（上接B30版）

77）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
78）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
79）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
80）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
81）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
82）大泰金石基金销售有限公司
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
83）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
84）北京格上富信基金销售有限公司
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
85）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
86）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
87）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
88）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
89）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
90）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：张烁
公司网址：www.jfzinv.com
客服电话：4009500888
91）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：臧晓强
公司网址：https://danjuanapp.com/
客服电话：4000618518
92）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
93）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
94）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
95）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
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
96）上海云湾投资管理有限公司
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
98）交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：牛锡明
联系人：曹榕
电话：（021）58781234
传真：（021）58408483
客服电话：95559
公司网址：www.bankcomm.com
99）上海华信证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
法人代表：郭林
联系人员：陈媛
联系电话：021-38784818
传真电话：021-68775878
客服电话：400-820-5999
公司网站：www.shhxzq.com
3、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：上海源泰律师事务所
住所：上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦1405室
负责人：廖海
电话：（021）51150298
传真：（021）51150398
经办律师：刘佳、范佳斐

（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
法定代表人：杨绍信
经办注册会计师：单峰、曹阳
电话：021-23238888
传真：021-23238800

四、基金的名称

华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

六、基金的投资目标

通过深入研究，本基金对股票、债券等金融资产进行灵活配置，在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，力争为投资者创造高于业绩比较基准的投资回报。

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（国债、金融债、企业/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）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、权证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）。本基金还可以在条件允许的情况下参与融资业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，如期权等，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：股票资产占基金资产的比例为0-95%；其中，基金持有全部权证的市值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，现金和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%。

八、基金的投资策略

本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面等情况，在经济周期不同阶段，依据市场不同表现，采用多种投资策略和交易手段进行大类资产配置和股票的行业配置，在消除单一策略可能失效风险的同时，保证整体投资业绩的持续性。

1、大类资产配置

本基金将通过研究宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素，对股票、债券和货币资产的风险收益特征进行深入分析，合理预测各类资产的价格变动趋势，确定不同资产类别的投资比例。在此基础上，积极跟踪由于市场短期波动引起的各类资产的价格偏差和风险收益特征的相对变化，动态调整各大类资产之间的投资比例，在保持总体风险水平相对平稳的基础上，获取相对较高的基金投资收益。

2、股票投资策略

本基金的股票资产投资采取行业轮动策略。所谓行业轮动策略是指，在宏观分析和个股选择的基础上强调行业的动态优化配置。通过超配不同时期的相对强势行业，获得超越市场平均水平的收益。

（1）行业配置策略

本基金采用自上而下与自下而上相结合的行业配置方法构建投资组合，综合考虑以下因素，进行股票资产在各行业间的配置。

1）国家经济政策

本基金将积极关注政府未来的产业发展规划方向，以及配套的国家财政与税收政策、货币政策、产业政策、贸易政策、汇率政策等政策的变化，分析国家政策对主题行业的影响，重点投资于受益于国家政策变化、预期收益率较高的行业。

2）经济周期

经济周期对各个行业的影响不尽相同，本基金主要从两个角度把握经济周期带来的投资机会：一是充分分析过往历史数据，找出经济周期对行业景气度影响的共性规律；二是将对当前所处经济周期阶段进行前瞻性分析，根据各行业在经济周期各阶段的预期表现，进行行业配置与调整，为投资者追求超额收益。

3）各行业的发展前景

本基金将重点关注各行业的发展进程，捕捉行业科技技术、制造工艺、商业模式、人才结构等因素的最新变化，从而预测各行业的发展前景，发掘具有广阔发展潜力的行业，并相应对基金资产的行业配置进行调整。

4）各行业基本面的变化

本基金将对影响各行业基本面的因素进行跟踪分析，预期各行业基本面变化的拐点，超配基本面即将发生有利变化的行业，低配基本面即将发生不利变化的行业。

5）各行业的相对估值水平

本基金将对各行业的相对估值水平进行动态分析，增加被市场低估的行业配置比例，降低监制低于预期的行业配置比例。

6）市场需求趋势

各行业市场需求的变化趋势不同，有的表现为刚性需求，有的呈现较大弹性，导致不同行业成长性出现差异。本基金将重点投资市场需求稳定或保持较高增长的行业。

7）行业竞争格局

各行业内部的竞争格局不同，行业利润率存在较大差异。本基金将重点投资行业进入壁垒较高、利润率稳定或保持增长的行业。

（2）个股选择策略

本基金股票资产以基金面良好的上市公司为投资对象，基于行业配置的要求，对股票进行分类和筛选，选择各行业龙头企业和价值被低估的企业作为重点关注对象。

1）行业龙头企业。一般指在该行业里股本、市值、规模、市场占有率居前的代表性企业。这些企业由于规模巨大，市场占有率高，所以其自身发展对全行业有重大影响，往往引领全行业的发展方向和兴衰。

2）成长性企业。一般指那些在较长时期内，具有持续挖掘未利用资源的能力、不同程度地表现出整体扩张的态势、未来发展预期良好的企业。

3）价值低估企业。通过深入分析研究市场和股票价格变动的诸多因素，综合判断企业的内在价值。如果企业股票价格没能反映其真实价值或潜在价值，则视之为价值低估企业。

3、固定收益资产投资策略

本基金固定收益资产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。

固定收益资产包括债券（国债、金融债、企业/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），资产支持证券、债券回购、银行存款等。

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固定收益资产的影响，进行合理的利率预期，判断市场的基本走势，制定久期控制下的资产类属配置策略。在固定收益资产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。

4、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，其投资原则为有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金在权证投资中将对权证标的证券的基本面进行研究，同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价。

5、资产支持证券投资策略

在对市场利率环境深入研究的基础上，本基金投资于资产支持证券将采用久期配置策略与期限结构配置策略，结合定量分析和定性分析的方法，综合分析资产支持证券的利率风险、提前偿付风险、流动性风险、税收溢价等因素，选择具有较高投资价值的资产支持证券进行配置。

6、其他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股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。

7、融资融券业务的投资策略

本基金参与融资业务，将综合考虑融资成本、保证金比例、冲抵保证金证券折算率、信用资质等条件，选择合适的交易对手方。同时，在保障基金投资组合充足流动性以及有效控制融资杠杆风险的前提下，确定融资比例。待监管机构允许本基金参与融券交易业务后，在法律法规允许的范围内，在不改变基金的风险收益特征及对基金份额持有人无不利影响的前提下，本基金可参与相关业务，以提高组合的投资效率，从而更好地实现投资目标。具体参与投资的比例将按照届时相关法律法规的规定执行。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

沪深300指数是由中证指数有限公司编制的反映A股市场整体走势的指数，该指数从上海和深圳证券交易所中选取300只交易活跃、代表性强的A股作为成份股，是目前中国证券市场中市值覆盖率高、代表性强且公信力较好的股票指数。上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成，反映了债券市场整体变动状况。因此，本基金适宜采用沪深300指数和上证国债指数为本基金的业绩比较基准。

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代表本基金风险收益特征的指数，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，与基金托管人协商一致后，对业绩比较基准进行相应调整，并报中国证监会备案并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

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。

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	124,958,258.20	92.07
	其中：股票	124,958,258.20	92.07
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	9,715,451.06	7.16
8	其他资产	1,040,353.11	0.77
9	合计	135,714,062.37	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	2,578,400.00	1.96
B	采矿业	8,432,334.96	6.40
C	制造业	41,688,605.85	31.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,604,488.24	8.05
F	批发和零售业	2,461,006.20	1.87
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	5,810,912.16	4.41
J	金融业	50,796,850.79	38.55
K	房地产业	2,585,660.00	1.96
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
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	124,958,258.20	94.84

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	118,402	5,873,923.22	4.46
2	601169	北京银行	639,950	5,868,341.50	4.45
3	601668	中国建筑	604,500	5,851,560.00	4.44
4	600188	兖州煤业	477,904	5,849,544.96	4.44
5	600016	民生银行	711,000	5,844,420.00	4.44
6	000625	长安汽车	405,200	5,842,984.00	4.43
7	601009	南京银行	519,223	5,820,489.83	4.42
8	300182	捷成股份	607,836	5,810,912.16	4.41
9	000059	华锦股份	578,908	5,794,869.08	4.40
10	600066	宇通客车	263,422	5,787,381.34	4.39

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。

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

注：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

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序的前五名贵金属投资明细

注：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

注：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

1）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。

2）本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1）本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

2）报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

3）本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

11、投资组合报告附注

1）报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的情形，也没有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情形。

3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	163,308.04
2	应收证券清算款	721,381.85
3	应收股利	-
4	应收利息	2,373.85
5	应收申购款	153,289.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,040,353.11

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的业绩

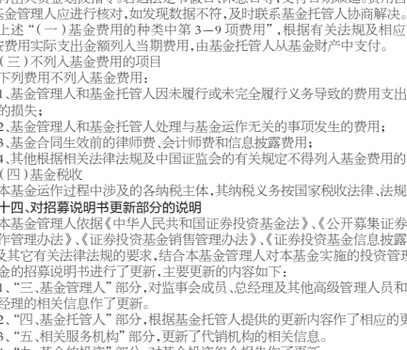
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2016.09.29-2016.12.31	0.20%	0.53%	1.54%	0.43%	-1.34%	0.10%
2017.01.01-2017.06.30	12.89%	0.55%	6.55%	0.34%	6.34%	0.21%
过去三个月	6.83%	0.63%	3.70%	0.37%	3.13%	0.26%

2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、图示日期为2016年9月29日至2017年6月30日。2、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，截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同投资范围中规定的比例，即股票资产占基金资产的比例为0-95%；其中，基金持有全部权证的市值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，现金和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%。

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、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
4、基金份额持有人大会费用；
5、基金的投资标的交易费用；
6、基金的银行汇划费用；
7、基金的开户费用、账户维护费用；
8、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
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）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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×1.50%÷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，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、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

基金托管费每日计提，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。

上述“（一）基金费用的种类中第3—9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、基金合同生效前的律师费、会计师费和信息披露费用；
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、“九、基金的投资”部分，对基金投资组合报告作了更新。
5、“十、基金的业绩”部分，对基金投资业绩作了更新。
6、“二十二、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
二〇一七年十一月十一日

证券代码：002661　证券简称：克明面业　公告编号：2017-131

克明面业股份有限公司关于使用闲置募集资金购买理财产品的进展公告

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

克明面业股份有限公司（以下简称“公司”）第四届董事会第八次会议审议通过了《关于使用闲置募集资金进行现金管理的议案》，同意公司及其全资（或控股）子公司在不影响募集资金投资项目建设和募集资金正常使用的情况下，使用不超过人民币9亿元(含9亿元)的闲置募集资金进行现金管理，在上述额度内，资金可以在决议有效期内进行滚动使用。此议案于2017年3月15日公司2017年第二次临时股东大会审议通过（详见2017年3月16日刊登在《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》、《上海证券报》和巨潮资讯网的2017-026《2017年第二次临时股东大会决议的公告》）。

近日，公司使用闲置募集资金10,000,000元购买中国邮政储蓄银行（以下简称“邮政银行”）“邮银财智?盛盈2017年第245期(全国)人民币理财产品”，相关情况公告如下：

一、理财产品主要内容

1、产品名称：邮银财智·盛盈2017年第245期(全国)人民币理财产品
2、产品类型：保本浮动收益型
3、产品期限：180天
4、预期年化收益率：4.20%
5、产品收益计算日：2017年11月10日
6、产品到期日：2018年05月09日
7、认购资金总额：人民币10,000,000元
8、资金来源：公司闲置募集资金
9、公司与邮政银行无关联关系

二、投资风险及公司风险控制措施

1、主要投资风险

（1）政策风险：货币政策、财政政策、产业政策和监管政策等国家政策的变化对金融市场产生一定的影响，可能导致金融市场投资品种的价值和风险发生较大变化。

（2）市场风险：由于金融市场内在波动性，客户投资本产品将面临一定的市场风险。

（3）流动性风险：本产品有约定的存续期限，可能导致投资者在需要资金时无法随时变现；且本产品可能面临资产不能迅速变现，或者选择变现会对资产价格造成重大不利影响的风险。

（4）信用风险：理财计划所投资的债券、信托计划或其他投资品种等，可能因基础资产发行人不能如期兑付本息，或交易对手发生违约，投资收益可能遭受损失。

（5）管理风险：信托公司、证券公司、托管银行等相关机构受技能及管理水平等因素的限制，可能会影响本理财计划的投资收益，导致本计划项下的理财收益遭受损失。

（6）不可抗力及意外风险：指由于自然灾害、战争、证券交易所系统性故障等不可抗力因素的出现，将严重影响金融市场的正常运行，从而导致本投资计划资产收益降低或损失，甚至影响本投资计划的受理、投资、偿还等的正常进行，进而影响投资计划的资产收益安全。

2、投资风险控制措施

（1）公司将及时分析和跟踪理财产品投向、项目进展情况，一旦发现或判断有不利因素，将及时采取相应的保全措施，控制投资风险。

（2）公司审计部负责对低风险投资理财资金使用与保管情况的审计与监督，每个季度末应对所有理财产品投资项目进行全面检查，并根据谨慎性原则，合理的预计各项投资可能发生的收益和损失，并向审计委员会报告。

（3）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

公司坚持“规范运作、防范风险、谨慎投资、保值增值”的原则，在确保资金安全的前提下，以闲置募集资金购买保本型银行理财产品，不会影响公司募集资金投资项目建设和主营业务的正常开展。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、本公告日前十二个月公司累计使用闲置募集资金购买理财产品的情况

截至公告日，公司在过去十二个月内使用闲置募集资金购买银行理财产品累计投资金额为25.86亿元（含本次公告理财产品1,000万元）。尚未到期金额73,700万元（含本次公告理财产品1,000万元），占公司最近一年（2016年）经审计总资产的29.80%。具体如下：

(1)已经到期的理财产品情况

序号	产品名称	产品成立日	产品期限	预期年化收益率	投资金额（元）
1	结构性存款产品(编号 J00161113)	2016年11月14日	91天	2.80%	100,000,000
2	安泰回报系列164期收益凭证	2016年11月24日	90天	1%-6.5%	35,000,000
3	工银理财共赢3号保本型2016年第4期A款	2016年12月29日	81天	3.30%	55,000,000
4	中国建设银行“乾元”保本型人民币理财产品2017年第1期	2017年01月10日	73天	3.40%	20,000,000
5	结构性存款90天	2016年12月28日	90天	3.60%	50,000,000
6	“乾元-众享”保本型人民币理财产品2016年第9期	2016年12月30日	104天	3.80%	26,000,000
7	中国民生银行人民币结构性存款D-1款	2017年01月17日	90天	3.50%	40,000,000
8	“乾元”保本型理财产品2017年第5期(养颐养老金机构专享)	2017年2月15日	62天	3.72%	10,000,000
9	中国建设银行“乾元”保本型人民币理财产品2017年第12期	2017年01月25日	92天	3.60%	30,000,000
10	结构性存款120天	2017年01月06日	120天	3.65%	30,000,000
11	“乾元-众享”保本型人民币理财产品2017年第3期	2017年01月23日	108天	3.40%	20,000,000
12	“乾元-众享”保本型人民币理财产品2017年第3期	2017年01月23日	108天	3.40%	30,000,000
13	广发银行“薪加薪16号”人民币理财计划	2017年02月13日	94天	2.6%或3.9%	50,000,000
14	北京银行“稳健系列人民币92天期限银行间保证收益理财产品”	2017年02月14日	92天	3.0%	75,000,000
15	稳健系列人民币40天期限银行间保证收益理财产品	2017年4月13日	40天	2.5%	13,000,000
16	委托资产管理AS00120160150Q01	2016年12月20日	182天	3.50%	50,000,000
17	中国民生银行人民币结构性存款D-1款	2017年3月23日	92天	4.1%	55,000,000
18	2017年对公结构性存款统发第四十六期产品5	2017年3月28日	90天	4.15%	50,000,000
19	中国建设银行湖南省分行“乾元”保本型理财产品2017年第32期(养颐四方)	2017年4月28日	62天	3.50%	37,000,000
20	中国建设银行湖南省分行“乾元”保本型理财产品2017年第32期(养颐四方)	2017年4月28日	62天	3.50%	100,000,000
21	稳健收益系列理财宝1号理财计划	2016年12月23日	192天	3.50%	30,000,000
22	溢通财富·日增利91天	2017年4月6日	91天	3.6%	20,000,000
23	中国民生银行人民币结构性存款D-1款	2017年4月21日	91天	3.9%	50,000,000
24	溢通财富·日增利85天	2017年5月2日	85天	3.50%	100,000,000
25	中国建设银行湖南省分行“乾元”保本型理财产品2017年第33期(养颐四方)	2017年5月9日	93天	3.7%	30,000,000
26	广发银行“薪加薪16号”人民币理财计划	2017年5月18日	90天	2.6%或4.2%	50,000,000
27	中国建设银行湖南省分行“乾元”保本型理财产品2017年第50期(养颐四方)	2017年5月23日	90天	3.75%	25,000,000
28	中国建设银行湖南省分行“乾元”保本型理财产品2017年第50期(养颐四方)	2017年5月23日	90天	3.75%	30,000,000
29	稳健系列人民币101天期限银行间保证收益理财产品	2017年5月26日	101天	3.2%	70,000,000
30	工银理财共赢3号保本型2017年第16期B款(拓户产品)	2017年5月11日	122天	3.40%	80,000,000
31	与利率挂钩的结构性产品	2017年8月2日	40天	3.90%	50,000,000
32	中国民生银行人民币结构性存款D-1款	2017年3月17日	182天	3.95%	35,000,000
33	与利率挂钩的结构性产品(CNYS17)	2017年6月23日	91天	4.3%	50,000,000
34	结构性存款90天	2017年6月29日	90天	4.15%	50,000,000
35	结构性存款90天	2017年6月30日	90天	4.15%	30,000,000
36	结构性存款	2017年6月30日	92天	4.20%	30,000,000
37	结构性存款	2017年7月3日	98天	3.43%-3.47%	18,000,000
38	溢通财富·日增利70天	2017年7月31日	70天	3.70%	100,000,000
39	与利率挂钩的结构性产品	2017年7月21日	91天	4.10%	20,000,000
40	保本型法人63天稳利人民币理财产品	2017年9月8日	63天	3.25%	35,000,000
41	稳健系列人民币60天期限银行间保证收益理财产品	2017年9月11日	60天	3.00%	70,000,000
投资金额合计					1,849,000,000

(2)尚未到期的理财产品情况

序号	产品名称	产品成立日	产品期限	预期年化收益率	投资金额（元）
1	2017年融智理财·稳益计划17152号人民币理财产品	2017年6月30日	194天	3.80%	50,000,000
2	溢通财富·日增利提升182天	2017年7月10日	182天	3.70%	20,000,000
3	溢通财富·日增利提升182天	2017年7月10日	182天