

(上接B45版)

回购策略略也是本基金重要的投资策略之一,把信用债投资和回购交易结合起来,在信用风险和流动性风险可控的前提下,或者通过回购融资来博取超额收益,或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。

5. 资产支持证券投资策略
本基金将重点对市场利率、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因素影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

6. 股票投资策略
本基金主要根据上市公司盈利能力、成长能力以及估值水平进行个股选择,运用定性和定量相结合的方法,综合分析其投资价值 and 成长性,确定投资标的股票,构建投资组合。

7. 国债期货投资策略
本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货交易。

8. 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,基金在权证投资方面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,立足于无风险套利,尽力减少组合净值波动率,力求稳健的超额收益。

第九部分 业绩比较基准
中证可转债指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%

中证可转债指数的样本由在沪深证券交易所上市的可转换债券组成,以反映国内市场可转换债券的总体表现。中证综合债指数由中证指数有限公司编制,是综合反映了银行间市场和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短期融资券的跨市场债券指数,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势。沪深300指数是由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。选用上述业绩比较基准目前能够比较真实、客观地反映本基金的 risk 收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或指数编制单位变更或停止该指数的编制、发布、维护,或该指数由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为该指数不宜继续作为业绩比较基准的,或证券市场有其他代表性更强、或者更客观的业绩比较基准适用于本基金时,本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,经与基金托管人协商一致,对业绩比较基准进行调整并及时公告。

第十部分 基金投资范围
本基金为债券型基金,预期收益和预期风险高于货币市场基金,但低于混合型基金、股票型基金。本基金主要投资于可转换债券(含可分离交易可转债),在债券型基金中属于风险水平相对较高的产品。

第十一部分 基金投资组合报告
本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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年7月17日复核了本报告中的财务资料、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6月30日,本报告所列财务数据未经审计。

1. 报告期末基金投资组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,024,351.21	6.18
其中:股票	7,024,351.21	6.18	
2	固定收益投资	102,842,104.21	90.42
其中:债券	102,842,104.21	90.42	
资产支持证券	--	--	
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入国债逆回购	--	--
其中:买入逆回购的买入返售金融资产	--	--	
6	银行存款和结算备付金合计	2,745,498.66	2.41
7	其他各项资产	1,120,391.39	0.99
8	合计	113,722,345.47	100.00

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、渔业	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	7,024,351.21	6.93
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	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	--	--
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	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	农林、环境和公共设施管理业	--	--
P	国防军工、医药和医疗器械业	--	--
Q	教育	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	7,024,351.21	6.93

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

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	600803	新奥股份	384,375	4,435,687.50	4.38
2	002332	仙乐制药	188,785	1,651,868.75	1.63
3	000739	普洛药业	127,600	913,610.00	0.90
4	002280	联化科技	2,628	23,179.96	0.02

4. 报告期末按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	4,042,302.60	3.99
其中:政策性金融债	4,042,302.60	3.99	
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债(可交换债)	98,799,801.61	97.51
8	同业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	102,842,104.21	101.50

为私募基金管理人,登记编码P1062180。

3. 投资决策委员会
合伙企业投资决策委员会,负责协助执行事务合伙人决定投资及投资退出事务,投资决策委员会由三名委员组成,由执行事务合伙人任免。

投资决策委员会按一人一票表决,表决事项须经全体委员一致同意方为通过。

(四) 托管事项
合伙企业可选择第三方结构机构作为合伙企业的托管人,履行资金托管有关义务,全体合伙人授权并认可执行事务合伙人代表合伙企业并以合伙企业的名义与托管人签订资金托管协议。

(五) 投资方向
投资方向:合伙企业的重点投资方向为文化、教育,原则上用于K12教育培训、教育科技、STEM教育项目投资。

合伙企业闲置资金可以投资于银行存款、银行现金管理类理财产品、购买国债及其他固定收益类产品,以提高闲置资金收益,合伙企业闲置资金产生的收益应分别核算。

(六) 合伙企业费用
合伙企业将负担所有包括与合伙企业的设立、运营、终止、解散、清算等相关的费用,包括但不限于:开办费;与合伙企业设立相关的法律服务费用;所有因拟投资项目投资、持有、运营、出售而发生的法律、审计、评估、咨询及其他第三方费用;以及因合伙企业实施项目投资或项目退出需由合伙人办理国有资产评估及备案而发生的必要费用;执行合伙企业报酬或基金管理费;基金托管费等。

合伙企业成立后,合伙企业应向执行事务合伙人支付执行合伙事务报酬,除非执行事务合伙人同意免除,执行合伙事务报酬按照如下方式计算:投资期内,每12个月执行合伙事务报酬为全体合伙人实缴出资的1.8%;退出期内,每12个月执行合伙事务报酬为全体合伙人实缴出资扣除已退出投资项目投资成本后余额的1.8%;清算期不收取执行合伙事务报酬。

合伙企业成立后,合伙企业应向基金管理人支付基金管理费,除非非基金管理人同意免除,基金管理费按照如下方式计算:投资期内,每12个月基金管理费为全体合伙人实缴出资的0.2%;退出期内,每12个月基金管理费为全体合伙人实缴出资扣除已退出投资项目投资成本后余额的0.2%;清算期内不收取基金管理费。

(七) 收益分配顺序
(1) 有限合伙人出资回收;向有限合伙人进行分配,直至有限合伙人均收回其在该项目中的投资本金以及该项目相关的费用(包括执行事务合伙人或基金管理人确定的与该项目投资直接相关的成本和费用的合理分摊部分)(“投资成本”);可供分配财产不足时各有限合伙人按实缴出资比例获得此项分配。

(2) 普通合伙人出资回收;向普通合伙人进行分配,直至普通合伙人收回其投资成本。(3) 全体合伙人分配收益;其余收益的20%分配予普通合伙人,另外80%在全体有限合伙人之间按实缴出资比例进行分配。

(八) 争议解决
本协议的全部事项,包括但不限于本协议的效力、解释、履行以及争议的解决均受中国法律管辖。如双方当事人首先通过友好协商的方式解决本协议引起或相关的任何争议或索赔,若出于任何原因,双方友好协商不能在合伙人提出书面要求协商之后的三十(30)日内解决争议或索赔,那么任何合伙人有权依法向北京仲裁委员会申请仲裁。

三、嘉兴法学(普通合伙人)的主要情况
名称:嘉兴法学投资管理有限公司
类型:有限责任公司(自然人投资或控股)
场所:浙江省嘉兴市南湖区江南路1856号基金小镇1号楼121室-94
法定代表人:吴海蒙
注册资本:壹佰万元整
成立日期:2018年7月13日
营业期限:2018年7月13日至2028年7月12日
经营范围:投资管理;资产管理。(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)

嘉兴法学于2018年7月13日取得了由嘉兴市南湖区行政审批局核发的营业执照。

四、备查文件
1、《嘉兴法盟股权投资合伙企业(有限合伙)合伙协议》
2、嘉兴法学投资管理有限公司营业执照
公司将根据相关要求,对本次设立基金后续相关事宜及时履行信息披露义务,请广大投资者理性投资,谨慎投资风险。

特此公告。

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

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	128032	双环转债	166,062	16,337,179.56	16.12
2	113509	新泉转债	103,250	9,969,930.00	9.78
3	122009	蓝鼎转债	62,660	8,112,590.20	8.01
4	120313	17宝武EB	71,140	7,124,671.00	7.03
5	128027	联达转债	45,850	5,267,706.50	5.20

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有国债期货。

11. 投资组合报告附注
(1) 本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或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

(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情况。

(3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保保证金	25,412.21
2	应收证券清算款	884,115.27
3	应收股利	--
4	应收利息	188,494.81
5	应收申购款	22,369.10
6	其他应收款	--
7	持摊费用	--
8	其他	--
9	合计	1,120,391.39

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128032	双环转债	16,337,179.56	16.12
2	128027	联达转债	5,267,706.50	5.20
3	128020	永晶转债	4,637,047.25	4.58
4	110311	光大转债	4,577,762.80	4.52
5	110032	三一转债	3,575,416.20	3.53
6	128018	鼎信转债	3,543,079.41	3.50
7	110440	恒信转债	3,466,679.20	3.42
8	123003	蓝鼎转债	3,433,780.88	3.39
9	110042	航电转债	3,248,083.50	3.21
10	128019	久立转债	2,980,808.05	2.94
11	128024	九州转债	2,519,113.41	2.49
12	110034	宁行转债	2,302,010.00	2.27
13	128023	亚太转债	967,212.53	0.95

(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。

第十一部分 基金的业绩
本基金业绩截止日为2018年6月30日,并经基金托管人复核。

本基金管理人依照恪尽职守、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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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	④-⑤
2017年12月28日至2017年12月31日	0.00%	0.00%	0.22%	0.13%	-0.22%	-0.13%
2018年上半年	-7.08%	0.79%	-1.39%	0.55%	-5.69%	0.24%
2017年12月28日至2018年6月30日	7.08%	0.78%	-1.17%	0.58%	-5.91%	0.23%

第十三部分 基金费用与税收
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信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、仲裁费和诉讼费;

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0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.70%÷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

基金管理人每日计提,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,自动在次月初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。

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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.20%÷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

基金托管人每日计提,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,自动在次月初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。

3. 基金信息披露费用
本基金信息披露费用按照《证券投资基金信息披露管理办法》及《基金合同》的约定执行。

4. 基金销售服务费
本基金销售服务费按照《证券投资基金销售管理办法》及《基金合同》的约定执行。

5. 基金审计费
本基金审计费按照《证券投资基金审计管理办法》及《基金合同》的约定执行。

6. 基金律师费
本基金律师费按照《证券投资基金律师管理办法》及《基金合同》的约定执行。

7. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

8. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

9. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

10. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

11. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

12. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

13. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

14. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

15. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

16. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

17. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

18. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

19. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

20. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

21. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

22. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

23. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

24. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

25. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

26. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

27. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

28. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

29. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

30. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

31. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

32. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

33. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

34. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

35. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

36. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

37. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

38. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

39. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

40. 基金其他费用
本基金其他费用按照《证券投资基金其他费用管理办法》及《基金合同》的约定执行。

证券代码:600661 股票简称:新南洋 编号:临2018-043

上海新南洋股份有限公司 关于董事辞职的提示性公告

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。

近日,公司董事会收到现任董事徐金辉女士的辞职报告。因个人工作原因,徐金辉女士申请辞去所任公司董事会董事及相关专业委员会职务。根据《公司法》及《公司章程》的有关规定,徐金辉女士的辞职申请自书面辞职报告送达董事会之日起生效。

公司董事会对徐金辉女士在任职期间为公司所做的贡献表示衷心感谢!特此公告。

上海新南洋股份有限公司
2018年8月11日

证券代码:600661 股票简称:新南洋 编号:临2018-044

上海新南洋股份有限公司 关于参与设立教育产业并购基金的 进展公告

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、情况概述
上海新南洋股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)于2018年6月15日召开了第九届董事会第七次会议,审议通过了公司与江西中文传媒蓝海国际投资有限公司(以下简称“蓝海国投”)和嘉兴法学投资管理有限公司(以下简称“嘉兴法学”)共同发起设立教育产业并购基金的议案。详见公司披露的《上海新南洋股份有限公司第九届董事会第七次会议决议公告》(公告编号:临2018-031)、《上海新南洋股份有限公司关于拟共同发起设立教育产业并购基金的公告》(公告编号:临2018-032)。

2018年8月10日,公司作为有限合伙人与蓝海国投及嘉兴法学正式签署了《嘉兴法盟股权投资合伙企业(有限合伙)合伙协议》(以下简称“《合伙协议》”)。

截至本公告发布日,该合伙企业尚未完成工商设立登记手续,尚未在基金业协会办理备案登记。

现将《合伙协议》和嘉兴法学的相关公告如下:
二、《合伙协议》的主要内容

(一) 合伙企业的名称、经营场所、经营范围及投资期限
名称:嘉兴法盟股权投资合伙企业(有限合伙)(以企业登记机关核准为准)
经营场所:浙江省嘉兴市南湖区江南路1856号基金小镇1号楼132室-19
合伙目的:从事文化、教育产业投资,为全体合伙人获得投资回报。

合伙企业:营业执照签发之日起算,合伙企业成立之日起的第三年为基金的投资期,第四年至第五年为基金的退出期,经合伙人会议批准,基金的退出期延长一年,合伙企业的经营期限相应延长。