(上接B38版)

公司网址:www.gjzq.com.cn
(64)华宝证券有限责任公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道100号57层
法定代表人:陈林
联系人:刘闻川
电话:021-20515589
传真:021-20515593
客服电话:4008209898
公司网址:www.cnhbstock.com
3.基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定,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。
(二)注册登记机构:东吴基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)
办公地址:上海市浦东新区源深路279号(200135)
法定代表人:王炯
联系人:贾云鹏
电话:021-50509888
传真:021-50509884
客户服务电话:400-821-0588(免长途话费)、021-50509666
网站: www.scfund.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:陆奇
经办律师:黎明、陆奇
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:江苏天衡会计师事务所有限公司
注册地址:南京市正洪街18号东宇大厦8楼
办公地址:南京市正洪街18号东宇大厦8楼
法定代表人:余瑞玉
联系人:魏娜
经办注册会计师:谈建忠、魏娜
电话:025-84711188
传真:025-84716883

四、基金的名称

本基金名称:东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:混合型基金

六、基金的投资目标

本基金主要投资于智慧医疗主题相关股票,通过量化选股与择时相结合的方法,在充分控制基金财产风险和保证基金财产流动性的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报,力争实现基金财产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证、债券(包括但不限于国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、公司债、中期票据、可转换债券(含分离型可转换债券)、次级债)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融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。
基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为0%-95%;投资于智慧医疗主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;权证投资比例不得超过基金资产净值的3% ;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持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%;本基金投资于其他工具的比例依照法律法规或监管机构的规定执行。
如法律法规或监管机构允许,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

(一)资产配置策略
本基金在资产配置过程中严格遵循自上而下的配置原则,强调投资纪律、避免因随意性投资带来的风险或损失。通过公司数量化模型,分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益,确定资产配置比例,并进行动态优化管理。
(二)智慧医疗主题相关公司的界定
本基金定义的智慧医疗主题相关公司主要包括三大类:1)医药医疗产业链上的公司,以产品创新、技术创新、模式创新、体制机制创新等手段(包括丰富的药品器械产品梯队、创新药、智能硬件与软件信息化、医药电商、医保管理、民营医疗机构等),服务国民的医疗健康事业;2)非医药医疗领域的公司,以先进的产品、技术或者商业模式,为医药医疗产业链提供重要的补充和服务(如硬件制造、软件及信息系统开发、中间产品供应等);3)非医药医疗领域的但有向医药医疗领域转型预期的公司。
同时,本基金将对智慧医疗主题相关产业的发展进行持续跟踪,随着产业结构的不断升级和发展,智慧医疗主题相关的上市公司范围也会相应改变。本基金将根据实际情况更新调整智慧医疗主题相关公司的认定。
(三)股票投资策略
1、个股精选
在综合考虑智慧医疗主题上市公司行业流动性和估值水平的基础上, 本基金管理人将采用定性和定量的双重标准对沪深两市符合智慧医疗主题的上市公司的基本面和投资价值进行细致分析,筛选得到智慧医疗主题股票池。
(1)定量指标
本基金在定量指标的设置上将重点侧重盈利能力和成长能力等成长性指标:
盈利能力:本基金通过盈利能力分析评估上市公司创造利润的能力,主要参考的指标包括净资产收益率(ROE)、毛利率、净利率、EBITDA/主营业务收入等。
成长能力:本基金通过成长能力分析评估上市公司未来的盈利增长速度,主要参考指标包括主营业务收入增长率、主营业务利润增长率等。
另外本基金将PE、PB、PCF等估值指标作为辅助考察指标。
(2)定性指标
本基金在定性分析方面将侧重企业竞争优势及企业治理等方面:
企业竞争优势:企业的竞争优势是企业获得长期增长的根本动力。本基金对企业竞争优势的分析将从企业的技术、管理、品牌和成本等各方面综合考虑。同时结合智慧医疗产业的特点,本基金将选择具有市场优势的企业,主要是指公司现在或未来有可能在行业细分市场中占据较大的市场份额,或拥有较高的市场份额增长率。
公司治理:本基金对公司治理结构的评估,主要是对上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察,包括对所有权和经营权的分离、对股东利益的保护、经营管理的自主性、政府及母公司对公司内部的干预程度,管理决策的执行和传达的有效性,股东会、董事会和监事会的实际执行情况,企业改制彻底性、企业内部控制的制订和执行情况等。
在智慧医疗主题股票池的基础上, 基金经理将采用多因子模型选出排名居前股票,对筛选出的股票进行资金配置。本基金采用的多因子选股模型,主要从价值因子、成长因子、动量因子(技术面因子)以及基于投资者行为的大类数据因子四个维度来量化描述整个市场,并伴有对个股以及个股组合的相对强度的刻画,当策略系统发出建仓信号时,基金经理根据多因子选股模型筛选出股票组合予以配置。在基金管理过程中,基金经理对策略模型的参数进行阶段评估,在市场结构发生变化时,做出相应调整。
2、股票择时策略
本基金通过对智慧医疗股票池中样本股从市场广度分析、成交量分析和动量分析三个维度进行趋势的量化跟踪分析,以此确定建仓时机。根据均线系统理论、相对强弱理论等形成具客观性、一致性的量化交易规则,严格执行开平仓、止盈止损、平仓后再入场等操作,避免了传统投资决策择时过程中主观非理性的干扰因素。当量化决策系统判断系统性风险较大时,本基金可以降低股票仓位,转投固定收益,从而控制回撤;当行情出现反转,再买入信号出现后,本基金通过再入场机制迅速完成加仓,获取收益;
(四)债券投资策略
本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。
本基金通过分析未来市场利率趋势及市场信用环境变化方向, 综合考虑不同券种收益率水平、信用风险、流动性等因素,尤其是智慧医疗主题相关的债券,构造债券投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期控制策略、收益率曲线策略、类别选择策略、个券选择策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。
(五)资产支持证券投资策略
本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、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基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用数量化定价模型,评估其内在价值。
(六)股指期货投资策略
本基金将以股指期货为主的金融衍生工具与资产配置策略进行搭配, 并利用股指期货灵活快速进出的优势,控制仓位风险,同时可以降低交易成本,为实际的投资操作提供多一项选择。
(七)权证投资策略
本基金权证投资将以价值分析为基础, 在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。具体投资方法如下:
考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率和无风险收益率等要素,估计权证合理价值。
根据权证合理价值与其市场价格间的差幅以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或沽出权证。

九、业绩比较基准

65%×中证医疗指数收益率+35%×中债综合全价(总值)指数收益率。

十、风险收益特征

本基金为混合型基金,预期风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

十一、基金投资组合报告

东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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。
本基金的托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月14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2017年6月30日(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	179,561,425.91	61.90
	其中:股票	179,561,425.91	61.90
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	88,988,088.04	30.68
8	其他资产	21,526,205.62	7.42
9	合计	290,075,719.57	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	448,634.00	0.16
B	采矿业	3,523,990.31	1.22
C	制造业	122,226,661.13	42.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	272,559.00	0.09
E	建筑业	542,630.00	0.19
F	批发和零售业	16,636,507.34	5.78
G	交通运输、仓储和邮政业	1,137,161.80	0.39
H	住宿和餐饮业	256,740.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,524,094.60	5.39
J	金融业	6,460,849.36	2.24
K	房地产业	6,258,950.56	2.17
L	租赁和商务服务业	1,098,555.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	126,274.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	117,976.00	0.04
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,894,281.92	0.66
R	文化、体育和娱乐业	2,145,435.18	0.75
S	综合	890,125.71	0.31
	合计	179,561,425.91	62.36

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有沪港通股票。
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

代码	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	000423	东阿阿胶	40,700	2,925,923.00	1.02
2	000571	新大洲A	352,421	2,858,134.31	0.99
3	600050	中国联通	381,000	2,846,070.00	0.99
4	000963	华东医药	56,974	2,831,607.80	0.98
5	601607	上海医药	86,000	2,483,680.00	0.86
6	000028	国药一致	28,708	2,322,477.20	0.81
7	600165	新日恒力	135,800	2,286,872.00	0.79
8	002162	悦心健康	336,181	2,222,156.41	0.77
9	000999	华润三九	69,653	2,211,482.75	0.77
10	002223	鱼跃医疗	91,605	2,169,206.40	0.75

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
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
9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有股指期货。
9.2 本基金投资股指期货的投资政策
本基金本报告期末投资股指期货。
10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
10.1 本期国债期货投资政策
本基金本报告期末投资国债期货。
10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末未持有国债期货。
10.3 本期国债期货投资评价
本基金本报告期末投资国债期货。
11、投资组合报告附注
11.1
本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。
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库。
11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	307,130.85
2	应收证券清算款	21,200,556.92
3	应收股利	-
4	应收利息	17,525.29
5	应收申购款	992.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,526,205.62

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

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	000571	新大洲A	2,858,134.31	0.99	重大资产重组
2	600050	中国联通	2,846,070.00	0.99	临时停牌
3	600165	新日恒力	2,286,872.00	0.79	重大资产重组
4	002162	悦心健康	2,222,156.41	0.77	临时停牌

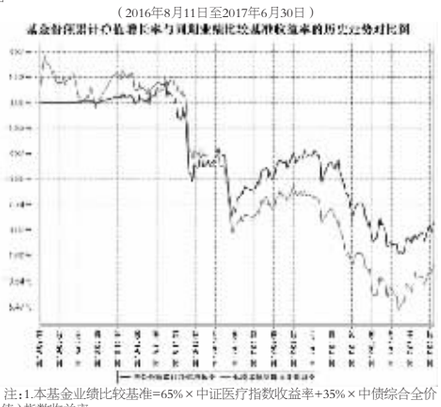
11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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资产,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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
(1)东吴智慧医疗基金历史时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

时间	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
2016.08.11-2016.12.31	-4.50%	0.52%	-4.81%	0.66%	0.31%	-0.14%
2017.01.01-2017.06.30	-4.82%	0.55%	-7.96%	0.61%	3.14%	-0.06%
2016.08.11-2017.06.30	-9.10%	0.54%	-12.31%	0.63%	3.21%	-0.09%

注:比较基准=65%×中证医疗指数收益率+35%×中债综合全价(总值)指数收益率,数据截止到2017年6月30日
(2)自基金合同生效以来基金累计净值增长率及其与同期业绩基准收益率的比较图
(2016年8月11日至2017年6月30日)



注:1.本基金业绩比较基准=65%×中证医疗指数收益率+35%×中债综合全价(总值)指数收益率。
2.本基金于2016年8月11日成立,截至本报告期末已完成建仓,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

十三、基金转换

基金管理人可以根据相关法律法规以及本基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的、且由同一注册登记机构办理注册登记的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费、相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及本基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。
1基金转换业务的适用范围
本基金已与本基金管理人旗下基金:东吴嘉禾优势精选混合型开放式证券投资基金(基金代码:580001)、东吴价值成长双动力混合型证券投资基金(基金代码:580002)、东吴行业轮动混合型证券投资基金(基金代码:580003)、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金(基金代码:580005)、东吴新经济混合型证券投资基金(基金代码:580006)、东吴安享量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:580007)、东吴新产业精选混合型证券投资基金(基金代码:580008)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金(基金代码:585001)、东吴优信稳健债券型证券投资基金A(基金代码:582001)、东吴优信稳健债券型证券投资基金C(基金代码:582201)、东吴增利债券型证券投资基金A(基金代码:582002)、东吴增利债券型证券投资基金C(基金代码:582202)、东吴货币市场证券投资基金A(基金代码:583001)、东吴货币市场证券投资基金B(基金代码:583101)、东吴配置优化混合型证券投资基金(基金代码:582003)、东吴内需增长混合型证券投资基金(基金代码:580009)、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:000531)、东吴移动互联灵活配置混合型证券投资基金A(基金代码:001323)、东吴新趋势价值线灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:001322)、东吴国企改革主题灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:002159)、东吴安盈量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:002270)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金A(基金代码:000958)、东吴鼎元双债债券型证券投资基金C(基金代码:000959)、东吴安鑫量化灵活配置混合型证券投资基金(基金代码:002561)、东吴增鑫宝货币市场基金A(基金代码:003588)、东吴增鑫宝货币市场基金B(基金代码:003589)的基金转换业务。
基金管理人今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于基金转换业务,并将另行公告。
2.开通转换的销售机构
投资者可通过基金管理人的直销渠道和以下代销机构办理以上基金的基金转换业务:
中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、苏州银行股份有限公司、天相投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、宜信普泽投资顾问(北京)有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、北京汇成基金销售有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、一路财富(北京)信息科技有限公司、北京钱景基金销售有限公司、中经北证(北京)资产管理有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、上海万得基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海汇付金融服务有限公司、北京微动利投资管理有限公司、上海基煜基金销售有限公司、大泰金石投资管理有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、奕丰金融服务(深圳)有限公司、中信期货有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、兴业证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、东吴证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、国联证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、华安证券有限责任公司、财富证券有限责任公司、东海证券股份有限公司、申万宏源(西部)证券有限公司、中泰证券股份有限公司、上海华信证券有限责任公司、华鑫证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、华宝证券有限责任公司。根据业务需要,本基金管理人还将会选择其他销售机构开办此业务并将按有关规定予以公告。

十四、费用概览

(一)基金运作相关费用
1、管理费:
本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.5÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。
2、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
基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内,按照指定的账户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。
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、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券、期货交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的相关账户开户费用及维护费用;
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。
(二)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。
(三)基金销售相关费用
1、申购费
本基金的申购费用由申购基金份额的投资者承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。具体申购费率如下:

申购金额M(含申购费)	申购费率
M<100 万	1.50%
100万≤M<200万	1.20%
200万≤M<500万	0.80%
500万≤M<1000万	0.30%
M≥1000万	1000元/笔

2、赎回费
本基金赎回费由赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取。对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期不少于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费,将不低于赎回费总额的75%计入基金财产;对持续持有期不少于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费,并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产;对持续持有期不少于6个月的投资人,应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。未计入基金财产的赎回费用于支付登记费和其他必要的手续费。
赎回费随基金持有时间的增加而递减,费率如下:

持有时间T	赎回费率
T<7日	1.50%
7日≤T<30日	0.75%
30日≤T<1年	0.50%
1年≤T<2年	0.25%
T≥2年	0%

注:1个月指30日,1年指365日
3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。
4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率,并进行公告。
(四)基金税收
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。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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,本基金管理人对本基金原招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:
1、在“重要提示”中,更新了相关内容。
2、在“三、基金管理人”中,更新了基金管理人及主要人员情况等内容。
3、在“四、基金托管人”中,更新了相关内容。
4、在“五、相关服务机构”中,更新了相关内容。
5、在“八、基金份额的申购与赎回”中,更新了相关内容。
6、在“九、基金的投资”中,更新了相关内容。
7、在“十、基金的业绩”中,更新了相关内容。
8、在“二十、基金托管协议的内容摘要”中,更新了相关内容。
9、在“二十二、其他应披露事项”中,更新了其他披露事项:
(1)2017年01月03日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金2016年年度资产净值公告》;
(2)2017年01月21日在中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金2016年第4季度报告》;
(3)2017年02月23日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》;
(4)2017年03月27日在中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要》;
(5)2017年03月29日在中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书以及摘要》;
(6)2017年04月12日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增奕丰金融服务(深圳)有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》;
(7)2017年04月12日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加奕丰金融服务(深圳)有限公司费率优惠的公告》;
(8)2017年04月14日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增宜信普泽投资顾问(北京)有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》;
(9)2017年04月14日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加宜信普泽投资顾问(北京)有限公司费率优惠的公告》;
(10)2017年04月24日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》;
(11)2017年04月24日在中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金2017年第1季度报告》;
(12)2017年06月07日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加中泰证券股份有限公司费率优惠的公告》;
(13)2017年06月07日在中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于开通旗下东吴智慧医疗量化策略灵活配置混合型证券投资基金在中国农业银行股份有限公司基金转换业务的公告》;
(14)2017年07月01日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司管理的基金2017年半年度资产净值公告》;
(15)2017年07月01日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购手续费费率优惠的公告》;
(16)2017年07月01日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金继续参加交通银行股份有限公司手机银行渠道基金申购及定期定额投资手续费率优惠的公告》;
(17)2017年07月14日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁(杭州)基金销售有限公司费率优惠活动的公告》;
(18)2017年07月19日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下基金新增西南证券股份有限公司为代销机构并推出定期定额业务及转换业务的公告》;
(19)2017年07月19日在中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、公司网站、深交所(巨潮资讯网)等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于参加西南证券股份有限公司费率优惠的公告》;
(20)2017年08月11日在中国证券报、证券时报、公司网站等媒体上公告了《东吴基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值方法变更的公告》;

十六、签署日期

本基金更新招募说明书于2017年9月22日签署。

东吴基金管理有限公司
二零一七年九月二十二日

证券代码:000707 证券简称:双环科技 公告编号:2017-076

湖北双环科技股份有限公司八届四十一次董事会决议公告

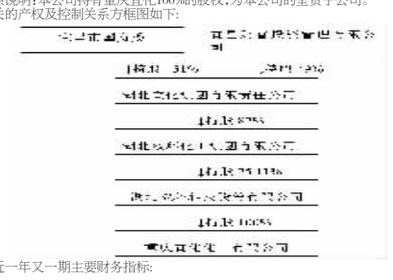
本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
一、董事会会议召开情况
1、湖北双环科技股份有限公司八届四十一次董事会通知于2017年9月15日以书面、传真、电子邮件等方式发出。
2、本次董事会会议于2017年9月21日举行,本次会议以通信表决方式举行。
3、本次董事会会议应出席的董事人数为9人,实际出席会议的董事人数9人。
4、本次董事会会议的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。
二、董事会会议审议情况
会议审议并表决了以下议案:
1、审议并表决《湖北双环科技股份有限公司关于为全资子公司重庆宜化化工有限公司银行借款提供担保的议案》
表决结果:同意9票,反对0票,弃权0票
详见本公司巨潮资讯网同日公告2017-077号,该事项还须提交本公司股东大会审议。
2、审议并表决《湖北双环科技股份有限公司关于全资子公司重庆宜化为其子公司重庆索特银行借款提供担保的议案》
表决结果:同意9票,反对0票,弃权0票
详见本公司巨潮资讯网同日公告2017-078号,该事项还须提交本公司股东大会审议。
3、审议并表决《湖北双环科技股份有限公司关于召开公司2017年第八次临时股东大会的议案》
表决结果:同意9票,反对0票,弃权0票
特此公告。

湖北双环科技股份有限公司董事会
二〇一七年九月二十二日

证券代码:000707 证券简称:双环科技 公告编号:2017-077

湖北双环科技股份有限公司关于为全资子公司重庆宜化化工有限公司银行借款提供担保的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
一、担保情况概述
1.本次担保基本情况
湖北双环科技股份有限公司(以下简称“公司”)本次为重庆宜化化工有限公司(以下简称“重庆宜化”)向兴业银行股份有限公司重庆分行1亿元综合授信提供全额担保,担保金额为1亿元。债权人为兴业银行股份有限公司重庆分行。
以上担保协议尚未签署。
重庆宜化是纳入本公司合并报表范围内的全资子公司,该笔担保不构成关联方担保。
2.公司八届四十一次董事会审议通过了本次担保议案。本担保议案还需经过公司股东大会审议批准,股东大会的详细情况见同日披露的《湖北双环科技股份有限公司关于召开公司2017年第八次临时股东大会的通知》,公告编号2017-079。
二、担保及被担保人基本情况
1. 担保人基本情况
本次担保人为湖北双环科技股份有限公司,其基本情况见公司定期报告及临时公告。
2. 被担保人基本情况及相关的产权及控制关系
被担保人:重庆宜化化工有限公司
成立日期:2006年9月22日
注册地点:万州区龙都大道519号
法定代表人:聂义民
注册资本:人民币50,000万元
主营业务:生产、销售联碱、销售化肥。
与本公司关系说明:本公司持有重庆宜化100%的股权,为本公司的全资子公司。
担保人相关的产权及控制关系方框图如下:



重庆宜化最近一年又一期主要财务指标:

单位:元

项目	2016年12月31日	2017年6月30日	
资产总额	2,208,266,455.26	2,193,040,386.89	
负债总额	1,669,316,245.34	1,631,207,641.67	
净资产	538,950,209.92	561,832,745.22	
营业总收入	1,583,838,818.11	858,350,863.19	
利润总额	-194,754,746.60	22,882,535.30	
净利润	-189,676,063.05	22,882,535.30	

截至目前为止,重庆宜化没有可能导致公司存在或有负债的情形。
三、担保协议的主要内容
(1)债权人:兴业银行股份有限公司重庆分行
(2)担保金额:人民币1亿元
(3)贷款用途:日常经营周转
(4)担保期限:本次借款期限为1年。本担保相应自借款合同生效之日起1年。
(5)担保方式:连带责任保证。
(6)本担保协议无其他重要内容。
四、董事会意见
1. 提供担保的原因
1.1本次担保符合国家相关法律法规的规定。
1.2重庆宜化维持正常的生产经营需要流动资金,本公司为子公司提供担保,获得资金,有利于子公司生产经营的正常开展。
2. 提供担保的必要性分析
重庆宜化生产经营需要资金,目前能够为其提供担保的对象相对有限。为子公司提供担保,才能获得资金,保证子公司生产经营的正常开展。出于以上原因,本公司为子公司提供担保是十分必要的。
3. 董事会对该担保事项的风险及被担保人偿还债务能力的判断
重庆宜化为本公司的全资子公司,生产经营情况正常,本公司对其具有较强的控制能力,担保风险较小。
五、累计对外担保数量及逾期担保的数量
截至本公告日,上市公司及其子公司的担保总额为284,594.46万元,占公司最近一期经审计净资产的比例为319.86%。本次担保全部实施后,上市公司及其子公司发生的担保总额将为294,594.46万元,占公司最近一期经审计净资产的比例为331.10%,敬请广大投资者注意风险。
本公司无逾期担保。
六、其他
本公司将及时披露担保的审议、协议签署和其他进展或变化情况。

湖北双环科技股份有限公司董事会
二〇一七年九月二十二日

证券代码:000707 证券简称:双环科技 公告编号:2017