(上接 B71 版)

92)北京创金启富投资管理有限公司
注册地址:北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A
办公地址:北京市西城区民丰胡同 31 号 5 号楼 215A
法定代表人:梁蓉
联系人:郭爱丽
电话:010-66154828-8013
传真:010-63583991
公司网址:www.5irich.com
客服电话:400-6262-818
93)佳泓(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市怀柔区怀北镇怀北路 308 号
办公地址:北京市朝阳区光华路 7 号汉威大厦 B1210
法定代表人:谢亚凡
联系人:陈冲
电话:010-65617753
公司网址:www.haofunds.com
客服电话:010-88580321
94)上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路 336 号 1807-5 室
办公地址:上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼
法定代表人:张晶
联系人:陈云卉
电话:021-54677088-6732
传真:021-33323830
公司网址:tty.chinapnr.com
客服电话:400-820-2819
95)上海利得基金销售有限公司
住所:上海市浦东新区峨山路 91 弄 61 号 1 幢 12 层(陆家嘴软件园 10 号楼)
法定代表人:李兴春
联系人:陈孜明
公司网址:www.leadfund.com.cn
客服电话:400-921-775596)北京钱景基金销售有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012
法定代表人:赵荣春
联系人:车倩倩
电话:010-57418813
传真:010-57569671
公司网址:www.qianjing.com
客服电话:400-893-6885
97)北京增财基金销售有限公司
注册地址:北京市西城区南礼士路 66 号 1 号楼 12 层 1208 号
办公地址:北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室
法定代表人:罗细安
联系人:杜娟
电话:010-67000988-6075
公司网址:www.zcvc.com.cn
客服电话:400-001-8811
98)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问公司
注册地址:上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室
办公地址:中国上海市杨浦区昆明路 508 号 B 座 12F
法定代表人:汪静波
联系人:李娟
电话:021-35882830
公司网址:www.noah-fund.com
客服电话:400-821-5399
99)上海陆金所资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼
法定代表人:郭坚
联系人:程晨
公司网址:www.lufunds.com
客服电话:4008219031
100)北京虹点基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603
办公地址:北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603
法定代表人:胡伟
联系人:陈铭洲
公司网址:www.pintec.com
客服电话:400-068-1176
101)珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔楼 1201-1203
法定代表人:肖雯
联系人:邱湘湘
公司网址:www.yingmi.cn
客服电话:020-89629066
102)大泰金石基金销售理有限公司
注册地址:南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室
办公地址:江苏省南京市秦淮区中山南路 1 号南京中心 66 楼
法定代表人:袁顾明
联系人:孟召社
联系电话:021-20324176
公司网址:www.dtfunds.com
客服电话:400-928-2266
103)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
公司网址:www.66zichan.com
客服电话:4000-466-788
104)和耕传承基金销售有限公司
注册地址:河南省郑州市郑东新区心仪路西广场路南升龙广场 2 号楼 701
办公地址:河南省郑州市郑东新区心仪路西广场路南升龙广场 2 号楼 701
法定代表人:李淑慧
联系人:郭兆英
联系电话:0371-5521 3196
公司网址:www.hgccpb.com
客服电话:4000555671
105)北京格上富信投资顾问有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路 19 号楼 701 内 09 室
法定代表人:李悦章
联系人:张林
联系电话:010-65983311
公司网址:www.igesafe.com
客服电话:010-82350618
106)深圳富济财富管理有限公司
注册地址:深圳前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室
办公地址:深圳市南山区高新南七道 12 号惠恒集团二期 418 室
法定代表人:齐小贺
联系人:杨涛
联系电话:0755-83999907-811
公司网址:www.jinqianwo.cn
客服电话:0755-83999907
107)海银基金销售有限公司
注册地址:上海市浦东新区东方路 1217 号 16 楼 B 单元
办公地址:上海市浦东新区东方路 1217 号 6 楼
法定代表人:刘惠
联系人:毛林
联系电话:021-80133597
公司网址:www.fundhaiyin.com
客服电话:400-808-1016
108)北京电盈基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室
办公地址:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室
法定代表人:程刚
联系人:赵立芳
联系电话:010-56176104
公司网址:www.dianyingfund.com
客服电话:400-100-3391
109)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室
注册地址:上海市黄浦区延安东路凯石大厦 4F
法定代表人:陈继武
联系人:黄祎
公司网址:www.vstonewealth.com
客服电话:4000-178-000
110)北京广源达信投资管理有限公司
注册地址:北京是西城区新街口外大街 28 号 C 座六层 605 室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区浦项中心 B 座 19 层
法定代表人:齐剑辉
联系人:王永霞
联系电话:010-82055860
公司网址:www.niuniufund.com
客服电话:400-623-6060
111)深圳市金斧子基金销售有限公司
注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑路 16 号东方科技大厦 18 楼
办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑路科兴科学园 B3 单元 7 楼
法定代表人:赖任军
联系人:张烨
公司网址:www.jfzinv.com
客服电话:4009500888
112)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
办公地址:上海市浦东新区福山路 33 号建工大厦 8 楼
法定代表人:王廷富
联系人:徐亚丹
联系电话:021-51327185
客服电话:021-51327185
113)北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院 6 号楼 2 单元 21 层
办公地址:北京市朝阳区阜通东大街 1 号院望京 SOHO 塔 3 19 层
法定代表人:钟斐斐
联系人:戚晓强
公司网址:https://danjuanapp.com/
客服电话:4000618518
114)上海中正达广投资管理有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室
办公地址:上海市徐汇区龙腾大道 2815 号 302 室
法定代表人:黄欣
联系人:戴珉微
联系电话:021-33768132-801
公司网址:www.zzwealth.cn
客服电话:400-6767-5263
115)浙江金观诚财富管理有限公司
注册地址:杭州市拱墅区登云路 45 号(锦昌大厦)1 幢 10 楼 1001 室
办公地址:浙江省杭州市拱墅区登云路 43 号金诚大厦 3F
法定代表人:徐黎云
联系人:孙成岩
联系电话:0571-88337717
公司网址:www.jincheng-fund.com
客服电话:400-068-0058
116)中证金牛(北京)投资咨询有限公司
注册地址: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
联系人:孟汉霄
联系电话:010-59336498
公司网址:www.jnlc.com
客服电话:4008-909-998
117)北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15
办公地址:北京市亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层
法定代表人:陈超
联系人:赵德赛
公司网址:http://fund.jd.com
客服电话:95518
118)上海云湾投资管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路 27 号 13 号楼 2 层
办公地址:上海市锦康路 308 号 7 楼
法定代表人:戴新装
联系人:范泽杰
联系电话:021-20530186
公司网址:www.zhengtongfunds.com
客服电话:400-820-1515
119)天津国美基金销售有限公司
注册地址:天津经济技术开发区南港工业区综合服务区办公楼 D 座二层 202-124 室
办公地址:北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 19 层
法定代表人:丁东华
联系人:许艳
公司网址:www.gomefund.com
客服电话:400-111-0889
120)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
办公地址:上海浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 9 楼
法定代表人:郭林
联系人:李颖
联系电话:021-38784818-8508
公司网址:www.shhxzq.com
客服电话:400-820-5999
121)上海朝阳永续基金销售有限公司
注册地址:浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室
办公地址:上海市浦东新区碧波路 690 号 4 号楼 2 楼
法定代表人:廖冰
联系人:裘爱萍
联系电话:021-80234888-6693
公司网址:www.998fund.com
客服电话:400-998-7172

3、H 类份额的销售机构为具备基金销售资格的由香港代表选聘或基金管理人直接选聘的相关销售机构。

4、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,并及时公告。

(二)注册登记机构
名称:华泰柏瑞基金管理有限公司
住所:上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层
法定代表人:贾波
办公地址:上海浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号楼 17 层
电话:400-888-0001,(021)38601777
传真:(021)50103016
联系人:赵景云

(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市金杜律师事务所
住所:北京市朝阳区东三环中路 39 号建外 SOHO A 座 31 层
负责人:王玲
电话:(021)24126000
传真:(021)24126150
经办律师:靳庆军、傅轶
联系人:傅轶

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
办公地址:上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
法定代表人:杨绍信
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
经办注册会计师:单峰、曹阳

四、基金的名称

华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型

六、基金的投资目标

在力求有效控制投资风险的前提下,力争实现达到或超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。

本基金力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在 8%以内。

七、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、债券、权证、股指期货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(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(包括公告等)后,可以将其纳入投资范围。

本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%;现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的 5%。

八、基金的投资策略

本基金利用量化投资模型,在控制组合跟踪误差的基础上,力求投资业绩达到或超越业绩比较基准。

1、比较基准的标的指数

本基金股票资产跟踪的标的指数为沪深 300 指数。沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映 A 股市场总体发展趋势。

沪深 300 指数是指由中证指数有限公司编制和发布的沪深 300 的价格指数。如果指数发布机构变更或者停止上述标的指数编制及发布,或者上述标的指数由其它指数代替,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,履行适当的程序变更本基金的标的指数。

2、以增强指数投资收益为目的的股票投资策略

本基金利用定量投资模型,选取并持有预期收益较好的股票构成投资组合,在严格控制组合预期跟踪误差的基础上,力求超越标的指数投资回报。一般情况下,本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 85%。

(1)多因子 alpha 模型——股票超额回报预测

多因子 alpha 模型以对中国股票市场较长期的回测研究为基础,结合前瞻性市场判断,用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处,以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲,本基金 alpha 模型的因子可归为如下几类:价值(value)、质量(quality)、动量(momentum)、成长(growth)、市场预期等等。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化,并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。

多因子 alpha 模型利用长期积累并最新扩展的数据库,科学地考虑了大量的各类信息,包括来自市场各类投资者,公司各类报表,分析师预测等等多方面的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断,适时调整各因子类别的具体组成及权重。

(2)风险估测模型——有效控制预期风险

纯指数化投资力求跟踪误差最小,指数增强投资策略则需要力求将跟踪误差控制在一定范围之内。本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施,有效控制投资组合的预期投资风险,并力求将投资组合的实现风险(用跟踪误差衡量)控制在目标范围内。

(3)交易成本模型——控制交易成本以保护投资业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本,也考虑交易的市场冲击效应,以减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上,进行投资收益的优化。

(4)投资组合的优化

本基金将综合考虑预期回报,风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括指数成份股和非指数成份股中,流动性和基本面信息较好的股票。

(5)投资组合的调整

本基金将根据所考虑各种信息的变化情况,对投资组合进行重新优化,调整投资组合的构成,并根据市场情况适当控制和调整投资组合的换手率。

3、债券投资策略

本基金管理人将基于对国内外宏观经济形势的深入分析、国内财政政策与货币市场政策等因素对债券市场的影响,进行合理的利率预期,判断债券市场的基本走势,制定久期控制下的资产类属配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中,本基金管理人将具体采用期限结构配置、市场转换、信用利差和相对价值判断、信用风险评估、现金管理等管理手段进行个券选择。

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,有效利用基金资产,提高基金资产的投资收益。

4、金融衍生工具投资策略

在法律法规允许的范围内,本基金可基于谨慎原则运用权证、股票指数期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理,以控制投资组合风险、提高投资效率,从而更好地实现本基金的投资目标。

5、融资融券和转融资转融券

从投资人的利益出发,本基金可在法律法规允许的范围内参与适当的融资融券和转融资转融券业务。

九、基金的业绩比较基准

95%×沪深 300 指数收益率+2.5% (指年收益率,评价时按期间折算)

沪深 300 指数是指由中证指数有限公司编制和发布的沪深 300 的价格指数。沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数,是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数。沪深 300 指数成份股为 A 股市场中市场代表性好、流动性高、交易活跃的主流股票,覆盖了沪深市场六成左右的市值,能够反映市场主流投资的收益情况。

随着法律法规和市场环境发生变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金、或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布,或者推出更权威的能够表征本基金风险收益特征的指数,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,基金管理人应在调整前 2 个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期风险与预期收益高于债券型基金与货币市场基金,低于股票型基金。

本基金的风险控制将力争将对业绩比较基准的年化跟踪误差控制在目标范围以内。因本基金为指数增强投资基金,跟踪误差的计算将剔除主动回报的均值。另外,在特殊情况下,从保护投资人利益出发对基金股票仓位做出调整,以至于股票持仓比例较大低于正常水平时,基金由此获得的对投资人有利的正收益不计入跟踪误差的计算,但基金由此获得的负收益则要计入跟踪误差的计算。

十一、基金的投资组合报告

投资组合报告截止日为 2017 年 6 月 30 日。

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	3,955,679,736.98	86.75
	其中:股票	3,955,679,736.98	86.75
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	79,696,000.00	1.75
	其中:债券	79,696,000.00	1.75
	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	300,661,390.72	6.59
8	其他资产	223,983,772.99	4.91
9	合计	4,560,020,900.69	100.00

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	26,226,959.96	0.59
B	采矿业	122,937,881.73	2.78
C	制造业	1,660,114,728.26	37.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,118,961.62	0.70
E	建筑业	65,409,179.96	1.48
F	批发和零售业	45,048,899.62	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	204,748,007.34	4.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	120,977,992.05	2.73
J	金融业	1,214,754,908.62	27.44
K	房地产业	231,670,730.93	5.23
L	租赁和商务服务业	120,150,125.29	2.71
M	科学研究和技术服务业	20,155,908.32	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	92,365,453.28	2.09
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	3,955,679,736.98	89.35

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	601318	中国平安	3,612,818	179,231,900.98	4.05
2	601006	大秦铁路	12,193,370	102,302,374.30	2.31
3	600030	中信证券	5,908,931	100,570,005.62	2.27
4	601288	农业银行	28,325,200	99,704,704.00	2.25
5	601398	工商银行	18,986,042	99,676,720.50	2.25
6	600688	上海石化	14,324,939	94,687,846.79	2.14
7	000069	华侨城 A	8,985,888	90,398,033.28	2.04
8	601231	环旭电子	5,640,974	88,619,701.54	2.00
9	600383	金地集团	7,354,065	84,351,125.55	1.91
10	000415	渤海金控	11,209,792	75,441,900.16	1.70

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	79,696,000.00	1.80
	其中:政策性金融债	79,696,000.00	1.80
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	79,696,000.00	1.80

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

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	170401	17农发 01	800,000	79,696,000.00	1.80

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

注: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名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8、报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

10、投资组合报告附注

1)本基金本报告期末投资的前十名证券中,中信证券(600030)于 2017 年 5 月 24 日收到中国证监会处罚决定。因公司在司度(上海)贸易有限公司从事证券交易时间连续计算不足半年的情况下,违规为其提供融资融券服务。对中信证券责令改正,给予警告,没收违法所得 61,655,849.78 元,并处以 308,279,248.90 元罚款;对直接负责人苴新亚、宋成给予警告,并分别处以人民币 10 万元罚款。在监管机构的指导下,公司持续完善相关内控机制,依法合规地开展各项业务,目前公司的经营情况正常。

报告期内基金投资的前十名证券的其他发行主体,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、处罚的情形。

2)基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	999,406.07
2	应收证券清算款	219,153,638.67
3	应收股利	-
4	应收利息	1,315,425.07
5	应收申购款	2,515,303.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	223,983,772.99

4)报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末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

注:截至本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

十二、基金的业绩

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资产,但不保证基金一定盈利。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。

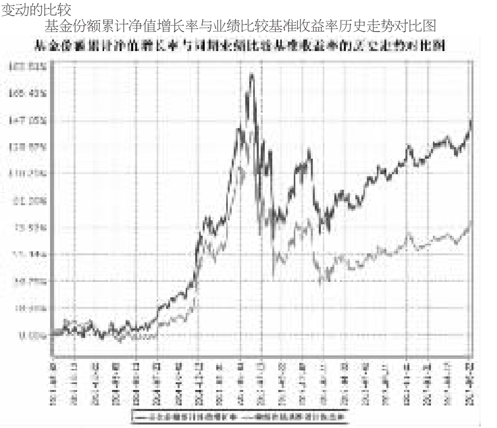
下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。基金的业绩报告截止日为 2017 年 6 月 30 日。

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
2013年	3.10%	0.98%	4.71%	1.08%	-1.61%	-0.10%
2014年	70.42%	1.12%	52.47%	1.15%	17.95%	-0.03%
2015年	24.77%	2.5%	8.39%	2.36%	16.38%	0.14%
2016年	-1.36%	1.42%	-8.34%	1.33%	6.98%	0.09%
过去六个月	14.27%	0.65%	11.61%	0.54%	2.66%	0.11%
成立至今	147.10%	1.61%	77.03%	1.54%	70.07%	0.07%

2、图示自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注:图示日期为 2013 年 8 月 2 日至 2017 年 6 月 30 日。

1、按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条(二)投资范围的要求,基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%,现金和到期日在一年以内的政府债券的投资比率不低于基金资产净值的 5%。

十三、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、因基金的证券交易或结算而产生的费用;
4、基金合同生效以后的信息披露费用;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金合同生效以后的会计师费和律师费;
7、基金资产的资金汇划费用;
8、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。

(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

基金管理人的基金管理费按基金资产净值的 1.00%年费率计提。

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.00%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

2、基金托管人的基金托管费

基金托管人的基金托管费按基金资产净值的 0.25%年费率计提。

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提。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

基金托管费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。

3、本条第(一)款第 3 至第 8 项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。

(三)不列入基金费用的项目

本条第(一)款约定以外的其他费用,以及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等不列入基金费用。处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(四)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情调低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。

(五)税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照中国、中国香港及投资人所在国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、"三、基金管理人"部分,对监事会成员、总经理及其他高级管理人员和本基金基金经理的相关信息作了更新。
2、"四、基金托管人"部分,根据基金托管人提供的更新内容作了相应的更新。
3、"五、相关服务机构"部分,更新了代销机构的相关信息;
4、"十、基金的投资"部分,对基金投资组合报告作了更新。
5、"十一、基金的业绩"部分,对基金投资业绩作了更新。
6、"二十三、其他应披露事项"部分,根据前次招募说明书(更新)公布日至本次更新内容截止日的历次信息披露作了更新。

华泰柏瑞基金管理有限公司
二〇一七年九月十四日

证券代码:000605 证券简称:渤海股份 公告编号:2017-066

渤海水业股份有限公司 2017 年第三次临时股东大会决议公告

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

特别提示:

1.本次股东大会未出现否决提案的情形;

2.本次股东大会不涉及变更以往股东大会已通过的决议。

一、会议召开和出席情况

1.会议召开时间:

(1)现场会议召开时间:2017 年 9 月 13 日(星期三)14:30;

(2)网络投票时间:

通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的时间为 2017 年 9 月 13 日(星期三)9:30~11:30,13:00~15:00。

通过深圳证券交易所互联网投票系统投票(http://wltp.cninfo.com.cn)的开始时间(2017 年 9 月 12 日 15:00)至投票结束时间(2017 年 9 月 13 日 15:00)间的任意时间。

2.会议召开地点:天津市河西区环岛西路梅江中心大厦 22 层,渤海水业股份有限公司会议室。

3.会议召开方式:现场投票结合网络投票。

4.会议召集人:公司第六届董事会。

5.会议主持人:董事长江波先生。

6.会议的召开符合《公司法》、《股票上市规则》等有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和《公司章程》的规定。

7.股东出席的总体情况:

通过现场和网络投票的股东 6 人,代表股份 145,744,102 股,占上市公司总股份的 57.8581%。

其中:通过现场投票的股东 6 人,代表股份 145,744,102 股,占上市公司总股份的 57.8581%。

通过网络投票的股东 0 人,代表股份 0 股,占上市公司总股份的 0.0000%。

中小股东出席的总体情况:

通过现场和网络投票的股东 0 人,代表股份 0 股,占上市公司总股份的 0.0000%。

其中:通过现场投票的股东 0 人,代表股份 0 股,占上市公司总股份的 0.0000%。

通过网络投票的股东 0 人,代表股份 0 股,占上市公司总股份的 0.0000%。

8.公司部分董事、监事、高级管理人员及北京国枫律师事务所见证律师列席了本次会议。

二、提案审议表决情况

1.表决方式:采取现场投票与网络投票相结合的方式。

2.表决结果:

提案 1:关于修订《公司章程》部分条款的提案

	同意		反对		弃权	
	票数	比例	票数	比例	票数	比例
总表决情况	145,744,102	100%	0	0%	0	0%
中小股东表决情况	0	-	0	-	0	-

审议结果:本提案为特别决议事项,已获得出席本次会议的股东(包括股东代理人)所持有表决权股份总数的 2/3 以上通过。

提案 2:关于单个募投项目结项并将节余募集资金永久补充流动资金的提案

	同意		反对		弃权	
	票数	比例	票数	比例	票数	比例
总表决情况	145,744,102	100%	0	0%	0	0%
中小股东表决情况	0	-	0	-	0	-

审议结果:通过。

提案 3:关于拟为公司全资子公司提供担保的提案

	同意		反对		弃权	
	票数	比例	票数	比例	票数	比例
总表决情况	145,744,102	100%	0	0%	0	0%
中小股东表决情况	0	-	0	-	0	-

审议结果:通过。

提案 4:关于拟为公司控股子公司提供担保的提案

	同意		反对		弃权	
	票数	比例	票数	比例	票数	比例
总表决情况	145,744,102	100%	0	0%	0	0%
中小股东表决情况	0	-	0	-	0	-

审议结果:通过。

三、律师出具的法律意见

1.律师事务所名称:北京国枫律师事务所。

2.律师姓名:王冠、王凤。

3.结论性意见:公司本次股东大会的召集、召开程序符合法律、法规和《公司章程》的有关规定;会议召集人和出席会议人员的资格合法、有效;表决程序和表决结果符合法律、法规和《公司章程》的规定;本次股东大会通过的有关决议合法有效。

四、备查文件

1.渤海水业股份有限公司 2017 年第三次临时股东大会决议;

2.北京国枫律师事务所关于公司 2017 年第三次临时股东大会的法律意见书。

特此公告。

渤海水业股份有限公司
董事会
2017 年 9 月 13 日

证券代码:603016 证券简称:新宏泰 公告编号:2017-075

无锡新宏泰电器科技股份有限公司股票交易异常波动公告

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。

重要内容提示:

无锡新宏泰电器科技股份有限公司(以下简称"公司"、"本公司")股票于 2017 年 9 月 11 日、9 月 12 日、9 月 13 日连续三个交易日内日收盘价格涨幅偏离值累计超过 20%,属于股票交易异常波动。

经公司自查,并书面征询控股股东及实际控制人,截止本公告披露日,确认不存在应披露而未披露的重大信息。

一、股票交易异常波动的具体情况

本公司股票于 2017 年 9 月 11 日、9 月 12 日、9 月 13 日连续三个交易日内日收盘价格涨幅偏离值累计达到 20%,根据《上海证券交易所交易规则》的相关规定,属于股票交易异常波动。

二、公司关注并核实的相关情况

1、本公司生产经营情况正常,内外部经营环境未发生重大变化,也不存在预计将要发生重大变化的情形。2017 年 8 月 29 日,公司在上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)披露了《2017 年半年度报告》及《2017 年半年度报告摘要》。

2、公司因筹划重大事项,根据上海证券交易所的有关规定,经公司申请,公司股票已于 2017 年 5 月 2 日起停牌。经与有关各方论证和协商,上述事项对公司构成了重大资产重组,并于 2017 年 5 月 16 日披露了《重大资产重组停牌公告》。停牌期间,公司按照相关规定披露了相关进展公告。2017 年 7 月 31 日,公司召开了第三届董事会第十七次次会议,审议通过了《关于公司本次发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易方案的议案》等相关议案,并于 2017 年 8 月 2 日披露了《无锡新宏泰电器科技股份有限公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(草案)》及其摘要等相关公告和文件。2017 年 8 月 15 日,公司收到上海证券交易所《关于无锡新宏泰电器科技股份有限公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易草案信息披露的问询函》(上证公函[2017]2115 号)(以下简称"《问询函》")。2017 年 9 月 6 日,公司向上海证券交易所提交了《无锡新宏泰电器科技股份有限公司关于对上海证券交易所<关于无锡新宏泰电器科技股份有限公司发行股份及支付现金购买资产并募集配套资金暨关联交易草案信息披露的问询函>的回复》及与之有关的文件。公司对《问询函》所提出的问题进行了认真分析、研究,按照《问询函》的要求,对有关问题进行了回复,并对重大资产重组报告书及摘要作了相应修改。具体内容详见公司于 2017 年 9 月 7 日披露的相关公告文件。根据上海证券交易所的相关规定,经公司申请,公司股票自 2017 年 9 月 7 日开市起复牌。上述重大资产重组事项正在按程序进行,公司将会按照相关规定及时履行信息披露义务。详细信息请见上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)及其它指定信息披露媒体披露的相关公告。

3、公司于 2017 年 7 月 31 日召开第三届董事会第十七次会议,审议通过了《关于修改<公司章程>的议案》,同意公司根据《关于进一步落实上市公司现金分红有关事项的通知》(证监发[2012]37 号)、《上市公司监管指引第 3 号--上市公司现金分红》(中国证监会公告[2013]43 号)等有关规定对《公司章程》中的利润分配政策相关条款进行修改。具体内容详见公司于 2017 年 8 月 3 日披露的《关于修改<公司章程>的公告》及 2017 年 8 月 4 日披露的《关于修改<公司章程>的更正公告》。公司于 2017 年 8 月 26 日召开第三届董事会第十八次会议,审议通过了《关于修改<股利分配政策和未来三年股东回报规划(2017-2019)>的议案》,具体内容详见公司于 2017 年 8 月 29 日披露的《股利分配政策和未来三年股东回报规划(2017-2019)修订稿》。

4、2017 年 9 月 6 日,公司实际控制人赵汉新、赵敏海与公司董事沈华、副总经理余旭签订《一致行动协议》,具体内容详见公司于 2017 年 9 月 7 日披露的《关于控股股东签署一致行动协议的公告》。

5、经公司自查,并向公司控股股东及实际控制人书面征询核实:除公司已披露上述事项之外,公司控股股东及实际控制人均不存在涉及公司应披露而未披露的重大信息,包括但不限于重大资产重组、发行股份、上市公司收购、债务重组、业务重组、资产剥离和资产注入等重大事项。

三、不存在应披露而未披露的重大信息的声明

本公司董事会确认,除公司已披露的事项之外,本公司没有任何根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定应披露而未披露的事项或与该等事项有关的筹划和意向,董事会也未获悉根据《上海证券交易所股票上市规则》等有关规定应披露而未披露的、对本公司股票及其衍生品种交易价格可能产生较大影响的信息。

四、相关风险提示

公司所有公开披露的信息均以在指定媒体《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)披露为准。敬请广大投资者及时注意、充分了解投资风险,谨慎、理性投资。

特此公告。

无锡新宏泰电器科技股份有限公司董事会
2017 年 9 月 13 日

证券代码:603843 证券简称:正平股份 公告编号:2017-055

正平路桥建设股份有限公司关于应收账款保理业务的后续进展公告

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。

正平路桥建设股份有限公司(以下简称"公司")于 2017 年 8 月 9 日召开的公司第二届董事会第三十六次会议审议通过了《关于审议办理应收账款保理业务的议案》,同意公司向海通恒信国际租赁股份有限公司(以下简称"海通恒信")办理人民币 250,000,000.00 元有追索权的应收账款保理业务。详见公司于 2017 年 8 月 11 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)上披露的公告(公告编号:2017-045)。

根据上述董事会决议,公司与海通恒信签订了《国内保理合同》(以下简称"本合同")和《应收账款转让登记协议》。公司已收到保理融资款人民币 250,000,000.00 元。

一、本合同的主要内容

(一)合同双方:正平路桥建设股份有限公司与海通恒信国际租赁股份有限公司

(二)应收账款转让

1.公司同意将工程施工过程中形成的应收账款人民币 303,927,699.91 元转让给海通恒信。

2.公司授权海通恒信在中国人民银行征信中心动产融资统一登记平台完成本合同项下应收账款转让登记。

(三)保理融资金额:人民币 250,000,000.00 元。

(四)保理期限:2017 年-2022 年

(五)保理方式:有追索权

(六)服务费及支付方式

公司向海通恒信支付服务费人民币 8,520,000.00 元/年,服务费的支付方式为利随本清,服务费从放款之日起按照实际放款金额计收,每季度支付一次。

(七)本合同项下的转让条款

事先未获得海通恒信书面认可,公司不得转让本合同及其相关的权利或义务。海通恒信对受让的应收账款享有充分、自主的处分权利。

(八)本合同项下的法律适用与司法管辖

本合同适用中国法律,与本合同相关的任何争议,若协商不成,均应提交本合同签约地(上海市黄浦区)有管辖权的法院通过诉讼解决。

(九)合同生效

《国内保理合同》和《应收账款转让登记协议》均经合同双方盖章或法定代表人(或其授权的委托代理人)签字之日起成立并生效。

二、对上市公司的影响

本合同项下的保理融资类型是有追索权保理业务,所以用于本次保理融资的应收账款暂不进行终止确认。上述合同的签订旨在满足公司业务需求,增加流动资金,缩短应收账款回笼时间,拓宽公司融资渠道,促进公司的正常生产经营,有利于公司的长期发展,符合公司发展规划和整体利益,不存在损害公司及股东利益的情况。

三、风险提示

1.上述合同存在不能完全履行的风险,如发生不能完全履行事项,公司将根据具体情况及时披露相关信息。

2.受不可抗力影响造成的风险。

特此公告。

正平路桥建设股份有限公司
董事会
2017 年 9 月 13 日

证券代码:603566 证券简称:普莱柯 公告编号:临 2017-034

普莱柯生物工程股份有限公司关于媒体报道的澄清公告

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。

一、媒体报道情况

2017年 9 月 13 日,普莱柯生物工程股份有限公司(以下简称"公司")关注到有关媒体刊登了《我国首个猪用基因工程疫苗将上市》的报道,该报道称"公司利用大肠杆菌表达系统成功制备 PCV-2 VLPs(病毒样颗粒 virus-like particles,VLPs),历时 7 年研发成功的国内首个纯病毒样颗粒猪圆环病毒基因工程亚单位苗将上市"。

二、澄清说明

该媒体报导的题目中所称的"我国首个猪用基因工程疫苗"与事实不符,公司申报的猪圆环病毒 2 型基因工程亚单位疫苗(大肠杆菌源)仍处于新兽药注册阶段,尚未获得新兽药注册证书。

按照《兽药注册管理办法》和《兽药产品批准文号管理办法》,新开发的兽药产品首先通过实验室研究(临床前研究)设计新药开发的可行性;实验室研究结束以后,向农业部申请批准进入临床试验,验证新药开发可行性;临床试验结束以后申请新兽药注册,经农业部审批后获得新兽药注册证书;获得新兽药证书后必须由获得 GMP 认证的企业向农业部申请产品批准文号;获得产品批准文号批件以后,企业可以生产上述研发的新产品,并经中国兽医药品监察所批签发后方可上市销售。

新兽药注册阶段主要分为申请新兽药注册、新兽药注册初审、新兽药注册复审、获得新兽药注册证书等环节。目前,公司申报猪圆环病毒 2 型基因工程亚单位疫苗(大肠杆菌源)于 2017 年 6 月 30 日收到农业部兽药评审中心复审意见的函[部评审生(2017)186 号],标志着该新兽药申请通过了新药注册复审,上述信息已于公司《2017 年半年度报告》中进行了披露。根据复审意见,公司向兽药评审中心提供了相关资料,并于 2017 年 8 月 24 日收到兽药评审中心下发的新兽药注册申报资料技术核查意见的函[部评审生函(2017)220 号],针对公司申报的猪圆环病毒 2 型基因工程亚单位疫苗(大肠杆菌源),经审查后拟建议注册为三类新兽药,并报农业部审批。

三、风险提示

虽然公司已经收到了农业部兽药评审中心下发的新药注册申报资料技术审查意见的函,并按照函件要求对该新药注册有关的标准文件进行了确认,但后续仍需评审中心承办人报请兽药评审中心、兽医局、农业部等有权部门批准后,方可获得新兽药注册证书,期间仍存在行政审批风险。公司获得新药注册证书之后,仍需获得农业部下发的产品批准文号及经过中国兽医药品监察所产品批签发合格后,方可上市销售。

公司指定的信息披露媒体为上海证券交易所网站(http://www.sse.com.cn)及《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》,公司所有信息均以在上述指定媒体披露的信息为准,敬请广大投资者及时关注,理性投资,注意风险。

特此公告。

普莱柯生物工程股份有限公司
董 事 会
2017 年 9 月 13 日