（上接B101版）

27	渤海证券股份有限公司	注册地址:天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室 办公地址:天津市南开区宾水西道8号 法定代表人:王春峰 联系人:蔡霆 电话:022-28451991 传真:022-28451892 客服电话:400-651-5988 网址:www.ewww.com.cn
28	平安证券股份有限公司	注册地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 办公地址:深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层 法定代表人:刘世安 联系人:周一涵 联系电话:021-38637436 客服电话:95511-8 网址:stock.pingan.com
29	国都证券股份有限公司	注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 联系人:黄静 电话:010-84183333 传真:010-84183311-3389 客服电话:400-818-8118 网址:www.guodu.com
30	东吴证券股份有限公司	注册地址:苏州工业园区星阳街5号 办公地址:苏州工业园区星阳街5号 法定代表人:范力 联系人:陆晓 电话:0512-62938521 传真:0512-65588021 客服电话:95330 网址:www.dwzq.com.cn
31	广州证券股份有限公司	注册地址:广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼 办公地址: 广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19楼、20楼 法定代表人:胡伏云 联系人:梁微 联系电话:95396 客服电话: 95396 网址:www.gzs.com.cn
32	华林证券股份有限公司	注册地址:西藏自治区拉萨市柳梧新区察古大道1-1号君泰国际B栋一层3号 办公地址:深圳市福田区民田路178号华融大厦6楼 法人代表:林立 联系人:郑琢 联系电话:0755-82707869 客服电话:400-188-3888 网址:www.chinalin.com
33	华安证券股份有限公司	注册地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号 办公地址:安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号财智中心B1座 法定代表人:章宏韬 联系人:范超 联系电话:0551-65161821 客服电话:95318 网址:www.hazq.com
34	西南证券股份有限公司	注册地址:重庆市江北区桥北苑8号 法定代表人:吴坚 联系人:周青 联系电话:023-63786633 客服电话:4008096096 网址:www.swsc.com.cn
35	德邦证券股份有限公司	注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼 办公地址:上海市浦东新区福山路500号城建国际中心26楼 法定代表人:武晓春 联系人:刘熠 电话:021-68761616 传真:021-68767032 客服电话:4008888128 网址:www.tebon.com.cn
36	中航证券有限公司	注册地址:南昌市红谷滩新区红谷中大道1619号国际金融大厦A座41楼 办公地址:北京市朝阳区安立路60号润枫德尚6号楼3层中航证券 法定代表人:王宜四 联系人:史江蕊 电话:010-64818301 传真:010-64818443 客服电话:400-8866-567 网址:http://www.avicsec.com/
37	大同证券有限责任公司	注册地址:大同市城区迎宾街15号桐城中央21层 办公地址:山西省太原市长治路111号山西世贸中心A座F12、F13 法定代表人:董祥 联系人:薛津 电话:0351-4130322 传真:0351-4192803 客服电话:4007121212 网址:http://www.dtsbc.com.cn
38	新时代证券股份有限公司	注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501 法定代表人:叶顺德 联系人:田芳芳 联系电话:010-83561146 客服电话:95399 网址:www.xsdzq.cn
39	万联证券股份有限公司	注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层 办公地址:广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层 法定代表人:张建军 联系人:甘蕾 联系电话:020-38286026 客服电话:400-8888-133 网址:www.wlzq.cn
40	国金证券股份有限公司	注册地址:成都市东城根上街95号 办公地址:成都市东城根上街95号 法定代表人:冉云 联系人:刘婧漪、贾鹏 联系电话:028-86690057、028-86690058 传真:028-86690126 客服电话:95310 网址:www.gjzq.com.cn
41	恒泰证券股份有限公司	注册地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层 办公地址:呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座D座14层 法定代表人:庞介民 联系人:熊丽 客服电话:4001966188 网址:www.cnht.com.cn
42	大通证券股份有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层 办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层 法定代表人:赵玺 联系人:谢立军 电话:0411-39991807 传真:0411-39991833 客服电话:4008-169-169 网址:www.daton.com.cn
43	联储证券有限责任公司	注册地址:广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路333号金砖大厦8楼 法定代表人:沙常明 联系人:丁倩云 电话:010-86499427 传真:010-86499401 客服电话:400-620-6868 网址:www.lczq.com
44	川财证券有限责任公司	注册地址:中国(四川)自由贸易试验区成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17楼 办公地址:中国(四川)自由贸易试验区成都市高新区交子大道177号中海国际中心B座17楼 法定代表人:孟建军 联系人:匡婷 电话:028-86583053 传真:028-86583002 客服电话:95105118 网址:www.cczq.com
45	中信期货有限公司	注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层 法定代表人:张皓 联系人:刘宏莹 电话:010-60833754 传真:0755-83217421 客服电话:400-990-8826 网址:http://www.citicsf.com
46	深圳众禄基金销售股份有限公司	注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼 法定代表人:薛峰 联系人:童彩平 电话:0755-33227950 传真:0755-33227951 客服电话:4006-788-887 网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com
47	上海好买基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号 办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903~906室;上海市虹口区欧阳路196号(法兰桥创意园)26号楼2楼 法定代表人:杨文斌 联系人:张茹 电话:021-20613999 传真:021-68596916 客服电话:400-700-9665 网址:www.ehowbuy.com
48	蚂蚁(杭州)基金销售有限公司	注册地址:杭州市余杭区仓前街文一西路1218号1栋202室 办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F 法定代表人:陈柏青 联系人:韩爱彬 客服电话:4000-766-123 网址:www.fund123.cn
49	上海长量基金销售投资顾问有限公司	注册地址:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室 办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层 法定代表人:张跃伟 联系人:张佳琳 电话:021-20691831 传真:021-20691861 客服电话:400-820-2899 网址:www.erichfund.com
50	上海天天基金销售有限公司	注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层 办公地址:上海市徐汇区宛平南路88号金座大楼(东方财富大厦) 法定代表人:其实 联系人:黄妮娟 电话:021-54509998 传真:021-64385308 客服电话:95021 网址:www.1234567.com.cn
51	浙江同花顺基金销售有限公司	注册地址:浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦903室 办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺街18号 同花顺大楼4层 法定代表人:凌顺平 联系人:吴强 电话:0571-88911818-8653 传真:0571-86800423 客服电话:4008-773-772 网址:www.5ifund.com
52	深圳市新兰德证券投资咨询有限公司	注册地址:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006# 办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦16层 法定代表人:马勇 联系人:文雯 电话:010-83363101 传真:010-83363072 客服电话:400-166-1188 网址:https://8.jrj.com.cn
53	北京恒天明泽基金销售有限公司	注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室 办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室 法定代表人:周斌 联系人:祖杰 电话:010-53509636 传真:010-57756199 客服电话:4008980618 网址:www.chtfund.com
54	北京植信基金销售有限公司	注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106-67 办公地址:北京市朝阳区盛世龙源国食苑10号楼 法定代表人:于龙 联系人:吴鹏 电话:010-56075718 传真:010-67767615 客服电话:4006-802-123 网址:http://www.zhixin-inv.com
55	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:上海市长宁区福泉北路518号8座3层 法定代表人:燕斌 联系人:陈东 电话:021-52822063 传真:021-52975270 客服电话:400-166-6788 网址:http://www.66zichan.com
56	上海利得基金销售有限公司	注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室 办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼 法定代表人:李兴春 联系人:郑茂 电话:021-50583533 传真:021-60195218 客服电话:400-921-7755 网址:www.leadfund.com.cn
57	上海陆金所基金销售有限公司	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:胡学勤 联系人:宁博宇 电话:021-20665952 传真:021-22066653 客服电话:4008219031 网址:www.lufunds.com
58	珠海盈米财富管理有限公司	注册地址: 珠海市横琴新区宝华路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12楼 1201-1203室 法定代表人:肖雯 联系人:邱湘湘 电话:020-89629099 传真:020-89629011 客服电话:020-89629066 网址:www.yingmi.cn
59	北京唐鼎耀华投资咨询有限公司	注册地址:北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室 办公地址:北京朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A座303 法定代表人:张鑫 联系人:刘美薇 电话:010-53570572/13121820670 传真:010-59200800 客服电话:400-819-9868 网址:http://www.tdyhfund.com/
60	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号新华社第三工作区5F 法定代表人:钱昊旻 联系人:孙雯 电话:010-59336519 传真:010-59336500 客服电话:4008-909-998 网址:www.jnlc.com
61	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222507 办公地址:北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507 法定代表人:钟斐斐 联系人:吴季林 电话:010-61840688 传真:010-61840699 客服电话:4000618518 网址:https:// www.danjuanapp.com
62	南京途牛金融信息服务有限公司	注册地址:南京市玄武区玄武大道699-1号 办公地址:南京市玄武区玄武大道699-1号 法定代表人:宋时琳 联系人:贺杰 电话:025-86853969-66727 客服电话:4007-999-999 网址:http://jr.tuniu.com
63	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(上海泰和经济发展区) 办公地址:上海市昆明路518号北美广场A栋1002-1003室 法定代表人:王翔 联系人:蓝杰 电话:021-35385521 传真:021-55085991 客服电话:400-820-5369 网址:www.jiyufund.com.cn
64	通华财富(上海)基金销售有限公司	注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼 法定代表人:马刚 联系人:杨徐霆 电话:021-60818187 传真:021-60818187 客服电话:95156 网址:https://www.tonghuafund.com
65	和耕传承基金销售有限公司	注册地址:郑州市郑东新区东风东路东、康宁街北6号楼6楼602、603房间 办公地址:郑州市郑东新区东风南路康宁街互联网金融大厦6F 法定代表人:李淑慧 联系人:胡静华 电话:0371-85518396 传真:0371-85518397 客服电话:4000-555-671 网址: http://www.hgccpb.com/
66	大连网金融信息服务有限公司	注册地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室 办公地址:辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层202室 法定代表人:卜勇 客服电话:4000-899-100 网址:http://www.yibaijin.com/
67	一路财富(北京)信息科技股份有限公司	注册地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208 办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208 法定代表人:吴雪秀 联系人:徐越 电话:18510640608 客服电话:400-001-1566 网址:www.yilucaifu.com
68	本基金其他代销机构情况详见基金管理人发布的相关公告	

3.2 登记机构

名称:南方基金管理股份有限公司

住所及办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路六号免税商务大厦31-33层

法定代表人:张海波

电话:(0755)82763849

传真:(0755)82763868

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)88604192

传真:(0755)36866661

经办律师:戴瑞冬、付强

3.4 审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号领展企业广场2座普华永道中心11楼

执行事务合伙人:李丹

联系人:曹阳

联系电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办注册会计师:薛竞、曹阳

§ 4 基金名称

南方天天宝货币市场基金

§ 5 基金的类型

货币市场基金

§ 6 基金的投资目标

在控制投资组合风险,保持流动性的前提下,力争为投资人提供稳定的收益。

§ 7 基金的投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金、期限在一年以内(含一年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

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,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

§ 8 基金的投资策略

本基金将采用积极管理型的投资策略,在控制利率风险、尽量降低基金净值波动风险并满足流动性的前提下,提高基金收益。

1、利率策略

本基金将首先采用"自上而下"的研究方法,综合研究主要经济变量指标,分析宏观经济情况,建立经济前景的情景模拟,进而判断财政政策、货币政策等宏观经济政策取向。同时,本基金还将分析金融市场资金供求状况变化趋势,对影响资金面的因素进行详细分析与预判,建立资金面的场景模拟。

在宏观分析与流动性分析的基础上,结合历史与经验数据,确定当前资金的时间价值、通货膨胀补偿、流动性溢价等要素,得到当前宏观与流动性条件下的均衡收益率曲线。区分当前利率债收益率曲线期限利差、曲率与券间利差所面临的历史分位,然后通过市场收益率曲线与均衡收益率曲线的对比,判断收益率曲线参数变动的程度和概率,确定组合的平均剩余期限,并据此动态调整投资组合。

2、骑乘策略

当市场利率期限结构向上倾斜并且相对较陡时,投资并持有债券一段时间,随着时间推移,债券剩余年限减少,市场同样年限的债券收益率较低,这时将债券按市场价格出售,投资人除了获得债券利息以外,还可以获得资本利得。在多数情况下,这样的骑乘操作策略可以获得比持有到期更高的收益。

3、放大策略

放大策略即以组合现有债券为基础,利用买断式回购、质押式回购等方式融入资金,并购买剩余年限相对较长的债券,以期获取超额收益的操作方式。在回购利率过高、流动性不足、或者市场状况不宜采用放大策略等情况下,本基金适时降低杠杆投资比例。

4、信用债投资策略

(1)信用风险控制。本基金拟投资的每支信用债券必须经过南方基金债券信用评级系统进行内部评级,符合基金所对应的内部评级规定的方可进行投资,以事前防范和控制信用风险。

(2)信用利差策略。信用产品相对国债、政策性金融债等利率产品的信用利差是获取较高投资收益的来源。首先,伴随经济周期的波动,在经济周期上行或下行阶段,信用利差通常会缩小或扩大,利差的变动会带来趋势性的信用产品投资机会。同时,研究不同行业在经济周期和政策变动中所受的影响,以确定不同行业总体信用风险和利差水平的变动情况,投资具有积极因素的行业,规避具有潜在风险的行业。其次,信用产品发行人资信水平和评级调整的变化会使产品的信用利差发生相应变动,本基金将充分发挥内部评级在定价方面的作用,选择评级有上调可能的信用债,以获取因利差下降带来的价差收益。第三,对信用利差期限结构进行研究,分析各期限信用债利差水平相对历史平均水平的位置,以及不同期限之间利差的相对水平,发现更具投资价值的期限进行投资;第四,研究分析相同期限不同信用评级债券的相对利差水平,发现偏离较大的债券,相对利差有收窄可能的债券。

(3)类属选择策略。不同审批机构批准发行的信用产品在定价、产品价格特性、信用风险方面具有一定差别,本基金将考虑产品定价的合理性、产品主要投资人的需求特征、不同类属产品的持有收益和价差收益特点和实际信用风险状况,进行信用债券的类属选择。

5、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,采用基本面分析和数量化模型相结合,对个券进行风险分析和价值评估后进行投资。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。

6、其他金融工具投资策略

本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向,一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资,本基金将在届时相应法律法规的框架内,根据对该金融工具的研究,制定符合本基金投资目标的投资策略,在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下,谨慎投资。

§ 9 基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

§ 10 基金业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率(税后)。

根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款税后利率作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时,本基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,依据维护投资人合法权益的原则,经与基金托管人协商一致并按照监管部门要求履行适当程序后,调整或变更本基金的业绩比较基准并及时在指定媒介上公告,而无需召开基金份额持有人大会。

§ 11 基金投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定复核了本报告中的财务指标、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。

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。

本投资组合报告所载数据截至2018年6月30日(未经审计)。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,189,747,426.38	76.23
	其中:债券	1,189,747,426.38	76.23
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	93,000,259.50	5.96
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	262,607,777.74	16.83
4	其他资产	15,425,494.21	0.99
5	合计	1,560,780,957.83	100.00

1.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	17.62	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	111,579,744.21	7.70
	其中:买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例(%)	原因	调整期
1	2018-04-09	39.82	大额赎回导致被动超标	3个工作日
2	2018-04-10	35.02	大额赎回导致被动超标	2个工作日
3	2018-04-11	22.64	大额赎回导致被动超标	1个工作日
4	2018-04-24	33.45	大额赎回导致被动超标	5个工作日
5	2018-04-25	35.33	大额赎回导致被动超标	4个工作日
6	2018-04-26	37.37	大额赎回导致被动超标	3个工作日
7	2018-04-27	38.08	大额赎回导致被动超标	2个工作日
8	2018-05-02	38.31	大额赎回导致被动超标	1个工作日
9	2018-05-15	38.59	大额赎回导致被动超标	5个工作日
10	2018-05-16	41.42	大额赎回导致被动超标	4个工作日
11	2018-05-17	50.01	大额赎回导致被动超标	3个工作日
12	2018-05-18	39.06	大额赎回导致被动超标	2个工作日
13	2018-05-21	30.27	大额赎回导致被动超标	1个工作日
14	2018-05-29	38.72	大额赎回导致被动超标	4个工作日
15	2018-05-30	43.17	大额赎回导致被动超标	3个工作日
16	2018-05-31	46.17	大额赎回导致被动超标	2个工作日
17	2018-06-01	47.33	大额赎回导致被动超标	1个工作日

1.3 基金投资组合平均剩余期限

1.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	74
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	98
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过120天。

1.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	18.10	7.70
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	28.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	36.42	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	17.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.68	7.70

1.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

注:本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

1.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,885,996.26	1.37
2	央行票据	-	-
3	金融债券	55,975,703.75	3.86
	其中:政策性金融债	55,975,703.75	3.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	210,701,801.74	14.54
6	中期票据	30,372,474.20	2.10
7	同业存单	872,811,450.43	60.25
8	其他	-	-
9	合计	1,189,747,426.38	82.13
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

1.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111809148	18浦发银行CD148	1,100,000	109,353,361.92	7.55
2	011758107	17华侨城SCP003	800,000	80,478,006.82	5.56
3	111898115	18成都农商银行CD006	700,000	69,539,486.76	4.80
4	011800923	18中铝集SCP008	500,000	50,028,046.96	3.45
5	111781998	17南京银行CD148	500,000	49,816,153.07	3.44
6	111809136	18浦发银行CD136	500,000	49,755,106.42	3.43
7	111803091	18农业银行CD091	500,000	49,748,798.70	3.43
8	111712285	17北京银行CD285	500,000	49,639,543.32	3.43
9	111818146	18华夏银行CD146	500,000	49,598,989.70	3.42
10	111815270	18民生银行CD270	500,000	49,559,678.43	3.42

1.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	
报告期内偏离度的最高值	0.2110%
报告期内偏离度的最低值	0.0024%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0708%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

注:本报告期内本货币市场基金负偏离度的绝对值未达到0.25%。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

注:本报告期内本货币市场基金正偏离度的绝对值未达到0.5%。

1.8 报告期末按摊余成本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。

1.9 投资组合报告附注

1.9.1 基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内平均摊销,每日计提收益。

1.9.2 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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。如是,还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

1.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,185,244.75
4	应收申购款	9,240,249.46
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	15,425,494.21

§ 12 基金业绩

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。

南方天天宝A						
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
2017.8.9-2017.12.31	1.4829%	0.0013%	0.5452%	0.0000%	0.9377%	0.0013%
2018.1.1-2018.6.30	1.8284%	0.0072%	0.6810%	0.0000%	1.1474%	0.0072%
自基金合同生效起至今	3.3384%	0.0054%	1.2300%	0.0000%	2.1084%	0.0054%

南方天天宝B						
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
2017.8.9-2017.12.31	1.5801%	0.0013%	0.5452%	0.0000%	1.0349%	0.0013%
2018.1.1-2018.6.30	1.9487%	0.0072%	0.6810%	0.0000%	1.2677%	0.0072%
自基金合同生效起至今	3.5596%	0.0054%	1.2300%	0.0000%	2.3296%	0.0054%

§ 13 基金的费用概览

13.1 与基金运作有关的费用

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、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费、律师费、诉讼费和仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金相关账户开户费用和账户维护费用;

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。

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0.32%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×年管理费率÷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。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令,基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。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0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×年托管费率÷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。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令,基金托管人复核无误后于2个工作日内进行支付。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%

本基金B类基金份额的年销售服务费率为0.01%

基金份额的销售服务费计提的计算公式具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人在次月初3个工作日内出具资金划拨指令,基金托管人复核无误后于2个工作日内支付给注册登记机构,由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

上述"一、基金费用的种类中第4—10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》生效前的相关费用;

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。

13.2 与基金销售有关的费用

1、本基金在一般情况下不收取申购费用和赎回费用,但是出现以下情形之一:

(1)当基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于5%且偏离度为负时;

(2)当本基金前10名基金份额持有人的持有份额合计超过基金总份额50%,且本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计低于10%且偏离度为负时;

为确保基金平稳运作,避免诱发系统性风险,对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额的1%以上的赎回申请(超过基金总份额1%以上的部分)征收1%的强制赎回费用,并将上述赎回费用全额计入基金财产。基金管理人与基金托管人协商确认上述做法无益于基金利益最大化的情形除外。

2、本基金的申购、赎回价格为每份基金份额1.00元。

3、基金申购份额的计算

本基金的申购采用"金额申购、份额确认"的方式。申购份额的计算公式为:

申购份额 = 申购金额/1.00

例:某投资人投资10万元申购本基金,则其可得到的申购份额为:

申购份额=100,000.00/1.00=100,000.00份

4、基金赎回金额的计算

本基金的赎回采用"份额赎回、金额确认"的方式。投资人在赎回基金份额时,基金份额对应的未付收益是否与赎回款一并支付给投资人,以销售机构或指定电子交易平台的具体规定为准。

(1)如销售机构或指定电子交易平台规定投资人在赎回基金份额时将按比例结转的未付收益一并结算并与赎回份额对应的款项一并支付给投资人,赎回金额包括赎回份额对应的款项和未付收益两部分,具体的计算方法为:

赎回金额=赎回份额×1.00元+赎回份额对应的未付收益

例:某投资人持有本基金份额100,000份,赎回50,000份,赎回份额对应的未付收益为1.50元,则其可得到的赎回金额为:

赎回金额=50,000×1.00+1.50=50001.50元

(2)如销售机构或指定电子交易平台规定投资人在赎回基金份额时未付收益不与赎回份额对应的款项一并支付给投资人,未付收益将结转为份额留存在投资人的基金账户。赎回金额的计算公式为:

赎回金额=赎回份额×1.00元

例:某投资人赎回本基金10,000份,则赎回金额=10,000×1.00=10,000元

5、申购份额的处理方式

申购份额的计算结果保留到小数点后2位,小数点后2位以后的部分舍弃,舍弃部分归入基金财产。

6、赎回金额的处理方式

赎回金额的计算结果保留到小数点后2位,小数点后2位以后的部分四舍五入,由此产生的误差计入基金财产。

§ 14 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人根据基金法及其他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,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在"重要提示"部分,对"重要提示"进行了更新。

2、在"绪言"部分,对"绪言"进行了更新。

3、在"释义"部分,对"释义"进行了更新。

4、在"基金管理人"部分,对"主要人员情况"进行了更新。

5、在"基金托管人"部分,对"基金托管人"进行了更新。

6、在"相关服务机构"部分,对"销售机构"进行了更新,对"审计基金财产的会计师事务所"进行了更新。

7、在"基金份额的申购和赎回"部分,对"申购与赎回的数额限制"进行了更新,对"申购费用和赎回费用"进行了更新,对"拒绝或暂停申购的情形及处理方式"进行了更新,对"暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形及处理方式"进行了更新,对"巨额赎回的情形及处理方式"进行了更新。

8、在"基金的投资"部分,对"投资限制"进行了更新,对"基金投资组合报告"进行了更新,对"基金业绩"进行了更新。

9、在"基金资产估值"部分,对"基金资产估值"进行了更新。

10、在"基金的信息披露"部分,对"基金的信息披露"进行了更新。

11、在"风险揭示"部分,对"风险揭示"进行了更新。

12、在"基金合同的内容摘要"部分,对"基金合同的内容摘要"进行了更新。

13、在"基金托管协议的内容摘要"部分,对"基金托管协议的内容摘要"进行了更新。

14、在"基金份额持有人服务"部分,对"基金份额持有人服务"进行了更新。

15、在"其他应披露事项"部分,对"其他应披露事项"进行了更新。

16、对部分其他表述进行了更新。

南方基金管理股份有限公司

2018年9月14日

证券代码:002246　　证券简称:北化股份　　公告编号:2018-085

四川北方硝化棉股份有限公司关于使用部分闲置本次募集资金购买理财产品到期赎回的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

四川北方硝化棉股份有限公司(以下简称"公司")于2018年3月2日召开第四届董事会第十五次会议及第四届监事会第十次会议,分别审议通过了《关于使用部分闲置本次募集资金进行现金管理的议案》及《关于使用部分闲置前次募集资金进行现金管理的议案》。同意公司使用不超过42,900万元的闲置募集资金进行现金管理,其中:使用不超过39,350万元的闲置本次募集资金进行现金管理,使用不超过3,550万元的闲置前次募集资金进行现金管理。决议有效期限为自公司董事会、监事会审议通过之日起十二个月内有效,在上述额度及决议有效期内,资金可以循环滚动使用。公司董事会授权公司总经理行使投资决策并签署相关合同文件,包括但不限于:选择合格的理财机构、理财产品品种、明确投资金额、投资期限、签署合同或协议等。公司独立董事、保荐机构均发表了明确同意的意见。具体内容登载于2018年3月3日的《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。

一、使用部分闲置本次募集资金购买理财产品及赎回的情况

2018年3月9日,公司与中国建设银行股份有限公司泸州分行签订《中国建设银行"乾元-北化"保本型人民币理财产品四川2018年第4期(总2018年第28期)客户协议书》,公司使用闲置本次募集资金20,000万元购买了中国建设银行"乾元-北化"保本型人民币理财产品四川2018年第4期(总2018年第28期)。具体内容登载于2018年3月13日的《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。公司已于2018年9月11日赎回上述已到期理财产品,实际年化收益率为4.4%,获得理财收益人民币4,412,054.79元,本金及收益已于2018年9月12日到账。

二、本公告日前十二个月内购买理财产品情况

(一)使用闲置募集资金购买银行理财产品的情况

序号	产品名称	产品类型	受托机构	金额(万元)	产品期限	资金来源	是否保本	预计年化收益率	其他(实际收益)
1	中银保本理财-人民币按期开放【CNYAQKF】	保证收益型	中国银行股份有限公司泸州分行	人民币3,550万元	2018年03月05日-2018年12月10日	闲置前次募集资金	是	4.0000%(扣除理财产品费用后可获得的年化收益率)	未到期
2	中国建设银行"乾元-北化"保本型人民币理财产品四川2018年第1期(总2018年第25期)	保本浮动收益型产品	中国建设银行股份有限公司泸州分行	人民币4,000万元	2018年3月12日-2018年4月12日	闲置本次募集资金	是	最高收益率3.8%	129,095.89元
3	中国建设银行"乾元-北化"保本型人民币理财产品四川2018年第2期(总2018年第26期)	保本浮动收益型产品	中国建设银行股份有限公司泸州分行	人民币5,000万元	2018年3月12日-2018年5月14日	闲置本次募集资金	是	最高收益率4.0%	345,205.48元
4	中国建设银行"乾元-北化"保本型人民币理财产品四川2018年第3期(总2018年第27期)	保本浮动收益型产品	中国建设银行股份有限公司泸州分行	人民币10,000万元	2018年3月12日-2018年6月11日	闲置本次募集资金	是	最高收益率4.2%	1,047,123.29元
5	中国建设银行"乾元-北化"保本型人民币理财产品四川2018年第4期(总2018年第28期)	保本浮动收益型产品	中国建设银行股份有限公司泸州分行	人民币20,000万元	2018年3月12日-2018年9月11日	闲置本次募集资金	是	最高收益率4.4%	4,412,054.79元
6	中国建设银行"乾元-北化"保本型人民币理财产品四川2018年第5期(总2018年第31期)	保本浮动收益型产品	中国建设银行股份有限公司泸州分行	人民币4,000万元	2018年4月16日-2018年5月16日	闲置本次募集资金	是	最高收益率2.8%	92,054.79元
7	中国建设银行"乾元-周周利"开放式资产组合型保本人民币理财产品	保本浮动收益型产品	中国建设银行股份有限公司泸州分行	人民币4,000万元	无固定期限	闲置本次募集资金	是	投资期49天;28天≤投资期<63天,预期年化收益率3.25%	174,520.55元
8	中国建设银行"乾元-周周利"开放式资产组合型保本人民币理财产品	保本浮动收益型产品	中国建设银行股份有限公司泸州分行	人民币5,000万元	无固定期限	闲置本次募集资金	是	投资期49天;28天≤投资期<63天,预期年化收益率3.25%	218,150.68元
9	中国建设银行"乾元-周周利"开放式资产组合型保本人民币理财产品	保本浮动收益型产品	中国建设银行股份有限公司泸州分行	人民币10,000万元	无固定期限	闲置本次募集资金	是	投资期28天;28天≤投资期<63天,预期年化收益率3.25%	249,315.07元

根据公司第四届董事会第十五次会议决议及第四届监事会第十次会议决议,截至本公告日,公司在前12个月内使用闲置募集资金购买理财产品累计金额为42,550万元,未超过授权额度。其中,已到期赎回的保本型理财产品总金额为39,000万元,尚未到期的保本型理财产品的总金额3,550万元。

(二)使用闲置募集资金购买证券公司理财产品的情况

序号	产品名称	产品类型	受托机构	金额(万元)	产品期限	资金来源	是否保本	预计年化收益率	其他(实际收益)
1	光大证券鼎富系列收益凭证5月期第622号	本金收益保障型	光大证券股份有限公司	人民币19,000万元	2018年07月17日-2018年12月25日	闲置本次募集资金	是	本计划到期约定收益率为4.70%(年化)	未到期

根据公司第四届董事会第二十次会议决议、第四届监事会第十三次会议决议及2018年第三次临时股东大会决议,截至本公告日,公司在前12个月内使用闲置募集资金购买证券公司理财产品累计金额为19,000万元,未超过授权额度。

(三)使用闲置自有资金购买信托产品的情况

序号	认购方	产品名称	产品类型	受托机构	金额(万元)	产品有效期	资金来源	是否保本	预计年化收益率	其他(实际收益)
1	四川北方硝化棉股份有限公司	华能信托.熙曜3号集合资金信托计划产品	集合资金信托计划	华能贵诚信托有限公司	人民币7,000万元	自C类信托单位成立并生效之日起满6个月	闲置自有资金	是(中兵投资出具《关于〈华能信托-熙曜3号集合资金信托计划信托合同〉利益及劣后级差额补足的承诺函》)	实际年收益率:约4.8667%	1,698,666.67元
2	子公司山西新华化工有限责任公司	华能信托.熙曜3号集合资金信托计划产品	集合资金信托计划	华能贵诚信托有限公司	人民币6,000万元	自F类信托单位成立并生效之日起至2019年5月11日	闲置自有资金	是(中兵财富出具《关于〈华能信托-熙曜3号集合资金信托计划信托合同〉利益及劣后级差额补足的承诺函》)	预期年收益率:5.6%(信托税前)	未到期

根据公司2018年第一次临时股东大会决议及2017年年度股东大会决议,截至本公告日,公司及子公司在前12个月内使用闲置自有资金购买信托产品累计金额为13,000万元,未超过授权额度。其中:公司使用闲置自有资金购买信托产品累计金额为7,000万元,已到期赎回;子公司山西新华化工有限责任公司使用闲置自有资金购买信托产品累计金额为6,000万元,尚未到期。

三、备查文件

理财产品到期赎回的相关凭证。

特此公告。

四川北方硝化棉股份有限公司

董　事　会

二〇一八年九月十四日

证券代码:002246　　证券简称:北化股份　　公告编号:2018-086

四川北方硝化棉股份有限公司关于向全资子公司提供委托贷款的进展公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、委托贷款概述

2018年8月6日,四川北方硝化棉股份有限公司(以下简称"公司")召开第四届董事会第二十一次会议审议通过了《关于向全资子公司提供委托贷款的议案》。同意公司以不超过10,000万元的自有资金委托兵工财务有限责任公司向公司全资子公司山西新华化工有限责任公司(以下简称"新华化工")提供委托贷款。决议有效期限为自公司董事会审议通过之日起十二个月内有效,在上述额度及决议有效期内,资金可以循环滚动使用。公司董事会授权公司总经理办理与本次委托贷款事项相关的协议签署、上述额度内款项支付以及签署未尽事项的补充协议等相关事项。具体内容登载于2018年8月7日的《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。

二、委托贷款协议主体的基本情况

(一)委托贷款借款方基本情况

1、公司名称:山西新华化工有限责任公司

2、公司类型:有限责任公司(非自然人投资或控股的法人独资)

3、公司住所:太原市新兰路71号

4、法定代表人:黄健

5、注册资本:15,000万元

6、成立时间:2003年06月02日

7、经营范围:军用防护器材、活性炭制品的设计开发、生产、制造、销售、服务;活性炭、活性焦、橡胶制品、工业防毒面具和滤毒罐、消防产品、水净化器材、环保器材、空调及制冷设备、活性炭设备及净化再生装置的研制、生产、安装、销售;水污染治理;大气污染治理;污水处理及再生利用;承揽工装模具、机械制造、球境工程(除建筑工程),建筑施工;建筑机电安装工程;环保工程施工;办公家具的生产和销售;进出口;经营本企业自产产品及技术的出口业务和本企业所需的机械设备、零配件、原辅材料及技术的进口业务,但国家限定公司经营或禁止进出口的商品和技术除外。(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)

8、与公司关联关系:新华化工系公司持股100%的全资子公司。

(二)委托贷款受托方基本情况

1、公司名称:兵工财务有限责任公司

2、公司类型:其他有限责任公司

3、公司住所:北京市东城区安定门外青年湖南街19号

4、法定代表人:史艳晓

5、注册资本:人民币317,000万元

6、成立时间:1997年06月04日

7、经营范围:对成员单位办理财务和融资顾问、信用鉴证及相关的咨询、代理业务;协助成员单位实现交易款项的收付;经批准的保险代理业务;对成员单位提供担保;办理成员单位之间的委托贷款及委托投资;对成员单位办理票据承兑与贴现;办理成员单位之间的内部转账结算及相应的结算、清算方案设计;吸收成员单位的存款;对成员单位办理贷款及融资租赁;从事同业拆借;对金融机构的股权投资;有价证券投资;承销成员单位的企业债券;经批准发行财务公司债券;成员单位产品的消费信贷、买方信贷及融资租赁;成员单位开展外汇资金集中管理及即期结售汇业务(包括自身结售汇业务和对成员单位的结售汇业务)。(企业依法自主选择经营项目,开展经营活动;依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动;不得从事本市产业政策禁止和限制类项目的经营活动。)

8、与公司关联关系:本公司及兵工财务有限责任公司的最终控股股东同为中国兵器工业集团有限公司。

(三)新华化工与公司在产权、资产、人员等方面独立,业务清晰。

(四)委托贷款借款方最近一年又一期的主要财务指标

截止2017年12月31日,新华化工资产总额143,114.18万元,负债总额66,522.78万元,净资产76,591.40万元;2017年全年,实现营业收入87,849.32万元,净利润5,479.90万元(经审计)。

截止2018年6月30日,新华化工资产总额146,200.89万元,负债总额64,421.21万元,净资产81,779.68万元;2018年上半年,实现营业收入49,144.62万元,净利润5,318.09万元(未经审计)。

(五)委托贷款受托方最近一年又一期的主要财务指标

截止2017年12月31日,兵工财务有限责任公司资产总额9,680,740万元,净资产674,841万元;2017年度营业收入112,141万元,净利润76,443万元(经审计)。

截止2018年6月30日,兵工财务有限责任公司资产总额8,075,732万元,净资产626,595万元;2018年上半年,营业收入68,226万元,净利润44,397万元(未经审计)。

三、委托贷款借款合同的主要内容

(一)委托贷款金额:4,000万元人民币

(二)委托贷款利率:4.35%

(三)委托贷款期限:5个月(2018年8月13日-2018年12月31日)

(四)利息计付方式:按季结息,结息日为每季度末月20日

(五)委托贷款手续费收取方式:一次性收取,由兵工财务有限责任公司直接从山西新华化工有限责任公司账户扣收,收取费率为贷款本金的0.06‰。

四、委托贷款的目的、存在的风险和对公司的影响

公司全资子公司新华化工因生产订单增加,但产品交付、结算周期长,为维持正常生产经营所需资金量逐步加大,运营资金趋紧。为支持新华化工生产经营稳定发展,公司对新华化工提供委托贷款。委托贷款资金为公司自有资金,不影响公司日常资金正常周转需要,不影响公司主营业务正常开展,也不会损害公司及股东权益。为全资子公司提供委托贷款,可以提高资金使用效率,有效降低财务费用。新华化工已建立了良好的风险控制体系,公司能够对其实施有效的业务、资金管理和风险控制。未来,公司将按照自身的内控要求,加强对新华化工开展业务情况的评估,确保公司资金的安全,不存在逾期或违约等风险。

五、其他事项

公司在对外提供财务资助后的十二个月内,不使用闲置募集资金暂时补充流动资金、不将募集资金投向变更为永久性补充流动资金、不将超募资金永久性用于补充流动资金或者归还银行贷款。

六、公司累计提供委托贷款的金额占最近一期经审计净资产的比例

截至本公告日,公司累计委托贷款的余额为4,000万元,占公司2017年经审计净资产的1.78%。

七、公司已提供委托贷款的逾期情况

截至本公告日,公司不存在提供委托贷款逾期的情况。

八、备查文件

1、委托贷款相关合同。

特此公告。

四川北方硝化棉股份有限公司董事会

二〇一八年九月十四日

证券代码:002246　　证券简称:北化股份　　公告编号:2018-087

四川北方硝化棉股份有限公司2018年第五次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

一、特别提示

(一)本次会议在召开期间未增加、否决或变更提案。

(二)本次股东大会采取现场投票与网络投票相结合的表决方式进行。

二、会议召开情况

(一)会议的通知:四川北方硝化棉股份有限公司(以下简称"公司")于2018年8月28日在《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网刊登了会议通知。

(二)现场会议召开时间:2018年9月13日(星期四)下午2:50。

(三)现场会议召开地点:四川省泸州市高坝公司办公楼东楼会议室。

(四)现场会议召集人:四川北方硝化棉股份有限公司董事会。

(五)表决方式:现场投票及网络投票相结合的方式。

会议的召集和召开符合《中华人民共和国公司法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《上市公司股东大会规则》等法律法规、规范性文件及《公司章程》的有关规定。

三、会议的出席情况

(一)总体情况

参加本次股东大会现场会议和网络投票的股东及股东代理人共10名,代表股份数为245,297,318股,占公司股份总数的44.678%。其中有表决权的股份数1,628,655股,占公司股份总数的0.297%。

(二)现场会议出席情况

出席本次股东大会现场会议的股东及股东代理人5名,代表股份245,232,218股,占公司股份总数的44.666%。其中有表决权的股份数1,563,555股,占公司股份总数的0.285%。

(三)网络投票情况

通过网络投票系统进行有效表决的股东及股东代理人5名,代表股份数为65,100股,占公司股份总数的0.012%。

(四)持股5%以下(不含持股5%)的中小投资者出席会议情况

通过现场和网络参加本次会议进行有效表决的中小投资者及代理人共6名,代表股份数为1,628,655股,占公司股份总数的0.297%。

(五)公司董事长张世安先生因公务在外地出差,会议由公司董事吴树宏先生主持,公司部分董事、监事、高级管理人员及见证律师出席或列席了会议。

四、提案审议和表决情况

本次股东大会按照《四川北方硝化棉股份有限公司关于召开2018年第五次临时股东大会的通知》所列议题进行,无否决或取消提案的情况。鉴于以下议案涉及关联交易,关联股东山西新华防护器材有限责任公司、中国北方化学工业集团有限公司、西安北方惠安化学工业有限公司、泸州北方化学工业有限公司回避表决,上述股东持有243,668,663股股份回避表决。经与会股东审议,审议通过了以下议案:

(一)审议并通过了《关于调整2018年度日常关联交易预计的议案》。

表决结果:1,563,655股同意,占出席会议股东所持有效表决权股份总数的96.01%;65,000股反对,占出席会议股东所持有效表决权股份总数的3.99%;0股弃权,占出席会议股东所持有效表决权股份总数的0%。

其中,中小投资者表决情况:1,563,655股同意,占出席会议中小投资者所持有效表决权股份总数的96.01%;65,000股反对,占出席会议中小投资者所持有效表决权股份总数的3.99%;0股弃权,占出席会议中小投资者所持有效表决权股份总数的0%。

(二)审议并通过了《关于公司及其子公司使用部分闲置自有资金进行投资理财暨关联交易的议案》。

表决结果:1,563,655股同意,占出席会议股东所持有效表决权股份总数的96.01%;65,000股反对,占出席会议股东所持有效表决权股份总数的3.99%;0股弃权,占出席会议股东所持有效表决权股份总数的0%。

其中,中小投资者表决情况:1,563,655股同意,占出席会议中小投资者所持有效表决权股份总数的96.01%;65,000股反对,占出席会议中小投资者所持有效表决权股份总数的3.99%;0股弃权,占出席会议中小投资者所持有效表决权股份总数的0%。

上述议案内容详见2018年8月28日的《中国证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网。

五、律师出具的法律意见

北京市金杜律师事务所经办律师现场见证并就本公司2018年第五次临时股东大会所出具的法律意见书认为:本次股东大会的召集、召开、出席会议人员资格、表决程序等相关事宜符合法律、行政法规、规范性文件和《公司章程》的规定,股东大会表决结果合法、有效。

六、备查文件

(一)2018年第五次临时股东大会决议;

(二)法律意见书;

(三)深交所要求的其他文件。

特此公告。

四川北方硝化棉股份有限公司董事会

二〇一八年九月十四日

证券代码:600598　　证券简称:北大荒　　公告编号:2018-041

黑龙江北大荒农业股份有限公司涉诉(仲裁)案件进展公告

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。

本公司于2016年6月25日发布了黑龙江北大荒农业股份有限公司涉及诉讼(仲裁)公告(公告编号:2016-022),共披露7起案件,其中第2起案件为北大荒鑫亚经贸有限责任公司(以下简称"鑫亚公司")诉讼黑龙江农垦九三圣龙亚麻产业有限公司、北大荒青枫亚麻纺织有限公司案件,涉案金额65,014,251.70元。鑫亚公司收到一审判决后向黑龙江省高级人民法院提起上诉(公告编号:2018-002号),于2018年5月2日收到黑龙江省高级人民法院二审传票,2018年5月16日黑龙江省高级人民法院开庭审理了此案(公告编号:2018-024号)。截止目前,本案件取得新进展。根据《上海证券交易所股票上市规则》有关规定,现将本案的进展情况公告如下:

鑫亚公司于2018年9月12日收到黑龙江省高级人民法院发来的民事判决书,判决如下:

一、撤销黑龙江省农垦中级法院(2016)黑81民初3号民事判决;

二、黑龙江农垦九三圣龙亚麻产业有限公司、北大荒青枫亚麻纺织有限公司于本判决送达之日起六十日内给付北大荒鑫亚经贸有限责任公司已加工完成的L24N型长麻纱366.98吨、S20N型短麻纱23.239吨、S15N型短麻纱205.2227吨、混支纱(短麻纱)0.375吨、精络0.8113吨、联络74.1225吨、亚麻布61,405.2米。如不能给付,应折价31,161,510.60元赔偿北大荒鑫亚经贸有限责任公司的损失;

三、驳回北大荒鑫亚经贸有限责任公司的其他诉讼请求。

一审案件受理费366,871元,由北大荒鑫亚经贸有限责任公司负担183,435.50元,黑龙江农垦九三圣龙亚麻产业有限公司、北大荒青枫亚麻纺织有限公司负担183,435.50元。二审案件受理费252,050.07元,由北大荒鑫亚经贸有限责任公司负担。

上述亚麻存货成本为33,091,902.40元,已计提存货跌价准备23,495,250.70元,净值9,596,651.70元。

本判决为终审判决,因本案件于2018年8月27日判决,还未进入执行阶段,暂时无法准确判断本次诉讼对公司本期利润或期后利润的影响。

特此公告。

黑龙江北大荒农业股份有限公司

董事会

二〇一八年九月十四日

股票代码:600372　　股票简称:中航电子　　编号:临2018 - 040

中航航空电子系统股份有限公司关于公司董事辞职的公告

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。

中航航空电子系统股份有限公司(以下简称"公司")董事会于2018年9月13日收到董事唐军先生、刘慧先生提交的书面辞职报告。因工作变动原因,唐军先生申请辞去公司董事职务,刘慧先生申请辞去公司董事及董事会下设关联交易委员会、审计委员会委员职务。根据相关规定,上述辞职申请自送达公司董事会之日起生效。

此次董事辞职不会导致公司董事会人数低于法定最低人数,不会影响董事会的正常运作和公司的日常生产经营。公司将根据《公司法》及《公司章程》的有关规定,尽快完成选举公司董事及后续相关工作。

唐军先生、刘慧先生在担任公司董事期间勤勉尽责,公司董事会对唐军先生、刘慧先生在任职期间为公司做出的贡献表示衷心的感谢!

特此公告。

中航航空电子系统股份有限公司

董　事　会

2018年9月13日

股票代码:600372　　股票简称:中航电子　　编号:临2018 —041

中航航空电子系统股份有限公司关于公司监事辞职的公告

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。

中航航空电子系统股份有限公司(以下简称"公司")监事会于2018年9月13日收到公司非职工代表监事顾荣芳女士、张予安先生,以及职工代表监事武兴全先生的书面辞职报告,顾荣芳女士、张予安先生因工作变动原因提请辞去其担任的非职工代表监事职务,武兴全先生因工作变动原因提请辞去其担任的职工代表监事职务。

根据《公司法》及《公司章程》的有关规定,此次监事辞职将导致公司第六届监事会成员低于法定最低人数,顾荣芳女士、张予安先生、武兴全先生的辞职申请将自公司股东大会选举产生新任监事填补其空缺后生效,在改选的监事就任前,顾荣芳女士、张予安先生、武兴全先生将继续履行其监事职责,不会影响监事会的正常运作和公司的日常生产经营。公司将根据《公司法》及《公司章程》的有关规定,尽快完成选举公司监事及后续相关工作。

顾荣芳女士、张予安先生、武兴全先生在担任公司监事期间勤勉尽责,公司监事会对顾荣芳女士、张予安先生、武兴全先生在任职期间为公司做出的贡献表示衷心的感谢!

特此公告。

中航航空电子系统股份有限公司监事会

2018年9月13日