证券代码:002446　证券简称:盛路通信　公告编号:2018-036

广东盛路通信科技股份有限公司 公开发行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）:长江证券承销保荐有限公司

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

特别提示

广东盛路通信科技股份有限公司（以下简称“盛路通信”、“发行人”或“公司”）根据《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144号]）、《深圳证券交易所可转换公司债券业务实施细则（2017年9月修订）》（以下简称“《实施细则》”）、《深圳证券交易所上市公司可转换公司债券发行上市业务办理指南（2017年9月修订）》等相关规定组织实施本次公开发行可转换公司债券（以下简称“可转债”）。

本次发行的可转债向发行人在股权登记日收市后中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司（以下简称“中国结算深圳分公司”或“登记公司”）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）通过深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易系统网上向社会公众投资者发行。参与网上申购的投资者请认真阅读本公告及深交所网站（www.szse.cn）公布的《实施细则》。

本次发行的可转债在发行流程、申购和缴款、投资者弃购等处理环节敬请投资者重点关注:

1、网上投资者申购可转债中签后,应根据《广东盛路通信科技股份有限公司公开发行可转换公司债券网上中签结果公告》履行资金交收义务,确保其资金账户在2018年7月19日（T+2日）日终有足额认购资金,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。网上投资者放弃认购的部分由主承销商包销。

2、当原股东优先认购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）将协商是否采取中止发行措施,并及时向中国证监会报告,如果中止发行,公告中止发行原因,择机重启发行。

3、本次发行认购金额不足10亿元的部分由保荐机构（主承销商）包销,包销基数为10亿元。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）包销比例原则上不超过本次发行总额的30%,即原则上最大包销金额为3亿元。当包销比例超过本次发行总额的30%时,保荐机构（主承销商）将立即召开证券发行委员会会议,由各发行委员会委员对此次发行是否中止发行进行讨论表决,并将表决结果与发行人协商沟通;如确定采取中止发行措施,保荐机构（主承销商）和发行人将及时向中国证监会报告,公告中止发行原因,并将在批文有效期内择机重启发行。

4、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,自结算参与人最近一次申报其放弃认购的次日起6个月（按180个自然日计算,含次日）内不得参与网上新股、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新股、可转债与可交换债的次数合并计算。

广东盛路通信科技股份有限公司公开发行10亿元可转换公司债券（以下简称“盛路转债”）原股东优先配售和网上申购已于2018年7月17日（T日）结束。

根据2018年7月13日（T-2日）公布的《广东盛路通信科技股份有限公司公开发行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获配信息。现将本次盛路转债发行申购结果公告如下:

一、总体情况

盛路转债本次发行10亿元,发行价格为100元/张,共计1,000万张,发行日期为2018年7月17日（T日）。

二、原股东优先配售结果

原股东优先配售的盛路转债总计为1,390,022张,即139,002,200元,占本次发行总量的13.90%。

三、社会公众投资者网上申购结果及发行中签率

本次发行最终确定的网上向社会公众投资者发行的盛路转债总计为8,609,970张,即860,997,000元,占本次发行总量的86.10%,网上中签率为0.6087166663%。

根据深圳证券交易所提供的网上申购数据,本次网上申购有效申购数量为1,414,446,240张,配号总数为141,444,624个,起讫号码为:000000000001-000141444624。

发行人和保荐机构（主承销商）将在2018年7月18日（T+1日）组织摇号抽签仪式,摇号中签结果将于2018年7月19日（T+2日）在《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上公告。投资者根据中签号码,确认认购可转债的数量,每个中签号只能认购10张（即1,000元）盛路转债。

本次发行配售结果汇总如下:

类 别	有效申购数量（张）	实际配售数量（张）	中签率
原股东	1,390,022	1,390,022	100%
网上社会公众投资者	1,414,446,240	8,609,970	0.6087166663%
合计	1,415,836,262	9,999,992	-

注:《发行公告》中规定向原股东优先配售每1张为1个申购单位,网上申购每10张为1个申购单位,因此所产生的余额8张由主承销商包销。

四、上市时间

本次发行的盛路转债上市时间将另行公告。

五、备查文件

有关本次发行的一般情况,请投资者查阅2018年7月13日（T-2日）刊登于《中国证券报》、《证券时报》的《广东盛路通信科技股份有限公司公开发行可转换公司债券募集说明书摘要》和《发行公告》,投资者亦可到巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）查询募集说明书全文及有关本次发行的相关资料。

六、发行人、保荐机构（主承销商）联系方式

（一）发行人

名称:	广东盛路通信科技股份有限公司
联系人:	陈嘉
注册地址:	佛山市三水区西南工业园进业二路四号
联系电话:	0757-87744984
传 真:	0757-87744984

（二）保荐机构（主承销商）

名称:	长江证券承销保荐有限公司
联系人:	资本市场部
注册地址:	中国(上海)自由贸易试验区世纪大道1198号28层
联系电话:	021-61118541
传 真:	021-61118973

发行人:广东盛路通信科技股份有限公司
保荐机构（主承销商）:长江证券承销保荐有限公司
2018年7月18日

证券代码:600618　900908　证券简称:氯碱化工　氯碱B股　编号:临2018-022

上海氯碱化工股份有限公司 2018年半年度业绩预告

本公司董事会及全体董事保证公告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:

1.公司预计2018年半年度实现利润总额45,800万元左右,与上年同期相比预计增加20,600万元左右,同比增加约81.96%;归属于上市公司股东的净利润为36,900万元左右,与上年同期相比预计增加11,844万元左右,同比增加约47.27%。

2. 扣除非经常性损益事项后,公司归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润与上年同期相比预计增加11,405万元左右,同比增加约43.79%。

一、本期业绩预告情况

（一）业绩预告期间

2018年1月1日至2018年6月30日。

（二）业绩预告情况

1.经财务部门初步测算,预计2018年半年度实现归属于上市公司股东的净利润与上年同期相比增加11,844万元左右,同比增加约47.27%。

2. 归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润与上年同期相比预计增加11,405万元左右,同比增加约43.79%。

二、上年同期业绩情况

（一）归属于上市公司股东的净利润:25,055.82万元。归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润:26,045.29万元

（二）每股收益:0.22元。

三、本期业绩增加的主要原因

（一）主营业务影响。

1、公司生产装置保持高负荷稳定运行;

2、公司优化产品销售结构,把握了市场节奏,提升了业绩水平;

3、公司优化生产经营,提升管理水平,运营成本得到有效控制。

（二）非经营性损益的影响。

因权益法核算的投资企业盈利能力较上年大幅提高,本期投资收益预计为 1.01亿元。

四、风险提示

公司本期主要产品烧碱售价环比2017年下半年度有所下降。

五、其他说明事项

以上预告数据仅为初步核算数据,具体准确的财务数据以公司正式披露的2018年半年度报告为准,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

上海氯碱化工股份有限公司
董事会
2018年7月18日

证券代码:600031　证券简称:三一重工　公告编号:2018-049
转债代码:110032　转债简称:三一转债

三一重工股份有限公司 可转债回售结果公告

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:

●回售期间:2018年7月9日至2018年7月13日

●回售有效申报数量:20张

●回售金额（不包含债券利息）:2,000元

●回售金额（包含债券利息）:2,060元

●回售资金到账日:2018年7月18日

一、本次可转债回售的公告情况

2018年7月2日,三一重工股份有限公司（以下简称“公司”）在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站（http://www.sse.com.cn）发布《可转债回售的提示性公告》,并分别于2018年7月4日、2018年7月6日发布《可转债回售的第二次提示性公告》、《可转债回售的第三次提示性公告》。

本次三一转债的回售价格为103元/张（含当期利息）,回售申报期为2018年7月9日至2018年7月13日,本次回售申报期已于2018年7月13日上海证券交易所收市后结束。

二、本次可转债回售结果和本次回售对公司的影响

本次三一转债的回售申报期为2018年7月9日至2018年7月13日;根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的数据,本次回售的有效申报数量为20张,回售金额（不包含债券利息）为2,000元,回售金额（包含债券利息）为2,060元;本公司委托中国证券登记结算有限责任公司上海分公司通过其资金清算系统进行清算交割,回售资金的发放日为2018年7月18日。

本次三一转债回售金额较小,不会对公司现金流、资产状况、股本情况造成重大影响。

三、本次可转债回售的后续事项。

根据相关规定,未回售的“三一转债”将继续在上海证券交易所交易。

特此公告。

三一重工股份有限公司
董事会
二〇一八年七月十八日

证券代码:002123　证券简称:梦网集团　公告编号:2018-063

梦网荣信科技集团股份有限公司 关于股东权益变动的提示性公告

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。

特别提示:

1、本次权益变动系公司回购股份注销,减少股本导致股东拥有权益的股份变动,不触及要约收购。

2、本次权益变动不会导致公司控股股东及实际控制人发生变化。

一、权益变动基本情况

梦网荣信科技集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2017年12月8日召开公司2017年第四次临时股东大会审议通过了《关于以集中竞价交易方式回购股份的议案》（以下简称“本次回购”),截至2018年7月7日,本次回购的实施期限已满,经公司向中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司申请并经审核确认,上述回购股份注销事宜已于2018年7月13日完成。公司本次累计回购注销50,988,506股,公司股份总数从861,595,025股减至810,606,519股。具体内容详见公司2018年7月17日刊登于《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）的《关于回购股份注销完成的公告》（2018-059）。

由于公司股份总数减少,公司控股股东余文胜先生持有的股份占公司总股本的比例由19.03%上升至20.23%;第二大股东深圳市松禾创业投资有限公司（以下简称“松禾创业”）及其一致行动人深圳市松禾成长创业投资合伙企业（有限合伙）（以下简称“松禾成长”）合计持有的股份占公司总股本的比例由9.60%上升至10.21%;股东孙慧女士持有的股份占公司总股本的比例由4.96%上升至5.28%,成为持有本公司5%以上股份的股东。具体变动情况如下:

股东名称	本次权益变动前			本次权益变动后		
	持股数量（股）	公司总股本（股）	持股比例	持股数量（股）	公司总股本（股）	持股比例
余文胜	163,978,375	861,595,025	19.03%	163,978,375	810,606,519	20.23%
松禾创业	70,573,316	861,595,025	8.19%	70,573,316	810,606,519	8.71%
松禾成长	12,157,070	861,595,025	1.41%	12,157,070	810,606,519	1.50%
孙慧	42,775,059	861,595,025	4.96%	42,775,059	810,606,519	5.28%

二、承诺及履行情况

（一）余文胜先生承诺及履行情况

1、公司发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易事项前,余文胜先生作出股份限售承诺:本人/本合伙企业通过本次交易而认购取得的荣信股份股份,自股份发行结束之日起12个月内不得转让。为保证盈利预测业绩补偿的可行性,自股份发行结束之日起12个月后,荣信股份向本人发行的股份按以下比例分批解锁:①自股份发行结束之日起12个月后解锁33%;②自股份发行结束之日起24个月后解锁33%;③自股份发行结束之日起36个月后解锁34%。除前述锁定期外。如本人担任荣信股份的董事、监事、高级管理人员的,则在本人担任荣信股份的董事、监事、高级管理人员期间,每年转让的股份不超过本人所持有的荣信股份股份总数的百分之二十五,离职后半年内,不转让本人所持有的荣信股份股份;并严格履行《公司法》、《上市规则》等规定的关于股份锁定的其他义务。若上述锁定期与监管机构的最新监管意见不相符,将根据监管机构的最新监管意见进行相应调整,前述锁定期届满后按中国证监会和深圳证券交易所的有关规定执行。

2、2017年1月23日,余文胜先生就上述承诺作出了追加承诺:本次重大资产重组完成后36个月内,本人不直接减持或不通过本人所控制的企业（如有）间接减持所持有上市公司股份。也不要求公司回购该部分股份。若在股份锁定期间发生资本公积转增股本、派送股票红利、配股、增发等使股份数量发生变动的事项,上述锁定股份数量相应调整。

3、2017年3月16日,余文胜先生就所持有的部分股份追加承诺:（1）自上市公司以发行股份及支付现金的方式购买梦网科技全体股东持有的梦网科技100%股权完成后36个月内,本人不减持或不通过本人所控制的企业（如有）间接减持自左强、深圳市深港产学研创业投资有限公司处受让的（包括未来受让的）上市公司股份。也不要求上市公司回购该部分股份。若在上述股份承诺期间发生资本公积转增股本、派送股票红利、配股、增发等使股份数量发生变动的事项,上述承诺股份数量相应调整。（2）前述承诺期届满后按中国证监会和深圳证券交易所的有关规定执行。如本人违反上述承诺,则本人自愿将买卖上市公司股份所得收益全部收归上市公司所有。

4、2017年10月16日,左强先生持有的14,270,972股高管锁定股通过司法划转过户至余文胜先生名下,余文胜先生就本次取得的公司股份作出承诺:（1）自上市公司以发行股份及支付现金的方式购买梦网科技全体股东持有的梦网科技100%股权完成后36个月内,本人不减持所持有的非交易过户股份,亦不要求上市公司回购非交易过户股份。若在非交易过户股份承诺期间,发生资本公积转增股本、派送股票红利、配股、增发等使非交易过户股份数量发生变动的事项,上述承诺的股份数量相应调整。（2）继续遵守现行相关法律法规关于上市公司董事、高级管理人员减持上市公司股份的相关限制性规定。如本人违反上述承诺,则本人自愿将买卖上市公司股份所得收益全部收归上市公司所有。

5、截至本公告披露日,上述承诺均在严格履行中。

（二）松禾创业及其一致行动人松禾成长承诺及履行情况

1、2017年3月16日,松禾创业就所持有的部分股份追加承诺:（1）自上市公司以发行股份及支付现金的方式购买梦网科技全体股东持有的梦网科技100%股权完成后36个月内,本公司/本人不减持或不通过本公司/本人所控制的企业（如有）间接减持所持有的上市公司股份。也不要求上市公司回购该部分股份。若在上述股份承诺期间发生资本公积转增股本、派送股票红利、配股、增发等使股份数量发生变动的事项,上述锁定股份数量相应调整。但将本公司/本人所持有的上市公司股份转让给余文胜先生,则不受上述股份承诺限制。（2）前述承诺期届满后按中国证监会和深圳证券交易所的有关规定执行。

2、公司发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易相关事项前,松禾成长作出承诺:本合伙企业通过本次交易而认购取得的荣信股份股份,自股份发行结束之日起36个月内不得转让。

3、截至本公告披露日,上述承诺均在严格履行中。

（三）孙慧女士承诺及履行情况

1、公司发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易相关事项前,孙慧女士作出承诺:本人（或本合伙企业）本次以现金方式认购的荣信股份非公开发行的股份,自股份发行结束之日起36个月内不转让或上市交易;前述锁定期届满后其转让和交易将按照中国证监会和深圳证券交易所的有关规定执行。

2、2017年10月16日,左强先生持有的3,171,327股高管锁定股通过司法划转过户至孙慧女士名下,孙慧女士就本次取得的公司股份作出承诺:（1）自上市公司以发行股份及支付现金的方式购买梦网科技全体股东持有的梦网科技100%股权完成后36个月内,本人不减持所持有的非交易过户股份,亦不要求上市公司回购非交易过户股份。若在非交易过户股份承诺期间,发生资本公积转增股本、派送股票红利、配股、增发等使非交易过户股份数量发生变动的事项,上述承诺的股份数量相应调整。但将本人所持有的非交易过户股份转让给余文胜先生,则不受上述股份锁定承诺限制。（2）继续遵守现行相关法律法规关于上市公司董事、高级管理人员减持上市公司股份的相关限制性规定。如本人违反上述承诺,则本人自愿将买卖上市公司股份所得收益全部收归上市公司所有。

3、截至本公告披露日,上述承诺均在严格履行中。

三、其他相关说明

1、根据《上市公司收购管理办法》的规定,因上市公司减少股本导致股东的股份变动超过5%的,股东免于履行报告和公告义务。本次权益变动符合《证券法》、《上市公司收购管理办法》等有关法律法规和规范性文件的规定。

2、本次权益变动不会导致公司控股股东及实际控制人发生变化。

特此公告。

梦网荣信科技集团股份有限公司
董事会
2018年7月18日

证券代码:600436　证券简称:片仔癀　公告编号:2018-032

漳州片仔癀药业股份有限公司 关于2018年半年度业绩快报公告

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。

本公告所载2018年半年度主要财务数据为初步核算数据,未经会计师事务所审计,具体数据以漳州片仔癀药业股份有限公司（以下简称“公司”）2018年半年度报告中披露的数据为准,敬请投资者注意投资风险。

一、2018年半年度主要财务数据和指标

单位:人民币万元

项 目	本报告期	上年同期	增减变动幅度（%）
营业总收入	240,406.33	175,283.13	37.15
营业利润	72,750.59	51,072.86	42.44
利润总额	72,209.30	50,850.48	42.00
归属于上市公司股东的净利润	61,894.20	43,319.89	42.88
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	60,676.20	41,689.81	45.54
基本每股收益（元）	1.03	0.72	43.06
加权平均净资产收益率	14.03	11.68	增加2.35个百分点
项 目	本报告期末	本报告期初	增减变动幅度（%）
总 资 产	611,408.81	564,827.74	8.25
归属于上市公司股东的所有者权益	442,960.53	413,604.16	7.10
股 本	60,331.72	60,331.72	-
归属于上市公司股东的每股净资产（元）	7.34	6.86	7.00

注:1、本报告期初数同法定披露的上年年末数。

二、经营业绩和财务状况情况说明

1、公司营业总收入同比增长37.15%,主要系公司强化市场及销售渠道的扩展,销售收入增加导致营业收入的增长。

2、公司营业利润同比增长42.44%、利润总额同比增长42.00%、归属上市公司股东的净利润同比增长42.88%、归属上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润同比增长45.54%及基本每股收益同比增长43.06%,主要系公司主导产品片仔癀系列产品销售增长导致营业利润增长所致。

三、风险提示

上述2018年半年度主要财务数据为公司初步核算数据,未经审计机构审计。2018年半年度业绩的具体财务数据将在2018年半年度报告中详细披露。敬请广大投资者谨慎决策,注意投资风险。

四、上网公告附件

经公司现任法定代表人、主管会计工作负责人、会计机构负责人签字并盖章的比较式资产负债表和利润表。

特此公告。

漳州片仔癀药业股份有限公司
董事会
2018年7月17日

证券代码:600637　证券简称:东方明珠　公告编号:临2018-047

东方明珠新媒体股份有限公司 第八届董事会第三十八次（临时）会议决议公告

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。

东方明珠新媒体股份有限公司（以下简称“公司”）第八届董事会第三十八次（临时）会议通知于2018年7月13日以书面、电子邮件等方式发出,于2018年7月17日以通讯表决的方式召开。本次会议应表决董事9名,实际表决9名。本次会议的通知和召开程序符合《公司法》和《公司章程》的有关规定。会议审议并通过议案、议题如下:

一、《关于调整公司高级管理人员的议案》

由于工作调动原因,公司副总裁何小兰女士将不在上市公司担任任何职务,公司同意免去何小兰女士公司副总裁职务,对何小兰女士任职期间的贡献表示衷心地感谢。

表决结果:9票赞成,0票反对,0票弃权。

二、《关于聘任公司高级管理人员的议案》

同意聘任金晓明先生担任公司总会计师（财务负责人）,简历附后。

独立董事发表了同意的独立意见。

表决结果:9票赞成,0票反对,0票弃权。

特此公告。

东方明珠新媒体股份有限公司
董事会
2018年7月18日

附件:

金晓明先生简历

金晓明,男,1971年6月出生,1993年7月参加工作,共产党员,大学本科学历,硕士学位,会计师,非执业注册会计师。现任上海广播电视台、上海文化广播影视集团有限公司计划财务部主任。1993年7月参加工作,历任上海纺织机械总厂财务部会计、经理助理、副经理、副总会计师等职务。1999年12月起,历任上海有线电视台财务部副主任、上海文广投资有限公司财务融资部主任、上海文广互动电视有限公司财务总监、副总经理等职务。2010年12月起任上海广播电视台、上海东方传媒集团有限公司计划财务部副主任。2014年4月起任上海广播电视台、上海文化广播影视集团有限公司计划财务部副主任（主持工作）。2015年3月起任上海广播电视台、上海文化广播影视集团有限公司计划财务部主任。

(上接B55版)

办公地址:湖北省武汉市江汉区武汉中央商务区泛海国际SOHO城（一期）第7栋23层1号、4号

法定代表人:陶捷

联系人:孔繁

电话:027-87006003*8020

传真:027-87006010

客户服务电话:400-027-9899

网址:www.buyfunds.cn

79、济安财富（北京）基金销售有限公司

住所:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室

办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层

联系人:李海燕

电话:010-65309516

传真:010-65330699

客服电话:400-673-7010

网址:www.jianfortune.com

80、金惠家保险代理有限公司

住所:北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部

办公地址:北京市朝阳门外大街18号丰联广场A座1009

联系人:胡明哲

电话:15810201340

传真:028-62825388

客服电话:400-8557333

网址:www.jhjhome.com

81、天津市凤凰财富基金销售有限公司

住所:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607

办公地址:天津市和平区南京路181号世纪都会1606-1607

联系人:孟媛媛

电话:18920017760

传真:022-23297867

客户服务电话:400-706-6880

网址:www.fhcfjj.com

（三）登记机构

名称:东方基金管理有限责任公司

住所:北京市西城区锦什坊街28号1-4层

办公地址:北京市西城区锦什坊街28号1-4层

法定代表人:崔伟

联系人:刘博睿

电话:010-66295824

传真:010-66578680

网址:www.orient-fund.com 或 www.df5888.com

（四）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

联系人:孙睿

电话:021-31358666

传真:021-31358600

经办律师:黎明、孙睿

（五）审计基金财产的会计师事务所

名称:立信会计师事务所（特殊普通合伙）

住所:上海市南京东路61号4楼

办公地址:北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层

法定代表人:朱建弟

联系人:朱锦梅

电话:010-68286868

传真:010-88210608

经办注册会计师:朱锦梅、赵立卿

五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称:东方启明量化先锋混合型证券投资基金

（二）本基金类型:混合型

（三）基金运作方式:契约型、开放式

六、基金投资目标和投资方向

（一）投资目标

在严格控制投资风险的前提下,通过量化选股策略,结合类别资产的配置,力争获得基金的长期稳定增值。

（二）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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具、权证、资产支持证券、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(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:股票资产占基金资产的比例为30%-95%;权证、股指期货及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行;本基金持有单只中小企业私募债券,其市值不得超过本基金资产净值的10%;本基金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%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

七、基金的投资策略

本基金基金资产的30%-95%可投资于股票,在符合法律法规的规定和基金合同约定的前提下,本基金通过量化选股策略筛选股票,结合类别资产的配置力争实现分散组合投资风险、提高投资收益的目标。

（一）类别资产配置

本基金结合各类经济数据对我国宏观经济运行、资本市场运行情况等进行分析,结合国家政策走向、国内外经济环境变化等因素对各类资产的当期、中短期和中长期风险收益水平形成判断,在符合相关投资比例限制的前提下,进行类别资产的配置和动态调整。

（二）股票投资策略

股票投资分为量化选股和量化择时。

量化选股是通过数量化的方法,分析股票交易数据、财务数据、分析师预测评级及宏观数据等,来建立各种股票预测模型,以战胜市场和获得稳定的绝对收益为根本目标。量化选股的策略包括但不限于:多因子策略、事件驱动策略、套利策略等。为了获得稳定、低风险的收益,本产品采用多个策略,从而在风格转换的行情下,规避单一策略的回撤风险。

量化择时是根据技术指标、宏观经济指标等,来判断未来股市整体走势,并根据判断结果,对股票仓位进行增减。在股票市场上涨期间高配股票,低配债券和货币,获得股票市场贝塔收益;在股票市场下跌期间低配股票,高配债券,规避市场风险。

（三）债券投资策略

本基金通过动态调整债券的投资比例,在一定程度上规避股票市场的投资风险,获得相对稳定的投资收益。结合市场利率趋势及信用环境变化情况等,综合判断各类券种的风险收益水平,构造债券的投资组合。在实际的投资运作中,本基金将运用久期调整策略、收益率曲线策略、类属券种配置策略、期限结构策略等多种策略,获取债券市场的长期稳定收益。

(四)中小企业私募债券投资策略

在控制信用风险的基础上,本基金对中小企业私募债投资,主要通过期限和品种的分散投资控制流动性风险。以买入持有到期为主要策略,审慎投资。

针对内嵌转股选择权的中小企业私募债,本基金通过深入的基本面分析及定性定量研究,自下而上精选个债,在控制风险的前提下,谋求内嵌转股权潜在的增强收益。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制订严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

（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,深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化,寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征,谨慎投资,追求较稳定的当期收益。

（六）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

(七) 股指期货投资策略

本基金进行股指期货的投资以套期保值为主要目的,本基金投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约,通过对股票市场和股指期货市场短期和中长期趋势的研究,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。

八、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%+中债总全价指数收益率×40%

本基金选择中债总全价指数收益率作为债券投资部分的业绩比较基准。中债总全价指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等）,是中国目前最权威,应用也最广的指数。中债总全价指数的构成品种基本覆盖了本基金的债券投资标的,反映债券全市场的整体价格和投资回报情况。

本基金选择沪深300指数收益率作为股票投资部分的业绩比较基准。沪深300指数样本覆盖了沪深市场60%左右的市值,具有良好的市场代表性和可投资性。

若今后法律法规发生变化,或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准,基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略,调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致,由基金管理人报中国证监会备案并及时公告。

九、基金的风险收益特征

本基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。

基金托管人根据本基金合同规定,已复核了本投资组合报告中的财务指标、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2018年3月31日（财务数据未经审计）。

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	7,009,998.00	80.26
	其中:股票	7,009,998.00	80.26
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	1,711,760.04	19.60
8	其他资产	11,876.12	0.14
9	合计	8,733,634.16	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,762,474.00	69.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	177,731.00	2.15
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	985,853.00	11.93
J	金融业	-	-
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	83,940.00	1.02
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	7,009,998.00	84.84

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	300188	美亚柏科	9,700	300,700.00	3.64
2	300639	凯普生物	1,900	108,357.00	1.31
3	300161	华中数控	5,800	107,648.00	1.30
4	002038	双鹭药业	2,800	107,184.00	1.30
5	300683	海特生物	2,000	107,000.00	1.30
6	300653	正海生物	2,600	106,730.00	1.29
7	002019	亿帆医药	4,600	102,442.00	1.24
8	300485	赛升药业	3,200	100,384.00	1.21
9	300009	安科生物	3,500	99,330.00	1.20
10	002007	华兰生物	3,300	99,231.00	1.20

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

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

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）本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内未发现存在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）本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股票。

（3）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	11,310.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	546.08
5	应收申购款	19.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,876.12

（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。

十一、基金的业绩

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。

（一）基金的净值表现

本期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
2015.12.03-2015.12.31	1.25%	0.57%	4.47%	1.20%	-3.22%	-0.63%
2016.01.01-2016.12.31	4.49%	1.19%	-7.07%	0.85%	11.56%	0.34%
2017.01.01-2017.12.31	-0.41%	0.61%	10.74%	0.39%	-11.15%	0.22%
2018.01.01-2018.03.31	-2.67%	1.18%	-1.41%	0.70%	-1.26%	0.48%

（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