(上接B46版)

信用债,是指不以公司任何资产作为担保的债券,属于无担保债券;其收益率等于基准收益率加信用利差收益。而信用利差收益主要受两方面影响,一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势;二是该信用债本身的信用变化。

本基金将综合考量宏观经济运行周期,信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势,合理预期市场平均信用利差曲线走势;并结合个券发行人所处行业发展前景、市场地位、财务状况、管理水平等因素,评估单个信用债本身的信用变化;进而博取信用利差收益。

(5)债券选择策略

本基金将贯彻自上而下和自下而上两条研究流程。自上而下的研究是指分析宏观基本面和资金技术面的因素,包括经济周期、物价走势、货币政策、资金供求、投资者结构等,形成对债券收益率曲线和市场趋势的判断。自下而上的研究是指利用收益率曲线模型和信用定价模型,精选个券。最后将两套研究结果相匹配,形成具体的投资策略。

(6)可转债投资

可转债兼具债性和股性。当正股股价下跌时,可转债价格受到债券价值的支撑,具有较好的防御性;当正股股价上涨时,可转债内含的期权使其可以分享股价上涨带来的收益,表现其股性的一面。

(7)中小企业私募债投资策略

中小企业私募债具有票息收益高、信用风险高、流动性差、规模小等特点。短期内,中小企业私募债对本基金的贡献有限,但本基金将在市场条件允许的情况下进行择优投资。由于中小企业私募债的发行主体多为非上市民营企业,个体异质性强、信息少且透明度低,因此在投资研究方面主要采用逐案分析的方法(Case-by-case),通过尽职调查进行独立评估,信用分析以经营风险、财务风险和回收率(Recovery rate)等指标为重点。此外,针对中小企业私募债的投资,基金管理人将根据审慎原则,制定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。

(8)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、个券选择和市场交易机会捕捉等积极策略,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。

个券选择方面,本基金将首先根据保本周期尽可能地投资于剩余期限匹配的固定收益工具并持有到期,以最大限度控制组合利率风险和流动性风险、实现本金保障;其次,本基金还将通过利率趋势分析、投资人偏好分析、收益率曲线形态分析、信用分析和流动性分析等,筛选出流动性良好、到期收益率有优势且信用风险较低的券种。

3、风险资产投资策略

(1)股票投资策略

本基金将充分发挥基金管理人的研究优势,将积极主动的投资风格与严谨规范的选股方法相结合,综合运用"自上而下"和"自下而上"的投资方法进行行业配置和个股选择;在对宏观经济运行、行业景气变化以及上市公司成长潜力进行定量评估、定性分析和实地调研的基础上,优选重点行业中基本面状况健康、具有估值优势、成长性良好、定价相对合理的股票进行投资,以谋求超额收益。

(2)权证投资策略

本基金管理人将以价值分析为基础,在采用权证定价模型分析其合理定价的基础上,充分考量可授权证品种的收益率、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。

(四)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)本基金投资的股票等风险资产占基金资产的比例不高于40%,债券、货币市场工具等稳健资产占基金资产的比例不低于60%;

(2)保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;

(3)本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的10%;

(4)本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5)本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;

(6)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;

(7)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%;

(8)本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(9)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(10)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(11)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;

(12)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(13)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;

(14)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;债券回购最长期限为1年,债券回购到期后不得展期;

(15)本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;

(16)基金总资产不得超过基金净资产的200%;

(17)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;

(18)本基金持有的单只流通受限证券,其市值不得超过基金资产净值的3%;本基金持有的全部流通受限证券,其市值之和不得超过基金资产净值的15%。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

(19)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%;因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合本款所规定比例限制的,本基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(20)本基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致;

(21)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

如果法律法规或监管部门对基金合同约定投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制,但须提前公告,不需经基金份额持有人大会审议。

除第(2)、(12)、(19)、(20)条以外,因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整。法律法规或监管部门另有规定时,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1)承销证券;

(2)违反规定向他人贷款或者提供担保;

(3)从事承担无限责任的投资;

(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;

(5)向其基金管理人、基金托管人出资;

(6)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;

(7)依照法律法规有关规定,由中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。

法律法规或监管部门取消上述禁止性规定,如适用于本基金,则本基金投资不再受相关限制。

十一、基金的业绩比较基准

1、衡量基金整体业绩的比较基准

本基金整体业绩比较基准:三年期银行定期存款收益率(税后)

上述"三年期银行定期存款收益率"是指中国人民银行网站上发布的三年期"金融机构人民币存款基准利率"。基金存续期内,三年期银行定期存款收益率随中国人民银行公布的利率水平的调整而调整。

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的业绩基准的指数时,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需经基金管理人与基金托管人协商一致报中国证监会备案后及时公告,并在更新的招募说明书中列示,而无需召开基金份额持有人大会。

十二、基金的风险收益特征

本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的低风险品种。

投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

十三、基金的投资组合报告

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	89,857,508.25	3.36
	其中:股票	89,857,508.25	3.36
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	2,531,491,660.00	94.77
	其中:债券	2,531,491,660.00	94.77
	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	13,211,819.62	0.49
8	其他资产	36,653,167.69	1.37
9	合计	2,671,214,155.56	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	5,556,275.00	0.29
C	制造业	50,127,037.25	2.59
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	17,962,100.00	0.93
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	3,649,448.00	0.19
J	金融业	3,038,868.00	0.16
K	房地产业	9,523,780.00	0.49
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	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	89,857,508.25	4.64

(2) 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金投资范围未包括港股通投资股票,无相关投资政策。

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	601607	上海医药	876,200	17,962,100.00	0.93
2	000639	西王食品	1,517,555	12,792,988.65	0.66
3	002422	科伦药业	357,500	9,534,525.00	0.49
4	600525	长园集团	986,489	7,418,397.28	0.38
5	002396	星网锐捷	385,000	6,829,900.00	0.35
6	601088	中国神华	272,500	5,556,275.00	0.29
7	600535	天士力	235,582	5,390,116.16	0.28
8	002430	杭氧股份	413,600	5,066,600.00	0.26
9	600466	蓝光发展	918,400	4,674,656.00	0.24
10	300166	东方国信	293,600	3,649,448.00	0.19

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	214,940,000.00	11.09
	其中:政策性金融债	165,315,000.00	8.53
4	企业债券	331,242,660.00	17.09
5	企业短期融资券	700,682,400.00	36.16
6	中期票据	922,506,100.00	47.61
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	362,120,500.00	18.69
9	其他	–	–
10	合计	2,531,491,660.00	130.64

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

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	111809224	18浦发银行CD224	1,400,000	135,016,000.00	6.97
2	018005	国开1701	1,050,000	105,630,000.00	5.45
3	041800005	18皖投集CP001	1,000,000	101,210,000.00	5.22
4	101800842	18华侨城MTN002	1,000,000	99,600,000.00	5.14
5	111808222	18中信银行CD222	1,000,000	97,390,000.00	5.03

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

注: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

注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注:本基金本报告期末未持有权证投资。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注:本基金本报告期末投资股指期货。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资范围未包括股指期货,无相关投资政策。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金投资范围未包括国债期货,无相关投资政策。

(2) 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					0.00
国债期货投资本期收益(元)					0.00
国债期货投资本期公允价值变动(元)					0.00

注:本基金报告期内未参与国债期货投资。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未参与国债期货投资,无相关投资评价。

11. 投资组合报告附注

(1) 申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

本基金持有的"18浦发银行CD224"的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于2018年2月12日收到中国银监会出具的行政处罚《银监罚决字〔2018〕4号),因"内控管理严重违反审慎经营规则"等,对其罚款5845万元,没收违法所得10.927万元,罚没合计5855.927万元;2018年7月26日收到中国人民银行出具的行政处罚《银反洗罚决字〔2018〕3号),因"未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易",对其合计处以170万元罚款。

信评团队负责对证券进行信用分析和筛选入池。基金经理通过对宏观经济、货币市场资金面和基金的持仓情况进行分析,决定证券投资的期限、品种和数量,在符合规定的证券池内选择合适的证券进行投资。

(2) 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是,还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资前十名股票中,不存在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	166,331.88
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	36,486,144.79
5	应收申购款	691.02
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	36,653,167.69

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券。

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

(6) 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算中四舍五入的原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差

十四、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,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、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
2016.4.29-2016.12.31	0.35%	0.04%	1.86%	0.01%	-1.51%	0.03%
2017.1.1-2017.12.31	2.65%	0.12%	2.70%	0.01%	-0.05%	0.11%
2018.1.1-2018.6.30	-2.01%	0.19%	1.30%	0.01%	-3.31%	0.18%
2018.1.1-2018.9.30	-1.25%	0.17%	1.97%	0.01%	-3.22%	0.16%
2016.4.29-2018.9.30	1.72%	0.12%	6.67%	0.01%	-4.95%	0.11%

2、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业绩比较基准收益率变动的比较

注:本基金基金合同于2016年4月29日生效。

十五、费用概览

一、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、《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费、律师费、仲裁费和诉讼费;

5、基金份额持有人大会费用;

6、基金的证券交易费用;

7、基金财产的银行汇划费用;

8、基金的开户费用、账户维护费用;

9、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。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。

上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、保本周期内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1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.2%÷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,逐日累计至每月月末,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。

在保本周期内,本基金的保证费用或风险买断费用从基金管理人的管理费收入中列支。

2、保本周期内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0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷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,逐日累计至每月月末,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、本基金在到期操作期间(除保本周期到期日)和过渡期内,基金管理人和基金托管人免收基金管理费和基金托管费。

4、若保本周期到期后,本基金不符合保本基金存续条件,基金份额持有人默认选择将所持有本基金份额转为变更后的"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"的基金份额,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法同上。

除管理费和托管费之外的基金费用,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)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照《信息披露办法》的有关规定于新的费率实施前在指定媒介上刊登公告。

(五)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。

二、与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

(1)保本周期内的申购费用

保本周期内,本基金的申购费用在投资者申购基金份额时收取。本基金对通过直销机构申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别化的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金,包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型,基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资人。

通过直销机构申购本基金基金份额的养老金客户申购费率为每笔500元。

其他投资人的申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在保本周期内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。具体费率如下表所示:

单笔申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.3%
100万≤M<300万	0.8%
300万≤M<500万	0.4%
M≥500万	每笔1000元

(2)过渡期内的申购费用

保本周期到期后,若符合保本基金存续条件(详见本招募说明书第九章),本基金转入下一保本周期,并在下一保本周期开始前安排过渡期进行申购。过渡期申购费率及收费方式在届时的临时公告或更新的基金招募说明书中列示。

(3)转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"后的申购费用

保本周期到期后,若不符合保本基金存续条件,本基金将转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"。转型后的申购费率及收费方式以届时公告为准。

2、赎回费用

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,在基金份额持有人赎回基金份额时收取。

(1)保本周期和到期操作期间内的赎回费用

保本周期和到期操作期间内,本基金赎回费率随申请份额持有时间的增加而递减,持有期从投资人获得基金份额开始计算。具体费率如下表所示:

申请份额持有时间(N)	赎回费率
N<1.5年	1.5%
1.5年≤N<3年	1.0%
N≥3年	0

其中,1年为365天,1.5年为547天,以此类推。

对持续持有期少于30日的投资人收取的赎回费全额计入基金财产;对持续持有期长于30日但少于3个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的75%计入基金财产;对持续持有期长于3个月但少于6个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的50%计入基金财产;对持续持有期长于6个月的投资人收取的赎回费中不低于总额的25%计入基金财产。未计入基金财产的部分用于支付登记费和其他必要的手续费。

鉴于《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》规定"基金管理人应当强化对投资者短期投资行为的管理,对除货币市场基金与交易型开放式指数基金以外的开放式基金,对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费,并将上述赎回费全额计入基金财产",基金管理人将本基金持续持有期少于7日(不含)对应的赎回费率调整为1.5%,并全额计入基金财产。转换业务涉及的本基金赎回费相关规则按上述规则进行调整。

赎回费调整事宜自2018年3月31日起生效,对于2018年3月30日15:00之前的赎回申请,适用调整前的赎回费规则;对于2018年3月30日15:00之后的赎回申请,适用调整后的赎回费规则。

(3)转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金"后的赎回费用

保本周期到期后,若本基金转型为"中银证券价值精选灵活配置混合型证券投资基金",转型后的赎回费率以届时公告为准。

3、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整本基金的申购、赎回费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行必要手续后,基金管理人可以适当调低基金申购费率、基金赎回费率和转换费率。

十六、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它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,对本基金的原更新招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、"一、重要提示"中更新了管理人名称、招募说明书内容截止日期及有关财务数据截止日期。

2、"三、基金管理人"一章进行了更新。

3、"三、基金托管人"一章进行了更新。

4、"五、相关服务机构"中更新了销售机构信息。

5、"八、基金份额的申购与赎回"中更新了申购和赎回场所、基金转换有关信息。

6、"十一、基金的投资"中更新了基金投资组合报告。

7、更新了"十二、基金的业绩"。

8、"十九、风险揭示"中补充了流动性规定有关内容。

9、"二十四、其他应披露事项"中对本报告期内的应披露事项予以更新。

中银国际证券股份有限公司
2018年12月12日

证券代码:601933 证券简称:永辉超市 公告编号:临-2018-088

永辉超市股份有限公司关于2018年限制性股票激励计划权益授予的结果公告

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:

●限制性股票登记日:2018年12月10日

●限制性股票登记数量:7,650,900股

一、限制性股票授予情况

(一)本次限制性股票的授予情况

永辉超市股份有限公司(下称"公司")2018年限制性股票激励计划(以下简称"本次激励计划")规定的限制性股票授予条件已经成就,根据公司2018年第一次临时股东大会的授权,公司于2018年10月24日公司第三届董事会第四十三次会议通过《关于向激励对象授予限制性股票的议案》,确定授予日为2018年11月1日,向21名激励对象授予限制性股票7,650,900股,授予价格为4.15元/股。股票来源是通过二级市场回购公司股票437,500股及2017年限制性股票激励计划授予登记完成后公司回购账户中剩余的7,213,400股股票,合计7,650,900股股票。

(二)激励对象名单及授予情况:

姓名	职务	授予数量(股)	占股权激励计划总量的比例	占授予时总股本的比例
李静	高管	1,092,900	14.28%	0.01%
高管小计		1,092,900	14.28%	0.01%
其他激励对象		6,558,000	85.72%	0.07%
总计		7,650,900	100.00%	0.08%

注:1、上述任何一名激励对象通过全部在有效期内的股权激励计划获授的限制性股票均累计未超过公司总股本的1%。公司全部在有效期内的股权激励计划所涉及的标的股票总数累计不超过公司总股本的10%。

2、本激励计划激励对象中没有单独或合计持有公司5%以上股份的股东或实际控制人及其配偶、父母、子女。

二、激励计划的有效期、锁定期和解锁安排情况

解锁期	解锁安排	解锁数量占获授权益数量比例
第一个解除限售期	自授予登记完成之日起12个月后的首个交易日起至授予登记完成之日起24个月内的最后一个交易日当日止	40%
第二个解除限售期	自授予登记完成之日起24个月后的首个交易日起至授予登记完成之日起36个月内的最后一个交易日当日止	30%
第三个解除限售期	自授予登记完成之日起36个月后的首个交易日起至授予登记完成之日起48个月内的最后一个交易日当日止	30%

三、限制性股票认购资金的验资情况

致同会计师事务所(特殊普通合伙)对公司本次授予股份事宜出具了《验资报告》(致同验字〔2018〕第351ZA0021号),截至2018年11月26日止,公司已收到激励对象(21人)缴纳的变更注册资本(股本)合计人民币31,751,235.00元,变更后占股本的0.08%。本次股权激励后,公司注册资本及股本与变更前一致。激励对象实际缴纳股权认购款人民币31,751,235.00元。其中:31,751,235.00元,于2018年11月26日止缴存在公司账户内。

四、限制性股票的登记情况

2018年12月10日,公司本次激励计划授予的限制性股票登记手续已完成。

五、授予前后对公司控股股东的影响

本次限制性股票的授予不会导致公司控股股东及实际控制人发生变化,控股股东持股比例也未发生变动。

六、股权结构变动情况

说明本次权益授予后公司股本结构变动情况。

单位:股

证券类别	变更前数量	变更数量	变更后数量
无限售流通股	7,975,942,216	-7,650,900	7,968,291,316
有限售流通股	1,594,519,892	7,650,900	1,602,170,792
合计	9,570,462,108	0	9,570,462,108

七、本次募集资金使用计划

本次限制性股票所筹集资金将全部用于补充公司流动资金。

八、本次授予后新增股份对最近一期财务报告的影响

激励成本各年度摊销明细表

单位:元

年度	2018年	2019年	2020年	2021年
费用金额	2,411,946.23	12,987,402.75	5,009,426.78	1,855,343.25

限制性股票的激励成本将在管理费用列支。本次股权激励对公司财务状况和经营成果的影响以会计师事务所出具的年度审计报告为准。

特此公告。

●报备文件

(一)中国证券登记结算有限责任公司上海分公司出具的《证券变更登记证明》

(二)验资报告

永辉超市股份有限公司董事会
二〇一八年十二月十二日

证券代码:601933 证券简称:永辉超市 公告编号:临-2018-89

永辉超市股份有限公司关于提前归还部分募集资金的公告

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。

2018年7月13日,永辉超市股份有限公司(下称"公司")第三届董事会第三十七次会议审议通过了《关于闲置募集资金补充流动资金的议案》,同意将200,000万元闲置募集资金暂时用于补充公司流动资金,使用期限为董事会通过之日起不超过12个月。(详见上海证券交易所网站www.sse.com.cn及2018年7月17日《上海证券报》、《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》有关决议公告。)

2018年12月11日,上述资金中20,000万元已提前归还至公司募集资金专户。

特此公告。

永辉超市股份有限公司
董事会
二〇一八年十二月十二日

证券代码:601966 证券简称:玲珑轮胎 公告编号:2018-094

山东玲珑轮胎股份有限公司第三届董事会第二十五次会议决议公告

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。

一、董事会会议召开情况

山东玲珑轮胎股份有限公司第三届董事会第二十五次会议,于2018年12月11日以传签表决方式召开,应出席董事9名,实际出席9名。本次会议的召集、召开方式符合《中华人民共和国公司法》及《山东玲珑轮胎股份有限公司章程》的规定。

二、董事会会议审议情况

本次会议以记名投票方式审议通过了以下议案:

1、关于聘任公司副总裁的议案

具体内容详见同日在上海证券交易所网站上披露的《山东玲珑轮胎股份有限公司关于聘任公司副总裁的公告》(公告编号:2018-095)。

表决结果:同意9票,反对0票,弃权0票。

三、备查文件

1、第三届董事会第二十五次会议决议;

2、独立董事关于公司第三届董事会第二十五次会议相关事项的独立意见;

3、上海证券交易所要求的其他文件。

特此公告。

山东玲珑轮胎股份有限公司董事会
2018年12月11日

证券代码:601966 证券简称:玲珑轮胎 公告编号:2018-095

山东玲珑轮胎股份有限公司关于聘任公司副总裁的公告

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。

2018年12月11日,山东玲珑轮胎股份有限公司(以下简称"公司")召开第三届董事会第二十五次会议,全票审议通过了《关于聘任公司副总裁的议案》。因公司经营发展需要,经公司总裁提名,第三届董事会提名委员会第四次会议审核,公司董事会同意聘任李伟先生为公司副总裁(简历详见附件),任期自董事会审议通过之日起至本届董事会届满为止。

公司独立董事同意本议案,并发表了独立意见:本次聘任人员具备有关法律、法规及《公司章程》规定的任职资格;议案的审议、表决程序符合相关法律法规和《公司章程》规定,合法、有效,不存在损害公司及股东利益的情形。

特此公告。

山东玲珑轮胎股份有限公司董事会
2018年12月11日

附件:李伟先生简历

李伟,中国国籍,1972年4月生,大专学历。1994年8月至2005年12月,担任建设银行招远支行计划信贷科副科长;2006年1月至2009年12月,担任山东玲珑橡胶有限公司办公室主任兼项目办主任;2009年12月至2011年11月,担任玲珑集团有限公司项目办主任;2011年12月至2016年11月,担任玲珑集团有限公司副总经理;2013年6月至2018年11月担任山东玲珑轮胎股份有限公司监事;2016年12月至今担任山东玲珑轮胎股份有限公司副总经理。

证券代码:600614 900907 证券简称:鹏起科技 鹏起B股 公告编号:临2018-120

鹏起科技发展股份有限公司关于公司涉及诉讼进展的公告

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。

重要内容提示:

●公司因金融借款合同纠纷涉讼,公司房产、银行账户被查封\冻结

●案件所处的诉讼阶段:公司尚未收到应诉通知书,案件尚未开庭

●公司所处的当事人地位:被告

●涉案的金额:20,198,953.86元

●本次诉讼相关情况已分别于2018年11月4日、2018年11月23日披露了《关于公司涉及诉讼公告》(公告编号:临2018-108)、《关于银行账户和资产被冻结查封的公告》(公告编号:临2018-114)。

●诉讼对公司本期利润或期后利润等的影响:案件尚未开庭,公司无法准确判断对本期利润及期后利润的影响。

一、本次诉讼基本情况

2016年9月13日,被告上海鼎立科技发展(集团)股份有限公司(现名称"鹏起科技发展股份有限公司",以下简称"公司"或"鹏起科技")与原告上海农村商业银行股份有限公司张江科技支行(以下简称"农商行张江支行")签订了《上海农商银行借款合同》(以下简称"《借款合同》"),约定:被告鹏起科技向原告借款人民币(以下币种均为人民币)3000万元整;借