

信息披露 Disclosure

泰信中证锐联基本面400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

依据《泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)的相关约定,当泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之泰信基本面400份场(场内简称:泰信400B、代码:150095)的基金份额参考净值达到0.250元时,本基金将针对泰信基本面400A份额(场内简称:泰信400A、代码:150094),泰信基本面400B份额(场内简称:泰信400B、代码:150095)和泰信基本面400份场(场内简称:泰信400B、代码:162907)进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截止2018年4月26日,泰信400B基金份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算的阀值0.250元,在此提醒投资者密切关注泰信400B份额近期参考净值的波动情况。

针对不定期折算可能带来的风险,基金管理人特别提示如下:

一、触发不定期折算当日,泰信400B份额的基金份额参考净值已跌至0.250元或以下,而折算基准日在触发日后才能确定,因此折算基准日泰信400B份额的基金份额参考净值可能与0.250元有差异。

二、由于泰信400A、泰信400B份额折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,泰信400A、泰信400B份额的折溢价率可能发生变化。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。

三、泰信400B份额具有预期风险、预期收益较高的特征,随着泰信400B份额的基金份额参考净值降低,其杠杆率升高。在不定期份额折算后,泰信400B份额的杠杆率将恢复至最初杠杆水平。

四、泰信400A份额具有预期风险、预期收益较低的特征。但在发生不定期份额折算后,泰信400A份额的持有人会获得一定比例的泰信400A份额,原泰信400A份额持有人的风险收益特征将发生一定变化,由持有单一的较低风险收益特征的泰信400A份额,因此原泰信400A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。此外,泰信400B份额为跟踪指数的基础份额,其份额净值将随市场涨跌而变化,因此原泰信400A份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

五、根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司和基金管理人的相关业务规则,场外份额进行份额折算的计算结果保留到小数点后2位,小数点后2位以后的部分舍去,舍去部分计入基金份额。场内份额进行份额折算时计算结果保留至整数位(最小单位为1份),小数点以后的部分舍去,舍去部分计入基金份额。因此,在不定期份额折算过程中,由于尾差处理,可能使得持有人的资产净值出现微小误差,但视为未改变基金份额持有人的资产净值。

六、在一级市场可以做交易的证券公司并不全部具备中国证监会颁发的基金销售资格,而投资者只能通过具备基金销售资格的证券公司购买泰信400A份额,在不定期份额折算后,则折算新增的泰信400份将无法赎回。投资者可以选择在折算前将泰信400A份额卖出,或者在折算后将新增的泰信400份转托管到具备基金销售资格的证券公司后赎回。

本基金管理人的其他重要提示:

1.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泰信400A份额与泰信400B份额的上市交易和泰信400B份额的申购、赎回、配对转换等相关业务。届时基金管理人将对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

泰信基金管理有限公司

2018年4月27日

泰信中证锐联基本面400指数分级基金B类份额交易价格波动提示公告

近期,泰信基金管理有限公司(以下简称“本基金管理人”)旗下泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金之B类份额(场内简称:泰信400B;交易代码:150095)二级市场交易价格连续大幅下跌,2018年4月26日,泰信400B类份额在二级市场的收盘价为0.399元,相对于当日0.365元的基金份额参考净值,溢价幅度为12.39%。截至2018年4月26日,泰信400B类份额二级市场的收盘价为0.399元,投资者如果盲目投资,可能遭受重大损失。

为此,基金管理人提示如下:

- 1.泰信400B类份额表现为高风险、高收益的特征。由于泰信400B类份额内含杠杠机制的设置,泰信400B类份额参考净值的变动幅度将大于泰信400份额(场内简称:泰信400,基金代码:162907)净值和泰信400A份额(场内简称:泰信400A,交易代码:150094)参考净值的变动幅度,即泰信400B类份额的波动性要高于其他两类份额,其承担的风险也较高。泰信400B类份额的持有人会因杠杠倍数的变化而承担不同程度的投资风险。
- 2.泰信400B类份额的交易价格,除了有份额参考净值变化的风险外,还会受到市场的系统性风险、流动性风险等其他风险影响,可能使投资人面临损失。

3.截至2018年4月26日收盘,泰信400B类份额的基本份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阀值。不定期份额折算后,泰信400B类份额的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。

4.截至本公告披露日,泰信中证锐联基本面400指数分级证券投资基金运作正常。本基金管理人仍将严格按照法律法规及基金合同进行投资运作。

5.截至目前本基金无其他应披露而未披露的重要信息。基金管理人仍将继续按照有关规定和要求,及时做好信息披露工作。

6.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。

泰信基金管理有限公司

2018年4月27日

长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同生效公告

送出日期:二〇一八年四月二十七日

§ 1 公告基本信息

基金名称	长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金
基金简称	长江汇聚量化多因子
基金主代码	006757
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年4月26日
基金管理人名称	长江证券(上海)资产管理有限公司
基金托管人名称	交通银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》和《长江汇聚量化多因子灵活配置混合型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定。

§ 2 基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号	证监许可[2017]1915号
基金募集期间	自2018年3月22日至2018年4月20日止
验资机构名称	中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)
募集资金划入基金托管专户的日期	2018-4-24
募集期间净认购金额(单位:元)	371,090,674.23
认购资金在募集期间产生的利息(单位:元)	23,877.10
募集份额(单位:份)	371,114,551.33
认购的基金份额(单位:份)	10,000,172.24
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金的情况	2,690%
其他资金认购本基金的情况	123,967.31
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金的情况	0.03%
募集期间基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件	是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期	2018-4-26

注:(1)本次基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费等费用由基金管理人承担,不从基金资产中支付。

注:(2)本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份(含)。

(3)本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份(含)。

§ 3 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,172.24	2.69%	10,000,172.24	2.69%	3年
基金管理人高级管理人员	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
基金经理等人员	15,900.96	0.00%	0.00	0.00%	-
基金管理人股东	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
其他	0.00	0.00%	0.00	0.00%	-
合计	10,016,153.20	2.70%	10,000,172.24	2.69%	3年

注:因四舍五入原因,持有份额占基金总份额比例的分项之和与合计存在尾差。

§ 4 其他需要提示的事项

(1)自基金合同生效之日起,基金管理人正式开始管理本基金。

(2)本基金的申购、赎回业务自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理。在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人将在申购、赎回开放日前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在指定媒体上公告。

(3)风险提示: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》、《招募说明书》等法律文件,投资与自身风险承受能力相适应的基金。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

长江证券(上海)资产管理有限公司

二〇一八年四月二十七日

瑞信方正证券有限责任公司 关于江苏东珠景观股份有限公司 2017年持续督导年度报告书

保荐机构	瑞信方正证券有限责任公司
上市公司简称	东珠景观
上市公司代码	603359
保荐代表人	赵留军 卢晋华
联系电话	010-66366699

关于江苏东珠景观股份有限公司(以下简称“东珠景观”、“公司”、“上市公司”或“发行人”)经中国证监会证监许可[2017]1311号文核准,向社会公开发行人民币690万股人民币普通股(A股),每股面值1.00元人民币。根据《证券法》、《证券发行上市保荐业务管理办法》、《上海证券交易所股票上市规则》和《上海证券交易所上市公司持续督导工作指引》等有关规定,瑞信方正证券有限责任公司(以下简称“瑞信方正”或“保荐机构”)作为东珠景观首次公开发行股票的保荐机构,对东珠景观进行持续督导,持续督导期为2017年9月1日至2019年12月31日。现就2017年度持续督导工作总结如下:

一、持续督导工作情况

序号	工作内容	完成持续督导情况
1	建立健全并有效执行内部控制制度,并针对具体的持续督导工作制定相应的工作计划	保荐机构已建立健全并有效执行持续督导工作制度,并针对具体的情况制定了相应的持续督导工作计划
2	根据中国证监会相关规定,在持续督导工作开始前,与上市公司及其相关当事人签署持续督导协议,并签订包含保密条款的协议文本,明确双方的权利义务	保荐机构与上市公司及其相关当事人签署了持续督导协议,并签订了包含保密条款的协议文本
3	通过日常沟通、定期回访、现场检查、尽职调查等方式,对上市公司的诚信状况、治理结构、内部控制制度的运行情况、募集资金使用情况、关联交易、购销政策、市场公平性等进行持续督导,并形成书面报告归档保存	保荐机构通过日常沟通、定期回访、现场检查、尽职调查等方式,对上市公司的诚信状况、治理结构、内部控制制度的运行情况、募集资金使用情况、关联交易、购销政策、市场公平性等进行了核查,形成了书面报告并归档保存
4	持续督导期间,按照有关规定对上市公司违法违规行为公开谴责的,督促上市公司及时披露相关信息,并记入诚信档案;持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方存在违法违规行为的,应当向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案;持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方涉嫌犯罪行为的,应当移送司法机关,依法配合司法机关开展后续工作	保荐机构持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方存在违法违规行为的,应当向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案;持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方涉嫌犯罪行为的,应当移送司法机关,依法配合司法机关开展后续工作
5	持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方存在严重损害上市公司利益、误导投资者决策、严重损害投资者合法权益等情形的,应当立即向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案;持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方严重损害上市公司利益、误导投资者决策、严重损害投资者合法权益等情形的,应当立即向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案	保荐机构持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方存在严重损害上市公司利益、误导投资者决策、严重损害投资者合法权益等情形的,应当立即向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案;持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方严重损害上市公司利益、误导投资者决策、严重损害投资者合法权益等情形的,应当立即向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案
6	持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方存在违反证券法律法规、损害投资者利益的重大违法行为的,应当立即向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案;持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方存在违反证券法律法规、损害投资者利益的重大违法行为的,应当立即向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案	保荐机构持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方存在违反证券法律法规、损害投资者利益的重大违法行为的,应当立即向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案;持续督导期间,发现上市公司及其董事、监事、高级管理人员、控股股东、实际控制人及其关联方存在违反证券法律法规、损害投资者利益的重大违法行为的,应当立即向中国证监会、上海证券交易所报告,并记入诚信档案
7	持续督导期间建立健全并有效执行内部控制制度,包括但不限于财务管理制度、会计核算制度、审计制度、关联交易制度、对外担保制度、对外投资制度、信息披露制度等,并督促上市公司严格执行	保荐机构持续督导期间,公司已建立健全并有效执行各项内部控制制度,包括但不限于财务管理制度、会计核算制度、审计制度、关联交易制度、对外担保制度、对外投资制度、信息披露制度等,并督促上市公司严格执行
8	持续督导期间对公司的内部控制制度设计、实施及运行情况进行核查,并形成书面报告,对内部控制制度的运行情况出具核查意见,并报中国证监会、上海证券交易所备案	保荐机构持续督导期间对公司的内部控制制度设计、实施及运行情况进行核查,并形成书面报告,对内部控制制度的运行情况出具核查意见,并报中国证监会、上海证券交易所备案
9	持续督导期间对公司的信息披露制度进行核查,审阅信息披露文件及向中国证监会、上海证券交易所提交的其他文件,并对其内容与格式、履行披露义务的时间等进行核查,确保信息披露真实、准确、完整、及时、公平,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏	保荐机构持续督导期间对公司的信息披露制度进行核查,审阅信息披露文件及向中国证监会、上海证券交易所提交的其他文件,并对其内容与格式、履行披露义务的时间等进行核查,确保信息披露真实、准确、完整、及时、公平,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏
10	对上市公司信息披露文件进行事前审阅,对存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的,应及时向中国证监会、上海证券交易所报告,并督促上市公司及时更正或补充公告,对存在误导性陈述的,应及时向中国证监会、上海证券交易所报告	保荐机构对上市公司信息披露文件进行事前审阅,对存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏的,应及时向中国证监会、上海证券交易所报告,并督促上市公司及时更正或补充公告,对存在误导性陈述的,应及时向中国证监会、上海证券交易所报告
11	对上市公司信息披露文件未进行事前审阅的,应及时向中国证监会、上海证券交易所报告	保荐机构对上市公司信息披露文件未进行事前审阅的,应及时向中国证监会、上海证券交易所报告

保荐代表人:
赵留军 卢晋华
瑞信方正证券有限责任公司
2018年4月26日

摩根士丹利华鑫基金管理有限公司关于旗下基金参与北京恒天明泽基金销售有限公司费率优惠活动的公告

为满足广大投资者的理财需求,摩根士丹利华鑫基金管理有限公司(以下简称“本公司”)经与北京恒天明泽基金销售有限公司(以下简称“恒天明泽”)协商一致,决定自2018年4月27日起,本公司旗下基金参与恒天明泽申购定期定额投资(以下简称“定投”)费率优惠活动,现将有关事项公告如下:

一、适用基金

1. 摩