证券代码:000576 证券简称:广东甘化 公告编号:2020-15

江门甘蔗化工厂(集团)股份有限公司 关于公司“三旧”改造第四块土地公开挂牌出让的公告

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。

根据《江门甘蔗化工厂(集团)股份有限公司本部厂区“三旧”改造协议书》的协定,江门市公共资源交易中心受托对公司“三旧”改造第四块土地(江门市JCR2020-55(蓬江08)号地块,以下简称“该地块”)进行公开挂牌出让,并于2020年5月9日予以了公告。主要内容如下:

一、根据城市规划,蓬江区甘北路东侧、西江西侧、泮边街南侧、北新街北侧地段的3、4、5、6号地按“三旧”政策实施整体连片改造。本次出让3、4、5号地块,出让建设用地面积174,537.52平方米(其中公司权属土地面积165,124.02平方米,占94.61%),用途为城镇住宅、商服用地,土地使用年限:住宅用地70年,商业用地40年,自土地移交之日起计。本次出让地块竞得人同时作为6号地的改造主体。

二、该地块挂牌起始价:168,365万元;竞买保证金:33,700万元;最低增价幅度:500万元/次。

三、时间安排:

(一)公告时间:2020年5月9日至2020年5月28日;

(二)竞买申请时间:2020年5月29日至2020年6月9日16时;

(三)交纳保证金时间:2020年5月29日至2020年6月9日17时;

(四)网上挂牌报价时间:2020年5月29日至2020年6月12日10时;

(五)网上限时竞价时间:2020年6月12日10时起。

该地块公开挂牌出让的具体信息详见江门市公共资源交易中心网站(http://www.jiangmen.gov.cn/bmpd/jmsggzyjyzx/)上发布的《江门市JCR2020-55(蓬江08)号国有建设用地使用权网上挂牌出让公告》等相关文件。公司将根据土地出让的进程及时履行信息披露义务,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

江门甘蔗化工厂(集团)股份有限公司
董事会
二〇二〇年五月十一日

证券代码:002893 证券简称:华通热力 公告编号:2020-065号

北京华远意通热力科技股份有限公司关于特定股东股份减持计划期限届满的公告

公司特定股东中山通用科技创业投资中心(有限合伙)保证向本公司提供的信息内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司及董事会全体成员保证公告内容与信息披露义务人提供的信息一致。

北京华远意通热力科技股份有限公司(以下简称“公司”、“本公司”)于2019年11月6日在巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)披露了《关于特定股东减持计划的预披露公告》(公告编号:2019-171号)。公司特定股东中山通用科技创业投资中心(有限合伙)(以下简称“中山通用投资”),拟通过大宗交易、集中竞价交易或协议转让等其他合法方式在六个月内减持本公司股份不超过7,428,564股(占本公司总股本159,749,200股的比例为4.65%)。

近日,公司董事会收到中山通用投资出具的《关于股份减持计划实施情况的告知函》,鉴于本次减持计划期限已经届满,现将本次股份减持计划实施结果有关情况公告如下:

一、减持情况

减持计划期间内中山通用投资未减持公司股份。

二、其他相关说明

1、中山通用投资本次股份减持计划已按照相关规定进行了预披露。本次股份减持计划未违反《证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》、《深圳证券交易所上市公司规范运作指引》、《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等法律、法规及规范性文件的规定。

2、本次减持事项与已披露的意向、承诺一致,未出现违反承诺的情况。

三、备查文件

中山通用投资出具的《关于股份减持计划实施情况的告知函》。

特此公告。

北京华远意通热力科技股份有限公司
董事会
2020年5月11日

证券代码:002773 证券简称:康弘药业 公告编号:2020-039

成都康弘药业集团股份有限公司 关于使用部分闲置募集资金进行现金管理的进展公告

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。

成都康弘药业集团股份有限公司(以下简称“康弘药业”或“公司”)第七届董事会第三次会议和第七届监事会第二次会议分别审议通过了《关于使用部分闲置募集资金进行现金管理的议案》,同意公司在确保不影响募集资金投资项目建设和公司正常运营的情况下,使用不超过8.9亿元的闲置募集资金进行现金管理,用于购买安全性高、短期(不超过一年)的保本型理财产品,使用期限为自公司董事会审议通过之日起24个月。在上述使用期限及额度范围内,资金可滚动使用。具体内容详见公司于2020年4月29日在指定信息披露媒体和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)刊登的《关于使用部分闲置募集资金进行现金管理的公告》(公告编号:2020-030)。

近日,公司使用部分闲置募集资金进行了现金管理。现将有关情况公告如下:

一、现金管理的进展情况

(一)成都银行理财产品的主要内容

所属银行		成都银行金牛支行	成都银行金牛支行
1	产品名称	“芙蓉锦程”单位结构性存款	“芙蓉锦程”单位结构性存款
2	产品代码	DZ-2020104	DZ-2020105
3	产品类型	定制型	定制型
4	购买金额	人民币3,000万元整	人民币8,000万元整
5	起息日	2020年5月8日	2020年5月8日
6	到期日	2020年6月8日(如遇法定节假日支取顺延)	2020年8月8日(如遇法定节假日支取顺延)
7	产品期限	31天	92天
8	产品挂钩标的	欧洲央行网站(网址www.ecb.europa.eu)上公布的EUR/USD汇率(通常于16:00 CET公布)	欧洲央行网站(网址www.ecb.europa.eu)上公布的EUR/USD汇率(通常于16:00 CET公布)
9	产品到期收益率的确定	若观察日EUR/USD≤1.19,则到期收益率为3.45%,(最高预期年收益率);若观察日1.30>EUR/USD>1.19,则到期收益率为1.43%-3.45%,(保底收益率-最高预期年收益率);若观察日EUR/USD≥1.30,则到期收益率为1.43%(保底收益率)。	若观察日EUR/USD≤1.19,则到期收益率为3.7%,(最高预期年收益率);若观察日1.30>EUR/USD>1.19,则到期收益率为1.54%-3.7%,(保底收益率-最高预期年收益率);若观察日EUR/USD≥1.30,则到期收益率为1.54%(保底收益率)。
10	资金来源	闲置募集资金	
11	关联关系说明	公司及下属子公司与成都银行金牛支行无关联关系	

12、风险提示:

(1)本金及收益风险:本产品有投资风险,成都银行仅保障资金本金以及合同明确承诺的收益,投资者应充分认识收益不确定的风险。本产品的收益由保值收益和浮动收益组成,浮动收益取决于挂钩标的价格变化,受市场多种要素的影响。收益不确定的风险由投资者自行承担,投资者应对此有充分的认识。如果在产品存续期内,市场收益上升,本存款的收益不随市场收益上升而提高。

(2)政策风险:本产品是针对当前的相关法规和政策设计的。如国家宏观政策以及市场相关法规政策发生变化,可能影响产品的起息、存续期、到期等的正常进行,甚至导致本产品收益降低。

(3)流动性风险:本产品存续期内,投资者只能在本产品说明书规定的时间内办理认购,产品成立后投资者不享有提前赎回权利。

(4)欠缺投资经验的风险:本产品的浮动收益与挂钩标的价格水平挂钩,收益计算较为复杂,故适合于具备相关投资经验和风险承受能力的投资者。

(5)信息传递风险:投资者应根据本产品说明书所载明的方式及时查询本产品相关信息。如果购买者未及时查询,或由于通讯故障、系统故障以及其他不可抗力等因素的影响使得投资者无法及时了解存款信息,并由此影响投资者的投资决策,因此而产生的责任和风险由投资者自行承担。另外,投资者预留在成都银行的有效联系方式变更的,应及时通知成都银行。如投资者未及时告知成都银行联系方式变更或因投资者其他原因,成都银行将可能在需要联系投资者时无法及时联系上,并可能会由此影响投资者的投资决策,由此而产生的责任和风险由投资者自行承担。

(6)产品不成立风险:如自投资者签署《成都银行单位结构性存款投资者协议书》至产品起息之前,国家宏观政策以及市场相关法规政策发生变化,或市场发生剧烈波动,且经成都银行合理判断难以按照本产品说明书规定向投资者提供本产品,则成都银行有权决定本产品不成立。

(7)数据来源风险:在本产品收益率的计算中,需要使用到数据提供商提供的挂钩标的价格水平。如果届时产品说明书中约定的数据提供商提供的参照页面不能给出所需的价格水平,成都银行将本着公平、公正、公允的原则,选择市场认可的合理的价格水平进行计算。

(8)不可抗力风险:指由于自然灾害、战争等不可抗力因素的出现,将严重影响金融市场的正常运行,可能影响本产品的受理、投资、偿还等的正常进行,甚至导致本产品收益降低的损失。对于由不可抗力风险所导致的任何损失,由投资者自行承担,成都银行对此不承担任何责任。

(9)再投资风险:成都银行有权但无义务提前终止本产品。如成都银行提前终止本产品,则该产品的实际产品期限可能小于预定期限。如果产品提前终止,则投资者将承担无法实现期初预期的全部收益的风险。

(10)产品风险:本期产品风险评定等级为I级,产品风险极低,本金损失风险为O。

(二)中国银行理财产品的主要内容

所属银行		中国银行武侯支行	中国银行武侯支行	中国银行武侯支行	中国银行武侯支行
1	产品名称	挂钩型结构性存款(机构客户)	挂钩型结构性存款(机构客户)	挂钩型结构性存款(机构客户)	挂钩型结构性存款(机构客户)
2	产品代码	CSDV202003669	CSDV202003670	CSDV202003699	CSDV202003700
3	产品类型	保本保最低收益型	保本保最低收益型	保本保最低收益型	保本保最低收益型
4	购买金额	人民币5,000万元整	人民币5,000万元整	人民币20,000万元整	人民币20,000万元整
5	收益起算日	2020年5月8日	2020年5月8日	2020年5月8日	2020年5月8日
6	到期日	2020年6月9日	2020年6月9日	2020年8月10日	2020年8月10日
7	产品期限	32天	32天	94天	94天
8	实际收益率	(1)收益率按照如下公式确定:如果在观察期内每个观察日,挂钩指标始终大于基准值减0.0100,扣除产品费用(如有)后,产品保底收益率【1.30%】(年率);如果在观察期内某个观察日,挂钩指标曾经小于或等于基准值减0.0100,扣除产品费用(如有)后,产品最高收益率【5.50%】(年率)。(2)挂钩指标为美元兑瑞郎即期汇率,取自每周一悉尼时间上午5点至每周五纽约时间下午5点之间,EBS(银行间电子交易系统)所取的美元兑瑞郎汇率的报价。(3)基准值为基准日北京时间14:00彭博“BFIX”版面公布的USDCHF中间价。(4)基准日为2020年5月8日。(5)观察期/观察时点为2020年5月8日北京时间15:00至2020年6月5日北京时间14:00。(6)产品收益计算基础为A/365。	(1)收益率按照如下公式确定:如果在观察期内某个观察日,挂钩指标始终曾经小于或等于基准值减0.0100,扣除产品费用(如有)后,产品保底收益率【1.30%】(年率);如果在观察期内每个观察日,挂钩指标始终大于基准值减0.0100,扣除产品费用(如有)后,产品最高收益率【5.50%】(年率)。(2)挂钩指标为美元兑瑞郎即期汇率,取自每周一悉尼时间上午5点至每周五纽约时间下午5点之间,EBS(银行间电子交易系统)所取的美元兑瑞郎汇率的报价。(3)基准值为基准日北京时间14:00彭博“BFIX”版面公布的USDCHF中间价。(4)基准日为2020年5月8日。(5)观察期/观察时点为2020年5月8日北京时间15:00至2020年6月5日北京时间14:00。(6)产品收益计算基础为A/365。	(1)收益率按照如下公式确定:如果在观察期内每个观察日,挂钩指标始终大于基准值减0.0200,扣除产品费用(如有)后,产品保底收益率【1.30%】(年率);如果在观察期内某个观察日,挂钩指标曾经小于或等于基准值减0.0200,扣除产品费用(如有)后,产品最高收益率【5.90%】(年率)。(2)挂钩指标为美元兑瑞郎即期汇率,取自每周一悉尼时间上午5点至每周五纽约时间下午5点之间,EBS(银行间电子交易系统)所取的美元兑瑞郎汇率的报价。(3)基准值为基准日北京时间14:00彭博“BFIX”版面公布的USDCHF中间价。(4)基准日为2020年5月8日。(5)观察期/观察时点为2020年5月8日北京时间15:00至2020年8月6日北京时间14:00。(6)产品收益计算基础为A/365。	(1)收益率按照如下公式确定:如果在观察期内某个观察日,挂钩指标始终曾经小于或等于基准值减0.0200,扣除产品费用(如有)后,产品保底收益率【1.30%】(年率);如果在观察期内每个观察日,挂钩指标始终大于基准值减0.0200,扣除产品费用(如有)后,产品最高收益率【5.90%】(年率)。(2)挂钩指标为美元兑瑞郎即期汇率,取自每周一悉尼时间上午5点至每周五纽约时间下午5点之间,EBS(银行间电子交易系统)所取的美元兑瑞郎汇率的报价。(3)基准值为基准日北京时间14:00彭博“BFIX”版面公布的USDCHF中间价。(4)基准日为2020年5月8日。(5)观察期/观察时点为2020年5月8日北京时间15:00至2020年8月6日北京时间14:00。(6)产品收益计算基础为A/365。
9	资金来源	闲置募集资金			
10	关联关系说明	公司及下属子公司与中国银行武侯支行无关联关系			

11、风险揭示

本结构性存款产品有投资风险,只保障产品认购资金和本结构性存款《认购委托书》约定的保底收益率,不保证高于保底收益率的收益,客户应充分认识投资风险,谨慎投资。

(1)政策风险:本结构性存款产品是根据当前的法律法规、相关监管规定和政策设计的,如果国家宏观政策以及市场法律法规、相关监管规定发生变化,可能影响本结构性存款产品的受理、投资运作、清算等业务的正常运行,由此导致本产品实际收益率降低;也可能导致本产品违反国家法律法规或其他政策的有关规定,进而导致本产品被宣告无效、撤销、解除或提前终止等。

(2)市场风险:受各种市场因素、宏观政策因素等的影响,挂钩指标价格变化将可能影响客户无法获得高于保底收益率的产品收益。

(3)流动性风险:本结构性存款产品不提供到期日之前的赎回机制,客户在产品期限内没有单方提前终止权,可能导致客户需要资金时不能随时变现,并可能使客户丧失其他投资机会的风险。

(4)信用风险:在中国银行发生信用风险的极端情况下,如被依法撤销或被申请破产等,将对本结构性存款产品的本金及收益支付产生影响。

(5)提前终止风险:本结构性存款产品存续期内,若遇法律法规、监管规定重大变更、或不可抗力等情形,可提前终止本产品。在提前终止情形下,客户面临不能按预定期限取得本金及预期收益的风险。

(6)信息传递风险:本结构性存款产品存续期内,客户应根据《产品说明书》所载明的信息披露方式及时查询本结构性存款产品的相关信息。如因客户未及时查询或由于非中国银行原因的通讯故障、系统故障以及其他不可抗力等因素的影响使得客户无法及时了解产品信息,并由此影响客户的投资决策,因此而产生的(包括但不限于因未及时获知信息而错过资金使用和再投资机会等)全部责任和风险由客户自行承担。另外,客户预留在中国银行的有效联系方式发生变更,应及时通知中国银行。如客户未及时告知联系方式变更,中国银行将可能在其认为需要时无法及时联系到客户,并可能由此影响客户的投资决策,因此而产生的全部责任和风险由客户自行承担。

(7)利率及通货膨胀风险:在本结构性存款产品存续期内,即使中国人民银行调整存款利率及/或贷款基准率,本产品的实际收益率可能并不会随之予以调整。同时,本产品存在客户实际收益率可能低于通货膨胀率,从而导致客户实际收益率为负的风险。

(8)产品不成立的风险:如本结构性存款产品募集期届满,募集总金额未达到规模下限(如有约定)或市场发生剧烈或发生本产品难以成立的其他情况,经中国银行合理判断难以按照《产品说明书》规定向客户提供本产品的,中国银行有权利宣布产品不成立。此时,客户应积极关注中国银行相关公告,及时对退回资金进行再投资安排,避免因误认为结构性存款产品按原计划成立而造成投资机会损失。

(9)其他风险:包括但不限于自然灾害、金融市场危机、战争或国家政策变化等不能预见、不能避免、不能克服的不可抗力事件或银行系统故障、通讯故障、电力中断、投资市场停止交易等意外事件的发生,可能对结构性存款产品的成立、投资运作、资金返还、信息披露、公告通知等造成影响,甚至可能导致产品实际收益率降低乃至本金损失。对于由于不可抗力及非因中国银行原因发生的意外事件风险导致的任何损失,由客户自行承担,中国银行对此不承担任何责任。

二、风险控制措施

(一)投资风险

1、尽管上述投资的现金管理品种属于低风险投资品种,但金融市场受宏观经济的影响较大,不排除该等投资受到市场波动的影响。

2、短期投资的实际收益不可预期。

3、相关人员操作风险。

(二)风险控制措施

1、公司进行现金管理,将选择资信状况、财务状况良好、无不良诚信记录及盈利能力强的合格专业理财机构作为受托方,并与受托方签订书面合同,明确委托理财的金额、期间、投资品种、双方的权利义务及法律责任等。

2、财务部门在实施期间及时分析和跟进现金管理品种的投向、项目进展情况,一旦发现或判断有不利因素,将及时采取相应的保全措施,控制投资风险。

3、财务部门定期对所有现金管理品种投资项目进行全面检查,根据审慎原则,合理预计各项投资可能发生的收益和损失。

4、强化相关人员的操作技能及素质。

5、公司内部审计部门定期对公司购买理财产品的资金使用与保管情况进行审计与监督。

6、独立董事、监事会有权对资金使用情况进行监督与检查,必要时可以聘请专业机构进行审计。

三、对公司经营的影响

1、公司运用部分闲置募集资金进行安全性高、风险低的短期理财产品投资是在确保不影响募集资金投资计划的前提下实施的,不会影响公司募集资金项目建设正常周转需要。

2、通过进行适度的低风险的短期理财,可以提高资金使用效率,能获得一定的投资效益,为公司和股东谋取更多的投资回报。

四、公告日前十二个月内进行现金管理的情况

截至本公告日,公司在过去十二个月内,累计使用闲置募集资金进行现金管理的金额合计6.10亿元,未超过公司董事会审议通过的金额范围和使用期限。具体如下表:

序号	银行名称	产品名称	产品类型	购买金额(万元)	起息日	到期日	是否赎回	投资收益(元)
1	成都银行金牛支行	“芙蓉锦程”单位结构性存款	定制型	3,000	2020年5月8日	2020年6月8日	否	-
2	成都银行金牛支行	“芙蓉锦程”单位结构性存款	定制型	8,000	2020年5月8日	2020年8月8日	否	-
3	中国银行武侯支行	挂钩型结构性存款(机构客户)	保本保最低收益型	5,000	2020年5月8日	2020年6月9日	否	-
4	中国银行武侯支行	挂钩型结构性存款(机构客户)	保本保最低收益型	5,000	2020年5月8日	2020年6月9日	否	-
5	中国银行武侯支行	挂钩型结构性存款(机构客户)	保本保最低收益型	20,000	2020年5月8日	2020年8月10日	否	-
6	中国银行武侯支行	挂钩型结构性存款(机构客户)	保本保最低收益型	20,000	2020年5月8日	2020年8月10日	否	-

五、备查文件

1、第七届董事会第三次会议决议;

2、第七届监事会第二次会议决议;

3、独立董事关于第七届董事会第三次会议相关议案的独立意见;

4、成都银行单位结构性存款投资者协议书、产品说明书、风险揭示书、认购凭条。

6、中国银行机构客户投资产品总协议书、产品说明书、风险揭示书、认购委托书。

特此公告。

成都康弘药业集团股份有限公司董事会
2020年5月11日

(上接C47版)

本基金债券投资将采取久期策略、收益率曲线策略、骑乘策略、息差策略、个券选择策略、信用策略等积极投资策略,灵活地调整组合的券种搭配,精选安全边际较高的个券,力争实现组合的绝对收益。

(1)久期策略

久期管理是债券投资的重要考量因素,本基金将采用以“目标久期”为中心、自上而下的组合久期管理策略。

(2)收益率曲线策略

收益率曲线的形状变化是判断市场整体走向的一个重要依据,本基金将据此调整组合长、中、短期债券的搭配,并进行动态调整。

(3)骑乘策略

本基金将采用基于收益率曲线分析对债券组合进行适时调整的骑乘策略,以达到增强组合的持有期收益的目的。

(4)息差策略

本基金将采用息差策略,以达到更好地利用杠杆放大债券投资的收益的目的。

(5)个券选择策略

本基金将根据单个债券到期收益率相对于市场收益率曲线的偏离程度,结合信用等级、流动性、选择权条款、税赋特点等因素,确定其投资价值,选择定价合理或价值被低估的债券进行投资。

(6)信用策略

本基金通过主动承担适度的信用风险来获取信用溢价,根据内、外部信用评级结果,结合对类似债券信用利差的分析以及对未来信用利差走势的判断,选择信用利差被高估、未来信用利差可能下降的信用债进行投资。

4、股票投资策略

(1)行业配置策略

在行业配置层面,本基金将运用“自上而下”的行业配置方法,通过对国内外宏观经济走势、经济结构转型的方向、国家经济与产业政策导向和经济周期调整的深入研究,采用价值理念与成长理念相结合的方法来对行业进行筛选。

(2)个股投资策略

本基金将结合定性与定量分析,主要采取自下而上的选股策略。基金依据约定的投资范围,基于对上市公司的品质评估分析、风险因素分析和估值分析,筛选出基本面良好的股票进行投资,在有效控制风险前提下,争取实现基金资产的长期稳健增值。

①品质评估分析

品质评估分析是本基金管理人基于企业的全面评估,对企业价值进行的有效分析和判断。上市公司品质评估分析包括财务品质评估和经营品质评估。

②风险因素分析

风险因素分析是对个股的风险暴露程度进行多因素分析,该分析主要从两个角度进行,一个是利用个股本身特有的信息进行分析,包括竞争引致的主营业务衰退风险、管理风险、关联交易、投资项目风险、股权变动、收购兼并等。另一个是利用统计模型对风险因素进行敏感性分析。

③估值分析

个股的估值是利用绝对估值和相对估值的方法,寻找估值合理和价值低估的个股进行投资。这里本基金主要利用股利折现模型、现金流折现模型、剩余收入折现模型、P/E模型、EV/EBIT模型、Franchise P/E模型等估值模型针对不同类型的产业和个股进行估值分析,另外在估值的过程中同时考虑通货膨胀因素对股票估值的影响,排除通胀的影响因素。

5、其他类型资产投资策略

在法律法规或监管机构允许的情况下,本基金将在严格控制投资风险的基础上适当参与权证、资产支持证券等金融工具的投资。

(1)权证投资策略

本基金对权证的投资是在严格控制投资组合风险,有利于实现资产保值和锁定收益的前提下进行的。

本基金将通过对权证标的股票基本面的研究,并结合期权定价模型,评估权证的合理投资价值,在有效控制风险的前提下进行权证投资;

本基金将通过权证与证券的组合投资,达到改善组合风险收益特征的目的,包括但不限于卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略,杠杆交易策略等,利用权证进行对冲和套利等。

(2)资产支持证券投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下,根据本基金资产管理的需要运用个券选择策略、交易策略等进行投资。

本基金通过对资产支持证券的发放机构、担保情况、资产池信用状况、违约率、历史违约记录和损失比例、证券信用风险等级、利差补偿程度等方面的分析,形成对资产证券的风险和收益进行综合评估,同时依据资产支持证券的定价模型,确定合适的投资对象。在资产支持证券的管理上,本基金通过建立违约波动模型、测评可能的违约损失概率,对资产支持证券进行跟踪和测评,从而形成有效的风险评估和控制。

九、基金的业绩比较基准

35%*中证股票型基金指数收益率+65%*中证债券型基金指数收益率

中证基金指数系列全面反映内地所有开放式证券投资基金及其细分种类的走势,为市场及投资者提供更丰富的基金业绩评价基准和基金投资参考依据。中证股票型基金指数、中证债券型基金指数为中证基金系列指数的细分指数。中证股票型基金指数样本包含主动股票基金和被动股票基金;中证债券型基金指数样本包含定开债基、分级债A、纯债债基、非纯债基、普通债基、转债债基等。基于本基金的投资范围和投资比例限制,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。

如果上述基准指数停止计算编制或更改名称,或者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比较基准时,本基金管理人在与基金托管人协商一致,并履行适当程序后调整或变更业绩比较基准并及时公告,而无须召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

本基金属于主动管理混合型FOF基金,预期风险与预期收益低于股票型基金、高于债券型基金与货币市场基金。

十一、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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,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2019年9月30日(摘自本基金2019年三季报),本报告中所列财务数据未经审计。

(一)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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	60,830,687.83	89.79
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	6,648,208.56	9.81
8	其他资产	269,734.86	0.40
9	合计	67,748,631.25	100.00

注:本基金本报告期末未通过港股通交易机制投资港股。

(二)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

本基金本报告期末未持有股票。

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通过港股通交易机制投资港股。

(三)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

本基金本报告期末未持有股票。

(四)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。

(五)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。

(六)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。

(七)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。

(八)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。

(九)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

本基金本报告期末未投资股指期货。

2、本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

(十)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

本基金本报告期末未投资国债期货。

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。

3、本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

(十一)投资组合报告附注

1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未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。

2、基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

报告期内本基金投资的前十名股票中,不存在超出基金合同规定备选股票库的情形。

3、其他资产的构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,295.38
2	应收证券清算款	199,970.24
3	应收股利	-
4	应收利息	1,516.13
5	应收申购款	52,836.28
6	其他应收款	12,116.83
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	269,734.86

注:其他应收款为应收销售服务费返还。

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。

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股票。

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,分项之和与合计项可能存在尾差。

(十二)基金中基金

1、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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	004609	长信乐信灵活配置混合C	契约型开放式	9,383,878.52	10,832,749.36	16.01	是
2	519985	长信纯债壹号债券A	契约型开放式	8,707,015.79	10,642,585.40	15.73	是
3	519152	新华纯债添利A	契约型开放式	8,305,518.55	9,858,650.52	14.57	否
4	004614	鹏扬利泽债券A	契约型开放式	7,414,148.67	7,732,957.06	11.43	否
5	003869	长信稳势纯债债券	契约型开放式	6,666,824.59	7,679,515.25	11.35	是
6	518880	华安易富黄金ETF	交易型开放式	1,007,800.00	3,422,488.80	5.06	否
7	510300	华泰柏瑞沪深300ETF	交易型开放式	643,300.00	2,488,927.70	3.68	否
8	070009	嘉实超短债债券	契约型开放式	1,997,526.87	2,100,399.50	3.10	否
9	519977	长信可转债债券A	契约型开放式	1,253,779.78	1,677,431.97	2.48	是
10	519971	长信改革红利灵活配置混合	契约型开放式	1,081,916.54	1,406,491.50	2.08	是

2、当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用2019年7月1日－2019年9月30日	其中:交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费(元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费(元)	1,342.92	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费(元)	7,949.23	6,428.20
当期持有基金产生的应支付管理费(元)	83,168.33	44,772.07
当期持有基金产生的应支付托管费(元)	22,600.37	11,355.87

注:当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值,上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定,基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费,基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的(ETF除外),应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费(按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取,并计入基金资产的赎回费用除外)、销售服务费等销售费用,其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行,销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

3、本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金本报告期持有的基金未发生重大影响事件。

十二、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。

基金各期间份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较:

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
自2018年9月5日(本基金合同生效日)起至2018年12月31日	1.90%	0.16%	-2.56%	0.55%	4.46%	-0.39%
2019年1月1日至6月30日	4.61%	0.22%	10.29%	0.52%	-5.68%	-0.30%
2019年7月1日至9月30日	1.69%	0.11%	2.12%	0.34%	-0.43%	-0.23%

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:1、图示日期为2018年9月5日至2019年9月30日。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内为建仓期,报告期末已完成建仓但报告期末距建仓结束不满一年;建仓期结束时,本基金的各项投资比例已符合基金合同的约定。

十三、费用概览

(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,但法律法规、中国证监会另有规定的除外;

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以及基金投资其他基金产生的相关费用(另有规定的除外);

7、基金的银行汇划费用;

8、账户开户费用、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。

(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

本基金基金财产中投资于本基金管理人管理的基金份额部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金管理人管理的基金份额部分基金资产后的余额(若为负数,则取0)的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×0.8%÷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扣除前一日所持有本基金管理人管理的基金份额部分基金资产后的余额(若为负数,则E取0)

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金基金财产中投资于本基金托管人托管的基金份额部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有本基金托管人托管的基金份额部分基金资产后的余额(若为负数,则取0)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扣除前一日所持有本基金托管人托管的基金份额部分基金资产后的余额(若为负数,则E取0)

基金托管费每日计提,按月支付,经基金管理人与基金托管人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至法定节假日、休息日结束之日起5个工作日内或不可抗力情形消除之日起5个工作日内支付。

上述“(一)基金费用的种类”中第3-9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。

基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的(ETF除外),应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费(按照相关法规、被投资基金招募说明书约定应当收取,并记入基金资产的赎回费用除外)、销售服务费等销售费用。

(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。

(五)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致,并履行适当程序后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调整基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议。

基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

(六)与基金销售有关的费用

1、申购费用

投资者申购本基金时交纳申购费用,申购费用按申购金额采用比例费率。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。具体费率如下:

单笔申购金额(M,含申购费)	申购费率
M<1000万	0.8%
M≥1000万	每笔1000元

注:M为申购金额

投资者选择红利自动再投资所转成的份额不收取申购费用。

2、赎回费率:

本基金的赎回费用在投资者赎回本基金份额时收取,赎回费率随持有时间的增加而递减,赎回具体费率如下:

持有期限(Y)	赎回费率
Y<7天	1.5%
7天≤Y<30天	0.75%
30天≤Y<6个月	0.5%
6个月≤Y<1年	0.25%
Y≥1年	0%

注:Y为持有期限

3、赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对于持有期少于30日的基金份额所收取的赎回费,全额计入基金财产;对于持有期不少于30日但少于3个月的基金份额所收取的赎回费,其75%计入基金财产;对于持有期不少于3个月但少于6个月的基金份额所收取的赎回费,其50%计入基金财产;对于持续持有期长于6个月的投资人,应当将赎回费总额的25%计入基金财产。未计入基金财产部分用于支付登记费和必要的手续费。

4、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,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。

5、基金管理人运用本基金基金财产申购自身管理的基金的(ETF除外),应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费(按照相关法律法规、基金招募说明书约定应当收取,并计入基金财产的赎回费用除外)、销售服务费等销售费用。

6、基金销售机构可以在不违反法律法规规定及基金合同约定,且对基金份额持有人利益无实质性不利影响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销售费率。

7、摆动定价机制

当本基金发生大额申购或赎回情形时,基金管理人可以采用摆动定价机制以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

8、基金的转换费用

基金管理人可以根据相关法律法规以及基金合同的规定决定开办本基金与基金管理人管理的其他基金之间的转换业务,基金转换可以收取一定的转换费,相关规则由基金管理人届时根据相关法律法规及基金合同的规定制定并公告,并提前告知基金托管人与相关机构。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《公开募集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,并结合本基金管理人对基金实施的投资经营活动,对本基金招募说明书(《长信稳进资产配置混合型基金中基金(FOF)招募说明书》)进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“三、基金管理人”部分,更新了基金经理相关信息。

长信基金管理有限责任公司
二〇二〇年五月十一日