(上接 D37 版)

法定代表人:弭洪军

客服电话:400-876-5716

97)深圳信诚基金销售有限公司

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:深圳市福田区时代财富大厦第 49A 单元

法定代表人:周文

客服电话:0755-23946579

98)喜鹊财富基金销售有限公司

住所:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

办公地址:西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦 1513 室

法定代表人:陈皓

客服电话:4006997719

99)通华财富(上海)基金销售有限公司

住所: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

客服电话:95156

100)深圳市小牛基金销售有限公司

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:深圳市福田区彩田路 2009 号瀚森大厦 17 楼

法定代表人:李俊

电话:0755-32981999

联系人:梁阳平

客服电话:4006695666

101)沈阳麟龙投资顾问有限公司

住所:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

办公地址:辽宁省沈阳市东陵区白塔二南街 18-2 号 B 座 601

法定代表人:朱荣晖

联系人:陈巧玲

客服电话:024-62833649

102)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

住所: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

客服电话:400-918-0808

103)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

住所: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 号环球财讯中心 A 座 5 层

法定代表人:钱昊旻

电话:010-59336593

联系人:徐英

客服电话:4008-909-998

104)中信期货有限公司

住所: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

电话:13718246886/010-60834022

联系人:刘宏莹

客服电话:400-9908-826

105)东海期货有限责任公司

住所:江苏省常州市延陵西路 23、25、27、29 号

办公地址:上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦 8 楼

法定代表人:陈太康

电话:021-68757102

联系人:李天雨

客服电话:95531/4008888588

106)大有期货有限公司

住所:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼

办公地址:湖南省长沙市天心区芙蓉南路二段 128 号现代广场三、四楼

法定代表人:颜如意

电话:0731-84409106、0731-84409130

联系人:马科、王霞

客服电话:4006-365-058

107)华信期货股份有限公司

住所:郑州市郑东新区商务内环路 27 号楼 1 单元 3 层 01 号、2 单元 3 层 02 号

办公地址:郑州市郑东新区商务内环路 27 号楼 1 单元 3 层 01 号、2 单元 3 层 02 号

法定代表人:张岩

电话:0371-69106682

联系人:李玉磊

客服电话:400-6197-666

108)华泰期货有限公司

住所:广州市越秀区东风东路 761 号丽丰大厦 20 层、29 层 04 单元

办公地址:广州市越秀区东风东路 761 号丽丰大厦 20 层、29 层 04 单元

法定代表人:吴祖芳

电话:0755-23887950

联系人:黄韵钰

客服电话:400-628-0888

109)新纪元期货股份有限公司

住所:江苏省徐州市淮海东路 153 号

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 8 楼

法定代表人:刘莎

电话:15102193460

联系人:王诗航

客服电话:0516-83831111/83835555

基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其他符合要求的其他机构销售本基金,并及时公告。

二、登记机构

名称:中融基金管理有限公司

住所:深圳市福田区莲花街道益田路 6009 号新世界中心 29 层

办公地址:北京市朝阳区东风南路 3 号院中融信托北京园区 C 座 4 层、5 层

法定代表人:王瑶

电话:010-56517000

传真:010-56517001

联系人:鞠帅平

网址:www.zrfunds.com.cn

三、出具法律意见书的律师事务所

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:安冬

经办律师:安冬、陆奇

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:上会会计师事务所

住所:上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 20 楼

办公地址:上海市静安区威海路 755 号文新报业大厦 20 楼

执行事务合伙人:张晓荣(首席合伙人)

电话:021-52920000

传真:021-52921369

经办注册会计师:张健、陈大愚

联系人:杨伟平

### 第四部分 基金的名称

中融现金增利货币市场基金

### 第五部分 基金类型、运作方式与存续期间

1.基金类型:货币型。

2.基金的运作方式:契约型开放式。

3.基金存续期间:不定期。

### 第六部分 基金的投资目标

在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

### 第七部分 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 1 年以内(含 1 年)的银行存款、债券回购、中央银行票据和同业存单,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货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

### 第八部分 基金的投资策略

本基金将根据宏观经济走势、货币政策、短期资金市场状况等因素对利率走势进行综合判断,并根据利率预期动态调整基金投资组合的平均剩余期限,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。

1、久期控制策略

本基金将根据对货币市场利率趋势的判断来配置基金资产的久期。在预期利率上升时,缩短基金资产的久期,以规避资本损失或获得较高的再投资收益;在预期利率下降时,延长基金资产的久期,以获取资本利得或锁定较高的收益率。

2、资产类属配置策略

资产类属配置是指基金资产在各类短期金融工具以及现金等投资品种之间配置的比例。本基金通过对各类别金融工具的流动性、收益率水平、供求关系、信用等级等因素的研究判断,挖掘不同类别金融工具的结构性投资价值, 制定并调整类属配置,形成合理组合以实现稳定的投资收益。

3、时机选择策略

债券发行以及季末、年末效应等因素可能会使市场资金供求情况发生暂时失衡,进而推高市场利率,充分利用这种短暂失衡能够提高基金资产的收益率。

4、套利策略

套利操作策略主要包括两个方面:

(1)跨市场套利。短期资金市场有交易所市场和银行间市场构成,由于其中的投资群体、交易方式等要素不同,使得两个市场的资金面、短期利率期限结构、流动性等方面都存在着一定的差别。本基金将在充分论证套利机会可行性的基础上,寻找合理的介入时机,进行跨市场套利操作,以期获得安全的超额收益。

(2)跨品种套利。由于投资群体存在一定的差异性,对期限相近的交易品种同样可能因为存在流动性、税收等市场因素的影响出现内在价值明显偏离的情况。本基金将在保证高流动性的基础上进行跨品种套利操作,以期获得安全的超额收益。

### 第九部分 基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:七天通知存款利率(税后) 。

通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。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利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者中国人民银行调整或停止该基准利率的发布,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金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,而无需召开基金份额持有人大会。

### 第十部分 基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金, 是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 第十一部分 基金的投资组合报告

本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金基金合同规定, 于 2018 年 6 月 12 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 3 月 31 日, 本报告中所列财务数据未经审计。

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 | 固定收益投资 | 11,073,491,444.06 | 36.61 |
|  | 其中:债券 | 11,073,491,444.06 | 36.61 |
|  | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 5,380,964,391.44 | 17.79 |
|  | 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 | 13,716,773,936.57 | 45.35 |
| 4 | 其他资产 | 78,468,785.21 | 0.26 |
| 5 | 合计 | 30,249,698,557.28 | 100.00 |

2、报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | - | 5.53 |
|  | 其中:买断式回购融资 | - | - |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 3,219,924,783.58 | 11.92 |
|  | 其中:买断式回购融资 | - | - |

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

3、基金投资组合平均剩余期限

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 | 77 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 78 |
| 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

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限无超过 120 天的情况。

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 | 28.96 | 11.92 |
|  | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 12.54 | - |
|  | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天(含)—90 天 | 48.37 | - |
|  | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 2.54 | - |
|  | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天(含) | 19.23 | - |
|  | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 |  | 111.65 | 11.92 |

4、报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期无超过 240 天的情况。

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 | 2,120,842,412.83 | 7.85 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 200,012,489.66 | 0.74 |
|  | 其中:政策性金融债 | 200,012,489.66 | 0.74 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 8,752,636,541.57 | 32.39 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 11,073,491,444.06 | 40.98 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

6、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名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 | 189906 | 18 贴现国债 06 | 12,000,000 | 1,196,230,012.57 | 4.43 |
| 2 | 111810031 | 18 兴业银行 CD031 | 10,000,000 | 997,935,534.14 | 3.69 |
| 3 | 111894196 | 18 盛京银行 CD120 | 10,000,000 | 989,470,464.80 | 3.66 |
| 4 | 189913 | 18 贴现国债 13 | 8,000,000 | 794,805,469.88 | 2.94 |
| 5 | 111713096 | 17 浙商银行 CD096 | 5,000,000 | 496,257,874.47 | 1.84 |
| 6 | 111894361 | 18 上海农商银行 CD025 | 5,000,000 | 494,831,482.99 | 1.83 |
| 7 | 111894443 | 18 重庆银行 CD060 | 5,000,000 | 489,443,454.21 | 1.81 |
| 8 | 111892042 | 18 哈尔滨银行 CD020 | 4,500,000 | 442,772,590.97 | 1.64 |
| 9 | 111894344 | 18 吴江农商行 CD023 | 4,000,000 | 390,821,913.25 | 1.45 |
| 10 | 111709507 | 17 浦发银行 CD507 | 3,500,000 | 346,996,918.81 | 1.28 |

5.7 “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 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0387% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0035% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0169% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.50%的情况。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8、投资组合报告附注

8.1 基金计价方法说明

本基金所持有的债券采用摊余成本法进行估值, 即估值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或折价,在其剩余期限内按实际利率法进行摊销,每日计提收益。

8.2 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。

8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 73,140,872.62 |
| 4 | 应收申购款 | 5,327,912.59 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 合计 | 78,468,785.21 |

8.4 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, 各比例的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### 第十二部分 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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截止日为 2018 年 3 月 31 日。

一、本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

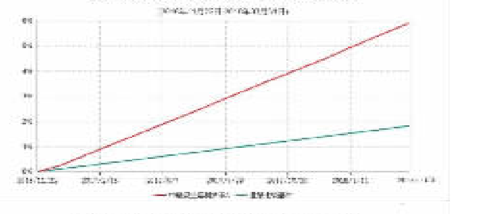
中融现金增利货币 A 净值表现

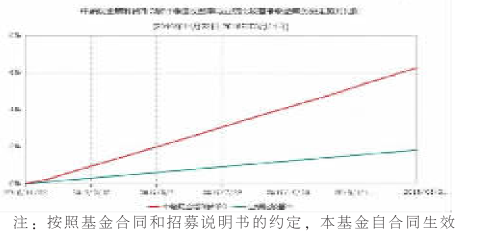
| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效日(2016 年 11 月 22 日)起至 2017 年 6 月 30 日 | 2.5471% | 0.0014% | 0.8174% | 0.0000% | 1.7297% | 0.0014% |
| 2017 年 7 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 2.1912% | 0.0005% | 0.6805% | 0.0000% | 1.5107% | 0.0005% |
| 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 31 日 | 1.0842% | 0.0006% | 0.3329% | 0.0000% | 0.7513% | 0.0006% |
| 自基金合同生效日(2016 年 11 月 22 日)起至 2018 年 3 月 31 日 | 5.9303% | 0.0010% | 1.8308% | 0.0000% | 4.0995% | 0.0010% |

中融现金增利货币 C 净值表现

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 自基金合同生效日(2016 年 11 月 22 日)起至 2017 年 6 月 30 日 | 2.6899% | 0.0014% | 0.8174% | 0.0000% | 1.8725% | 0.0014% |
| 2017 年 7 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日 | 2.3151% | 0.0005% | 0.6805% | 0.0000% | 1.6346% | 0.0005% |
| 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 3 月 31 日 | 1.1440% | 0.0006% | 0.3329% | 0.0000% | 0.8111% | 0.0006% |
| 自基金合同生效日(2016 年 11 月 22 日)起至 2018 年 3 月 31 日 | 6.2692% | 0.0010% | 1.8308% | 0.0000% | 4.4384% | 0.0010% |

二、自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





注:按照基金合同和招募说明书的约定,本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

第十三部分 基金的费用与税收

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、仲裁费和诉讼费;

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、账户开户费用、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 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.15%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核无误后 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,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 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷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,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核无误后 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,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%, 对于由 C 类基金份额降级为 A 类基金份额的基金份额持有人,年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。C 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%,对于由 A 类基金份额升级为 C 类基金份额的基金份额持有人,年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 C 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同,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

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核后 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构,由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

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,从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

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。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

(一)更新了“重要提示”中的相关内容。

(二)更新了“第一部分 绪言”中的相关内容。

(三)更新了“第二部分 释义”中的相关内容。

(四)更新了“第三部分 基金管理人”中的相关内容。

(五)更新了“第四部分 基金托管人”中的相关内容。

(六)更新了“第五部分 相关服务机构”中的相关内容。

(七)更新了“第八部分 基金份额的申购与赎回”中的相关内容。

(八)更新了“第九部分 基金的投资”中的相关内容。

(九)更新了“第十部分 基金的业绩”中的相关内容。

(十)更新了“第十二部分 基金资产的估值”中的相关内容。

(十一)更新了“第十六部分 基金的信息披露”中的相关内容。

(十二)更新了“第十七部分 风险揭示”中的相关内容。

(十三)更新了“第二十部分 托管协议的内容摘要”中的相关内容。

(十四)更新了 “第二十一部分 对基金份额持有人的服务”中的相关内容。

(十五)更新了“第二十二部分 其他应披露事项”中的相关内容。

**中融基金管理有限公司**
**2018 年 7 月 5 日**

---

# 中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于基金不定期份额折算的相关约定,当中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之 B 类份额的基金份额参考净值小于或等于 0.250 元时,中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金之基础份额(场内简称:钢铁母基,基金代码:168203)、钢铁 A 份额(场内简称:钢铁 A,基金代码:150287)、钢铁 B 份额 (场内简称: 钢铁 B, 基金代码:150288)将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大,截至 2018 年 7 月 4 日收盘,钢铁 B 份额的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值,提请投资者密切关注钢铁 B 份额近期基金份额参考净值的波动情况。

针对不定期份额折算可能带来的风险,基金管理人特别提示如下:

1.由于钢铁 A 份额、钢铁 B 份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,钢铁 A 份额、钢铁 B 份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

2.钢铁 B 份额表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

3.由于触发折算阀值当日,钢铁 B 份额的参考净值可能已低于阀值,而折算基准日在触发阀值日后才能确定,此折算基准日钢铁 B 份额的净值可能与折算阀值 0.250 元有一定差异。

4.钢铁 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后钢铁 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征钢铁 A 份额变为同时持有较低风险收益特征钢铁 A 份额与较高风险收益特征的中融钢铁份额的情况,因此钢铁 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

1.根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为 1 份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量中融钢铁份额、钢铁 A 份额、钢铁 B 份额的持有人存在折算后份额因为不足 1 份而被强制归入基金资产的风险。

2.为保证折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停钢铁 A 份额与钢铁 B 份额的上市交易以及中融钢铁份额的申购、赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情, 请参阅本基金基金合同及《中融国证钢铁行业指数分级证券投资基金招募说明书》或者拨打本公司客服电话 400-160-6000(免长途话费)或 010-56517299。

3.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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

**中融基金管理有限公司**
**2018 年 7 月 5 日**

---

**证券代码:600392 证券简称:盛和资源 公告编号:临 2018-047**
**债券代码:122418 债券简称:15 盛和债**

# 盛和资源控股股份有限公司关于“15 盛和债”公司债券回售的第一次提示性公告

**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:

? 回售代码:100932

? 回售简称:盛和回售

? 回售价格:按面值人民币 100 元/张

? 本次回售申报期:2018 年 7 月 9 日至 2018 年 7 月 11 日

? 回售资金发放日:2018 年 8 月 6 日

? 债券利率是否调整:债券利率不调整,仍为 4.7%

特别提示:

1、根据《盛和资源控股股份有限公司公开发行公司债券募集说明书(面向合格投资者)》(以下简称“《募集说明书》”)中设定的发行人调整票面利率选择权, 盛和资源控股股份有限公司 (以下简称 “公司”、“发行人”) 有权决定盛和资源控股股份有限公司 2015 年公开发行公司债券(债券简称“15 盛和债”,债券代码“122418”,以下简称“本期债券”)存续的第 3 年末是否调整后 2 年的票面利率。根据公司的实际情况及当前的市场环境,公司决定不行使票面利率调整选择权,即“15 盛和债”债券存续期后 2 年的票面利率不上调,仍为 4.7%。

2、根据《募集说明书》设定的投资者回售选择权,发行人发出关于是否调整本期债券票面利率及调整幅度的公告后,本期债券持有人有权在债券存续期间第三个计息年度付息日将其持有的全部或部分本期债券按票面金额回售给发行人。发行人将按照上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则完成回售支付工作。自发行人发出关于是否调整本期债券票面利率及调整幅度的公告之日起的 3 个交易日内,债券持有人可通过指定的交易系统进行回售申报。债券持有人的回售申报经确认后不能撤销,相应的公司债券份额将被冻结交易;回售登记期不进行申报的,则视为放弃回售选择权,继续持有本期债券并接受发行人上述关于是否调整本期债券票面利率及调整幅度的决定。

3、本公告仅对本期债券持有人申报回售的有关事宜作简要说明,不构成对申报回售的建议,本期债券持有人欲了解本次债券回售的详细信息,请通过上海证券交易所网站(http://www.sse.com.cn)查阅相关文件。

4、本次回售资金发放日指公司向本次有效申报回售的“15 盛和债”债券持有人支付本金及当期利息之日,即 2018 年 8 月 6 日。

为保证投资者回售选择权及发行人调整票面利率选择权有关工作的顺利进行,现将有关事宜公告如下:

一、本期债券基本情况

1、债券名称:盛和资源控股股份有限公司 2015 年公司债券。

2、债券简称:15 盛和债。

3、债券代码:122418。

4、发行人:盛和资源控股股份有限公司。

5、发行总额:人民币 4.5 亿元。

6、债券期限:本期债券期限为 5 年,附第 3 年末公司调整票面利率选择权及投资者回售选择权。

7、票面金额:本期债券票面金额为 100 元。

8、发行价格:本期债券按面值平价发行。

9、债券发行批准机关文号:本期债券经中国证券监督管理委员会证监许可【2015】1663 号文核准公开发行。

10、债券利率及其确定方式:本期债券票面利率为 4.7%,本期债券票面利率在其存续期前 3 年固定不变。如公司行使调整票面利率选择权, 则未被回售部分在其存续期后 2 年票面利率为前 3 年票面利率加调整基点,在其存续期后 2 年固定不变。如公司未行使调整票面利率选择权,则未被回售部分在其存续期后 2 年票面利率仍维持原有票面利率不变。

11、发行人调整票面利率选择权:发行人有权决定是否在本期债券存续期的第 3 年末调整本期债券后两年的票面利率。发行人将于本期债券的第三个计息年度的付息日前的第 20 个交易日, 在中国证监会指定的信息披露媒体上发布关于是否调整本期债券票面利率以及调整幅度的公告。

12、投资者回售选择权:发行人发出关于是否调整本期债券票面利率及调整幅度的公告后,本期债券持有人有权在债券存续期间第三个计息年度付息日将其持有的全部或部分本期债券按票面金额回售给发行人。发行人将按照上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司相关业务规则完成回售支付工作。自发行人发出关于是否调整本期债券票面利率及调整幅度的公告之日起的 3 个交易日内,债券持有人可通过指定的交易系统进行回售申报。债券持有人的回售申报经确认后不能撤销,相应的公司债券份额将被冻结交易;回售登记期不进行申报的,则视为放弃回售选择权,继续持有本期债券并接受发行人上述关于是否调整本期债券票面利率及调整幅度的决定。

13、还本付息方式:本期债券采用单利按年计息,不计复利。利息每年支付一次,到期一次还本,最后一期利息随本金一起支付。

14、起息日:本期债券的起息日为 2015 年 8 月 5 日。

15、利息登记日:本期债券的利息登记日将按照登记结算公司的相关规定执行。

16、付息日: 本期债券的付息日为 2016 年至 2020 年每年的 8 月 5 日,如遇法定节假日或休息日,则顺延至其后的第 1 个工作日,顺延期间兑付款项不另计利息。

17、到期日:本期债券的到期日为 2020 年 8 月 5 日。

18、兑付登记日:本期债券的本金及最后一次利息的兑付登记日将按照登记结算公司的相关规定执行。

19、兑付日:本期债券的兑付日为 2020 年 8 月 5 日,如遇法定节假日或休息日,则顺延至其后的第 1 个工作日,顺延期间兑付款项不另计利息。

20、付息、兑付方式:本期债券本息支付将按照本期债券登记机构的有关规定统计债券持有人名单,本息支付方式及其他具体安排按照债券登记机构的相关规定办理。

21、债券形式:本期债券为实名制记账式公司债券。投资者认购的本期债券在证券登记机构开立的托管账户记载。

22、信用级别及资信评级机构:经鹏元评定,发行人主体长期信用等级为 AA,本期债券的信用等级为 AA。

23、担保情况:本期债券为无担保债券。

24、主承销商、债券受托管理人:西部证券股份有限公司。

25、承销方式:本期债券由主承销商负责组建承销团,以余额包销的方式承销。

26、上市交易所:上海证券交易所。

27、募集资金用途:公司拟将本期债券募集资金扣除发行费用后全部用于补充流动资金。

二、本期债券利率调整情况

本期债券在存续期前 3 年 (即 2015 年 8 月 5 日至 2018 年 8 月 4 日)票面利率为 4.7%,在债券存续期内前 3 年固定不变。在本期债券存续期的第 3 年末,根据公司实际情况及当前的市场环境,公司决定不行使票面利率调整选择权,即“15 盛和债”债券存续期后 2 年的票面利率不上调,仍为 4.7%。

三、本期债券回售实施办法

1、回售代码:100932

2、回售简称:盛和回售

3、回售申报期:2018 年 7 月 9 日至 2018 年 7 月 11 日

4、回售价格:面值 100 元人民币。以 1,000 元为一个回售单位,回售金额必须是 1,000 元的整数倍。

5、回售申报办法:债券持有人可选择将持有的本期债券全部或部分回售给本公司, 在回售申报期通过上海证券交易所系统进行回售申报,当日可以撤单;当日收市后,申报一经确认不能撤销,相应债券将被冻结交易,直至本次回售实施完毕后相应债券被注销。

6、选择回售的债券持有人必须于回售申报期进行回售申报,逾期未办理回售登记手续即视为债券持有人放弃回售,同意继续持有本期债券并接受上述调整后的票面利率。

7、回售兑付日:2018 年 8 月 6 日。发行人委托中国证券登记结算有限责任公司上海分公司为登记回售的投资人办理兑付。

四、回售债券付款安排

1、回售资金发放日:2018 年 8 月 6 日。

2、回售债券付息方案:回售债券享有自 2017 年 8 月 5 日至 2018 年 8 月 4 日期间的利息。本期债券票面年利率为 4.7%。每手面值 1,000 元的派发利息为人民币 47.00 元(含税)。

3、付款方式:发行人将依照中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的回售申报结果对本期债券回售部分支付本金及利息。该回售资金通过中国证券登记结算有限责任公司上海分公司清算系统进入债券持有人开户的证券公司的登记公司备付金账户中,再由该证券公司在回售资金到账日划付至债券持有人在该证券公司的资金账户中。

五、回售申报期间的交易

“15 盛和债”在回售申报期内将继续交易;回售申报的债券,经确认后不能撤销,将被冻结交易。

六、回售价格

根据《盛和资源控股股份有限公司公开发行公司债券募集说明书(面向合格投资者)》的有关约定,“15 盛和债”回售价格为债券面值(100 元/张)。

七、回售申报程序

1、申报回售的 “15 盛和债” 债券持有人应在 2018 年 7 月 9 日至 2018 年 7 月 11 日正常交易时间(9:30-11:30,13:00-15:00),通过上交所交易系统进行回售申报,申报代码为 100932,申报方向为卖出,回售申报一经确认后不能撤销,相应的债券将被冻结交易,直至本次回售实施完毕后相应债券被注销。在回售资金发放日之前,如发生司法冻结或扣划等情形,债券持有人的该笔回售申报业务失效。

2、“15 盛和债” 债券持有人可对其持有的全部或部分有权回售的债券申报回售。“15 盛和债”债券持有人在本次回售申报日不进行申报的,视为对回售选择权的无条件放弃。

3、对“15 盛和债”债券持有人的有效回售申报,公司将在本年度付息日(2018 年 8 月 6 日)委托登记机构通过其资金清算系统进行清算交割。

八、回售实施时间安排

| 日期 | 内容 |
|---|---|
| 2018 年 7 月 4 日 | 发布本期债券票面利率不上调公告 |
|  | 发布本次回售公告 |
| 2018 年 7 月 5 日 | 发布“15 盛和债” 回售的第一次提示性公告 |
| 2018 年 7 月 6 日 | 发布“15 盛和债” 回售的第二次提示性公告 |
| 2018 年 7 月 9 日 | 发布“15 盛和债” 回售的第三次提示性公告 |
| 2018 年 7 月 9 日至 2018 年 7 月 11 日 | 本次回售申报期 |
| 2018 年 7 月 13 日 | 发布本次回售申报情况的公告 |
| 2018 年 8 月 6 日 | 发布本次回售结果的公告 |
| 2018 年 8 月 6 日 | 本次回售资金发放日,对有效申报回售的“15 盛和债”完成资金清算交割 |

注:因 2018 年 8 月 5 日为周末,根据《募集说明书》约定,回售资金发放日顺延至其后的第一个工作日,即 2018 年 8 月 6 日。

九、风险提示及相关处理

1、本次回售等同于“15 盛和债”债券持有人于债券存续期间第 3 个计息年度付息日(即 2018 年 8 月 6 日)以 100 元/张的价格卖出“15 盛和债”债券。请“15 盛和债”债券持有人对是否申报本次回售进行慎重判断并作出独立决策,本公告不构成对“15 盛和债”持有人是否行使回售选择权的建议。

2、上海证券交易所对公司债券实行“净价交易,全价结算”,即“15 盛和债”按净价进行申报和成交,以成交价格和应计利息额之和作为结算价格。

十、关于本次回售所付利息缴纳所得税的说明

(一)关于向个人投资者征收公司债券利息所得税的说明

根据《中华人民共和国个人所得税法》以及其他相关税收法规和文件的规定,本期债券个人投资者(包括证券投资基金)应缴纳公司债券个人利息收入所得税。本期债券利息个人所得税将统一由各兑付机构负责代扣代缴并直接向各兑付机构所在地的税务部门缴付。

本期债券的个人利息所得税征缴说明如下:

1、纳税人:本期债券的个人投资者(包括证券投资基金)

2、征税对象:本期债券的利息所得

3、征税税率:按利息额的 20%征收

4、征税环节:个人投资者在兑付机构领取利息时由兑付机构一次性扣除

5、代扣代缴义务人:负责本期债券付息工作的各兑付机构

(二)关于向居民企业征收公司债券利息所得税的说明

根据《中华人民共和国企业所得税法》以及其他相关税收法规和文件的规定,对于持有本期债券的居民企业,其债券利息所得税自行缴纳。

(三)关于向非居民企业征收公司债券利息所得税的说明

对于持有“15 盛和债”的合格境外机构投资者、人民币境外机构投资者(以下简称“QFII、RQFII”)等非居民企业(其含义同《中华人民共和国企业所得税法》),根据《中华人民共和国企业所得税法》及其实施条例、《非居民企业所得税源泉扣缴管理暂行办法》(国税发 [2009]3 号) 以及《关于中国居民企业向 QFII 支付股息、红利、利息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》(国税函[2009]47 号)等规定,本期债券非居民企业(包括 QFII、RQFII)取得的本期债券利息应缴纳 10%的企业所得税,并由公司代扣代缴。需要享受税收协定(安排)待遇的,可向主管税务机关提出申请后按规定办理。

(四)其他投资者缴纳公司债券利息所得税的说明

对于其他投资者,债券利息所得税自行缴纳。

十一、本期债券回售的相关机构

1、发行人:盛和资源控股股份有限公司

地址:成都市高新区盛和一路 66 号城南天府 7 楼

法定代表人:胡泽松

联系人:黄厚兵

电话:028-85425108

传真:028-85530349

2、主承销商:西部证券股份有限公司

地址:陕西省西安市新城区东新街 319 号 8 幢 10000 室

联系人:田海良

电话:010-68086722

传真:010-68086758

3、托管人:中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

地址:上海市陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 3 层

电话:021-38874800

邮编:200120

特此公告。

**盛和资源控股股份有限公司董事会**
**2018 年 7 月 5 日**