的名称

本基金名称:中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式,混合型

六、投资目标

本基金将灵活应用各种金融工具和风险对冲策略降低投资组合风险,实现基金资产的长期稳健增值。

七、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(包含中小板、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、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、货币市场工具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相关规定)。

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。

本基金的投资组合比例为:本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%—120%之间。其中:权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值;权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。

开放期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%,封闭期内的每个交易日日终,持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的100%。

开放期内,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或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%。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第(一)项、第(三)项、第(五)项及第(七)项的限制。

基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下,经与基金托管人协商一致后, 参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会决定。

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。

八、投资策略

本基金通过多种绝对收益策略、多种交易品种的操作,有效地规避市场的系统性风险。同时在严格控制风险敞口的前提下,捕捉套利机会和趋势性交易机会,力求为基金份额持有人赢取稳定的绝对收益。

(一)股票绝对收益投资策略

本策略积极依托基金管理人投研平台的研究能力进行积极主动的个股选择策略,通过定量与定性相结合的分析方法考量上市公司的盈利状况、估值水平、市场情绪、股价催化剂等因素,辅以量化投资模型从基金管理人的股票库中精选股票,努力获取超额收益,同时在金融衍生品市场上对冲,剥离系统性风险,力争实现较为稳定的绝对收益。在构建投资组合的过程中,本基金将遵循以下投资策略:

1、定性与定量相结合构建股票组合

本基金选取具有良好投资价值的股票作为投资对象,以深入的基本面研究为基础,采取自下而上的方法,通过定量和定性相结合的方法精选个股。

1)数量化分析策略

a.多因素选股模型

根据对中国证券市场运行特征的长期研究以及大量历史数据的实证检验,选取成长性、估值、盈利能力、市场情绪及分析师情绪等五大类对股票超额收益具有较强解释度的指标,建立多因素模型,并根据该模型进行股票选择。成长性主要考虑每股收益增长率、营业收入的增长趋势以及现金流的变动情况等;估值主要考虑市盈率、市净率、市现率、股息率等指标;盈利能力主要考虑净资产报酬率、总资产报酬率、毛利率及净利率等指标;市场情绪主要考虑股价趋势及换手率等指标;分析师情绪主要考虑股票评级的变动情况以及盈利预测的变动情况等指标。多因素选股模型利用个股历史数据分析考察上述五类因素的有效性,对各只股票进行分步筛选,确定股票投资组合。当股票投资组合构建完成后,本基金会进一步根据组合内股价格波动、风险收益变化的实际情况,定期或不定期优化个股权重,以确保整个股票组合的风险处于可控范围内。多因素模型所纳入考察的选股因子以上述五类为主,会根据日常跟踪观察的因子有效性适时将可能对未来市场变化更为敏感有效的因子纳入选股框架。

b. 事件驱动策略

主要考虑重大政策事件的发布、上市公司定向增发及破发、产业资本的变化、公司股东和高管的增减持、公司股票的高送转、指数样本股调整、研报超预测、高送转、盈余公告后漂移异象等事件因素,利用量化研究方法分析这些因素对未来股价变化和时间周期的影响,以获得由事件引发带来的个股超额收益。

c.量化行业配置

在Black-Litterman资产配置模型的基础上结合行业多因子模型进行行业配置。充分考虑市场均衡的行业配置比例后加入通过基本面分析结合资金参与度变化、增量信息等市场交易面特征得到的基金管理人对于各行业风险收益的预期,从而测算出满足条件的最优化行业配置比例。对于每个行业分别建立各自的模型,使用宏观经济数据、行业基本面信息数据、上下游行业数据、净利润增长一致预期数据加总行业盈利增长数据、资金参与度变化、预期变化等全方位立体信息建模估计行业未来月度走势并选择相对占优行业作为重点配置行业。

本基金量化优选投资策略通过多个 Alpha 策略避免单一策略的超额收益率波动风险,构造低波动率、低下行风险的投资组合。

2)基本面分析策略

寻找内在价值被低估的股票、被市场错估的股票、未来收益很有潜力的公司,以此预期获取未来较好的超额收益,选取公司治理结构完善、管理层优秀,并在生产、技术、市场、政策环境等经营层面上具有一方面或多方面难以被竞争对手在短时间所模仿或超越的竞争优势的企业。

a.公司治理结构

企业具有良好的公司治理结构,信息透明,注重公众股东利益和投资者关系,历史上没有发生过由公司治理结构带来的风险事件。

b.管理层优秀

企业具有优秀的管理层,且企业的经营实绩证明管理层是精明能干、正直诚实、富有理性的。不以上市套现为目的,踏实做事。

c.竞争优势突出

企业在生产、技术、市场、政策环境等经营层面上具有一方面或几方面竞争优势,而且,这种优势难以在短时间被竞争对手所模仿或超越;通过上述竞争优势能不断提升经营能力,强化其技术壁垒、市场占有率、品牌影响力等。

d.行业地位领先

企业在行业中具有很高的知名度和影响力,对行业的发展起着主导性的作用,处于同行业中的领先地位。

3)定性与定量结合投资策略

在定量和定性研究的基础上,发挥公司投研团队优势,将基本面分析中的关键要素及研究方法通过定量的方法刻画出来并形成量化模型,选择行业发展空间大、行业内具有明显优势的上市公司标的作为投资目标。

2、市场中性策略

现阶段本基金将利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素,计算需要用到的期货合约数量,对这个数量进行动态跟踪与测算,并进行适时灵活调整。同时,综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素,在不同月份期货合约之间进行动态配置,通过优化股指期货合约的持仓来创造额外收益。另外当本基金出现大量净申购或净赎回的情况时,本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理,根据基金净申购或净赎回的规模,分别买入数量匹配的多头或者空头股指期货合约,并选择适当的时机平仓。随着监管的放开及其他工具流动性增强,我们会优选空头工具,采用最优的多头系统性风险剥离方式,在数量模型的约束下,严格控制运作风险,并根据市场变化趋势,定期对模型进行调整,以改进模型的有效性,最大化超额收益。

(二)其他绝对收益策略

1、固定收益品种投资策略

本基金投资债券首先综合考量股票组合及股指期货套期保值对资金的需求,对闲置资金投资债券做出规划,包括债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排等。然后在这些约束条件下,综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法,结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素,对个券进行积极的管理。

2、衍生品投资策略

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束,合理利用股指期货、权证等衍生工具,利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值,控制下跌风险,实现保值和锁定收益。目前衍生品投资策略主要是股指期货套利,即采用股指期货套利的对冲策略积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系,进行套利,以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式:

1)期现套利

期现套利过程中,由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动,套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

2)跨期套利

跨期套利过程中,不同期货合约之间的价差不断变动,套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

基金经理会实时关注市场的发展,前瞻性地运用其他绝对收益策略。

九、业绩比较基准

本基金整体业绩比较基准构成为:金融机构人民币一年期定期存款基准利率(税后)+2%

十、风险收益特征

本基金为特殊的混合型基金,通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险,与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金,其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性,因此收益不一定能超越业绩比较基准。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告期为2017年4月1日起至2017年6月30日止。

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	170,872,528.68	41.25
	其中:股票	170,872,528.68	41.25
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	215,480,593.51	52.02
8	其他资产	27,857,871.83	6.73
9	合计	414,210,994.02	100.00

注:由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	2,090,561.00	0.51
C	制造业	62,774,628.58	15.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	520,146.00	0.13
E	建筑业	3,999,899.00	0.97
F	批发和零售业	1,634,950.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	1,147,621.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,865,710.61	9.42
J	金融业	43,192,055.49	10.46
K	房地产业	1,584,047.00	0.38
L	租赁和商务服务业	495,006.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	417,760.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,004,944.00	0.97
R	文化、体育和娱乐业	10,145,200.00	2.46
S	综合	-	-
	合计	170,872,528.68	41.39

注:由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	002019	亿帆鑫富	600,000	10,008,000.00	2.42
2	600079	人福医药	500,000	9,810,000.00	2.38
3	300287	飞利信	1,000,000	9,180,000.00	2.22
4	300104	乐视网	300,000	8,586,000.00	2.08
5	601318	中国平安	164,800	8,175,728.00	1.98
6	600036	招商银行	320,000	7,651,200.00	1.85
7	300144	宋城演艺	350,000	7,304,500.00	1.77
8	300059	东方财富	600,000	7,212,000.00	1.75
9	300115	长盈精密	200,000	5,836,000.00	1.41
10	601398	工商银行	919,900	4,829,475.00	1.17

4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金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名的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有资产权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1707	IC1707	-38	-46,382,800.00	-1,340,640.00	-
IF1707	IF1707	-32	-35,015,040.00	-1,177,636.00	-
IH1707	IH1707	-74	-56,112,720.00	-1,717,800.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-4,236,076.00
股指期货投资本期收益(元)					-2,242,712.06
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-4,476,147.94

9投资组合报告附注

(1)本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查,无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

(2)基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内股票。

(3) 基金的其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	27,634,942.40
2	应收证券清算款	25,871.62
3	应收股利	-
4	应收利息	197,057.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,857,871.83

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

(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	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300104	乐视网	8,586,000.00	2.08	重大事项

10 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	523,920,007.13
报告期期间基金总申购份额	31,804.32
减:报告期期间基金总赎回份额	63,489,664.41
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	460,462,147.04

11、基金的业绩

基金管理人承诺以恪尽职守、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,也不向投资者保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金合同生效以来的(截至2017年6月30日)的投资业绩及同期基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.43%	0.19%	0.84%	0.01%	-2.27%	0.18%
自合同生效之日起	-10.40%	0.21%	5.26%	0.01%	-15.66%	0.2%

十二、基金的费用与税收

(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、律师费和诉讼或仲裁费;

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、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)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为基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费之和。其中,基金管理人的基本管理费和基金管理人的附加管理费计提方法、计提标准和支付方式如下:

(1)基金管理人的基本管理费

本基金的基本管理费按前一日基金资产净值的1%年费率计提。基本管理费的计算方法如下:

H=E×1%÷当年天数

H为每日应计提的基金基本管理费

E为前一日的基金资产净值

基金基本管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金管理人向基金托管人发送基本管理费划款指令,基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

(2)基金管理人的附加管理费

1)基金管理人可在同时满足以下条件的前提下,提取附加管理费:

①符合基金收益分配条件

②附加管理费是在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。按照"新高法原则"提取超额收益的10%作为附加管理费:即每次提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值必须超过以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和1的孰高者,管理人才能收取附加管理费,附加管理费按照下述公式计算并收取。

提取评价日:每次基金封闭期的最后一个工作日

2)附加管理费的计算方法和提取

在同时满足以上附加管理费提取条件的情况下,附加管理费的计算方法为

附加管理费 = $(P_A - P_H) \times 10\% \times S_A$

其中:

P_A为提取评价日提取附加管理费前的基金份额累计净值

P_A= 提取评价日基金份额净值 [illegible]

P_H为以往提取评价日的最高基金份额累计净值、以往开放期期间最高基金份额累计净值和1的孰高者,其中首次封闭期的P_H为1

S_A为提取评价日的基金份额 = 提取评价日基金总份额÷提取评价日的折算因子

某日的折算因子为相应日期(包括当日)之前所有折算系数的乘积

折算系数 = 基金折算日除权前基金份额净值÷基金折算日除权后基金份额净值

附加管理费在每一封闭期的最后一个工作日计算并计提。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金管理人向基金托管人发送附加管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

上述"一、基金费用的种类中第3-7项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(三)不列入基金费用的项目

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、《基金合同》生效前的相关费用;

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。

(四)基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日2日前在指定媒介刊登公告。

(五)基金税收

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。本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人刊登的本基金招募说明书《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金》)进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"三、基金管理人"中,对公司法人代表进行了变更、公司注册资本发生了变更、公司股权结构发生了变更、对董事会成员进行了变更、对高级管理人员进行了变更、对投资决策委员会人员进行了变更;

2、在"四、基金托管人",对基金托管人情况进行了更新;

3、在"五、相关服务机构",对代销机构进行了更新;

4、在"九"基金的投资",更新了组合报告内容;

5、在"二十一、其他应披露事项",增加了本次更新内容期间的历次公告;

中邮创业基金管理股份有限公司
2017年8月12日

证券代码:002240 证券简称:威华股份 公告编号:2017-061

广东威华股份有限公司
关于向湖北省资产管理有限公司申请借款的补充公告

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

广东威华股份有限公司(以下简称"公司")于2017年8月11日披露了《关于向湖北省资产管理有限公司申请借款的公告》(公告编号:2017-058),现对上述公告补充如下:

一、本次交易对方基本情况

1、交易对方基本情况

(1)公司名称:湖北省资产管理有限公司

(2)成立日期:2015年2月16日

(3)经营场所:武汉市武昌区洪山路64号

(4)法定代表人:刘步云

(5)注册资本:300,000万人民币元

(6)经营范围:参与省内金融企业不良资产批量转让业务(凭湖北省人民政府文件经营);资产管理、资产投资及资产管理相关的重组、兼并、投资管理咨询服务;企业管理咨询及服务;对外投资;财务、投资、法律及风险管理咨询和顾问。(涉及许可经营项目,应取得相关部门许可后方可经营)

2、交易对方湖北省资产管理有限公司与本公司没有关联关系,也不存在其他可能或已经造成上市公司对其利益倾斜的其他关系。

二、借款合同主要内容

1、借款金额:人民币10,000万元;

2、借款期限:壹年,自借款之日起计算;

3、借款利率:按年利率8%计算;

4、借款用途:补充流动资金;

5、还款方式:在借款期限届满后一次性偿还借款本金,利息按季结算。经双方协商一致,公司可提前还款;

6、合同生效:自双方法定代表人或授权代表签字并加盖双方公章之日起生效。

除上述补充披露内容外,《关于向湖北省资产管理有限公司申请借款的公告》其他内容无变动。

特此公告。

广东威华股份有限公司董事会
二〇一七年八月十一日

证券代码:002803 证券简称:吉宏股份 公告编号:2017-063

厦门吉宏包装科技股份有限公司
关于持股5%以上股东股份质押的公告

本公司及全体董事保证本公告内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

厦门吉宏包装科技股份有限公司(以下简称"公司")近日接到持股5%以上股东厦门金润悦投资有限公司(以下简称"金润悦")函告,获悉金润悦所持有公司的部分股份被质押,具体事项如下:

一、股东股份质押的基本情况

1、股东股份被质押基本情况

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
金润悦	否	300万股	2016-10-19	2017-10-19	兴业证券股份有限公司	20%	融资
金润悦	否	280万股	2016-11-29	2017-11-29	兴业证券股份有限公司	18.67%	融资
金润悦	否	120万股	2017-01-20	2018-01-12	兴业证券股份有限公司	8%	融资
金润悦	否	180万股	2017-01-24	2018-01-19	兴业证券股份有限公司	12%	融资
金润悦	否	290万股	2017-08-09	2018-08-09	安信证券股份有限公司	19.33%	融资
合计	-	1170万股	-	-	-	78%	-

2、股东股份累计被质押的情况

截至本公告披露日,金润悦共持有公司股份数量为15,000,000股,占公司总股本的12.93%,累计办理质押登记的股份数量为11,700,000股,占其所持公司股份的78%,占公司总股本的10.09%。

二、备查文件

中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司股份冻结数据。

特此公告。

厦门吉宏包装科技股份有限公司
董 事 会
2017年8月11日

证券代码:603899 证券简称:晨光文具 公告编号:2017-034

上海晨光文具股份有限公司
关于使用部分闲置募集资金进行低风险投资理财的实施公告

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。

上海晨光文具股份有限公司(以下简称"公司")于2017年4月12日召开2016年年度股东大会,审议通过了《关于使用部分闲置募集资金进行低风险投资理财的议案》。公司及子公司上海晨光文具礼品有限公司(以下简称"晨光礼品")(营销网络扩充及升级项目--加盟店营销网络扩充项目实施主体)使用最高额度不超过人民币8,000万元的闲置募集资金进行投资理财,在上述额度内,资金可以滚动使用。授权公司总裁具体实施上述理财事宜,授权期限自股东大会审议通过之日起1年内有效。公司独立董事、监事会、保荐机构已分别对此发表了同意的意见。

一、投资理财概况

(一)晨光礼品与中国农业银行股份有限公司上海光明支行签订《理财产品及风险和客户权益说明书》,具体情况如下:

1、产品名称:中国农业银行"本利丰?34天"人民币理财产品

2、投资及收益币种:人民币

3、收益类型:保本保证收益型

4、产品起息日:2017年8月12日

5、产品到期日:2017年9月15日

6、实际理财天数:34天

7、投资收益率:3.20%

8、投资金额:1,500万元

9、投资范围:本理财产品资金由资产管理人主要投资于国债、金融债、央行票据、货币市场工具、较高信用等级的信用债、非公开定向债务融资工具、低风险同业资金业务、掉期等可锁定风险收益的本外币货币资金市场工具,商业银行或其他符合资质的机构发行的固定收益类投资工具、非标准化债权,以及符合监管要求的信托计划及其他投资品种。其中银行间债券市场的国债、央行票据、金融债、回购、高等级信用债券、非公开定向债务融资工具、现金、存款、投资比例约25-55%;货币市场工具、投资类信托计划、非标准化债权及其他固定收益类投资工具,投资比例约45-75%,以上投资比例在[-10%,10%]区间内浮动。

10、资金来源:闲置募集资金

11、关联关系说明:晨光礼品与中国农业银行股份有限公司上海光明支行不存在关联关系。

(二)晨光礼品与中国农业银行股份有限公司上海光明支行签订《理财产品及风险和客户权益说明书》,具体情况如下:

1、产品名称:中国农业银行"本利丰·90天"人民币理财产品

2、投资及收益币种:人民币

3、收益类型:保本保证收益型

4、产品起息日:2017年8月12日

5、产品到期日:2017年11月10日

6、实际理财天数:90天

7、投资收益率:3.30%

8、投资金额:5000万元

9、投资范围:本理财产品资金由资产管理人主要投资于国债、金融债、央行票据、货币市场工具、较高信用等级的信用债、非公开定向债务融资工具、低风险同业资金业务、掉期等可锁定风险收益的本外币货币资金市场工具,商业银行或其他符合资质的机构发行的固定收益类投资工具、非标准化债权,以及符合监管要求的信托计划及其他投资品种。其中银行间债券市场的国债、央行票据、金融债、回购、高等级信用债券、非公开定向债务融资工具、现金、存款、投资比例约25-55%;货币市场工具、投资类信托计划、非标准化债权及其他固定收益类投资工具,投资比例约45-75%,以上投资比例在[-10%,10%]区间内浮动。

10、资金来源:闲置募集资金

11、关联关系说明:晨光礼品与中国农业银行股份有限公司上海光明支行不存在关联关系。

二、风险控制措施

晨光礼品购买标的为保本型理财产品,风险可控。公司及子公司按照决策、执行、监督职能相分离的原则建立健全保本理财产品购买的审批和执行程序,确保保本理财产品购买事宜的有效开展和规范运行,确保理财资金安全。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。

三、对公司的影响

公司及子公司坚持规范运作、防范风险,在不影响募集资金投资项目的进度和确保资金安全的前提下,以部分闲置募集资金适度进行低风险的投资理财业务,不影响公司募集资金投资项目建设。通过适度理财,可以提高资金使用效率,获得一定的投资效益,同时提升公司整体业绩水平,为公司股东谋取更多的投资回报。

四、截至本公告披露日,公司使用闲置募集资金进行投资理财的余额为人民币6,500万元(含本次)。

特此公告。

上海晨光文具股份有限公司
董事会
2017年8月12日