

(上接B33版)
(四) 报告期未投资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	130,484,000.00	12.70
4	其中:政策性金融债	130,484,000.00	12.70
5	企业债券	634,885,581.40	61.81
6	中期票据	20,090,000.00	1.96
7	可转债(可交换债)	2,839,238.16	0.28
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	788,238,909.56	76.74

(五) 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

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	170215	17国债15	800,000	80,344,000.00	7.82
2	160802	16广信债	600,000	58,972,000.00	5.73
2	150207	15国债07	500,000	50,110,000.00	4.88
4	160403	16招商开债03	500,000	49,625,000.00	4.83
5	160406	16招商开债06	500,000	49,020,000.00	4.57

(六) 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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

(七) 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

本基金报告期末未持有贵金属。

(八) 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

本基金报告期末未持有权证。

(九) 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
本基金报告期末未投资股指期货。

2.本基金投资股指期货的投资政策
本基金报告期末未投资股指期货。

(十) 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
本基金报告期末未投资国债期货。

2.报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金报告期末未投资国债期货。

3.本期国债期货投资评价
本基金报告期末未投资国债期货。

(十一) 投资组合报告附注

1.报告期末本基金持有的前十名证券中, 百花潭(300313)的发行主体于2016年11月28日发布浙江核新同花顺网络信息股份有限公司关于收到中国证券监督管理委员会《行政处罚决定书》的公告,主要内容如下:2016年11月26日公司收到了中国证监会下发的[2016]124号《行政处罚决定书》,《行政处罚决定书》认为:“公司开发运营的资产管理系统,包含了账户开立、提供委托交易、存摺、查询等多种具有证券业务属性的功能,公司明知其客户经营方式,仍向不具有证券业务资格的客户销售该系统,提供开户服务,并获取佣金收入,违反了《证券法》第一百二十七条的规定,构成《证券法》第一百九十七条所述非法经营证券业务的行为。时任公司副总经理朱志峰为直接负责的主管人员,产品经理郭虹波为其他直接责任人员,根据当事人违法行为的事实、性质、情节与社会危害程度,依据《证券法》第一百九十七条的规定,中国证监会决定对公司违法所得予以没收,并处没收违法所得一倍罚款,对责任人给予警告处分,并处以罚款。”

证券代码:601128 股票简称:常熟银行 公告编号:2018-006

江苏常熟农村商业银行股份有限公司 公开发行A股可转换公司债券 网上中签率及优先配售结果公告

保荐机构(主承销商):中信建投证券股份有限公司

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。

特别提示

江苏常熟农村商业银行股份有限公司(以下简称“常熟银行”或“发行人”)和中信建投证券股份有限公司(以下简称“保荐机构(主承销商)”)根据《中华人民共和国证券法》、《上市公司证券发行管理办法》、《证券发行与承销管理办法》(证监会令[第135号])、《上海证券交易所上市公司可转换公司债券发行实施细则》(上证发[2017]54号)(以下简称“《实施细则》”)、《上海证券交易所证券发行上市业务指引》(上证发[2017]55号)等相关规定组织实施本次公开发行A股可转换公司债券(以下简称“可转债”或“常熟转债”)。

本次发行的可转债将向发行人在股权登记日(2018年1月18日,T-1)收市后中国证券登记结算有限责任公司上海分公司(以下简称“中国结算上海分公司”)登记在册的原股东优先配售,原股东优先配售后余额部分(含原股东放弃优先配售部分)通过上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易系统网上向社会公众投资者发行。请投资者认真阅读本公告及上交所网站(www.sse.com.cn)公布的《实施细则》。

本次发行在发行流程、申购、缴款和投资者申购处理等环节均发生重大变化,敬请投资者关注,主要变化如下:

1、网上投资者申购可转债中签后,应根据《江苏常熟农村商业银行股份有限公司公开发行A股可转换公司债券网上中签结果公告》(以下简称“《网上中签结果公告》”)履行资金交收义务,确保其资金账户在2018年1月23日(T+2日)终有足额的认购资金,投资者款项划付需遵守投资者所在证券公司的相关规定。投资者认购资金不足的,不足部分视为放弃认购,由此产生的后果及相关法律责任,由投资者自行承担。根据中国结算上海分公司的相关规定,放弃认购的最小单位为1手。网上投资者放弃认购的部分由保荐机构(主承销商)包销。

2、当原股东优先认购的可转债数量和网上投资者申购的可转债数量合计不足本次发行数量的70%时,或当原股东优先认购的可转债数量和网上投资者缴款认购的可转债数量合计不足本次发行数量的70%时,发行人及保荐机构(主承销商)将协商采取中止发行措施,并就中止发行的原因和后续安排进行信息披露。

本次发行认购金额不足30.00亿元的部分由保荐机构(主承销商)包销,保荐机构(主承销商)根据网上资金到账情况确定最终配售结果和包销金额,保荐机构(主承销商)包销比例不超过本次发行总额的30%,即最大包销额为9.00亿元。

3、网上投资者连续12个月内累计出现3次中签但未足额缴款的情形时,自中国证监会上海分公司收到申购申报的次日起6个月(按180个自然日计算,含次日)内不得参与新股、可转债、可交换债的申购。放弃认购的次数按照投资者实际放弃认购的新股、可转债、可交换债的次数合并计算。

常熟银行本次公开发行30.00亿元可转换公司债券原股东优先配售和网上申购已于2018年1月19日(T日)结束。根据2018年1月17日(T-2日)公布的《江苏常熟农村商业银行股份有限公司公开发行A股可转换公司债券发行公告》(以下简称“《发行公告》”),本公告一经刊出即视为向所有参加申购的投资者送达配信息。现将本次常熟转债发行申购结果公告如下:

- 一、总体情况
常熟转债本次发行30.00亿元,发行价格为100元/张,共计3,000万张(300万手),发行日期为2018年1月19日(T日)。
- 二、原股东优先配售结果
1.原有限售条件股东优先配售结果
发行人原有限售条件股东有效认购数量为857,649手,即857,649,000元;最终

股票简称:国信证券 证券代码:002736 编号:2018-003

国信证券股份有限公司 股票交易异常波动公告

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、股票交易异常波动情况的说明
国信证券股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)连续三个交易日(2018年1月17日、2018年1月18日、2018年1月19日)收盘价格涨幅偏离累计超过20%。根据深圳证券交易所的相关规定,属于股票交易异常波动的情况。
二、对重要问题的核实、关注情况说明
1.公司前期所披露的信息,不存在需要更正、补充之处。
2.公司未发生近期公共传媒报道了可能或已经对公司股票交易价格产生较大影响的未公开信息。
3.公司已披露的经营情况,内外部经营环境未发生重大变化。
4.经核查,公司及控股股东、实际控制人不存在应披露而未披露的重大事项。
5.经核查,控股股东、实际控制人在股票异常波动期间未买卖公司股票。
三、是否存在应披露而未披露信息的声明
公司董事会确认,公司目前没有任何根据《深圳证券交易所股票上市规则》

对如上股票投资决策程序说明;研究发展部按照内部研究工作规范对该股票进行分析后将列入基金投资对象备选库并跟踪研究。在此基础上本基金的基金经理根据具体市场情况独立作出投资决策。该事件发生后,本基金管理人对该股票的发行主体进行了进一步了解与分析,认为此事件未对该股票价值判断产生重大的实质性影响。本基金投资于该股票的投资决策过程符合制度规定的投资权限范围与投资决策程序。

报告期内本基金投资的前十名证券中其余九名的发行主体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。

2.报告期内本基金投资的前十名股票中,不存在超出基金合同约定的备选股票库的情形。

三、其他资产构成

序号	项目名称	金额(元)
1	银行存款	612,472,613
2	应收证券清算款	21,396,269.53
3	应收股利	—
4	应收利息	18,713,507.52
5	应收申购款	194.81
6	其他应收款	—
7	预付款项	—
8	其他	—
9	合计	413,824,844.54

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金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
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6.投资组合报告附注的其他文字描述说明
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差。

十二、基金的投资业绩

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。基金的投资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请仔细阅读本基金的招募说明书。

基金2017年第3季度及历史各时间段份额净值增长率与同期业绩比较基准收益

率比较:

(一)本报告期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	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2015年6月1日-2015年12月31日	1.20%	0.07%	2.69%	0.03%	-1.49%	0.06%
2016年1月1日-2016年12月31日	11.17%	0.41%	4.61%	0.03%	6.56%	0.40%
2017年1月1日-2017年6月30日	1.51%	0.13%	2.20%	0.03%	-0.69%	0.12%
2017年7月1日-2017年9月30日	2.63%	0.27%	1.14%	0.03%	1.49%	0.20%

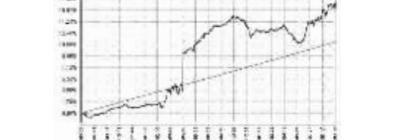
2.长信利盈混合C份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2015年6月1日-2015年12月31日	0.40%	0.04%	0.40%	0.03%	0.00%	0.03%
2016年1月1日-2016年12月31日	4.24%	0.18%	4.61%	0.03%	-0.37%	0.17%
2017年1月1日-2017年6月30日	1.33%	0.13%	2.20%	0.03%	-0.87%	0.12%
2017年7月1日-2017年9月30日	2.62%	0.28%	1.14%	0.03%	1.48%	0.27%

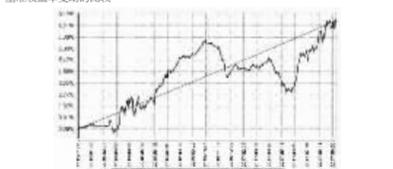
(二)自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1.长信利盈混合A自基金合同生效以来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



2.长信利盈混合C份额净值增加以来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.长信利盈混合A截至日期为2015年6月1日至2017年9月30日,长信利盈混合C截至日期为2015年11月30日(份额增加日)至2017年9月30日。

2.按基金合同约定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,建仓期结束时,本基金的各项投资比例应符合基金合同的约定。

十三、费用概览

- 1.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)基金销售服务费;
- (4)基金合同)生效后与基金相关的信息披露费用;
- (5)基金合同)生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所、审计费和仲裁费;
- (6)基金份额持有人大会费用;
- (7)基金的证券、期货等交易费用;
- (8)基金合同)约定的银行汇兑费用;
- (9)证券账户开户费用、账户维护费用;
- (10)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。

2.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0.6%费率计提。基金管理费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2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,顺延至法定节假日、休息日结束之日起2个工作日内或不可抗力情形消除之日起2个工作日内支付。

(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0.1%的费率计提。基金托管费的计算方法如下:

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金托管费

注:Y为持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费,全额计入基金财产;对于持有期少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费,其75%计入基金财产;对于持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费,其50%计入基金财产;对于持有期少于6个月但少于1年的基金份额所收取的赎回费,其25%计入基金财产,未计入基金财产部分用于支付登记费及其他必要的手续费。

3.转换费用与计算方法

证券代码:002803 证券简称:吉宏股份 公告编号:2018-005

厦门吉宏包装科技股份有限公司 关于参与投资设立并购基金的 进展公告

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”)于2018年1月15日召开第三届董事会第十七次会议,审议通过《关于参与投资设立并购基金的议案》。

同意公司以自有资金人民币4,000万元,与北京九州鑫诺投资基金管理有限公司、宁波君世投资管理合伙企业(有限合伙)、宁波梅山保税港区宏信投资管理合伙企业(有限合伙)共同出资设立规模为人民币1亿元的并购投资基金,具体内容详见公司于2018年1月16日刊登于《证券时报》《证券日报》《中国证券报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)的《第三届董事会第十七次会议决议公告》(公告编号:2018-003)和《关于参与投资设立并购基金的公告》(公告编号:2018-004)。

近日,该并购基金已完成工商注册登记手续并取得宁波市场监督管理局下发的营业执照,具体信息如下:

- 1.统一社会信用代码:91330201MA2AGW7T6H
- 2.名称:宁波维斯塔股权投资合伙企业(有限合伙)
- 3.类型:有限合伙企业
- 4.住所:浙江省宁波市大榭开发区永丰路128号9幢109-32室
- 5.执行事务合伙人:北京九州鑫诺投资基金管理有限公司
- 6.成立日期:2018年01月18日
- 7.营业期限:自2018年01月18日至2038年01月17日
- 8.营业范围:股权投资及相关信息咨询业务。(未经金融监管部门批准不得从事吸收存款、融资担保、代客理财、向社会公众(融)资等金融业务)(依法须经批准的项目,经相关部门批准后方可开展经营活动)

特此公告。

厦门吉宏包装科技股份有限公司
董 事 会
2018年1月22日

证券代码:002803 证券简称:吉宏股份 公告编号:2018-006

厦门吉宏包装科技股份有限公司 关于公司控股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”)近日接到公司控股股东庄浩女士通知,获悉庄浩女士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

证券代码:002363 证券简称:隆基机械 公告编号:2018-003

山东隆基机械股份有限公司 关于使用闲置募集资金购买保本浮动收益型人民币理财产品进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

山东隆基机械股份有限公司(以下简称“公司”)于2017年12月22日召开了第四届董事会第五次会议,审议通过了《关于使用部分闲置募集资金购买短期理财产品的议案》,同意公司对最高额度不超过20,000.00万元的部分闲置募集资金适时进行现金管理,投资于安全性高、流动性好、有保本约定的理财产品。在上述额度内,资金可在董事会审议通过之日起一年内滚动使用,具体内容详见2017年12月25日的《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》和巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)上的《关于使用部分闲置募集资金购买短期理财产品的公告》(公告编号:2017-057)。

2018年1月19日,公司与广发银行股份有限公司(以下简称“广发银行”)签订协议,以闲置募集资金2,000.00万元人民币购买“新加薪16号”人民币理财产品,现将相关事项公告如下:

- 一、理财产品主要内容
- 1.理财产品名称:广发银行“新加薪16号”人民币理财产品。
- 2.理财产品认购金额:2,000.00 万元人民币。
- 3.投资期限:90天。
- 4.产品起始日:2018年01月19日。
- 5.产品到期日:2018年04月19日。
- 6.理财产品类型:保本浮动收益型。
- 7.预期收益率:年化收益率为2.6%或4.7%。
- 8.收益计算基数:A/365
- 9.提前终止:本理财产品存续期内,理财计划投资者无提前终止权利。
- 10.提前赎回:本理财产品投资期间不设置提前赎回,理财计划投资者无提前赎回理财产品的权利。

11.本金及收益兑付时间:理财期满,广发银行将在收到投资收益(包括本金和收益)后两个工作日内将产品理财本金及应得理财收益划付给客户。

12.投资方向及受益权比例:本理财产品所募集的资金全部纳入发行人资金统一运作管理,投资于货币市场(包括但不限于银行存款、拆借、回购等金融工具),运作管理,投资于货币市场(包括但不限于银行存款、拆借、回购等金融工具),中期票据、公司债券(包括国债、股票、金融债、短期融资券、企业债、中期票据、公司债券)等金融资产的的比例区间为0%-80%,收益部分投资于美元兑港币的汇率水平挂钩的金融衍生产品,投资者的理财收益取决于美元兑港币的汇率在观察期内的表现。

13.资金来源:暂时闲置募集资金

14.公司与广发银行无关联关系

二、产品风险提示

1.理财产品风险:本理财产品为投资计划,我行仅有条件保证理财资金本金安全,即在投资者持有到期的情况下本理财产品保证本金安全,但不保证理财收益。本理财产品存续期间投资者不享有提前赎回权利,在最不利投资情形即投资者违约的情况下,可能损失部分本金。本理财计划的理财收益为浮动收益,影响本理财产品表现的最大因素为美元兑港币的汇率走势,由此产生的投资风险由投资者自行承担。

2.市场利率风险:本产品为保本、浮动收益型理财产品,如果在理财期内,市场利率上升,本理财产品的预计收益率不随市场利率上升而提高。

3.流动性风险:本理财产品存续期间投资者不得提前赎回且无权提前终止该理财产品。

4.管理风险:由于广发银行的知识、经验、判断、决策、技能等会影响其对其信息的占有以及对投资的判断,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为2.6%。

5.政策风险:本理财计划是针对当前的相关法规和政策设计的,如国家宏观政策及与市场相关法规政策发生变化,可能影响理财计划的投资、偿还等的正常进行,甚至导致本理财计划收益降低。

本公司开通了长信利盈混合基金与长信利息收益货币基金A、B份额(A级代码:519999;B级代码:519999)、长信利盈精选混合基金(前端代码:519997)、长信利盈精选混合基金(前端代码:519995)、长信增利优选混合基金(前端代码:519993)、长信双利优选混合基金、长信红利债券基金C类份额(C类代码:519989)、长信利盈优势混合基金、长信海德货币基金A类份额(A类代码:519985)、长信长利优选混合基金A类份额(A类代码:519983)、长信内嵌成长混合基金、长信可转债债券基金、长信改革红利混合基金、长信量化中盘股票基金、长信新利混合基金、长信利富债券基金、长信量化多策略股票基金A类份额(A类代码:519965)、长信利混合基金、长信多利混合基金、长信普进混合基金、长信利源混合基金、长信利保债券基金、长信先施债券基金、长信利发债券基金、长信电子量化混合基金、长信创新驱动股票基金、长信利混合基金、长信上证港股通指数发起式股票基金、长信先利债券基金、长信中证500指数基金之同利互换业务,具体业务信息详见本公司相关公告。

本公司于2017年4月30日披露了《长信基金管理有限责任公司关于长信上证港股通指数发起式证券投资基金暂停转出和转入相关业务公告》,自2017年7月4日起,暂停长信上证港股通指数发起式基金的转出转入和转换转出业务。

根据中国证监会2009123号《开放式证券投资基金销售费用管理规定》的相关规定,本公司从2010年4月23日起调整开放式基金转换业务规则,具体规则如下:

1.投资者进行基金转换时,转换费率将按照转出基金的赎回费用加上转出与转入基金申购费用补差的标准收取,当转出基金申购费率低于转入基金申购费率时,费用补差为按照转出基金金额计算的申购费用差额;当转出基金申购费率高于转入基金申购费率时,不收取费用补差。

2.转换份额的计算公式:

(1)非货币类之间转换
转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值
转入确认金额=转出确认金额÷转入基金份额净值
补差费=转出确认金额×赎回费率+补差费率-(1+补差费率)
转入确认金额=转入确认金额-赎回费-补差费

转入确认金额=转入确认金额-赎回费-补差费
转入确认金额=转入确认金额-补差费
转入确认金额=转入确认金额-补差费

(2)货币类基金转入非货币类基金
转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值+转出份额对应的未结转收益
补差费=转出确认金额×转出基金份额净值×补差费率-(1+补差费率)
转入确认金额=转入确认金额-补差费
转入确认金额=转入确认金额-补差费

(3)非货币类基金转入货币类基金
转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值
赎回费=转出确认金额×赎回费率
转入确认金额=转入确认金额-赎回费
转入确认金额=转入确认金额-赎回费-货币基金份额净值
(货币基金份额净值为1.00元,补差费为零)

(4)非货币类基金转入非货币类基金
转出确认金额=转出份额×转出基金份额净值
赎回费=转出确认金额×赎回费率
转入确认金额=转入确认金额-赎回费
转入确认金额=转入确认金额-赎回费-货币基金份额净值
(货币基金份额净值为1.00元,补差费为零)

十四、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》、《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,并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动,对《本招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

1.在“三、基金管理人”部分,更新了公司基金管理人主要人员情况;

2.在“四、基金托管人”部分,更新了基金托管人的基本情况和业务经营情况有关资料;

3.在“五、相关服务机构”部分,更新了代销机构基本资料、会计师事务所及相关信息;

4.在“八、基金份额的申购与赎回”部分,更新了可申购的基金信息;

5.在“十一、基金投资组合”部分,根据最新的定期报告,更新了相应的内容;

6.在“十一、基金的业绩”部分,根据最新的定期报告,更新了相应的内容,并经托管人复核;

7.在“十三、基金资产的估值”部分,更新了净值受限股票估值方法的相关内容;