(上接 B45 版)

(111)大河财富基金销售有限公司
法定代表人:王荻
住所:贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号
网址:http://www.urainf.com/
联系电话:0851-88235678
(112)北京电盈基金销售有限公司
法定代表人:程刚
住所:北京市朝阳区呼家楼(京广中心)1 号楼 36 层 3603 室
电话:400-100-3391
网址:http://www.dianyingfund.com/
(113)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
客户服务电话:95310
网址:www.gjzq.com.cn
(114)上海有鱼基金销售有限公司
法定代表人:林琼
办公地址:上海徐汇区桂平路 391 号 B 座 19 层
客服电话:021-60907378
网址:http://www.youyufund.com/
(115)洪泰财富(青岛)基金销售有限责任公司
法定代表人:任淑桢
注册地址:山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 701 室
办公地址:山东省青岛市崂山区香港东路 195 号 9 号楼 706 室;北京市西什库大街 31 号九思文创园
客服电话:400 6706 863
网址:https://www.hongtaiwealth.com
(116)厦门市鑫鼎盛控股有限公司
注册地址:厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室
办公地址:厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室
法定代表人: 陈洪生
联系电话:0592-3122673
传真号码:0592-3122701
客服热线:400-918-0808
公司网址:www.xds.com.cn
(117)北京唐鼎耀华基金销售有限公司
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:北京市朝阳区建国门外大街 19 号 A 座 1504/1505 室
法定代表人: 张冠宇
联系电话: 86-10-85870662
传真号码:86-10-85932880
客服电话:400-819-9868
网址:http://www.tdyhfund.com/
(118)上海钜派钰茂基金销售公司
注册地址:上海市浦东新区泥城镇新城路 2 号 24 幢 N3187 室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 379 号金穗大厦 14 楼
法定代表人:胡天翔
联系电话:021-50778395
传真号码:021-68367031
(119)中银国际证券有限责任公司
地址:中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39 层
办公地址:中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 31、39、40、41 层
法定代表人:宁敏
客户服务电话:021-4006208888
网址:www.bocichina.com
(120)嘉实财富管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心办公楼二期 53 层 5312-15 单元
法定代表人:赵学军
客户服务电话:4000218850
公司网站:www.harvestwm.cn
(121) 腾安基金销售(深圳)有限公司
地址:深圳市南山区科技中一路腾讯大厦
法定代表人:刘明军
联系电话:0755-86013388-77386
网址: tenganxinxi.com
客服电话:0755-86013388 转 65864
(122) 深圳前海微众银行股份有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室(入驻深圳市前海商务秘书有限公司)
办公地址:广东省深圳市南山区沙河西路 1819 号深圳湾科技生态园 7 栋 A 座
法定代表人:顾敏
客服电话:4009998877
网址:www.webank.com
(123) 北京植信基金销售有限公司
地址:北京市密云区兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室 -67
法定代表人:于龙
网站网址:www.zhixin-inv.com
客服联系方式:4006-802-123
(二)注册登记机构
名称:华安基金管理有限公司
住所:中国(上海)自由贸易试验区世纪大道 8 号国金中心二期 31—32 层法定代表人:朱学华
电话:(021)38969999
传真:(021)33627962
联系人:赵良
客户服务中心电话:40088-50099
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
办公地址:上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼
负责人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398
联系人:刘佳
经办律师:刘佳、张兰
(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:(021)22288888
传真:(021)22280000
联系人: 蒋燕华
经办会计师: 蒋燕华,蔡玉芝

四、基金的名称

本基金名称:华安生态优先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

本基金重点投资于生态保护与生态友好相关的行业或企业,在严格控制风险的前提下,力争把握标的行业投资机会实现基金资产的长期稳健增值。

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, 包括国内依法发行上市的 A 股股票等权益类证券(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、权证等)、债券、货币市场工具、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。

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。

本基金的股票投资比例为基金资产的 60%-95%,其中,投资于生态保护与生态友好相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

八、基金的投资策略

(一)投资策略

1、资产配置策略

本基金采取相对稳定的资产配置策略, 一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定,避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。在大类资产配置过程中,本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测, 结合使用公司自主研发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等经济模型,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,确定合适的资产配置比例,动态优化投资组合。

2、股票投资策略

本基金通过对生态保护相关行业和生态友好型行业的精选以及对行业内相关股票的深入分析,挖掘该类型企业的投资价值。

(1)生态优先主题的界定

本基金所指的生态优先主题是指那些生产和经营过程中对环境的影响较小或者以改善环境生态作为主业的相关行业。

据此界定,本基金借鉴上海申银万国证券研究所的行业分类方法,将机械设备、纺织服装、信息服务、信息设备、交运设备、电子、医药生物、农林牧渔、食品饮料、餐饮旅游、化工新材料、环保工程与服务等申万一级和二级行业界定为生态优先主题相关行业。未来,本基金管理人可根据整体经济、行业的发展变化以及申万行业分类的调整,动态调整对于生态优先相关行业的定义,以适应经济社会发展的需要。

(2)行业配置

生态优先相关的各个行业由于所处的商业周期不同, 面临的上下游市场环境也各不相同,因此,其相关行业表现也并非完全同步,在不同行业之间进行资产配置有助于提高基金投资组合的总体收益,配置过程中需要考虑的具体因素如下:

1)经济发展转型因素

在中国经济发展转型的过程中, 与本主题相关的各行业所面临的战略机会及出现时点各不相同,本基金将密切跟踪中国经济发展及结构调整的步伐,前瞻性地在各个行业间进行布局, 以充分分享中国经济发展与结构转型为生态保护和生态友好型行业带来的发展机遇。

2)技术发展因素

技术的发展与变革可能对生态保护和生态友好型行业造成深远的影响, 新技术和工艺的出现会很大程度上影响行业和企业的生产方法和资源消耗程度, 从而影响相关子行业的发展前景。鉴于此,本基金管理人将密切关注相关科学技术领域的最新进展,并重点配置于那些受益于新技术新工艺发展的子行业。

3)政策因素

生态保护和生态友好型行业的发展会受到政府产业政策、环境政策等政策的影响,不同子行业会因为相关政策的出台而面临或正面或负面的影响,本基金管理人将密切跟踪政府政策的变化, 重点配置于那些受益于当时政策或者未来政策变化预期的子行业。

4)经济社会因素

随着人均收入水平的提高、人口分布和结构的变化,不同子行业面临的发展机遇各不相同,也会不断的涌现出新的适宜于生态优先主题的新兴行业。本基金管理人将动态地跟踪这些变化,积极配置于符合经济社会发展趋势的相关子行业。

5)市场短期因素

中短期内,各个子行业所面临的市场需求弹性也各不相同,基金管理人将在分析短期宏观经济形势,及子行业产品价格变化的基础上,积极配置于各个阶段预期收益率较高的子行业。

(3)个股选择

在个股选择方面, 本基金所界定的符合生态优先要求的上市公司分为以下两个层次:第一个层次是目前已经满足相关条件,被界定为生态优先相关子行业成分股的上市公司;另一个层次是当前仍未被界定为生态优先相关子行业,但是未来生态保护和生态友好型的相关业务可能成为其主要利润来源的上市公司。基金管理人将对两类公司分别进行系统地分析,最终确定投资标的股票,构建投资组合。

1)第一层次的上市公司

对于目前已被界定为生态优先相关子行业成分股的上市公司, 本基金将采用定量与定性相结合的研究方法选择个股。

首先,本基金基于公司财务指标分析公司的基本面价值,选择财务和资产状况良好且盈利能力较强的公司。具体的考察指标包括成长性指标(主营业务收入增长率、息税折旧前利润增长率、现金流)、盈利指标(毛利率、净资产收益率、投资回报率、企业净利润率)等指标。结合相关财务模型的分析,形成对标的股票的初步判断。

其次, 公司投资研究人员将通过案头研究和实地调研等基本面研究方法深入剖析影响公司未来投资价值的驱动因素,重点从以下几个方面进行研究:

①市场竞争格局:企业在市场格局中处于有利位置,有能力进行创新投入和技术改造;

②盈利效率:企业盈利效率较高,财务结构合理,各项财务指标在业内处于领先水平;

③技术升级: 企业核心生产技术符合国家科技创新的大政方针和经济社会发展的内在需求且存在技术壁垒;

④公司治理:企业的公司治理结构稳定高效,同时企业家致力于打造企业的核心竞争力,规划公司长远发展;

⑤短期事件:企业是否有诸如整体上市、集团公司优质资产注入、并购重组、股权激励等短期事件对公司未来发展可能会有正面的影响。

2)第二层次的上市公司

对于当前仍未被界定为生态优先相关子行业, 但是未来生态优先相关业务可能成为其主要利润来源的上市公司,除了采用 1)中提到的定量和定性分析方法外,还会重点关注该公司的业务构成指标和行业占比指标, 分析公司主营业务与生态优先相关业务的比例;生态优先相关业务产生的利润占比;以及该公司生态优先相关业务未来的成长性等。

3、债券投资策略

本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券组合。

在选择利率债品种时, 本产品将重点分析利率债品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预测模型构造最佳期限结构的利率债券组合;在选择信用债品种时,本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的信用资质, 信用资质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约、担保纪录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化,综合考虑可转债的市场流动性等因素,决定投资可转债的品种和比例,捕捉其套利机会。

4、股指期货投资策略

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时, 首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型 (多头套期保值或空头套期保值),并根据风险资产投资(或拟投资)的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例; 其次, 本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

5、权证投资策略

本基金在实现权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,谨慎地进行投资,以追求较为稳定的收益。

6、资产支持证券的投资

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、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,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。

(二)投资限制

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1)股票投资比例为基金资产的 60%-95%,其中,投资于生态保护与生态友好相关的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%;

(2)每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等;

(3)本基金持有一家上市公司的股票,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)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;

(9)本基金持有的所有流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 20%;本基金持有的同一流通受限证券,其公允价值不得超过本基金资产净值的 8%;

(10) 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%;

(11)本基金在任何交易日日终,持有的买入股指期货合约价值不得超过基金资产净值的 10%,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金

资产净值的 95%,其中有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;本基金在任何交易日日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的 20%;本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%;本基金持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值的轧差合计不得超过基金资产的 90%;

(12)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%;

(13)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%;

(14)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%;

(15) 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%;

(16)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;

(17)本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)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) 本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的 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前款所规定比例限制的, 基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;

(19) 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;

(20)相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

除上述第(2)、(16)、(18)、(19)项外, 因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

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。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。

如果法律法规对上述投资组合比例进行变更的,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,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:

(1)承销证券;
(2)违反规定向他人贷款或提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是另有规定的除外;
(5)向基金管理人、基金托管人出资;
(6)从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
(7)法律、行政法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

如法律法规或监管部门取消上述禁止性规定, 本基金管理人在履行适当程序后可不受上述规定的限制。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的证券, 或者从事其他重大关联交易的, 应当遵循基金份额持有人利益优先的原则, 防范利益冲突,符合中国证监会的规定,并履行披露义务。

(三)基金的融资融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:80%中证 800 指数收益率+20%中国债券总指数收益率

十、基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金、低于股票型基金,属于证券投资基金中的中高风险投资品种。

十一、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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2018 年 10 月 24 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。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日。

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	106,259,074.96	82.31
	其中:股票	106,259,074.96	82.31
2	固定收益投资	301,591.80	0.23
	其中:债券	301,591.80	0.23
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	20,191,805.02	15.64
7	其他各项资产	2,342,908.63	1.81
8	合计	129,095,380.41	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
C	制造业	48,325,036.51	37.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	777.00	0.00
F	批发和零售业	11,827,160.00	9.24
G	交通运输、仓储和邮政业	9,689,890.00	7.57
H	住宿和餐饮业	3,820,262.25	2.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,003,882.00	3.91
J	金融业	8,823,976.00	6.89
K	房地产业	18,865.00	0.01
L	租赁和商务服务业	15,654,651.20	12.22
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	533,600.00	0.42
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	2,560,975.00	2.00
S	综合	-	-
	合计	106,259,074.96	82.98

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	601888	中国国旅	151,900	10,332,238.00	8.07
2	600009	上海机场	138,800	8,157,276.00	6.37
3	603708	家家悦	364,100	8,101,225.00	6.33
4	002127	南极电商	726,750	5,319,810.00	4.15
5	601318	中国平安	66,800	4,575,800.00	3.57
6	603345	安井食品	111,414	4,436,505.48	3.46
7	601336	新华保险	79,200	3,998,016.00	3.12
8	600519	贵州茅台	5,300	3,869,000.00	3.02
9	603043	广州酒家	148,100	3,669,918.00	2.87
10	600309	万华化学	84,600	3,592,962.00	2.81

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	301,591.80	0.24
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	301,591.80	0.24

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	113513	安井转债	2,740	301,591.80	0.24

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。

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

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

9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末投资股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

本基金在进行股指期货投资时, 首先将基于对证券市场总体行情的判断和组合风险收益的分析确定投资时机以及套期保值的类型 (多头套期保值或空头套期保值),并根据风险资产投资(或拟投资)的总体规模和风险系数决定股指期货的投资比例; 其次, 本基金将在综合考虑证券市场和期货市场运行趋势以及股指期货流动性、收益性、风险特征和估值水平的基础上进行投资品种选择,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期内, 本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的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

11.2 本基金投资的前十名股票中, 不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	91,200.22
2	应收证券清算款	1,906,016.25
3	应收股利	-
4	应收利息	3,744.29
5	应收申购款	341,947.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,342,908.63

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。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有存在流通受限情况的股票。

十二、基金的业绩

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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用, 计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(一)基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

(截止时间 2018 年 6 月 30 日)

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效(2013 年 11 月 28 日)起至 2013 年 12 月 31 日	0.00%	0.07%	-2.47%	0.87%	2.47%	-0.80%
2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	24.00%	0.93%	40.12%	0.92%	-16.12%	0.01%
2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	57.34%	3.23%	12.83%	2.00%	44.51%	1.23%
2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-16.86%	2.13%	-10.98%	1.22%	-5.88%	0.91%
2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	28.11%	1.12%	11.28%	0.52%	16.83%	0.60%
2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	0.10%	1.36%	-10.48%	0.93%	10.58%	0.43%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

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 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×1.5 %÷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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷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,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日。

上述“一、基金费用的种类中第 3-8 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或摊入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

(二)与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金在投资人申购时收取申购费。本基金申购费率随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。

本基金对通过直销中心申购的养老金客户与除此之外的其他投资人实施差别的申购费率。通过基金管理人的直销中心申购本基金份额的养老金客户申购费率为每笔 500 元。

申购费率如下表所示:

单笔申购金额(M)	申购费率
M<100 万	1.5%
100万≤M<300 万	1.2%
300万≤M<500 万	0.8%
M≥500 万	每笔 1000 元

本基金的申购费用由本基金的投资者承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2、赎回费用

本基金的赎回费率按持有期递减。赎回费用由赎回本基金的基金份额持有人承担,基金管理人将不低于其总额的 25%计入基金财产,其余用于支付登记结算费和其他必要的手续费。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取的赎回费将全额计入基金财产。具体费率如下:

赎回费率(持有期限 Y)	
Y<7 天	1.5%
7天≤Y<1 年	0.5%
1年≤Y<2 年	0.25%
Y≥2 年	0

注:一年指 365 天,两年为 730 天,依此类推。3、转换费用

基金转换的总费用包括转出基金的赎回费和申购补差费。

转出基金赎回费=转出份额×转出基金当日基金份额净值×转出基金赎回费率

转出金额 = 转出份额×转出基金当日基金份额净值 - 转出基金赎回费

基金转换申购补差费按转入与转出基金之间申购费的差额计算收取, 具体计算公式如下:

基金转换申购补差费= max[(转入基金的申购费—转出基金的申购费),0],即转入基金申购费减去转出基金申购费,如为负数则取 0

转入金额 = 转出金额—基金转换申购补差费

转入份额 = 转入金额÷转入基金当日基金份额净值

转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。

其中:

转入基金的申购费=[转出金额 - 转出金额÷(1+转入基金的申购费率)] 或转入基金固定收费金额

转出基金的申购费=[转出金额 - 转出金额÷(1+转出基金的申购费率)] 或转出基金固定收费金额

注 1:转入份额的计算结果四舍五入,保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金资产。

注 2:本基金暂未开通后端收费模式的基金转换业务。

注 3:关于转换费用的其它相关条款请详见公司网站的有关临时公告。

(三)其他费用

1、基金的开户费用、账户维护费用;
2、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
3、《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;
4、基金份额持有人大会费用;
5、基金的证券交易费用;
6、基金的银行汇划费用;
7、依法可以在基金财产中列支的其他费用。

(四)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。

(五)基金管理费、基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可协商酌情降低基金管理费和基金托管费, 此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。

(六)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。

十四、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》、《公开募集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:

章节	主要更新内容
三、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。
四、基金托管人	更新了基金托管人的相关信息。
五、相关服务机构	更新了相关服务机构的相关信息。
九、基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告等信息。
十、基金的业绩	更新了本基金投资业绩至最新。
二十二、其他应披露事项	披露了自 2018 年 5 月 28 日至 2018 年 11 月 28 日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一九年一月十二日

证券代码:600749 股票简称:*ST 藏旅 公告编号:2019-002 号

西藏旅游股份有限公司关于使用闲置募集资金进行现金管理的进展公告

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。

西藏旅游股份有限公司(以下简称“公司”或者“西藏旅游”)于 2018 年 3 月 19 日召开第六届董事会第六十次会议、第六届监事会第二十九次会议,并于 2018 年 4 月 4 日召开了 2018 年第一次临时股东大会,审议通过《关于使用部分闲置募集资金进行现金管理的议案》,同意使用不超过 43,000 万元闲置募集资金进行现金管理,使用期限自公司股东大会审议批准之日起不超过 12 个月,到期及时归还到募集资金专用账户。在上述期限及额度内,资金可滚动使用,并授权公司董事长或董事长授权人员具体负责办理实施。公司独立董事、监事会、保荐机构已分别对此发表了同意的意见。详见公司 2018 年 3 月 20 日刊登于上海证券交易所网站的《西藏旅游股份有限公司关于公司使用部分闲置募集资金进行现金管理的公告》(公告编号:2018-018 号)。

一、使用闲置募集资金进行现金管理的进展情况

(一)使用闲置募集资金进行现金管理的进展情况

2018 年 4 月 4 日,公司使用闲置募集资金 33,000 万元、10,000 万元,在中国民生银行股份有限公司拉萨分行分别办理人民币结构性存款业务。

上述 33,000 万元结构性存款到期赎回之后,公司于 2018 年 7 月 5 日以本金 33,000 万元继续在中国民生银行股份有限公司拉萨分行办理人民币结构性存款业务。该笔结构性存款到期赎回后,公司于 2018 年 12 月 28 日以本金 33,000 万元继续在中国民生银行股份有限公司拉萨分行办理人民币结构性存款业务。

上述 10,000 万元结构性存款到期赎回后,公司于 2018 年 10 月 11 日以本金 10,000 万元继续在中国民生银行股份有限公司拉萨分行办理人民币结构性存款业务。

结构性存款相关进展, 详请参考公司通过指定信息披露媒体披露的公告:2018-022 号、2018-054 号、2018-080 号、2018-084 号。

(二)本次到期人民币结构性存款具体情况。如下:

资金来源	受托方	产品名称	产品类型、风险收益特征	起息日	到期日	产品期限	产品预期最高年化收益	金额(人民币,万元)
闲置募集资金	中国民生银行拉萨分行	中国民生银行人民币结构性存款 D 款	保本浮动收益型	2018年 10 月 11 日	2019 年 1 月 11 日	92天	4.20%	10,000

2019 年 1 月 11 日, 公司到期赎回上述 10,000 万元的中国民生银行人民币结构性存款,并已取得相关于银行凭证。实际年化收益率为 4.20%,收回本金人民币 10,000 万元,并获得利息收益 105.86 万元。

二、本次继续使用闲置募集资金进行现金管理的情况

2019 年 1 月 11 日,公司继续使用上述到期赎回的闲置募集资金 10,000 万元,与中国民生银行股份有限公司拉萨分行签署《中国民生银行结构性存款合同(机构版)》,办理人民币结构性存款业务。具体情况如下:

资金来源	受托方	产品名称	产品类型、风险收益特征	起息日	到期日	产品期限	产品预期最高年化收益率	金额(人民币,万元)
闲置募集资金	中国民生银行拉萨分行	中国民生银行人民币结构性存款 D 款	保本浮动收益型	2019年 1 月 11 日	2019 年 3 月 28 日	76天	3.90%	10,000

三、公司使用闲置募集资金进行现金管理未到期情况

截至本公告披露之日,公司尚未到期的结构性存款共计 43,000 万元(含本次),具体如下:

序号	资金来源	受托方	产品名称	产品类型、风险收益特征	起息日	到期日	产品期限	产品预期最高年化收益率	金额(人民币,万元)
1	闲置募集资金	中国民生银行拉萨分行	中国民生银行人民币结构性存款 D 款	保本浮动收益型	2018 年 12 月 28 日	2019 年 3 月 28 日	90天	4.05%	33,000
2					2019 年 1 月 11 日	2019 年 3 月 28 日	76天	3.90%	10,000
合计									43,000

四、现金管理对公司日常经营的影响

在符合国家法律法规,确保不影响公司正常运营、公司募集资金投资计划正常进行和募集资金安全的前提下, 公司使用部分闲置募集资金办理保本型结构性存款可以提高公司资金使用效率,可以获得一定的投资收益,为公司股东谋取更多的投资回报。

五、投资风险及风险控制措施

公司本着维护股东和公司利益的原则,将风险防范放在首位,对现金管理相关产品严格把关、谨慎决策,公司所选择的结构性存款均为保本型产品,在实施现金管理期间,公司将与结构性存款的受托方保持密切联系,及时跟踪资金运作情况,评估发现可能影响公司资金安全的风险因素,及时采取相应措施,控制投资风险。

六、公司累计购买银行结构性存款的情况

截至本公告披露之日,公司使用闲置募集资金、闲置自有资金累计购买银行结构性存款 153,000 万元(其中 88,000 万元为滚动续存),除前述已到期赎回的 110,000 万元以外,目前尚未到期的结构性存款共计 43,000 万元(均为滚动续存),未超出闲置募集资金、闲置自有资金进行现金管理的授权额度。

特此公告。

西藏旅游股份有限公司董事会
2019 年1月11 日

备查文件

1、中国民生银行结构性存款到期赎回凭证;
2、新办理结构性存款业务的《中国民生银行结构性存款合同(机构版)》

证券代码:000908 证券简称:景峰医药 公告编号:2019-003

湖南景峰医药股份有限公司关于归还暂时用于补充流动资金的募集资金的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

湖南景峰医药股份有限公司(以下简称“公司”)于 2018 年 2 月 7 日召开第七届董事会第二次会议,审议通过了《关于继续使用部分闲置募集资金暂时补充流动资金的议案》,同意公司在不影响募集资金项目建设和募集资金使用情况下, 公司全资子公司上海景峰制药有限公司继续使用 2.5 亿元闲置募集资金暂时用于补充流动资金, 使用期限不超过十二个月。详细内容参见公司在指定信息披露媒体披露的 2018-005 号《关于继续使用部分闲置募集资金暂时补充流动资金的公告》。

公司在使用闲置募集资金暂时补充流动资金期间,对资金进行了合理的安排与使用,没有影响募集资金投资计划的正常进行,没有变相改变募集资金用途,资金运用情况良好。

2018 年 9 月 21 日, 公司将上述暂时用于补充流动资金的募集资金中 0.4 亿元提前归还至募集资金专用账户,并已将上述募集资金的归还情况通知了独立财务顾问主办人。

2019 年 1 月 11 日, 公司将暂时用于补充流动资金的募集资金中剩余的 2.1 亿元归还至募集资金专用账户。至此,本次使用部分闲置募集资金暂时补充流动资金 2.5 亿元已全部归还完毕。公司已将上述募集资金的归还情况通知了独立财务顾问主办人。

特此公告

湖南景峰医药股份有限公司
董事会
2019 年1月11 日

证券代码:603630 证券简称:拉芳家化 公告编号:2019-002

拉芳家化股份有限公司关于部分银行理财产品到期赎回的公告

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。

拉芳家化股份有限公司(以下简称“公司”)第二届董事会 2018 年第二次临时会议和第二届监事会第十二次会议,第二届董事会第二十一次会议和第二届监事会第十七次会议,分别审议通过《关于使用闲置募集资金投资银行理财产品的议案》及《关于使用闲置自有资金购买理财产品的议案》,同意公司在确保不影响募集资金投资项目建设使用和自有资金日常使用的情况下, 使用最高额度不超过合计人民币 62,000 万元的暂时闲置资金购买理财产品。具体内容详见公司分别于 2018 年 3 月 22 日和 2018 年 10 月 30 日刊发在上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)及《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》的相关公告。

一、本次理财产品到期赎回情况

公司于 2018 年 11 月 8 日以部分闲置自有资金人民币 5,000 万元在交通银行股份有限公司汕头分行购买了理财产品。具体内容详见公司于 2018 年 11 月 10 日刊发在上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)及《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》的相关公告。上述理财产品已于 2019 年 1 月 11 日到期,公司收回本金人民币 5,000 万元,并取得理财收益人民币 353,835.62 元,实际年化收益率为 4.10%。上述理财产品本金和利息已全部收回。

二、截至本公告日,公司累计购买理财产品的情况

截至本公告日,公司使用闲置资金累计购买理财产品尚未到期的金额共计人民币 10,000 万元,未超过审议批准通过的总额度人民币 62,000 万元。

特此公告。

拉芳家化股份有限公司
董事会
2019 年1月12 日

证券代码:002383 证券简称:合众思壮 公告编号:2019-005

北京合众思壮科技股份有限公司关于对深圳证券交易所问询函的回复公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

北京合众思壮科技股份有限公司(以下简称“合众思壮”或“公司”)于 2019 年 1 月 3 日收到深圳证券交易所下发的《关于对北京合众思壮科技股份有限公司的问询函》(中小板问询函【2019】第 3 号)(以下简称“问询函”),现公司就《问询函》所涉及事项的回复公告如下:

1、郭信平目前所持你公司股票被杭州市中级人民法院司法冻结的具体原因、相关进展情况、是否影响你公司偿债能力、是否存在被强制过户的风险、郭信平先生已采取和拟采取的解决措施。

回复:

针对郭信平先生持有的部分公司股票被杭州市中级人民法院司法冻结的事宜, 经向郭信平先生核实,冻结原因系其个人对外担保出现违约所致。2017 年蒋某因经营需要向债权人借款 2 亿元, 出于信任郭信平先生为蒋某借款提供连带担保, 期限为 2017 年 11 月 7 日至 2018 年 5 月 6 日。由于合同届满后债务人未按期归还本金, 债权人向法院申请诉前财产保全,导致郭信平先生持有本公司部分股份被冻结,目前尚未收到杭州市中级人民法院正式财产保全文书。上述担保系郭信平先生个人行为,并不涉及上市公司,对公司生产经营不产生直接影响。

根据了解,郭信平先生正在积极与债权人、债务人进行沟通协商,争取短期内撤销冻结,郭信平先生所持本公司股份因为此事被强制过户的可能性很低。

2、请你公司了解并说明郭信平质押你公司股份所获得资金的用途,该部分质押股份是否存在平仓风险以及针对平仓风险拟采取的应对措施。

回复:

根据了解, 截至本公告日, 公司实际控制人郭信平先生质押了其所持有的股份数量为 263,231,773 股。根据了解,该融资款中绝大部分用于了认购上市公司定向发行股份,少部分用于为上市公司战略业务布局所需的个人股权投资。目前,郭信平先生部分质押股份已出现逾期情形,郭信平先生与质权人保持密切沟通并申请进行延期,目前暂不存在平仓风险。

另外,郭信平先生正积极采取相关措施彻底解决股权质押风险。2019 年 1 月 3 日,郭信平先生与北京市海淀区国有资本经营管理中心(简称“海淀国资”)签订了《股权转让意向协议》,海淀国资联合央企以及指定的关联企业,拟采取现金收购的方式,适时收购郭信平先生所持有的上市公司 5%-20%的股份,相关信息已作公告。

3、结合郭信平先生所持你公司股票的质押、司法冻结等受限状态,说明上述事项对你公司日常生产经营、控制权稳定等的影响,并充分提示风险。

回复:

目前,郭信平先生所持本公司股票的质押、冻结事项对公司的日常生产经营并未造成影响。根据郭信平先生与海淀国资签署的《股权转让意向协议》,郭信平先生近期可能转让所持有的上市公司 5%-20%的股份,相关内容已作公告。

4、你公司在保持独立性、防范控股股东违规资金占用等方面采取的内部控制措施。

回复:

公司严格按照《公司法》、《证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》等相关法律法规及《公司章程》、《北京合众思壮科技股份有限公司防范控股股东及关联方占用公司资金专项制度》等要求建立健全公司治理机构与治理结构,规范运作,在业务、人员、资产、机构、财务等方面完全保持独立性。公司审计部密切关注和跟踪公司关联方的资金往来情况,定期核查公司与关联人之间的资金往来明细。同时,公司每个会计年度末聘请会计师事务所对公司控股股东及其关联方占用资金情况进行专项核查, 且由独立董事对关联方资金往来情况发表独立意见。公司从防范控股股东及关联方占用资金的责任和措施、责任追究及处罚等角度,加强与规范了防范机制,切实保护公司、股东及其他利益相关人的合法权益。截至目前,未发生控股股东及关联方资金占用的情形。

特此公告。

北京合众思壮科技股份有限公司董事会
二〇一九年一月十一日

证券代码:002554 证券简称:惠博普 公告编号:HBP2019-003

华油惠博普科技股份有限公司关于控股股东部分股份解除质押的公告

本公司董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述及重大遗漏。

华油惠博普科技股份有限公司(以下简称“公司”)近日接到公司共同控股股东之中白明垠先生的通知,获悉其部分股票质押贷款已归还并已办理完成相关股份的解除质押手续,具体情况如下:

一、控股股东股份解除质押的基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	解除质押股数(万股)	质押开始日期	质押解除日期	质权人	本次解除质押占其所持股份比例
白明垠	非第一大股东,为第一大股东的一致行动人	2,660 万股	2017年 7 月 31 日	2019 年 1 月 10 日	平安证券股份有限公司	24.02%

二、控股股东股份累计被质押的情况

截至公告日,白明垠先生持有本公司股份 11,076.40 万股,占公司股份总数的 10.34%,白明垠先生累计质押公司股份 5,091 万股,占其所持公司股份总数的 45.96%,占公司股份总数的 4.75%。

黄松先生、白明垠先生和肖荣先生为一致行动人,三人共同作为公司的控股股东和实际控制人。截至公告日, 上述三人合计持有公司股份 34,727.835 万股, 占公司股份总数的 32.43%;三人累计质押公司股份 21,342 万股,占三人所持公司股份总数的 61.46%,占公司股份总数的 19.93%。

三、其他说明

公司股东黄松、白明垠、肖荣所质押股份不存在平仓风险,股份质押行为不会导致公司实际控制权变更。同时,黄松、白明垠、肖荣承诺如若质押的股份出现平仓风险将及时通知上市公司并履行信息披露义务。

四、备查文件

1、中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司股份冻结明细;
2、证券解除质押登记证明。

特此公告。

华油惠博普科技股份有限公司董事会
二〇一九年一月十一日

证券代码:002365 证券简称:永安药业 公告编号:2019-02

潜江永安药业股份有限公司关于控股股东部分股份质押的公告

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。

潜江永安药业股份有限公司(以下简称“公司”)近日接到公司控股股东及实际控制人陈勇先生通知,获悉陈勇先生所持有公司部分股份被质押,具体事项如下:

一、股东股份质押的基本情况

1、股东股份被质押基本情况

股东名称	是否为第一大股东及一致行动人	质押股数	质押开始日期	质押到期日	质权人	本次质押占其所持股份比例	用途
陈勇	是	15,100,000	2019年 1 月 10 日	至申请解除质押登记为止	广发证券股份有限公司	23.79%	融资
合 计	—	15,100,000	—	—	—	23.79%	—

2、股东股份累计被质押情况

截至公告披露日,陈勇先生持有公司股份 63,468,000 股,占公司股本总额的 21.54%。本次质押后,其持有的公司股份累计质押 35,350,000 股,占其所持本公司股份的 55.70%,占本公司股份总数的 12.00%。

3、公司控股股东及实际控制人陈勇先生所质押股份不存在平仓风险,本次质押行为不会导致公司实际控制权变更。

陈勇先生未来股份变动如达到《证券法》、《上市公司收购管理办法》等规定的相关情形的,将遵守相关规定,及时履行信息披露义务。

二、备查文件

中国证券登记结算有限责任公司《证券质押及司法冻结明细表》。

特此公告。

潜江永安药业股份有限公司
董 事 会
二〇一九年一月十一日