证券代码:603722　证券简称:阿科力　公告编号:2018-068

无锡阿科力科技股份有限公司首次公开发行股票部分限售股上市流通提示性公告

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。

重要内容提示:

●本次限售股上市流通数量为19,030,000股

●本次限售股上市流通日期为2018年10月25日

一、本次限售股上市类型

经中国证券监督管理委员会《关于核准无锡阿科力科技股份有限公司首次公开发行股票的批复》(证监许可[2017]1721号)核准,无锡阿科力科技股份有限公司(以下简称"公司"或"阿科力")公开发行人民币普通股(A股)2,170万股,并于2017年10月25日在上海证券交易所挂牌上市。本次发行后,公司总股本增加至86,700,000股,其中有限售条件股份为65,000,000股,无限售条件股份为21,700,000股。

公司本次申请上市的限售股属于首次公开发行限售股,涉及尤卫民、陈昱、何旭强、中山联动第一期股权投资中心(有限合伙)(以下简称"中山联动")、无锡金投产业升级股权投资基金企业(有限合伙)(以下简称"无锡金投")、甘源、黄健伟、张文泉、上海艾朋投资合伙企业(有限合伙)(以下简称"上海艾朋")、巴小昂、董永辉、上海中汇金玖三期创业投资基金合伙企业(有限合伙)(以下简称"中汇金玖")、丛远明、常俊、陆敏、徐杰、倪卫东共17名股东。上述股东承诺的股份锁定期为公司股票上市之日起12个月,共持有限售股19,030,000股。

二、本次限售股形成后至今公司股本数量变化情况

本次限售股形成后,公司未发生因分配、公积金转增导致股本数量变化的情况。

三、本次限售股上市流通的有关承诺

本次申请解除股份限售的股东有尤卫民、陈昱、何旭强、中山联动第一期股权投资中心(有限合伙)、无锡金投产业升级股权投资基金企业(有限合伙)、甘源、黄健伟、张文泉、上海艾朋投资合伙企业(有限合伙)、巴小昂、董永辉、上海中汇金玖三期创业投资基金合伙企业(有限合伙)、丛远明、常俊、陆敏、徐杰、倪卫东共17名股东。上述股东承诺的股份锁定期为公司股票上市之日起12个月,共持有限售股19,030,000股。

上述股东在公司《首次公开发行股票招股说明书》中,所做的承诺如下:

1、公司股东陈昱、何旭强、甘源、黄健伟、巴小昂、董永辉、从远明、徐杰、倪卫东9名自然人及中山联动第一期股权投资中心(有限合伙)、无锡金投产业升级股权投资基金企业(有限合伙)、上海艾朋投资合伙企业(有限合伙)、上海中汇金玖三期创业投资基金合伙企业(有限合伙)4位非自然人承诺:所持有的公司公开发行股份前已发行的股份,自股票上市之日起12个月内,不转让或者委托他人管理所持有的公司股份,也不由公司回购该等股份。如违反关于股份锁定的相关承诺,应将出售股份而取得的收益(转让所得扣除税费后的金额)上缴给发行人。

2、作为发行人董事、监事、高级管理人员并持有发行人股份的尤卫民、张文泉、常俊、陆敏(离任)承诺:1、自发行人股票上市之日起十二个月内,不转让或者委托他人管理本人持有的发行人的股份,也不由发行人回购该部分股份;不在该部分股份之上设定担保或其他足以影响本人充分行使基于该部分股份所产生之权益的限制;2、本人担任发行人高级管理人员(或董事)期间,每年转让的股份不超过本人直接和间接持有发行人股份总数的百分之二十五;自离职后半年内,不转让本人直接和间接持有的发行人股份;3、直接或间接持有的发行人股票在锁定期满后两年内减持的,减持价格不低于发行价;发行人上市后六个月内如发行人股票连续二十个交易日的收盘价均低于发行价,或者上市后六个月期末收盘价低于发行价,持有发行人股票的锁定期限自动延长六个月(若发行人股票在此期间发生派息、送股、资本公积转增股本等除权除息事项的,发行价应相应调整)。如本人违反关于股份锁定的相关承诺,应将出售股份而取得的收益(转让所得扣除税费后的金额)上缴给发行人。本人不会因职务变更、离职等原因而放弃履行上述承诺。如未来相关监管规则发生变化,本承诺载明事项将相应修订,修订后的承诺事项亦应满足届时监管规则的要求。

截至本公告披露日,上述股东均严格履行了股份锁定承诺,不存在相关承诺未履行而影响本次限售股上市流通的情况。

四、中介机构核查意见

保荐机构光大证券股份有限公司认为:阿科力本次限售股份上市流通符合《首次公开发行股票并上市管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》及《上海证券交易所上市公司持续督导工作指引》等相关法律法规和规范性文件的要求;本次限售股份解除限售数量、上市流通时间符合有关法律法规、部门规章等规定和股东承诺;本次解除限售股份股东严格履行了其在公司首次公开发行股票中做出的股份锁定承诺;截至本核查意见出具之日,公司与本次限售股份相关的信息披露真实、准确、完整。保荐机构对阿科力本次限售股份解禁上市流通事项无异议。

五、本次限售股上市流通情况

本次限售股上市流通数量为19,030,000股;

本次限售股上市流通日期为2018年10月25日;

首发限售股上市流通明细清单

序号	股东名称	持有限售股数量(单位:股)	持有限售股占公司总股本比例	本次上市流通数量(单位:股)	剩余限售股数量(单位:股)
1	尤卫民	2,900,000	3.34%	2,900,000	0
2	陈昱	2,000,000	2.31%	2,000,000	0
3	何旭强	2,000,000	2.31%	2,000,000	0
4	中山联动	2,000,000	2.31%	2,000,000	0
5	无锡金投	2,000,000	2.31%	2,000,000	0
6	甘源	1,820,000	2.10%	1,820,000	0
7	黄健伟	1,380,000	1.59%	1,380,000	0
8	张文泉	1,020,000	1.18%	1,020,000	0
9	上海艾朋	1,000,000	1.15%	1,000,000	0
10	巴小昂	700,000	0.81%	700,000	0
11	董永辉	600,000	0.69%	600,000	0
12	中汇金玖	500,000	0.58%	500,000	0
13	丛远明	400,000	0.46%	400,000	0
14	常俊	360,000	0.42%	360,000	0
15	陆敏	155,000	0.18%	155,000	0
16	徐杰	120,000	0.14%	120,000	0
17	倪卫东	75,000	0.09%	75,000	0
合计		19,030,000	21.95%	19,030,000	0

六、股本变动结构表

单位:股		本次上市前	变动数	本次上市后
有限售条件的流通股份	1、其他境内法人持有股份	5,500,000	-5,500,000	-
	2、境内自然人持有股份	59,500,000	-13,530,000	45,970,000
	有限售条件的流通股份合计	65,000,000	-19,030,000	45,970,000
无限售条件的流通股份	A股	21,700,000	19,030,000	40,730,000
	无限售条件的流通股份合计	21,700,000	19,030,000	40,730,000
股份总额		86,700,000	-	86,700,000

七、上网公告附件

《光大证券股份有限公司关于无锡阿科力科技股份有限公司首次公开发行股票部分限售股解禁上市流通的核查意见》。

特此公告。

无锡阿科力科技股份有限公司董事会
2018年10月19日

证券代码:603722　证券简称:阿科力　公告编号:2018-069

无锡阿科力科技股份有限公司关于使用部分闲置募集资金进行现金理财的进展公告

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。

无锡阿科力科技股份有限公司(以下简称"公司")于2018年4月16日召开第二届董事会第十五次会议、第二届监事会第十一次会议审议通过了《关于使用部分闲置募集资金进行现金理财的议案》。为了提高公司闲置募集资金使用率,增加公司现金资产收益,实现股东利益最大化,在确保募投项目运作资金需求、有效控制投资风险的情况下,拟使用最高额度不超过8,000万元人民币的暂时闲置募集资金购买安全性高的保本型理财产品,该额度在股东大会审议通过之日起12个月内可以滚动使用,并授权董事长在上述额度内组织实施。具体内容详见公司与2018年4月18日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站披露的《关于使用部分闲置募集资金进行现金理财的议案》(公告编号:2018-023)。

一、使用部分闲置募集资金进行现金理财到期赎回的情况

序号	受托方	产品名称	产品类型	投入金额	起止期限	预期年化收益率	赎回金额	实际收益
1	招商证券股份有限公司	招商证券收益凭证一"磐石"618期本金保障型收益凭证	本金保障型固定利率收益凭证	2,000万元人民币	2018年7月5日至2018年10月15日	4.35%	2,000万元人民币	243,123.29元人民币

说明:公司与招商证券股份有限公司不存在关联关系。

二、本次使用部分闲置募集资金进行理财的实施情况

序号	受托方	产品名称	产品类型	金额	起息日	到期日	期限	预期年化收益率
1	中国银行股份有限公司无锡锡山支行	人民币挂钩型结构性存款	保证收益型	2,000万元人民币	2018年10月18日	2018年11月23日	36天	3.0%-3.4%

说明:公司与中国银行股份有限公司不存在关联关系。

三、截至本公告日公司使用部分闲置募集资金进行现金理财未到期产品的情况

序号	受托方	产品名称	产品类型	金额	起息日	到期日	期限	预期年化收益率
1	中国银行股份有限公司无锡锡山支行	人民币挂钩型结构性存款	保证收益型	2,000万元人民币	2018年10月18日	2018年11月23日	36天	3.0%-3.4%

说明:公司与中国银行股份有限公司不存在关联关系。

四、理财产品的安全性及公司风险控制措施

1、严格筛选投资对象,选择信誉好、规模大、有能力保障资金安全,经营效益好、资金运作能力强的单位所发行的产品。

2、公司将实时分析和跟踪产品的净值变动情况,如评估发现存在可能影响公司资金安全的风险因素,将及时采取相应措施,控制投资风险。

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。

4、及时履行信息披露义务。公司将按照《上海证券交易所股票上市规则》等相关规定及时履行信息披露义务。

五、对公司日常经营的影响

公司坚持规范运作,保值增值、防范风险,确保不影响募投项目的正常进行的前提下,使用闲置募集资金委托现金理财,不会影响公司主营业务的正常开展,同时可以提高闲置募集资金使用效率,获得一定的投资收益,为公司股东谋取更多的投资回报。

六、理财产品的总金额

截至公告日,累计使用闲置募集资金2,000万元人民币投资保本型理财产品。

七、备查文件

1、中国银行股份有限公司理财产品总协议书。

无锡阿科力科技股份有限公司董事会
2018年10月19日

证券代码:603722　证券简称:阿科力　公告编号:2018-070

无锡阿科力科技股份有限公司关于使用闲置自有资金进行委托理财到期赎回并继续进行委托理财的公告

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。

无锡阿科力科技股份有限公司(以下简称"公司")于2017年12月13日召开2017年第三次临时股东大会审议通过了《关于使用闲置自有资金进行委托理财的议案》。在满足公司运营资金需要的前提下,为提高资金使用效率和资金收益水平,为公司及股东谋取更多收益,根据自有资金的情况和银行理财产品的市场状况,对最高额度不超过10,000万元的闲置自有资金进行委托理财,在确保不影响公司日常运营的情况下在董事会审议通过之日起12个月内滚动使用,并授权公司总经理在上述额度内组织实施。具体内容详见公司与2017年11月22日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》及上海证券交易所网站披露的《关于使用闲置自有资金进行委托理财的公告》(公告编号:2017-011)。

一、使用闲置自有资金进行委托理财到期赎回的情况

序号	受托方	产品名称	产品类型	投入金额	起止期限	预期年化收益率	赎回金额	实际收益
1	宁波银行股份有限公司无锡太湖新城支行	单位结构性存款	保本浮动型	1,000万元人民币	2018年7月16日至2018年10月17日	4.20%	1,000万元人民币	107,013.70元人民币

说明:公司与宁波银行股份有限公司不存在关联关系。

二、本次使用闲置自有资金进行委托理财的实施情况

序号	受托方	产品名称	产品类型	金额	起息日	到期日	期限	预期年化收益率
1	宁波银行股份有限公司无锡太湖新城支行	单位结构性存款	保本浮动型	1,000万元人民币	2018年10月18日	2018年12月18日	61天	3.60%
2	中国银行股份有限公司无锡锡山支行	人民币挂钩型结构性存款	保证收益型	1,000万元人民币	2018年10月18日	2018年12月21日	64天	3.00%

说明:公司与宁波银行股份有限公司不存在关联关系。

三、截至本公告日公司使用闲置自有资金进行委托理财未到期产品的情况

序号	受托方	产品名称	产品类型	金额	起息日	到期日	期限	预期年化收益率
1	中信银行股份有限公司无锡五爱支行	共赢利率结构21586期人民币结构性存款	保本浮动收益、封闭式	1,000万元人民币	2018年8月31日	2018年12月12日	103天	4.20%
2	中国银行股份有限公司无锡锡山支行	中银保本理财-人民币按期开放	保证收益型	3,000万元人民币	2018年9月26日	2018年12月27日	93天	3.90%
3	中国银行股份有限公司无锡锡山支行	中银保本理财-人民币按期开放	保证收益型	2,000万元人民币	2018年9月29日	2018年11月6日	38天	2.85%
4	宁波银行股份有限公司无锡太湖新城支行	单位结构性存款	保本浮动型	1,000万元人民币	2018年10月11日	2018年12月11日	61天	3.70%
5	宁波银行股份有限公司无锡太湖新城支行	单位结构性存款	保本浮动型	1,000万元人民币	2018年10月18日	2018年12月18日	61天	3.60%
6	中国银行股份有限公司无锡锡山支行	人民币挂钩型结构性存款	保证收益型	1,000万元人民币	2018年10月18日	2018年12月21日	64天	3.00%

说明:公司与中国银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司不存在关联关系。

四、委托理财产品的安全性及公司风险控制措施

1、严格筛选投资对象,选择信誉好、规模大、有能力保障资金安全,经营效益好、资金运作能力强的单位所发行的产品。

2、公司将实时分析和跟踪产品的净值变动情况,如评估发现存在可能影响公司资金安全的风险因素,将及时采取相应措施,控制投资风险。

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。

4、及时履行信息披露义务。公司将按照《上海证券交易所股票上市规则》等相关规定及时履行信息披露义务。

五、对公司日常经营的影响

公司坚持规范运作,保值增值、防范风险,确保不影响公司正常运营的前提下,使用闲置自有资金委托理财,不会影响公司主营业务的正常开展,同时可以提高公司资金使用效率,获得一定的投资收益,为公司股东谋取更多的投资回报。

六、理财产品的总金额

截至公告日,公司使用闲置自有资金9,000万元人民币投资保本型理财产品,未超过董事会及股东大会对公司使用闲置自有资金进行委托理财的批准投资额度。

七、备查文件

1、中国银行股份有限公司理财产品总协议书

2、宁波银行股份有限公司单位结构性存款产品协议

3、中信银行股份有限公司理财产品总协议

无锡阿科力科技股份有限公司董事会
2018年10月19日

股票简称:凯盛科技　证券代码:600552　公告编号:2018-048

凯盛科技股份有限公司关于回购并注销2017年业绩承诺补偿股份实施结果及股份变动的公告

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。

●本次业绩承诺补偿应回购股份3,165,569股,已全部完成回购

●公司总股本由767,049,572股变更为763,884,003股

●已回购股份对应的2016年度现金分红已全部返还公司

一、回购审批情况

2015年经中国证券监督管理委员会核准,凯盛科技股份有限公司(以下简称"公司")实施完成重大资产重组,通过发行股份和支付现金的方式收购欧木兰、苏俊扶、梁诗豪、新余市昌讯投资发展有限公司、郑琦林、冯国寅、唐铸、欧严、深圳市创新投资集团有限公司、深圳市龙岗创新投资有限公司、广东红土创业投资有限公司、深圳市星河投资有限公司、深圳市中企汇创业投资有限公司、深圳市一德兴业创业投资有限公司、广州红土科信创业投资有限公司持有的深圳市国显科技有限公司(以下简称"国显科技")75.58%的股权,并且与欧木兰、苏俊扶、梁诗豪、新余市昌讯投资发展有限公司、郑琦林、唐铸、欧严(以下简称"业绩补偿方")签订了《盈利预测补偿协议》以及《利润预测补偿协议之补充协议》(以下合并简称"补偿协议")。因重大资产重组标的资产2017年度实现的归属于母公司所有者的扣除非经常性损益后的净利润未达到相关承诺数,公司根据《补偿协议》的约定,以1元的总价回购业绩补偿方在重大资产重组中取得的3,165,569股本公司股票并注销。

公司于2018年4月18日、2018年5月11日分别召开第六届董事会第二十四次会议、2017年年度股东大会,先后审议通过了《关于回购公司重大资产重组标的资产未完成业绩承诺对应股份并注销的议案》,并于2018年5月12日发布了《关于回购注销业绩补偿股份的债权人通知暨减资公告》(详见公司2018-018号公告),将本次回购注销股份的情况通知债权人。

二、回购实施情况

本次实施回购业绩补偿方持有的公司股份3,165,569股,回购总价款为人民币1.00元。公司已于2018年10月18日取得中国证券登记结算有限责任公司上海分公司出具的《过户登记确认书》。

三、回购期间相关主体买卖股票情况

基于对公司未来发展的信心及对公司长期投资价值的认可:公司间接控制人凯盛科技集团有限公司于2018年5月3日、2018年6月11日通过上海证券交易所集中竞价交易系统分别增持了公司股份4,863,275股、2,790,450股,累计增持公司股份7,653,725股,占公司总股本的0.998%(详见公司公告2018-016号、2018-022号);公司董事、监事、高级管理人员自本公司披露回购注销股份公告之日起至今通过上海证券交易所集中竞价交易系统合计增持公司股票1,554,800股,占公司总股本的0.203%。

除上述增持情况外,自本公司披露回购注销股份公告之日起至本公告披露前一日,公司董事、监事、高级管理人员、控股股东及其一致行动人、实际控制人在回购期间均不存在减持公司股票的情况。

四、股份注销安排

经公司申请,公司将于2018年10月19日在中国登记结算有限责任公司上海分公司注销所回购股份,并及时办理工商变更登记手续等相关事宜。

五、股份变动报告

单位:股

股份类别	回购前		本次回购股份总数	回购完成后	
	股份数	比例(%)		股份数	比例(%)
有限售条件流通股份	26,155,552	3.41	2,254,518	23,901,034	3.13
无限售条件流通股份	740,894,020	96.59	911,051	739,982,969	96.87
总股本	767,049,572	100	3,165,569	763,884,003	100

特此公告。

凯盛科技股份有限公司董事会
2018年10月19日

证券代码:600572　证券简称:康恩贝　公告编号:临2018-099

浙江康恩贝制药股份有限公司关于第一期员工持股计划存续期届满自行终止的公告

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。

浙江康恩贝制药股份有限公司(以下简称:公司、康恩贝)于2016年7月28日召开的公司八届董事会2016年第五次临时会议和2016年8月19日召开的公司2016年第三次临时股东大会审议通过了《关于《浙江康恩贝制药股份有限公司第一期员工持股计划(草案)》及其摘要》的议案》,同意公司实施第一期员工持股计划(以下简称"本员工持股计划"、"本计划")。

公司第一期员工持股计划委托长江证券(上海)资产管理有限公司(简称:长江资管)管理,具体由长江资管设立康恩贝1号专项资产管理集合计划(以下简称:资管计划)实施操作与管理,资管计划筹集资金总额共30,000万元人民币,按照不超过1:1的比例设立优先级份额和进取级份额,员工持股计划中的员工出资15,000万元认购全部的进取级份额,同时募集了15,000万元认购优先级份,资管计划实际到位资金总额30,000万元。该资管计划已按规定备案。

2017年1月25日,公司第一期员工持股计划完成康恩贝股票的购买计划。公司第一期员工持股计划通过资管计划以竞价交易方式(二级市场)累计买入康恩贝股票41,246,137股,成交金额为人民币295,604,464.34元,成交均价约为人民币7.17元/股(经2016年、2017年分红除权后均价6.90元/股),买入股票数量占公司当时总股本251,073万股的1.64%(具体内容详见2017年1月16日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报、上海证券交易所网站www.sse.com.cn上的临2017-006《公司关于公司第一期员工持股计划完成股票购买的公告》)。

根据《浙江康恩贝制药股份有限公司第一期员工持股计划(草案)》,第一期员工持股计划的存续期不超过24个月,自股东大会审议通过该员工持股计划之日起算,即2016年8月19日至2018年8月18日止。考虑证券市场现况和公司2018年半年报披露后距离员工持股计划存续期满时间较接近等原因,按原存续期届满前较难全部出售变现,同时考虑到资管计划的到期情况,经2018年8月1日召开的公司第一期员工持股计划持有人会议和2018年8月6日召开的公司第九届董事会第四次会议审议通过,同意将公司第一期员工持股计划存续期限延长至2018年10月18日(具体内容详见2018年8月8日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报、上海证券交易所网站www.sse.com.cn上的临2018-066《关于延长公司第一期员工持股计划存续期的公告》)。

由于今年8月8日以来,公司因筹划重大事项(诸如9月上旬筹划提出股票期权激励计划,9月中旬筹划提出回购公司股份预案等事项)的窗口期交易限制,进入10月份又是公司2018年三季报窗口期交易限制,同时受近期以来国内股市状况影响,截止2018年9月28日及本公告日,公司员工持股计划委托长江资管管理的资管计划所持康恩贝股票已出售27,352,000股,仍持有康恩贝股票13,894,137股。根据《浙江康恩贝制药股份有限公司第一期员工持股计划(草案)》的相关规定,本员工持股计划在2018年10月18日存续期满后自行终止,员工持股计划存续期在届满或终止之日起15个工作日内(规定的窗口期日除外)完成清算,并按持有人持有的份额进行分配;若员工持股计划届满时,长江资管康恩贝1号集合资产管理计划所持资产仍包含标的股票,具体处置办法由员工持股计划管理委员会与资产管理机构(长江资管)协商确定。本计划管理委员会与资产管理机构将协商确定剩余部分公司股票的具体处置办法,并将在存续期届满后按照公司员工持股计划(草案)和资管计划的有关规定完成清算,并按相关约定分配剩余资产。

特此公告。

浙江康恩贝制药股份有限公司董事会
2018年10月19日

(上接B66版)

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
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
联系人:黎明
经办律师:吕红、黎明

(四)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号普华永道中心11楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:朱宏宇
经办注册会计师:薛竞、朱宏宇

四、基金的名称

本基金名称:交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

本基金精选具有长期增长潜力和较好分红能力的股票,以及具有较高息票率的债券,力争实现基金资产的长期增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法上市的股票(含中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、债券、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

本基金的投资组合比例为:股票、权证等权益类资产占基金资产净值的30%-70%,其中权证的投资比例不超过基金资产净值的3%;债券、资产支持证券、货币市场工具、银行存款等固定收益类资产和现金不低于基金资产净值的30%,其中现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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调整投资范围。

八、基金的投资策略

本基金精选具有较好现金分红能力、长期增长潜力且估值水平合理的上市公司以及具有较高息票率的债券,通过在股票和债券等不同类别资产中的平衡配置,追求基金资产在风险可控前提下的持续增值,充分享受股票分红和债券利息的双重收益。

1、资产配置策略

本基金的大类资产配置采取在股票和债券等不同类别资产进行平衡配置的策略,并在基金合同约定的资产配置范围内以投资时钟理论为指导,通过对经济周期所处的发展阶段及其趋势的分析和判断以及不同资产类别的预期表现,对基金资产配置进行动态调整。

在资产配置过程中,本基金对于经济周期的判断主要通过分析经济增长与通货膨胀的方向性变化实施。对于中长期的经济波动,本基金重点考察社会需求结构变化进而带动产业或行业结构变迁条件下经济增长与通货膨胀之间的演绎关系。如分析居民收入与财富增长的结构性变化、新兴技术的出现、出口结构的变化、政府政策鼓励等;在中短期内,产业或行业发展相对稳定、经济周期调整更多地体现为实体经济运行中需求与成本的阶段性波动,此时,本基金将重点考察经济领域各宏观经济指标的变动及其趋势。通过经济运行周期以及不同阶段内经济运行特征的分析判断,本基金将结合证券市场投资价值综合评估的结果,确定一定阶段内的类别资产配置比例及其调整方向。

2、股票投资策略

本基金的股票资产主要投资于具有较好现金分红能力、长期增长潜力且估值水平合理的上市公司的股票。本基金采取定性和定量相结合的方法,对上市公司分红能力、分红意愿和分红预期等因素进行综合考察和筛选,并辅以投资价值评价,通过深入的调查研究,挖掘上市公司的价值,合理降低投资风险,实现基金资产的长期、稳定增值。

(1)品质筛选

筛选出在公司治理、财务及管理品质上符合基本品质要求的上市公司,构建备选股票池,主要筛选指标包括:盈利能力指标、经营效率指标和财务状况指标。

(2)现金分红能力和估值水平评估

在上述品质筛选的基础上,本基金采取定性和定量的方法对备选股票进行综合分析,通过综合分析上市公司分红历史和分红预期等因素对上市公司的现金分红能力进行评估,在优选红利股票的同时,本基金将注重考查具有长期增长潜力的公司;

1)定量分析指标主要包括分红能力指标、分红意愿指标、估值水平指标等。

分红能力指标包括盈利能力指标(如ROE,ROA等)和现金流指标(如经营性现金支出/折旧、自由现金流/销售等)。

分红意愿指标包括股息支付比例、股利分配率等。

估值水平指标包括市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市价现金流比率(P/CF)等。

2)定性分析主要集中于对公司基本面因素,本基金将重点考察上市公司的治理结构、盈利持续性和财务稳定性等因素,深入挖掘上市公司的潜在价值。定性分析时重点关注具有以下特征的优质公司:

①所处行业具有良好的行业发展空间;

②具有良好公司治理结构,公司注重股东回报,管理层能力较强,内部运作机制顺畅;

③已建立起市场化经营机制、决策效率高、对市场变化反应灵敏;

④行业地位突出,具有较强的核心竞争力,并具有与行业竞争结构相适应的、清晰的竞争战略;

⑤在行业内拥有成本优势、规模优势、品牌优势、技术优势或其它特定优势,公司主要业务或产品市场份额处于行业前列;

⑥财务稳健,经营效率及盈利能力较强等。

(3)股票选择及组合优化

本基金将综合定性分析与定量价值评估的结果,精选估值合理或被低估以及具有上升潜力和投资价值的股票构建股票投资组合,并根据股票的预期收益与风险水平对投资组合进行优化。

3、债券投资策略

本基金的债券资产主要投资于信用债,包括金融债(不含政策性金融债)、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、可转换债券及分离交易可转债、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类金融工具。

债券投资方面,本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将规范化的基本面研究、严谨的信用分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,自上而下决定债券组合久期及债券类属配置;在严谨深入的信用分析基础上,综合考量信用债券的信用评级,以及各类债券的流动性、供求关系和收益率水平等,自下而上地精选个券。

(1)久期管理策略

在全球经济的框架下,本基金管理人对宏观经济运行趋势及其引致的财政货币政策变化做出判断,密切跟踪CPI、PPI、汇率、M2等利率敏感指标,运用数量化工具,对未来市场利率趋势进行分析与预测,并据此确定合理的债券组合目标久期,通过合理的久期控制实现对利率风险的有效管理。

(2)债券的类属配置

本基金定性和定量地分析不同类属债券类资产的信用风险、流动性风险及其经风险调整后的收益率水平或盈利能力,通过比较或合理预期不同类属债券类资产的风险与收益率变化,确定并动态地调整不同类属债券类资产间的配置比例。

(3)信用债券投资策略

信用债券同时承载了利率风险与信用风险,而信用风险对信用债券表现的影响胜于利率风险。具体而言,本基金信用债券的投资遵循以下流程:

①信用债券研究

信用分析师通过系统的案头研究、走访发行主体、咨询发行中介等各种形式,"自上而下"地分析宏观经济运行趋势、行业(或产业)经济前景,"自下而上"地分析发行主体的发展前景、偿债能力、国家信用支撑等。通过交银施罗德的信用债券信用评级指标体系,对信用债券进行信用评级,并在信用评级的基础上,建立本基金的信用债券池。

②信用债券投资

本基金从信用债券池中精选债券构建信用债券投资组合,主要考虑以下因素:

a.信用债券信用评级的变化。

b.不同信用等级的信用债券,以及同一信用等级不同标的债券之间的信用利差变化。

(4)资产支持证券(含资产收益计划)投资策略

本基金将通过宏观经济、提前偿还率、资产池结构及资产池资产所在行业景气变化等因素的研究,预测资产池未来现金流变化;研究标的证券发行条款、预测提前偿还率变化对标的证券的久期与收益率的影响,同时密切关注流动性对标的证券收益率的影响。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,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

(5)可转换债券投资策略

可转换债券是介于股票和债券之间的投资品种,兼具股性和债性的双重特征。

本基金对于可转换债券投资的研究将完全依托于公司投研团队对标的股票的研究,在此基础上量化投资部利用可转换债券定价模型,充分考虑转债发行后目标转债标的股票股价波动率可能出现的变化,对目标转债的股性进行合理定价。

对于本基金可转换债券债性的研究,将引进公司信用债券信用评级指标体系,对可转换债券的发行主体及标的债券进行信用评级,并在信用评级的基础上对其进行合理定价。

通过对标的转债股性与债性的合理定价,力求寻找出被市场低估的品种,构建本基金可转换债券的投资组合。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为50%×中证红利指数收益率+50%×中债综合全价指数收益率

中证红利指数挑选在上海证券交易所和深圳证券交易所上市的现金股息率高、分红比较稳定、具有一定规模及流动性的100只股票作为样本,以反映A股市场红利股票的整体状况和走势。该指数具有较好的权威性、市场代表性,作为衡量本基金股票投资部分业绩的比较基准,较为合适。

中债综合全价指数综合反映了债券市场整体价格和回报情况,是目前市场上较为权威的反映债券市场整体走势的基准指数之一。该指数合理、透明、公开,具有较好的市场接受度,作为衡量本基金债券投资部分业绩的比较基准,较为合适。

考虑到本基金的投资比例及各投资对象价格的变动对基金净值的不同影响,本基金对上述两个基准指数按照目标资产配置比例分配权重,作为综合衡量本基金投资业绩的比较基准。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者今后法律法规发生变化,又或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的指数,则本基金管理人可与基金托管人协商一致,调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金是一只混合型基金,在证券投资基金中属于较高风险的品种,其长期平均风险和预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

十一、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。

本基金托管人中国农业银行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。

本报告财务数据截至2018年6月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

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	893,187,599.80	60.83
	其中:股票	893,187,599.80	60.83
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	447,783,493.43	30.50
	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	122,406,402.54	8.34
8	其他各项资产	4,854,747.19	0.33
9	合计	1,468,232,242.96	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	14,618,682.50	1.01
C	制造业	220,174,421.54	15.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	71,559.85	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	96,474,985.38	6.68
G	交通运输、仓储和邮政业	42,938,317.25	2.97
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	338,052,407.66	23.40
J	金融业	-	-
K	房地产业	26,858,409.00	1.86
L	租赁和商务服务业	17,085,895.20	1.18