

(上接B14版)

本基金通过量化统计模型,建立企业成长因子库,根据历史表现,将直接反映超额收益的成长因子作为本基金的投资因子。本基金的成长因子主要包括主营业务增长率、净利润增长率等。

① 投资业绩考核
 主营业务增长率=(本期主营业务收入-上期主营业务收入总额/上期主营业务收入总额)×100%
 该指标通常是公司利润增长的先导指标,是分析公司投资价值的重要指标。主营业务收入增长率在一定程度上随着市场占有率的上升,这是公司竞争力提高的重要体现,体现了公司的持续增长能力。

② 净利润增长率
 净利润增长率=(本期净利润/上期净利润)/上期净利润
 该指标反映的是企业实际价值最大化扩张速度,是反映公司成长状况和发展能力的重要指标。

③ 因子阿尔法模型
 “多因子阿尔法模型”计算每只股票的因素因子得分,并挑选得分最高的若干只个股构建投资组合,每隔一段时间,将重新计算个股因子得分,并以新得分作为依据对股票投资组合进行调整,始终保持组合中个股具有相对较高的分值。在挑选多因子模型的过程中,最大化评估基金的投资业绩,而这是以达到模型的有效性为最大量。

④ 定性分析主要依据基本的财务、TMT产业的上市公司包含很多一般意义的行业,其发展阶段也有所不同,在不同的精选下,本基金将着重选择那些产品已经过前期的技术和产业准备、下游需求在政策刺激下将大幅增长、具有良好业绩成长性、市值合理的上市公司。因此,本基金将在上市公司成长性、科技研发能力、估值水平等方面对TMT产业的上市公司进行筛选分析。

⑤ 成长性:本基金通过对上市公司成长性分析包括定量及定性两方面。在定量的分析方法上,主要参考主营业务收入增长率、主营业务净利润增长率、净资产收益率(ROE)、毛利率等成长性指标。在实际操作中,本基金并不拘泥于单一成长性指标,而是将成长性上市公司的基本面,最大程度地筛选出具有持续增长潜力的优质上市公司。此外,在对上市公司成长性的定性分析上,本基金将通过企业成长能力、盈利能力、重点行业成长前景、行业地位、用户获取习惯、产品前景、盈利能力和财务结构等方面进行研判。

⑥ 科技研发能力:本基金将选择那些产品具有较高科技含量或公司具有较强技术开发能力的上市公司,考虑的因素包括:产品技术含量、技术开发前景、技术成熟程度、研发投入强度、配套政策支持、科研成果转化的经济效益等。

⑦ 公司治理结构:公司治理结构的评估包括上市公司经营管理层面的组织和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察,包括对上市公司和控股公司的治理和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察,包括对上市公司和控股公司的治理和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察,包括对上市公司和控股公司的治理和制度上的灵活性、完整性和规范性的全面考察。

⑧ 估值水平分析
 基金经理将对科技主题上的上市公司给予估值分析,并结合行业地位分析,优选出具有盈利持续稳定增长、价值低估且在未来自上市公司具有领先优势的上市公司股票进行投资。本基金采用的估值方法包括市盈率法(P/E)、市净率法(P/B)等。

⑨ 债券投资策略
 本基金的债券投资采取稳健的投资管理方式,获得与风险相匹配的投资收益,以实现在一定程度上规避股票市场的系统性风险和保证基金资产的流动性。本基金通过分析宏观经济形势和市场利率变化趋势,把握债券市场整体走势,动态调整投资组合,力争实现基金资产的长期增值。在资产配置上,本基金将根据市场利率变化,动态调整投资组合,力争实现基金资产的长期增值。

⑩ 风险管理
 本基金在投资管理上,本基金通过对未来基金收益的预测进行风险预算,及时足额计提基金运作中的流动性风险。

⑪ 其他事项
 (1)国家有关法律法规和基金合同的有关规定;

(2)公司投资及风险控制政策;
 (3)宏观经济发展态势、证券市场运行环境和走势,以及上市公司的基本面;
 (4)投资对象的预期收益和预期风险的匹配关系,本基金将在承担适度风险的范围内,选取收益风险配比最佳品种进行投资。

2. 投资决策机制
 本基金投资决策基本原则是根据基金的投资目标、投资理念以及范围等因素,制定基金投资策略。本基金采用投资团队分级负责制投资决策方式。本基金基金经理是基金投资决策的重要成员,一方面积极参与投资团队的投资研究工作,另一方面在公司授权下主动行使投资决策管理职责。

① 投资决策流程
 本基金主要通过包括本基金投资决策委员会在内的共同努力来争取良好的投资业绩,在投资过程中采取分级授权的投资决策机制,对于不同的投资规模的决策程序有所不同,力争实现基金资产在合理控制投资风险的前提下稳定增值。

② 资产配置策略的形成
 基金经理在内外研究平台的支持下,对不同类别的大类资产的收益风险状况作出判断,公司的策略研究员提供宏观经济分析和策略建议,行业研究员提供行业和个股投资建议,债券研究员提供债券和市场工具的投资建议,数量研究员提供本基金基金的产品定位和风险控制要求提供资产配置的建议。基金经理结合自己的分析判断和研究团队的投资建议,根据基金的投资目标、投资理念和投资范围拟定大类资产的配置方案,向投资决策委员会提交投资策略报告,投资决策委员会进行投资策略报告的程序审核和实质性判断,并根据审核和判断结果予以审批。

③ 组合构建
 研究员根据自己的研究独立构建股票、债券等投资品种的备选库,基金经理在其中选择投资品种,并决定交易的数量和时机。对于投资比例重大的单一品种的投资必须经过投资决策委员会的批准,投资决策委员会根据相关规定进行决策程序,基金经理根据审核和判断结果予以审批。

④ 交易操作和执行
 由交易部负责投资指令的操作和执行,通过交易交易系统确保投资指令处于合法、合规的执行状态,对交易指令的执行出现的任何情况,负有监督、处置的职责。交易部需保持无法自行处置并可能影响指令执行的情况及时和市场交易向基金经理、投资部及时汇报。

⑤ 定期及不定期的风险评估和绩效分析
 数量研究员定期和不定期地对基金组合进行风险评估和绩效分析并提交报告,风险评估报告帮助投资决策委员会和基金经理了解投资组合承担的风险水平和对业绩的来源,绩效分析报告帮助分析业绩的投资策略是否成功,以及投资组合来源是否是长期稳定超额收益。数量研究员对风险评估和绩效分析的结果编制成报告向基金经理和投资决策委员会汇报,对重大的风险事项应报告风险管理部门。基金经理需根据报告的需要调整上述投资组合。

⑥ 投资业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为:中证TMT产业主题指数收益率×80%+中债综合指数收益率×20%
 中证TMT产业主题指数从电信业务、信息技术、媒体、消费电子等产品等行业与TMT产业相关的股票中挑选规模和流动性较好的100只公司股票组成样本股,中证TMT产业指数按半年调整一次样本股,样本股调整频率分别为每年7月和次年1月的第一个交易日,每次调整比例一般不超过10%。
 如果今后法律法规发生变化,或本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布,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的业绩比较基准的指数时,本基金经基金管理人和基金托管人协商一致,可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

⑦ 基金的风险收益特征
 本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的高风险品种,预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金。

⑧ 基金的投资组合报告
 截至2018年9月30日(财务数据未经审计)。

1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	40,734,476.66	68.86
2	其中:股票	40,734,476.66	68.86
3	债券投资	-	-
4	固定收益投资	-	-
5	其中:国债	-	-
6	金融债	-	-
7	央行票据	-	-
8	中期票据	-	-
9	短期融资券	-	-
10	资产支持证券	-	-
11	买入返售金融资产	10,000,000.00	16.91
12	其中:买入返售金融资产	-	-
13	银行存款和结算备付金合计	4,716,871.55	7.98
14	其他资产	3,968,983.11	6.26
15	合计	59,339,332.32	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	-	-
B	制造业	19,841,643.00	34.01
C	采矿业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储和邮政业	-	-
G	信息、软件和信息技术服务业	20,872,628.16	35.79
H	金融业	-	-
I	房地产业	-	-
J	公共事业	-	-
K	国防军工	-	-
L	医药生物	-	-
M	计算机、通信和其他电子设备制造业	-	-
N	有色金属冶炼和压延加工业	-	-
O	化学原料和化学制品制造业	-	-
P	教育	-	-
Q	医疗保健	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,207.40	0.00
S	综合	4,716,871.55	8.20
合计		40,734,476.66	68.86

1.3 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	300365	恒润科技	71,400	1,762,152.00	3.02
2	002868	天晟仪表	57,100	1,747,831.00	3.00
3	300036	超图软件	78,000	1,727,600.00	2.96
4	002410	广联达	63,500	1,708,764.00	2.93
5	600686	东方明珠	83,500	1,596,440.00	2.74
6	600888	通达股份	37,100	1,588,520.00	2.73
7	000977	浪潮信息	64,600	1,556,520.00	2.67
8	600870	恒电电子	27,500	1,518,275.00	2.60
9	002912	深赛格	15,900	1,482,834.00	2.54
10	300654	深智尚	17,700	1,469,484.00	2.52

1.4 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。

1.5 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。

1.6 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。

1.7 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。

1.8 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。

1.9 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投资股指期货。

1.10 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投资国债期货。

1.10.1 本期国债期货投资政策
 本基金本报告期末未持仓国债期货。

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

1.10.3 本期国债期货投资评价
 本基金本报告期末未持仓国债期货。

1.11 股指期货投资情况
 本基金本报告期末未投资股指期货。

1.11.1 股指期货持仓和损益明细
 本基金本报告期末未投资股指期货。

1.11.2 股指期货投资政策
 本基金本报告期末未投资股指期货。

1.11.3 其他衍生品投资
 本基金本报告期末未投资其他衍生品。

1.11.4 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处于转股期的可转换债券。

1.11.5 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。

1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
 由于四舍五入的原因,投资组合报告中数字分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十一、基金的业绩
 基金经理人依照恪尽职守、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,投资者应仔细阅读基金合同及基金招募说明书。

十二、基金净值表现
 本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

期间	净值增长率	业绩比较基准收益率	超额收益
2014.03.31-2014.12.31	2.6%	1.32%	21.38%
2015.01.01-2015.12.31	76.02%	2.48%	61.36%
2016.01.01-2016.12.31	-23.49%	2.07%	-21.82%
2017.01.01-2017.12.31	13.09%	1.34%	8.28%
2018.01.01-2018.09.30	-27.96%	1.94%	-19.22%

十三、对基金投资业绩的说明
 本基金本报告期业绩表现良好,主要得益于对科技主题股票的精选,以及对市场整体走势的把握。

十四、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

十五、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

十六、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

十七、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

十八、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

十九、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

二十、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

二十一、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

二十二、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

二十三、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

二十四、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

二十五、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

二十六、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

二十七、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

二十八、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

二十九、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

三十、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

三十一、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

三十二、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

三十三、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

三十四、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

三十五、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

三十六、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

三十七、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

三十八、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

三十九、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

四十、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

四十一、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

四十二、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

四十三、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

四十四、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

四十五、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

四十六、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

四十七、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

四十八、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

四十九、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

五十、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

五十一、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

五十二、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

五十三、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

五十四、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

五十五、其他事项
 本基金本报告期末未发生其他事项。

五十六、基金管理人承诺
 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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

五十七、基金托管人承诺
 基金托管人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则保管基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

大理药业股份有限公司 关于召开2018年第一次临时股东大会的通知

证券代码:603963 证券简称:大理药业 公告编号:2018-042

重要内容提示:
 ●本次股东大会召开日期:2018年11月29日
 ●本次股东大会采用的网络投票系统:上海证券交易所股东大会网络投票系统

一、召开会议的基本情况
 (一)股东大会类型和届次
 2018年第一次临时股东大会
 (二)股东大会召集人:董事会

(三)投票方式:本次股东大会所采用的表决方式是现场投票和网络投票相结合的方式
 (四)现场会议召开的日期、时间和地点
 召开的日期时间:2018年11月29日14:00分
 召开地点:昆明南亚风情置业有限公司七彩云南温德姆至尊家庭大酒店会议室

(五)网络投票的系统、起止日期和投票时间
 网络投票系统:上海证券交易所股东大会网络投票系统
 网络投票起止时间:自2018年11月29日
 至2018年11月29日

采用上海证券交易所网络投票系统,通过交易系统投票平台的投票时间为股东大会召开当日的交易时间,即9:15-9:25、9:30-11:30、13:00-15:00;通过互联网投票平台的投票时间为股东大会召开当日9:15-15:00。

(六)融资融券、转融通、约定购回业务账户和沪股通投资者的投票程序
 涉及融资融券、转融通业务、约定购回业务相关账户以及沪股通投资者的投票,应按照《上海证券交易所上市公司股东大会网络投票实施细则》等有关规定执行。

(七)涉及公开征集股东投票权
 无

二、会议审议事项
 本次股东大会审议议案及投票股东类型

序号	议案名称	投票股东类型
1	《关于终止首次公开发行股票并上市事项的议案》	所有股东
2	《关于修订公司章程并修订上市后治理制度(征求意见稿)的议案》	所有股东
3	《关于修订公司章程并修订上市后治理制度(征求意见稿)的议案》	所有股东

1、各议案已披露的时间和披露媒体
 上述议案1已经公司第二届董事会第十次会议及第二届监事会第七次会议审议通过,议案2、3已经公司第三届董事会第九次会议及第三届监事会第九次会议审议通过,具体内容详见公司披露于《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》以及上海证券交易所网站www.sse.com.cn的相关公告。

2、特别决议议案:2、3
 3、对中小投资者单独计票的议案:1
 4、涉及关联股东回避表决的议案:无
 5、涉及关联交易的议案:无
 6、涉及优先股股东参与表决的议案:无

三、股东大会投票注意事项
 (一)本公司股东通过上海证券交易所股东大会网络投票系统行使表决权的,既可以登陆交易系统投票平台(通过指定交易的证券公司交易终端)进行投票,也可以登陆互联网投票平台(网址:vote.sseinfo.com)进行投票。首次登陆互联网投票平台进行投票的,投资者需完成股东身份认证。具体操作请见互联网投票平台网站说明。

(二)股东通过上海证券交易所股东大会网络投票系统行使表决权的,如果其拥有多个股东账户,可以使用持有公司股票的任一股东账户参加网络投票,投票后,视为其全部股东账户下的相同类别普通股或相同品种优先股均已分别投出同一意见的表决票。

附件1:授权委托书

大理药业股份有限公司:
 董 莹 先生(女士)代表本单位(或本人)出席2018年11月29日的股东大会

2018年第一次临时股东大会,并代为行使表决权。
 委托人持普通股数:
 委托人持优先股数:
 委托人股东账户号:

序号 重要和披露事项名称 披露 反对 弃权

1 《关于终止首次公开发行股票并上市事项的议案》

2 《关于修订公司章程并修订上市后治理制度(征求意见稿)的议案》(2018年11月29日)

3 《关于修订公司章程并修订上市后治理制度(征求意见稿)的议案》(2018年11月29日)

委托人签名(盖章): 受托人签名:
 委托人身份证号码: 受托人身份证号码:
 委托日期: 年 月 日
 备注:
 委托人应在委托书中“同意”、“反对”或“弃权”意向中选择一个并打“√”,对于委托人在本授权委托书中未作具体指示的,受托人有权按自己的意愿进行表决。

大理药业股份有限公司董事会
 2018年11月14日

股票代码:601108 证券简称:财通证券 公告编号:2018-067

财通证券股份有限公司 关于全资子公司更名的公告

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。

近日,经浙江省工商行政管理局核准,财通证券股份有限公司(简称“公司”或“财通证券”)全资子公司浙江财通创新投资有限公司名称变更为“财通创新投资有限公司”,并办理完成工商变更登记手续,取得了新的营业执照。该公司基本信息如下:

名称:财通创新投资有限公司
 统一社会信用代码:91330000MA27U00E3F
 类型:有限责任公司(非自然人投资或控股的法人独资)
 住所:浙江省杭州市上城区白云路26号285室
 法定代表人:刘未
 注册资本:叁拾捌亿玖仟整
 成立日期:2015年10月15日
 营业期限:2015年10月15日至长期
 经营范围:金融股权投资、股权投资。(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。
 财