

| 基金名称                 | 注册地址  | 法定代表人 | 联系人 | 电话                          | 网址                  |
|----------------------|---|-------|-----|-----------------------------|---------------------|
| 104 上海凯石财富基金销售有限公司   | 注册地址:上海市浦东新区(中国)银盛街91号602-113室<br>办公地址:上海市浦东新区银盛街91号石大里4楼<br>法定代表人:陈捷<br>联系人:曹瑞<br>电话:(021)433388-230<br>客服电话:4006-433-889<br>网址:www.wsmvsh.com   | 曹瑞    | 曹瑞  | (021)433388-230             | www.wsmvsh.com      |
| 105 大合基金(上海)基金销售有限公司 | 注册地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代之窗大厦2105室<br>办公地址:南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代之窗大厦2105室<br>法定代表人:王莉<br>联系人:李强<br>电话:(86)21-52919619<br>客服电话:400-920-2266/021-22267959<br>网址:www.dhfund.com   | 王莉    | 李强  | (86)21-52919619             | www.dhfund.com      |
| 106 济安财富(北京)资本管理有限公司 | 注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼4002460室<br>办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼4002460室<br>法定代表人:李海潮<br>联系人:李海潮<br>电话:(010)65309166<br>客服电话:400-638-7010<br>网址:bjp.jianfortune.com   | 李海潮   | 李海潮 | (010)65309166               | bjp.jianfortune.com |
| 107 中国证监会(北京)投资有限公司  | 注册地址:北京市丰台区东管庄15号4号楼2-45室<br>办公地址:北京市西城区宣武门大街101号新华证券大厦三层工作区<br>联系人:李强<br>电话:(010)59353519<br>客服电话:4008-890-998<br>网址:www.cdicfund.com  | 李强    | 李强  | (010)59353519               | www.cdicfund.com    |
| 108 鼎信汇金(北京)投资管理有限公司 | 注册地址:北京市西城区金融大街9号8层1011室<br>办公地址:北京市西城区金融大街9号8层1011室<br>法定代表人:王志刚<br>联系人:王志刚<br>电话:(010)82038210<br>客服电话:400-818-1686<br>网址:www.wdfund.com  | 王志刚   | 王志刚 | (010)82038210               | www.wdfund.com      |
| 109 徽商期货有限责任公司       | 注册地址:安徽省合肥市芜湖路258号<br>办公地址:安徽省合肥市芜湖路258号<br>法定代表人:李永强<br>联系人:李永强<br>电话:(0551)4286280<br>客服电话:4009999999<br>客服电话:4008-878-2787<br>网址:www.hqhq.net  | 李永强   | 李永强 | (0551)4286280               | www.hqhq.net        |
| 110 北京汇成基金销售有限公司     | 注册地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼1511室<br>办公地址:北京市朝阳区东三环北路38号院1号楼1511室<br>法定代表人:王刚<br>联系人:王刚<br>电话:(010)56828277<br>客服电话:4006190699<br>网址:www.hicfund.com   | 王刚    | 王刚  | (010)56828277               | www.hicfund.com     |
| 111 南京苏宁基金销售有限公司     | 注册地址:南京市玄武区玄武大道1-9号<br>办公地址:南京市玄武区玄武大道1-9号<br>法定代表人:钱昊旻<br>联系人:钱昊旻<br>电话:(025)66996999-887226<br>客服电话:955177<br>网址:www.sujin.com  | 钱昊旻   | 钱昊旻 | (025)66996999-887226        | www.sujin.com       |
| 112 北京广达投资管理有限公司     | 注册地址:北京市西城区新街口外大街2号6层606室<br>办公地址:北京市西城区新街口外大街2号6层606室<br>法定代表人:李勇<br>联系人:李勇<br>电话:(010)60926600<br>客服电话:4006260600<br>网址:www.guangda.com   | 李勇    | 李勇  | (010)60926600               | www.guangda.com     |
| 113 上海万得基金销售有限公司     | 注册地址:上海市浦东新区浦东南路1115号1001室<br>办公地址:上海市浦东新区浦东南路1115号1001室<br>法定代表人:王廷富<br>联系人:王廷富<br>电话:(021)51321788<br>客服电话:4000116661<br>客服电话:400-821-0203  | 王廷富   | 王廷富 | (021)51321788               | www.wand.com        |
| 114 北京蛋蛋基金销售有限公司     | 注册地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元212207号<br>办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元212207号<br>法定代表人:王丹<br>联系人:王丹<br>电话:(010)61848808<br>客服电话:4000661818<br>网址:bjdd.com  | 王丹    | 王丹  | (010)61848808               | bjdd.com            |
| 115 上海云财富投资管理有限公司    | 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楼<br>办公地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2楼<br>法定代表人:俞超<br>联系人:俞超<br>电话:(021)20688999<br>客服电话:400-820-1515<br>网址:www.yunfutu.com   | 俞超    | 俞超  | (021)20688999               | www.yunfutu.com     |
| 116 上海中正达广投资管理有限公司   | 注册地址:上海市浦东新区川沙新镇21151302室<br>办公地址:上海市浦东新区川沙新镇21151302室<br>法定代表人:王洪军<br>联系人:王洪军<br>电话:(021)53768132<br>客服电话:400-6707-4023<br>网址:www.zhongzheng.com   | 王洪军   | 王洪军 | (021)53768132               | www.zhongzheng.com  |
| 117 东方财富证券股份有限公司     | 注册地址:拉萨市柳梧新区国际城D2-25、27、29号<br>办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东方财富大厦8楼<br>法定代表人:陈万里<br>联系人:李海荣<br>电话:(021)68787102<br>客服电话:95351400888888<br>网址:www.eastmoney.com  | 陈万里   | 李海荣 | (021)68787102               | www.eastmoney.com   |
| 118 上海基煜基金销售有限公司     | 注册地址:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室(上海金融创新孵化中心)<br>办公地址:上海市崇明县长兴镇路158号A1561802-1003室<br>法定代表人:王翔<br>联系人:王翔<br>电话:(021)58858999<br>客服电话:400-820-3340<br>网址:www.jiayufund.com  | 王翔    | 王翔  | (021)58858999               | www.jiayufund.com   |
| 119 深圳市新资本基金销售有限公司   | 注册地址:深圳市福田区香梅路1066号404室<br>办公地址:深圳市福田区香梅路1066号404室<br>法定代表人:李强<br>联系人:李强<br>电话:(0755)29309602<br>客服电话:0755-29292630<br>客服电话:400-600-8888<br>网址:www.xinzhiben.com  | 李强    | 李强  | (0755)29309602              | www.xinzhiben.com   |
| 120 北京肯瑞财富投资管理有限公司   | 注册地址:北京市朝阳区东三环北路22号2603-06<br>办公地址:北京市朝阳区东三环北路22号2603-06<br>法定代表人:江存<br>联系人:江存<br>电话:(010)89188566<br>客服电话:010-89188566<br>网址:qr.com  | 江存    | 江存  | (010)89188566               | qr.com              |
| 121 上海爱建基金销售有限公司     | 注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼260室<br>办公地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼260室<br>法定代表人:毛野<br>联系人:毛野<br>电话:(010)88666232/010-88666532<br>客服电话:400-818-7666<br>网址:www.aianfunds.com  | 毛野    | 毛野  | (010)88666232/010-88666532  | www.aianfunds.com   |
| 122 大财富基金销售有限公司      | 注册地址:贵州省贵阳市南明区新华路106-114号富中国际广场B座12号<br>办公地址:贵州省贵阳市南明区新华路106-114号富中国际广场B座12号<br>法定代表人:王鹏<br>联系人:王鹏<br>电话:(0851)8860565/0851-88605652<br>客服电话:(0851)88633678<br>网址:www.dcfund.com  | 王鹏    | 王鹏  | (0851)8860565/0851-88605652 | www.dcfund.com      |
| 123 本基金管理人聘请的会计师事务所  | 会计师事务所名称:普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)<br>办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展银大厦4楼<br>联系人:李强<br>电话:(021)23238888<br>联系人:陈捷<br>电话:(0755)36866620<br>传真:(0755)36866661<br>经办会计师:戴瑞冬、付强<br>名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)<br>办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展银大厦4楼<br>执行事务合伙人:李丹<br>联系电话:(021)23238888<br>联系人:陈捷<br>经办注册会计师:薛莹、陈霖 | 李强    | 陈捷  | (021)23238888               |                     |

### 招商基金管理有限公司

#### 关于招商招熹纯债债券型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告

根据《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》、《招商招熹纯债债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)或“基金合同”的有关规定,招商招熹纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)可能触发基金合同终止情形。现将相关事宜公告如下:

一、本基金基本情况  
基金名称:招商招熹纯债债券型证券投资基金  
基金简称:招商招熹纯债  
基金代码:003616  
基金运作方式:契约开放式  
基金合同生效日:2017年6月16日  
基金管理人名称:招商基金管理有限公司  
基金托管人名称:中国建设银行股份有限公司  
二、可能触发基金合同终止的情形说明  
根据《基金合同》“第五部分基金备案”中“三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模”的约定:  
“基金合同生效后,连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元情形的,基金管理人应当在定期报告中予以披露;连续六十个工作日出现前述情形的,基金管理人应当终止基金合同,并对本基金进行变现及清算程序,无需召开基金份额持有人大会。  
法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。”  
截至2017年10月12日,本基金已连续56个工作日基金资产净值低于5000万元。根据基金合同约定,若连续60个工作日出现基金资产净值低于5000万元的情形,本基金管理人将终止基金合同,并对本基金进行变现及清算程序,且无需召开基金份额持有人大会。  
三、其他事项  
1、若出现触发基金合同终止的情形,基金管理人将根据相关法律法规、《基金合同》等规定成立基金财产清算小组,履行基金财产清算程序。本基金进入清算程序后将不再开放办理申购、赎回等业务。敬请投资者予以关注。  
2、本公告的解释权归招商基金管理有限公司所有。投资者可登陆招商基金管理有限公司网站(www.cmfnchina.com)或拨打招商基金管理有限公司客户服务热线

证券代码:603330 证券简称:上海天洋 公告编号:2017-066

### 上海天洋热熔粘接材料股份有限公司

#### 关于全资子公司南通天洋新材料有限公司获得政府补贴的公告

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、获得政府补贴的基本情况  
上海天洋热熔粘接材料股份有限公司(以下简称“公司”)全资子公司南通天洋新材料有限公司(以下简称“南通天洋”)于2017年10月11日收到江苏如东洋口港经济开发区管理委员会(以下简称“洋口港管委会”)下发的《关于奖励给予南通天洋新材料有限公司部分产业扶持引导基金的资金》。由于南通天洋年产6000吨热熔粘接材料项目进展顺利,因此洋口港管委会同意从产业扶持引导基金中拿出1119.84万元对南通天洋予以扶持。目前该笔扶持款项尚未到账。

二、获得政府补贴对上市公司的影响

联系人:古和鹏

3.3 出具法律意见书的律师事务所  
名称:北京市盈科(深圳)律师事务所  
注册地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心B座3层  
负责人:姜敏  
电话:(0755)3686620  
传真:(0755)3686661  
经办律师:戴瑞冬、付强

3.4 审计招商基金的会计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号展银大厦4楼  
执行事务合伙人:李丹  
联系电话:(021)23238888  
联系人:陈捷  
经办注册会计师:薛莹、陈霖

5.4 基金名称  
南方中证中证证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类

5.5 基金的类型  
股票型证券投资基金 联接基金

6 基金的投资目标  
本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相近的回报。

本基金主要投资于目标ETF基金份额,标的指数成份股、备选成份股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中概股、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、中期票据、短期融资券、次级债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、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、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,每个交易日在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

8.1 投资策略  
本基金以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(一)资产配置策略  
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

(二)目标ETF投资策略  
本基金投资目标ETF的方式如下:  
1.(1)申购赎回:目标ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回或者按照目标ETF法律文件的约定以其他方式申购目标ETF。  
(2)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

(3)特殊申购:在目标ETF开放日常申购赎回前,本基金可以用现金特殊申购目标ETF基金份额,申购价格以特殊申购日目标ETF的基金份额净值为基准计算,不收取申购费用。

当目标ETF申购、赎回或交易方式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

(三)成份股、备选成份股投资策略  
本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取跟踪法,即根据标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在特殊情况下(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将根据合理方法进行调整,以确保投资组合的跟踪误差最小化。

(四)债券投资策略  
在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作上,采用骑乘策略、放大操作、换券操作等灵活的多样的操作方式,获取超额的投资收益。

(五)权证投资策略  
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值投资策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。  
基金管理人将充分考量权证资产的投资收益、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(六)股指期货等投资策略  
本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的指数风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。

(七)资产支持证券投资策略  
资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面和数理模型相结合的方式,在对个券进行风险评估和信用评级后,进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。  
今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易品种的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

8.2 投资决策依据和决策程序  
(一)决策依据  
1、国家有关法律、法规、基金合同和标的指数的有关规定;  
2、宏观经济发展态势、宏观经济运行环境和证券市场走势;  
3、即期投资方式。本基金在投资决策委员会领导下,通过投资研究全体人员的共同努力与分工合作,由基金经理具体制定并执行投资计划,争取对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  
(二)决策程序  
1、成立投资决策委员会:投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资策略;投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资策略;投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资策略;

| 代码 | 行业类别            | 公允价值(元)       | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|-----------------|---------------|---------------|
| A  | 农林牧渔            | 6,992,522.35  | 8.41          |
| B  | 医药              | 6,992,522.35  | 8.41          |
| C  | 制造业             | 46,207,420.40 | 55.85         |
| D  | 交通运输            | -             | -             |
| E  | 建筑业             | -             | -             |
| F  | 批发和零售业          | 9,304.00      | 0.01          |
| 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             | 6,983,218.35  | 9.66          |
| 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      | 3,580.00      | 0.00          |
| N  | 管理业             | -             | -             |
| O  | 国防军工、医药和信息技术    | -             | -             |
| P  | 教育              | -             | -             |
| Q  | 互联网社区工作         | -             | -             |
| R  | 综合              | -             | -             |
| S  | 综合              | 6,992,522.35  | 9.68          |
| S  | 合计              | 6,992,522.35  | 9.68          |

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合  
注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

1.3 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  | 600030 | 中信证券 | 64,000 | 1,089,280.00 | 1.51 |
| 2  | 600837 | 海通证券 | 67,045 | 995,588.55   | 1.38 |
| 3  | 601211 | 招商证券 | 37,000 | 758,700.00   | 1.05 |
| 4  | 603688 | 华泰证券 | 27,885 | 495,541.50   | 0.69 |
| 5  | 600958 | 东方证券 | 25,500 | 354,750.00   | 0.49 |
| 6  | 600918 | 中信证券 | 33,500 | 332,650.00   | 0.46 |
| 7  | 600999 | 招商证券 | 17,900 | 328,280.00   | 0.45 |
| 8  | 603177 | 华安证券 | 39,600 | 294,280.00   | 0.41 |
| 9  | 601788 | 光大证券 | 18,200 | 226,900.00   | 0.31 |
| 10 | 601099 | 太平洋  | 53,100 | 221,502.00   | 0.31 |

1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合  
注:本基金本报告期末未持有债券。

证券代码:002855 证券简称:捷荣技术 公告编号:2017-052

### 东莞捷荣技术股份有限公司

#### 2017年第三次临时股东大会决议公告

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。  
重要提示:  
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  
(一)会议召开情况  
1、召开时间  
(1)现场会议召开时间:2017年10月12日(星期四)下午 15:00  
(2)网络投票时间:2017年10月11日至10月12日。  
通过深圳证券交易所系统进行网络投票的时间为 2017年10月12日上午9:30-11:30,下午13:00-15:00。  
通过深圳深圳证券交易所互联网投票系统投票的时间为2017年10月11日下午15:00至2017年10月12日下午15:00期间的任意时间。  
2、现场会议召开地点:深圳市南山区科技园科发路3号长城科技大厦2号楼13楼深圳分公司会议室  
3、召集人:公司董事会  
4、会议主持人:董事长赵晓晖  
5、召开方式:现场投票与网络投票相结合  
本次股东大会的召开符合《公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》和《公司章程》的规定。  
(二)会议出席情况  
1、通过现场和网络投票的股东6人,代表股份174,604,700股,占上市公司总股份的72.7500%;其中:  
(1)通过现场投票的股东4人,代表股份174,600,100股,占上市公司总股份的72.7500%;  
(2)通过网络投票的股东2人,代表股份4,600股,占上市公司总股份的0.0019%。  
(3)参加本次股东大会表决的中小投资者(除上市公司董事、高级管理人员以及单独或者合计持有公司5%以上股份的股东以外的其他股东)共1人,代表股份67,400股,占上市公司总股份的0.0029%。其中:通过现场投票的股东1人,代表股份100股,占上市公司总股份的0.0000%。  
2、公司部分董事、监事、高级管理人员列席了本次会议。  
3、上海市方正(深圳)律师事务所律师列席了本次会议,并对本次股东大会进行见证,并出具法律意见书。  
二、议案审议表决情况  
(一)审议通过了《关于调整与重庆市渝北区人民政府签订的<投资协议>部分内容的议案》  
总表决情况:  
同意174,604,300股,占出席会议所有股东所持股份的99.9998%;反对400股,占出席会议所有股东所持股份的0.0002%;弃权0股(其中,因未投票默认弃权0股),占出席会议所有股东所持股份的0.0000%。  
中小投资者表决情况:  
同意4,300股,占出席会议中小股东所持股份的0.49894%;反对400股,占出席会议中小股东所持股份的0.51006%;弃权0股(其中,因未投票默认弃权0股),占出席会议中小股东所持股份的0.00000%。  
(二)审议通过了《法律意见书》  
(三)律师事务所名称:上海市方正(深圳)律师事务所  
(四)律师姓名:刘翔、赵磊  
(三)结论性意见:本次股东大会的召集、召开程序符合有关法律、法规及《公司章程》的规定;出席本次股东大会人员的资格合法、有效;本次股东大会召集人的资格合法、有效;本次股东大会的表决程序和结果合法、有效。  
四、备查文件目录  
(一)东莞捷荣技术股份有限公司2017年第三次临时股东大会决议;  
(二)上海市方正(深圳)律师事务所律师出具的《东莞捷荣技术股份有限公司2017年第三次临时股东大会的法律意见书》。  
特此公告。  
东莞捷荣技术股份有限公司董事会  
2017年10月12日

证券代码:000820 股票简称:神雾节能 公告编号:2017-074

### 神雾节能股份有限公司

#### 关于控股股东部分股权质押的公告

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。  
神雾节能股份有限公司(以下简称“公司”)于2017年10月11日接到公司控股股东神雾集团股份有限公司(以下简称“神雾集团”)的通知,获悉神雾集团所持有的本公司部分有限限售条件股份质押,具体情况如下:  
一、股东质押的基本情况  
1. 股东股份本次被质押基本情况

| 股东名称     | 质押股份数量及一致行动人 | 质押股份(万股) | 质押开始日期      | 质押到期日          | 质权人        | 本次质押与其所持股份比例 | 用途     |
|----------|--------------|----------|-------------|----------------|------------|--------------|--------|
| 神雾集团股份有限 | 是            | 1272     | 2017年10月10日 | 神雾集团办理质押登记手续之日 | 华夏银行有限责任公司 | 3.64%        | 补充流动资金 |
| 神雾集团股份有限 | 是            | 467      | 2017年10月10日 | 神雾集团办理质押登记手续之日 | 长城国融证券有限公司 | 1.34%        | 补充流动资金 |

注:  
1、其他需要提示的事项  
为了保证基金的平稳运作,维护基金持有人利益,招商基金管理有限公司决定自2017年10月16日起暂停招商招熹纯债债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)的申购(含定期定额投资)和转换转入业务。  
在上述期间的交易,本基金作为转出方的转换业务,赎回业务仍照常办理。  
本基金如有疑问,请拨打客户服务热线:400-887-9555(免长话费),或登陆网站www.cmfnchina.com获取相关信息。  
特此公告。  
招商基金管理有限公司  
2017年10月12日

主要投资策略,确立基金的投资策略,审定基金资产的配置方案。  
2、即期投资与投资决策程序:在遵守投资决策委员会制定的投资原则前提下,通过投资研究全体人员的即期投资、分工合作,由基金经理具体执行投资计划。  
3、金融工程:组合运用风险测度模型以及各种风险监控指标,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算,并提供数量化风险分析报告;对市场预期风险的构成因素中基本面恶化的企业情况提供及时的风险分析报告;市场部每日提供基金申购赎回的数据分析报告,供基金经理决策参考。  
4、投资决策委员会依据金融工程小组提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策基金的投资。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理日常决策。  
5、基金经理以完全复制指数权重方法构建组合,并跟踪量化风险分析报告和申购赎回分析报告,在追求跟踪误差最小化的前提下,采取适当的方法以降低交易成本,控制投资风险。  
6、交易部根据基金经理的指令,制定交易策略,通过指数交易系统执行指数投资组合的买卖,同时跟踪执行投资指令是否将发生违法违规、违规行为,是否会发生特殊交易,是否将超过比例限制等,履行一线监控职责。  
7、金融工程小组根据市场变化定期或不定期对基金进行投资绩效评价,并提供相关绩效评估报告。基金经理根据评估报告分析基金的投资操作,组合状况和跟踪误差等情况,重点分析基金的偏差度和跟踪误差产生原因,现况控制情况,标的指数的跟踪误差前后的操作,以及成份股未来可能发生的变化等,监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和风险控制。  
8、基金经理跟踪标的指数变动,结合成份股基本面变化、流动性状况、基金申购赎回以及组合投资绩效评估报告,对投资组合进行监控和调整。  
本基金管理人确保基金份额持有人利益的前提下有权根据市场环境变化和实际需要调整上述投资策略,并予以公告。

6 基金的投资目标  
本基金通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求与业绩比较基准相近的回报。

7 基金的投资策略  
本基金主要投资于目标ETF基金份额,标的指数成份股、备选成份股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中概股、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、中期票据、短期融资券、次级债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、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、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,每个交易日在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

8.1 投资策略  
本基金以目标ETF作为其主要投资标的,方便特定的客户群通过本基金投资目标ETF。本基金并不参与目标ETF的管理。在正常市场情况下,本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过0.35%,年跟踪误差不得超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(一)资产配置策略  
为实现紧密跟踪标的指数的投资目标,本基金将以不低于基金资产净值90%的资产投资于目标ETF。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

(二)目标ETF投资策略  
本基金投资目标ETF的方式如下:  
1.(1)申购赎回:目标ETF开放申购赎回后,以股票组合进行申购赎回或者按照目标ETF法律文件的约定以其他方式申购目标ETF。  
(2)二级市场方式:目标ETF上市交易后,在二级市场进行目标ETF基金份额的交易。

(3)特殊申购:在目标ETF开放日常申购赎回前,本基金可以用现金特殊申购目标ETF基金份额,申购价格以特殊申购日目标ETF的基金份额净值为基准计算,不收取申购费用。

当目标ETF申购、赎回或交易方式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

(三)成份股、备选成份股投资策略  
本基金对成份股、备选成份股的投资目的是为准备构建股票组合以申购目标ETF,因此对可投资于成份股、备选成份股的资金头寸,主要采取跟踪法,即根据标的指数的成份股及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在特殊情况下(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将根据合理方法进行调整,以确保投资组合的跟踪误差最小化。

(四)债券投资策略  
在选择债券品种时,首先根据宏观经济分析、资金面动向分析和投资人行为分析判断未来利率期限结构变化,并充分考虑组合的流动性管理的实际情况,配置债券组合的久期;其次,结合信用分析、流动性分析、税收分析等确定债券组合的类属配置;再次,在上述基础上利用债券定价技术,进行个券选择,选择被低估的债券进行投资。在具体投资操作上,采用骑乘策略、放大操作、换券操作等灵活的多样的操作方式,获取超额的投资收益。

(五)权证投资策略  
本基金在进行权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆策略、价值投资策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等。  
基金管理人将充分考量权证资产的投资收益、流动性及风险性特征,通过资产配置、品种与类属选择,谨慎进行投资,追求较稳定的当期收益。

(六)股指期货等投资策略  
本基金在进行股指期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的指数风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪标的指数的目的。

(七)资产支持证券投资策略  
资产支持证券投资关键在于对基础资产质量及未来现金流的分析,本基金将在国内资产证券化产品具体政策框架下,采用基本面和数理模型相结合的方式,在对个券进行风险评估和信用评级后,进行投资。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。  
今后,随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易品种的创新等,基金还将积极寻求其他投资机会,如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,本基金将在履行适当程序后,将其纳入投资范围以丰富组合投资策略。

8.2 投资决策依据和决策程序  
(一)决策依据  
1、国家有关法律、法规、基金合同和标的指数的有关规定;  
2、宏观经济发展态势、宏观经济运行环境和证券市场走势;  
3、即期投资方式。本基金在投资决策委员会领导下,通过投资研究全体人员的共同努力与分工合作,由基金经理具体制定并执行投资计划,争取对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。  
(二)决策程序  
1、成立投资决策委员会:投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资策略;投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资策略;投资决策委员会是公司投资的最高决策机构,决定基金的主要投资策略;

| 序号 | 项目          | 金额(人民币元)      | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|-------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资        | 6,992,522.35  | 8.41          |
| 2  | 其中:股票       | 6,992,522.35  | 8.41          |
| 3  | 固定收益投资      | -             | -             |
| 4  | 其中:债券       | -             | -             |
| 5  | 资产支持证券      | -             | -             |
| 6  | 金融衍生品投资     | -             | -             |
| 7  | 合计          | 9,339,887.39  | 11.23         |
| 8  | 其中:买入返售金融资产 | -             | -             |
| 9  | 其他          | 20,650,807.47 | 24.92         |
| 10 | 合计          | 81,186,674.61 | 100.00        |

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合  
1.2.1 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)  | 占基金资产净值的比例(%) |
|----|------|----------|---------------|
| A  | 农林牧渔 | 6,992,52 |               |