证券代码:603858 证券简称:步长制药 公告编号:2020-021

山东步长制药股份有限公司
关于对控股子公司提供借款及担保的补充公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容不存在虚假记载、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。

山东步长制药股份有限公司(以下简称"公司"或"步长制药")于 2020 年 3 月 31 日披露于上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)的《关于向控股子公司提供借款暨关联交易的公告》(公告编号:2020-013)以及《关于公司新增控股子公司融资额度及公司为其提供担保额度的公告》(公告编号:2020-014),现将有关情况补充如下:

一、股权结构

上海合璞医疗科技有限公司(以下简称"上海合璞")为公司控股子公司,公司持有其 71.3%的股权,薛人珲(公司董事、营销副总裁)持有其 0.2%股权(由其配偶段琳代为持有),王宝才(公司财务总监)持有其 0.1%股权,股权结构如下:

股东名称 / 姓名	注册资本(万元)	持股比例(%)
山东步长制药股份有限公司	14,260	71.30
沙靖轶	40	0.20
薛人珲(由其配偶段琳代为持有)	40	0.20
胡昂	40	0.20
王宝才	20	0.10
上海益督企业管理中心(有限合伙)	5,600	28.00
合计	20,000	100.00

南京华派为公司控股子公司,公司持有其 54.4%的股权,蒲晓平(公司董事、董事会秘书、副总裁)持有其 1%股权;王宝才(公司财务总监)持有其 0.1%股权,股权结构如下:

股东名称 / 姓名	出资额(万元)	股权比例(%)
山东步长制药股份有限公司	6,112.36	54.40
无锡逸度科技合伙企业(有限合伙)	2,500	22.25
无锡道润锦度科技合伙企业(有限合伙)	1,500	13.35
泰州逸文华派医药合伙企业(有限合伙)	552.90	4.92
南京华尔派生物技术有限公司	447.10	3.98
蒲晓平	112.36	1.00
王宝才	11.24	0.10
合 计	11,235.96	100.00

二、本次事项对公司的影响及分析

(一)借款风险及担保风险

本次借款主要用于支持控股子公司日常经营活动、研发项目等相关事项,因运营管理、市场等方面的不确定性,造成收益的不确定性,且存在相关项目未来发展不达预期的风险。

本次担保存在控股子公司未能及时偿还金融机构融资借款的可能,公司存在对此承担连带责任的风险。

(二)风险评估及应对措施

本次借款及担保事宜,上海合璞、南京华派的其他股东未提供同比例财务资助及担保。虽然其他股东未提供同比例财务资助及担保,但上海合璞、南京华派为公司合并报表范围内的控股子公司,公司能控制其经营状况和财务状况,且此类借款和担保符合一般市场经营规则,公司亦能有效的防范和控制风险,因而本次借款以及担保相关事宜的风险在公司可控范围内,不会损害公司利益,特别是中小股东的利益。

上海合璞、南京华派的生产经营情况、未来发展存在不确定因素,未来可能出现无法偿还公司或其他金融机构资金的情况,届时公司将承担全额损失,提醒广大投资注意投资风险。

上述借款及担保事宜提交股东大会审议通过后,将根据实际情况在额度内分次确定执行。超出额度的借款及担保,必须另行召开董事会或股东大会作出决议后才能实施。

(三)对公司的影响

截至 2019 年 9 月 30 日,公司总资产 2,013,778.91 万元,归属于上市公司股东的净资产 1,304,131.49 万元,营业收入 1,024,235.58 万元,归属于上市公司股东的净利润 134,903.85 万元,期末现金及现金等价物余额 211,572.49 万元。(数据未经审计)

公司本次审议的借款额度事项批准后,借款总额度占公司 2019 年 9 月 30 日总资产的 12.91%,净资产的 19.94%(数据未经审计)。本次审议的担保事项批准后,担保总额占公司 2019 年 9 月 30 日总资产的 16.88%,净资产的 26.07%(数据未经审计)。

根据公司 2019 年三季度报告显示,公司期末现金及现金等价物余额 211,572.49 万元,资金流充裕。为子公司提供借款事项是在年度股东大会通过后至下一年度股东大会的时间段内,公司将综合考虑经营需求和资金流的调配,借款和担保事宜将严格按照项目进展分期分批的进行,按照公司实际承受能力进行合理安排,预计不会对公司的日常经营造成影响。

上述借款及担保事宜不会对公司的正常运转、财务状况和未来的经营成果造成重大不利影响。

三、控股子公司经营情况分析

(一)上海合璞主营业务

上海合璞从事医疗科技专业领域内技术开发、技术转让、技术咨询、技术服务,一类、二类医疗器械销售,从事货物及技术的进出口业务,商务信息咨询,会务服务,展览展示服务,三类医疗器械(许可类项目详见许可证)批发。

上海合璞是从事医疗器械的国际贸易型进口公司,从医疗器械生产商购买产品,在境内进行销售,进入门槛较高,需要资金支持,存在资金周转周期长、投入金额大等相关特点,本次为其提供的借款及担保额度,后期将视项目的进展情况,在当地贷款时,提供具体担保。

(二)南京华派主营业务

南京华派从事医学工程技术、生物制品技术、药品技术研究、技术开发、技术咨询、技术服务及技术转让。

南京华派及其子公司主营疫苗研发业务,由于医药产品具有高科技、高风险、高附加值的特点,产品从研制、临床试验报批到投产的周期长、环节多、投入大,容易受到一些不确定性因素的影响,本次为其提供的借款及担保额度,后期将视具体项目和金融机构融资情况合理分配。

特此公告。

山东步长制药股份有限公司董事会
2020 年 4 月 3 日

证券代码:603858 证券简称:步长制药 公告编号:2020-022

山东步长制药股份有限公司
关于受让吉林银行股份有限公司部分股权暨关联交易的补充公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容不存在虚假记载、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。

山东步长制药股份有限公司(以下简称"公司"或"步长制药")于 2020 年 3 月 31 日披露于上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)的《关于受让吉林银行股份有限公司部分股权暨关联交易的公告》(公告编号:2020-016)现将有关情况补充如下:

一、本次交易的目的和必要性

公司拟受让关联方上海德涛投资有限公司(以下简称"上海德涛")持有的吉林银行股份有限公司(以下简称"吉林银行")30,000,000 股股份,本次受让吉林银行股份推动了实体产业与金融行业的协同发展,同时,通过本次投资,有利于公司改善融资结构,提升抗风险能力和整体竞争力,优化产业布局,增强盈利能力和综合实力,有利于促进公司的持续稳步发展。公司本次受让吉林银行股份是公司立足整体战略,布局金融投资板块业务发展的需要。

吉林银行具有较好的发展前景和可观的股权收益预期,有利于公司加强与银行的合作关系,能够取得一定的投资收益,有利于公司扩大收入来源,提升公司综合竞争力。同时,本次交易的资金来源于公司自有资金,不会导致公司合并报表范围变更,不会对公司财务状况及经营成果造成不良影响,不存在损害公司及全体股东利益的情形,对公司不构成重大影响。

根据中国银行业监督管理委员会的"两参"或"一控"政策,步长制药已投资朝阳银行股份有限公司(以下简称"朝阳银行")(为其第一大股东,持股比例 8.52%),详见公司 2019 年 1 月 4 日披露于上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)的《对外投资进展暨完成工商变更登记的公告》(公告编号:2019-003)。符合公司 2018 年 11 月 2 日披露于上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)的《对外投资进展公告》(公告编号:2018-092)中的承诺:后续公司将与朝阳银行签订正式协议,并严格履行"在成为朝阳银行股东后,遵守相关监管规定,参股商业银行不超过 2 家,或控股商业银行数量不超过 1 家"。

二、未提供有效期内经审计财务报告的说明

截至本公告日,吉林银行暂未出具经审计的 2019 年度报告。

截至 2019 年 6 月 30 日,吉林银行总资产 38,023,935.86 万元,净资产 2,653,555.74 万元,营业收入 468,932.65 万元,净利润 78,487.26 万元,每股净资产为 3.63 元(以上数据未经审计)。

结合 2018 年年报(经审计)的每股净资产为 3.52 元,及 2019 年半年报(未经审计)的每股净资产为 3.63 元(较 2018 年每股净资产高 0.11 元),为保证定价公允,公司参考经审计的财务报告(以每股净资产孰低计算)。

本次受让吉林银行股份的交易金额为 1.056 亿元,占公司最近一期经审计总资产的 0.53%,并未达到《上海证券交易所股票上市规则》中规定的提交股东大会审议的标准。经公司综合考虑金融机构的特殊性及维护广大股东利益的必要性,公司谨慎决定将本事项提交股东大会审议。

特此公告。

山东步长制药股份有限公司董事会
2020 年 4 月 3 日

证券代码:603858 证券简称:步长制药 公告编号:2020-023

山东步长制药股份有限公司
关于新增 2019 年度预计日常关联交易的补充公告

本公司董事会及全体董事保证公告内容不存在虚假记载、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。

山东步长制药股份有限公司(以下简称"公司"或"步长制药")于 2020 年 3 月 31 日披露于上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)的《关于新增 2019 年度预计日常关联交易的公告》(公告编号:2020-015)现将有关情况补充如下:

一、本次新增日常关联交易的内容及 2019 年度实际发生情况

关联交易类别	关联方	关联交易内容	2019 年度已发生金额(万元)	2019 年度预计新增交易金额(万元)
购买商品	咸阳步长中医心脑病医院	购买商品	0	100
提供劳务	咸阳步长中医心脑病医院	提供劳务	0	1,500
委托进行再临床研究	咸阳步长中医心脑病医院	委托进行再临床研究	0	2,000
销售商品	银川脑心同治互联网医院有限公司	销售商品	0	1,500

上表中:

向咸阳步长中医心脑病医院(以下简称"咸阳步长")购买商品,主要项目为购买健脑丹胶囊,解郁安神胶囊,癫痫灵胶囊,脑通舒胶囊,失语灵胶囊,心通舒胶囊等医院自身配制的药剂产品。公司拟进一步研究医院自研配制药物的有效性,并储备开发项目。

给咸阳步长提供劳务,主要项目为产品加工,如:药材烘干、粉碎;细粉辐照;总混;胶囊填充;铝塑包装,外包。加工产品如下:健脑丹胶囊,解郁安神胶囊,癫痫灵胶囊,脑通舒胶囊,失语灵胶囊,心通舒胶囊。咸阳步长已取得陕西省药品监督管理局发放的上述制剂批件及《关于咸阳步长中医心脑病医院制剂委托配置的批复》(陕药监函[2019]382 号),同意上述制剂委托陕西步长制药有限公司配置,委托配置期限:自 2019 年 11 月 12 日起至 2020 年 11 月 21 日止。

委托咸阳步长进行的再临床研究,主要为对公司已上市心脑血管类药品进行观察,研究其药效表现,并出具观察报告,为未来正式的临床研究做前期数据统计和收集工作;或委托咸阳步长在临床实践中提供临床观察资料,便于公司筛选出疗效好,具有市场潜力的品种,为后续研发提供数据支撑。此次关联交易拟涉及合作药品主要包括:稳心颗粒、丹红注射液、冠心舒通胶囊、银杏蜜环口服溶液等心脑血管类用药。截至本公告日,公司与咸阳步长尚未签订相关协议,后续正式签署协议时公司将履行信息披露义务。

与银川脑心同治互联网医院有限公司的销售商品关联交易主要为公司医药销售子公司向银川脑心同治互联网医院有限公司销售的产品,主要为:红核薰衣草抑菌洗液 160ML(弱酸泡沫型)、孕洁舒去味抑菌洗液 160ML(免洗泡沫型)、男士私处洗液 100ML(泡沫型)、红核薰衣草抑菌洗液 200ML(水剂)等。

二、定价依据

公司与上述关联方之间的关联交易的价格遵循以下原则确定:1、有国家规定价格的,依照该价格进行;2、没有政府定价的,有可适用行业价格标准的,依照该价格进行;3、如无适用的行业价格标准,依据市场价格进行;4、没有市场价参照的,参照产品的实际成本加合理的利润进行。

公司向咸阳步长提供劳务,主要涉及的是药品委托加工。公司子公司陕西步长制药有限公司在前述批复和批件的范围内委托加工,每次加工均按照加工成本加利润合理收费,每次加工均需核算成本,在双方同意的前提下签订具体协议。公司向咸阳步长提供劳务的定价以同行业公司签订同类型合同的定价原则为依据。

公司委托咸阳步长进行再临床研究遵循了市场定价规律,因为药品观察的时间周期长,为未来正式的临床研究做前期数据统计和收集工作人力成本大,结合公司与第三方签订的技术开发、技术服务合同及实际情况合理定价,价格公允。相关协议尚未签署,公司将在实际委托时,就实际人力成本及其他研究情况签署具体合同。

公司给银川脑心同治互联网医院有限公司销售商品参考市场价格,参照产品的实际成本加合理的利润进行。红核薰衣草抑菌洗液 160ML(弱酸泡沫型)第三方价格为 58.31 元、孕洁舒去味抑菌洗液 160ML(免洗泡沫型)第三方价格为 134.3 元、男士私处洗液 100ML(泡沫型)第三方价格为 83.81 元、红核薰衣草抑菌洗液 200ML(水剂)第三方价格为 32.30 元等。相关产品公司出售给关联方及第三方价格并无差异,定价公允。

上述日常关联交易遵循平等互利、等价有偿的一般商业性原则,交易价格按以上原则确认,上述日常关联交易不存在损害公司及股东,尤其是中小股东利益的情形。

三、履约能力分析

1、名称:咸阳步长中医心脑病医院

法定代表人:赵步长

成立时间:1992 年

开办资金:壹佰万元整

业务范围:中医、康复医疗

医疗机构执业许可证有效期限:自 2018 年 11 月 12 日至 2033 年 11 月 11 日。

医疗机构执业许可证登记号:74125610X61990417A5151

主要财务数据:截至 2019 年 12 月 31 日,咸阳步长总资产 207.78 万元,净资产-738.83 万元,2019 年度营业收入 534.76 万元,净利润-24.47 万元。

咸阳步长为中医心脑病医院,属于心脑血管专科医院,有丰富的参考病例,成立至今已就相关业务开展广泛且详细的研究,熟悉公司药品疗效,具备开展再临床研究的资质和能力。

2、名称:银川脑心同治互联网医院有限公司

法定代表人:付巍

注册资本:贰仟万元整

成立日期:2017 年 03 月 07 日

诊疗科目:内科/外科/妇产科/儿科/口腔科/皮肤科(以上诊疗科目均为线上诊疗)

医疗机构执业许可证有效期限:自 2017 年 7 月 4 日至 2022 年 7 月 3 日

医疗机构执业许可证登记号:pdy10021364010617A1002

主要财务数据:截至 2019 年 12 月 31 日,银川脑心同治总资产 26.53 万元,净资产 2.90 万元,2019 年度营业收入 14.77 万元,净利润-51.91 万元。

银川脑心同治互联网医院有限公司具有医疗机构执业许可证,可以以线上诊疗与线下销售相结合的方式进行药品销售,新型的销售方式拓宽了公司的销售方式。

上述关联方的主要财务指标正常,目前经营状况良好,具备支付实际发生额的能力。上述预计额度的提出一是基于发展长期业务考虑,实际业务量将随市场的发展情况而存在变动。二是为了提高决策效率,在实际发生业务时,能及时高效地开展业务,故该额度属于合理范畴。且不存在关联方长期占用本公司资金并造成呆、坏帐的可能,具有良好的履约能力。

特此公告。

山东步长制药股份有限公司
董事会
2020 年 4 月 3 日

(上接C109版)

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构,将信贷资产信托给受托机构,由受托机构向投资机构发行,以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响,谨慎投资资产支持证券。

7、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比,中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为:

①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息,分析企业的长期运作风险;

②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价,评估发行人财务风险;

③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算私募债券发行人的违约率及违约损失率;

④考察债券发行人的增信措施,如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等;

⑤综合上述分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择具有投资价值的品种进行投资。

8、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上,本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判,估算权证合理价值,同时还充分考虑个券的流动性,谨慎进行投资。

9、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则,以套期保值为主要目的,参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下,选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判,并结合股指期权定价模型,选择估值合理的期权合约。

基金管理人将根据审慎原则,建立股票期权交易决策部门或小组,按照有关要求做好人员培训工作,确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力,同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项,以防范期权投资的风险。

10、可转换债券及可交换债券投资策略

可转换债券和可交换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和内嵌期权价值,本基金管理人将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估,选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券进行投资。此外,本基金可根据新发可转债和可交换债券的预计中签率、模型定价结果,参与可转债和可交换债券新券的申购。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 × 60%+ 中债综合指数收益率 × 40%

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数,其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、流通市值大的主流股票,能够反映 A 股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数,其选样债券信用类别覆盖全面,期限构成宽泛。选用上述业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意,并报中国证监会备案,而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前 2 个工作日在指定媒介上予以公告。

第十部分 基金的风险收益特征

本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

第十一部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人根据本基金合同规定,复核了本投资组合报告,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取自本基金 2019 年第 1 季度报告,所载数据截至 2019 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	权益投资	48,638,732.92	92.46
	其中:股票	48,638,732.92	92.46
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	-	-
	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	3,709,460.48	7.05
8	其他资产	254,218.60	0.48
9	合计	52,602,412.00	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	-	-
C	制造业	33,727,858.47	64.98
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	-	-
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	10,272,517.95	19.79
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,723,840.50	5.25
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	1,914,516.00	3.69
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	48,638,732.92	93.70

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	002475	立讯精密	216,444	5,367,811.20	10.34
2	300450	先导智能	126,600	4,708,254.00	9.07
3	002812	恩捷股份	74,400	4,523,520.00	8.71
4	600570	恒生电子	38,269	3,350,833.64	6.46
5	002127	南极电商	237,890	2,723,840.50	5.25
6	603583	捷昌驱动	37,600	2,699,680.00	5.20
7	300271	华宇软件	110,100	2,341,827.00	4.51
8	002415	海康威视	62,055	2,176,268.85	4.19
9	603882	金域医学	62,200	1,914,516.00	3.69
10	300014	亿纬锂能	69,300	1,689,534.00	3.25

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。

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。

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。

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。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种,有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。基金管理人将按照相关法律法规的规定,结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系,对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控,在最大限度保证基金资产安全的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。

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持有国债期货。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资国债期货以套期保值为目的,以回避市场风险。故国债期货空头的合约价值主要与债券组合的多头价值相对应。基金管理人通过动态管理国债期货合约数量,以萃取相应债券组合的超额收益。

11、投资组合报告附注

11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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。

11.2 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	93,423.21
2	应收证券清算款	153,882.29
3	应收股利	-
4	应收利息	1,112.65
5	应收申购款	5,800.45
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	254,218.60

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因,投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

第十二部分 基金的业绩

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。

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。

本基金合同生效日 2017 年 12 月 1 日,基金业绩截止日 2019 年 3 月 31 日。

1.本报告期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

中欧瑾灵 A

阶段	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2017.12.1-2017.12.31	1.23%	0.65%	0.40%	0.51%	0.83%	0.14%
2018.1.1-2018.12.31	-19.04%	1.67%	-14.01%	0.80%	-5.03%	0.87%
2019.1.1-2019.3.31	34.04%	1.84%	16.73%	0.93%	17.31%	0.91%
2017.12.1-2019.3.31	9.86%	1.67%	0.78%	0.81%	9.08%	0.86%

数据来源:中欧基金

中欧瑾灵 C

阶段	①净值增长率	②净值增长率标准差	③业绩比较基准收益率	④业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2017.12.1-2017.12.31	1.16%	0.65%	0.40%	0.51%	0.76%	0.14%
2018.1.1-2018.12.31	-19.92%	1.67%	-14.01%	0.80%	-5.91%	0.87%
2019.1.1-2019.3.31	33.82%	1.84%	16.73%	0.93%	17.09%	0.91%
2017.12.1-2019.3.31	8.41%	1.67%	0.78%	0.81%	7.63%	0.85%

数据来源:中欧基金

2.基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

注:本基金基金合同生效日期为 2017 年 12 月 1 日,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

注:本基金基金合同生效日期为 2017 年 12 月 1 日,按基金合同的规定,本基金自基金合同生效起六个月为建仓期,建仓期结束时各项资产配置比例已符合基金合同约定。

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、基金的销售服务费;

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、诉讼费或仲裁费;

6、基金份额持有人大会费用;

7、基金的证券 / 期货交易费用;

8、基金的银行汇划费用;

9、基金的相关账户的开户及维护费用;

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 0.60%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E × 0.60% ÷ 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

基金管理费每日计算,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,基金托管人复核后于次月前 3 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 0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E × 0.10% ÷ 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

基金托管费每日计算,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,基金托管人复核后于次月前 3 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、基金的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.80%,销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.80%年费率计提。计算方法如下:

H=E × 0.80% ÷ 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算,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销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中支付到指定账户。基金销售服务费由基金管理人代收,基金管理人收到后按相关合同规定支付给销售机构。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。

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,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。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《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》及其他有关规定,并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动,对本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

本基金本次更新招募说明书仅根据 2019 年 9 月 1 日生效的《信息披露办法》及《基金合同》、《托管协议》的修订,更新《招募说明书》前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的收益与分配、基金的会计与审计、基金的信息披露、法律文件摘要等章节内容。

中欧基金管理有限公司
2020 年 4 月 3 日