

(上接 C19 版) 本基金将借助公司内部研究员的专业研究能力,并综合参考外部权威、专业研究机构的研究成果,采用定量分析与定性分析相结合的分析方法对发债主体企业进行深入的基本面分析,并结合债券的发行条款等因素确定信用债的实际信用风险状况及其信用利差水平,挖掘并投资于信用风险相对较低、信用利差收益相对较大的优质品种。发债主体的信用基本面分析是信用债投资的基础性工作。具体的分析内容及指标包括但不限于国民经济运行的周期阶段、债券发行人所处行业发展前景、发行人业务发展状况、企业市场地位、财务状况、管理水平及其债务水平等。

4、信用债调整 信用债发行企业在存续期间可能会受到多种因素或事件的影响,从而导致其信用状况发生变化。债券发行人的信用状况发生变化后,本基金将及时采用新的债券信用评级所对应的信用利差曲线对信用债等进行重新定价,尽可能的挖掘和把握信用利差暂时性偏离带来的投资机会,获得超额收益。

(四) 息差策略 本基金可以通过债券回购融入和滚动短期资金作为杠杆,投资于收益率高于融资成本的其它获利机会,从而获得杠杆放大收益。本基金进入银行间同业市场进行债券回购的资金余额不超过基金资产净值的40%。

(五) 中小企业私募债券投资策略 本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较,对个券发行主体的性质、行业、经营情况,以及债券的增信措施等进行全面分析,选择具有优势的品种进行投资,并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

(六) 资产支持证券投资策略 资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

(七) 国债期货投资策略 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。管理人将以风险管理为原则,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。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

2、开放期投资策略 开放期内,为了保证组合具有较高的流动性,本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下,投资于具有较高流动性的投资品种,通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。

第九部分 基金的业绩比较基准 本基金业绩比较基准:中债综合财富(总值)指数收益率×90%+银行1年期定期存款利率(税后)×10%。

其中,银行1年期定期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构一年期人民币存款基准利率。

本基金选择上述业绩比较基准的原因:本基金是通过债券等固定收益资产获取收益,力争获取较稳健的绝对回报,追求基金资产的保值增值。中债综合财富(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,该指数旨在综合反映债券市场整体价格和投资回报情况,具有较强的权威性。指数涵盖了银行间市场、交易所市场及柜台市场,具有广泛的市场代表性,适合作为本基金债券投资业绩的衡量标准。由于本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产净值的80%,扣除国债期货交易保证金后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%,采用90%乘以中债综合财富(总值)指数作为业绩比较基准中债券资产所代表的权重,10%乘以银行1年期定期存款利率(税后)作为剩余资产所对应的权重可以较好的反映本基金的风险收益特征。

未来,如果人民银行调整或停止发布基准利率,或者中央国债登记结算有限责任公司停止计算编制中债综合财富(总值)指数或更改指数名称,经与基金托管人协商一致,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。

如果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,基金管理人可以根据具体情况,依据维护基金份额持有人合法权益的原则,经与基金托管人协商一致并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 本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。

第十一部分 基金投资组合报告 基金管理人及董事会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。 基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年12月26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。 本报告投资组合报告所载数据截至2019年9月30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 -- -- 其中:股票 -- -- 2 固定收益投资 7,780,380,000.00 98.31 其中:债券 6,930,369,000.00 87.57 资产支持证券 850,011,000.00 10.74 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 21,404,489.78 0.27 7 其他资产 112,054,560.15 1.42 8 合计 7,913,839,049.93 100.00

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 本基金本报告期末未持有境内股票。 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通过港股通投资的股票。 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组合 本基金本报告期末未持有股票。 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 国债债券 -- -- 2 央行票据 -- -- 3 金融债券 3,653,248,000.00 62.07 其中:政策性金融债 1,730,230,000.00 29.40 4 企业债券 1,688,076,000.00 28.68 5 企业短期融资券 60,240,000.00 1.02 6 中期票据 1,238,555,000.00 21.04 7 可转债(可交换债) -- -- 8 同业存单 290,250,000.00 4.93 9 其他 -- -- 10 合计 6,930,369,000.00 117.75

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组合 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 1828005 18浙商银行 01 4,500,000 458,325,000.00 7.79 2 180210 18国开10 4,000,000 407,880,000.00 6.93 3 190205 19国开05 4,000,000 393,000,000.00 6.68 4 1820013 18江苏银行 01 3,000,000 315,240,000.00 5.36 5 0980146 09中航债 固 3,000,000 303,390,000.00 5.15

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 序号 证券代码 证券名称 数量(份) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 1 1889274 18工元1A2 3,500,000 363,160,000.00 6.17 2 1889264 18交盈1A2 2,500,000 257,700,000.00 4.38 3 1889399 18中盈万家 1A3 2,000,000 157,600,000.00 2.68 4 1889434 18工元宏富 5A2 500,000 51,405,000.00 0.87 5 1889398 18中盈万家 1A2 200,000 20,146,000.00 0.34

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 (1)本基金本报告期末未持有股指期货。 (2)本基金本报告期末未进行股指期货交易。 10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 (1)本基金本报告期末未持有国债期货。 (2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。 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中,中国工商银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司和江苏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会(含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会)或其派出机构的处罚。 本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。 11.2 本报告期内,本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。 11.3 其他投资组合构成

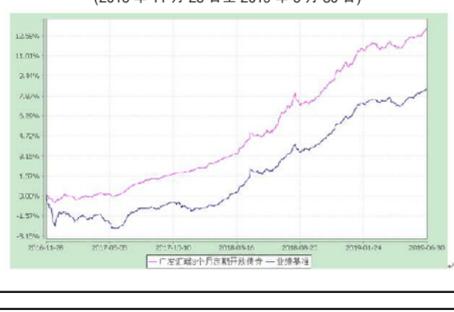
序号 名称 金额(元) 1 存出保证金 92,986.78 2 应收证券清算款 -- 3 应收股利 -- 4 应收利息 111,961,573.37 5 应收申购款 -- 6 其他应收款 -- 7 待摊费用 -- 8 其他 -- 9 合计 112,054,560.15

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。

第十二部分 基金的业绩 本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资产,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。基金业绩数据截至2019年6月30日。

1. 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 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 2016.11.28-2016.12.31 -0.27% 0.07% -1.27% 0.19% 1.00% -0.12% 2017.1.1-2017.12.31 2.52% 0.03% 0.37% 0.06% 2.15% -0.03% 2018.1.1-2018.12.31 8.15% 0.07% 7.55% 0.06% 0.60% 0.01% 2019.1.1-2019.6.30 2.33% 0.06% 1.71% 0.05% 0.62% 0.01% 自基金合同生效至今 13.15% 0.06% 8.39% 0.07% 4.76% -0.01%

2 本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 广发汇瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资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(2016年11月28日至2019年6月30日)



浙江嘉澳环保科技股份有限公司 简式权益变动报告书

上市公司名称:浙江嘉澳环保科技股份有限公司 上市地点:上海证券交易所 股票简称:嘉澳环保 股票代码:603822 信息披露义务人:君润国际投资有限公司 住所及通讯地址:FLAT/RM A 12/F KIU FU COMMERCIAL BLOG 300 LOCKHART ROAD WAN CHAI HK

签署日期:二〇二〇年二月二十一日 信息披露义务人声明:本人/公司等作为信息披露义务人签署本报告,旨在提供有关信息披露义务人持有上市公司股份的情况,并不构成任何投资建议,也不构成任何要约或要约邀请,且本人/公司等对信息披露内容的真实性、准确性和完整性不承担任何个别及连带责任。

一、信息披露义务人依据《证券法》、《上市公司收购管理办法》、《公开发行证券信息披露内容与格式准则第15号——权益变动报告书》(简称“15号准则”)及相关的法律、法规编制本报告,并保证本报告不存在虚假记载、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。 二、依据《证券法》、《收购办法》规定,本报告书已全面披露信息披露义务人在嘉澳环保中拥有权益的股份变动情况。 三、截至本报告书签署之日,除本报告书披露的信息外,信息披露义务人没有通过任何其他方式增加或减少其在嘉澳环保中拥有权益的股份。 四、本报告书披露的信息,信息披露义务人没有委托或授权任何其他人提供未在本报告书中列载的信息,且对本报告书做出任何解释或说明。

第一节 释义 本报告书中,除非文意另有所指,下列简称具有如下特定含义: 信息披露义务人指 君润国际投资有限公司 君润国际指 君润国际投资有限公司 上市公司指 浙江嘉澳环保科技股份有限公司 本报告书指 《浙江嘉澳环保科技股份有限公司简式权益变动报告书》 证监会指 中国证券监督管理委员会 上交所指 上海证券交易所 公司指 《中华人民共和国公司法》 上市规则指 《上海证券交易所股票上市规则》 元、万元指 人民币元

第二节 信息披露义务人基本情况 一、信息披露义务人基本情况 公司名称 君润国际投资有限公司 注册地 香港 住所 FLAT/RM A 12/F KIU FU COMMERCIAL BLOG 300 LOCKHART ROAD WAN CHAI HK 注册资本 100,000港币 注册证书号 875544 控股股东 黄瑞金持有100%股份 二、信息披露义务人的董事及主要负责人基本情况 姓名 性别 职务 国籍 长期居住地 是否取得其他国家或地区居留权 黄瑞金 男 董事 中国 浙江杭州 是 三、信息披露义务人在境内、境外其他上市公司中拥有权益的股份达到或超过该公司已发行股份5%的情况 截至本报告书签署之日,信息披露义务人除嘉澳环保外,持有浙江今凯达超毅股份有限公司(002863.SZ)13.74%的股份。 四、信息披露义务人持有上市公司股份情况 本次权益变动的目的为信息披露义务人根据自身经营发展需要而减持上市公司股份。 二、持股计划 信息披露义务人于2020年1月14日向嘉澳环保出具《关于减持浙江嘉澳环保科技股份有限公司股份告知函》拟减持上市公司股份,上市公司已发布公告(详见嘉澳环保2020-005号公告)。 截止本报告书签署之日,上述减持计划尚未实施完毕,信息披露义务人在未来十二个月内拟继续减持嘉澳环保股份。信息披露义务人严格按照相关法律法规的要求,及时履行信息披露义务和相应的报告义务。 一、本次权益变动前信息披露义务人持有上市公司股份情况 本次权益变动前,嘉澳环保总股本73,355,023股,信息披露义务人直接持有嘉澳环保股份9,950,000股,占其总股本的13.56%。 二、本次权益变动情况 信息披露义务人于2018年5月10日、2018年12月2日、2019年6月25日、2020年1月14日向上交所发出减持计划告知函,严格按照相关法律法规的要求减持上市公司股份,并履行了信息披露和相应的报告义务。

证券代码:002239 证券简称:奥特佳 公告编号:2020-013 奥特佳新能源科技股份有限公司 关于控股股东股权质押延期的公告

本公司及董事会全体成员保证本次信息披露的内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 北京天佑作为北京天佑投资有限公司(以下简称北京天佑)于2020年2月20日延期了其前期实施的股权质押融资事项。延期涉及的股份数为32500万股,延长期限为6个月。详情如下: 一、控股股东股份质押延期情况

北京天佑持有北京天佑投资有限公司(以下简称“北京天佑”)于2020年2月20日延期了其前期实施的股权质押融资事项。延期涉及的股份数为32500万股,延长期限为6个月。详情如下: 一、控股股东股份质押延期情况 北京天佑持有北京天佑投资有限公司(以下简称“北京天佑”)于2020年2月20日延期了其前期实施的股权质押融资事项。延期涉及的股份数为32500万股,延长期限为6个月。详情如下: 一、控股股东股份质押延期情况

二、前期质押情况和本次延期的原因 北京天佑于2018年2月22日与申万宏源证券有限责任公司签署了股票质押回购融资业务协议,以本公司17300万股股票为质押物办理了质押融资(详见本公司2018年2月24日披露的《关于公司控股股东股份质押的公告》(2018-013号)),后因补充质押物,质押股数增至32500万股。 2020年2月20日质押到期后,北京天佑与申万宏源证券协商延期质押股份,延长期限为6个月,自2020年2月20日至2020年8月20日,用途仍为用于补充

基本情形 浙江嘉澳环保科技股份有限公司 上市公司所在地 桐乡经济开发区 股票简称 嘉澳环保 股票代码 603822 信息披露义务人名称 君润国际投资有限公司 信息披露义务人联系地址 住所及通讯地址:FLAT/RM A 12/F KIU FU COMMERCIAL BLOG 300 LOCKHART ROAD WAN CHAI HK 拥有权益的股份数量变化 增加□ 减少□ 不变,但持股人有无一致行动人 有□ 无□ 信息披露义务人是否为上市公司第一大股东 是□ 否□ 信息披露义务人是否为上市公司实际控制人 是□ 否□ 通过证券交易所的集中交易(协议转让□ 国有行政划转或变更□ 司法拍卖□ 取得上市公司发行的新股□ 执行法院裁定□ 继承□ 赠与□ 其他√ 大宗交易(请注明) 信息披露义务人披露前拥有权益的股份数量及上市公司已发行股份比例 股票种类:无限售条件流通股 持股数量:9,950,000股 持股比例:13.56% 本次权益变动后,信息披露义务人拥有权益的股份数量及变动比例 股票种类:无限售条件流通股 变动数量:3,667,720股 变动比例:5% 变动后持股数量:6,282,280股 持股比例:8.56% 信息披露义务人是否属于未来12个月内拟减持计划 是□ 否□ 信息披露义务人在此6个月是否在二级市场买入该上市公司股票 是□ 否□ 附注: 信息披露义务人:君润国际投资有限公司 日期:2020年2月21日

证券代码:603822 债券代码:113502 转股代码:191502 股票简称:嘉澳环保 债券简称:嘉澳转债 转股简称:嘉澳转股 编号:2020-020 浙江嘉澳环保科技股份有限公司 关于股东权益变动的提示公告

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: 本次权益变动属于减持,不触及要约收购 本次权益变动不会使公司控股股东及实际控制人发生变化 一、本次权益变动基本情况 1.信息披露义务人基本情况 信息披露义务人名称:君润国际投资有限公司(以下简称“君润国际”) 注册地址:香港 公司注册资本:100,000港币 公司注册地址:875544 住所及通讯地址:FLAT/RM A 12/F KIU FU COMMERCIAL BLOG 300 LOCKHART ROAD WAN CHAI HK 2.本次权益变动情况 浙江嘉澳环保科技股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)于近日收到本公司股东君润国际的通知,其在2019年4月3日至2020年2月20日通过上海证

北京天佑持有北京天佑投资有限公司(以下简称“北京天佑”)于2020年2月20日延期了其前期实施的股权质押融资事项。延期涉及的股份数为32500万股,延长期限为6个月。详情如下: 一、控股股东股份质押延期情况 北京天佑持有北京天佑投资有限公司(以下简称“北京天佑”)于2020年2月20日延期了其前期实施的股权质押融资事项。延期涉及的股份数为32500万股,延长期限为6个月。详情如下: 一、控股股东股份质押延期情况

券交易所大宗交易系统及竞价交易系统减持本公司股份合计3,667,720股,占公司股份总数的5%。 本次股份减持前,君润国际持有9,950,000股股份,占公司股份总数的比例为13.56%。 本次股份减持后,君润国际持有6,282,280股股份,占公司股份总数的比例约为8.56%,仍为持有本公司5%以上股份的股东。 本次权益变动未导致本公司控股股东或者实际控制人发生变化。 二、所涉及后续事项 本次权益变动不会导致本公司控股股东、实际控制人发生变化,不涉及披露收购报告书摘要、要约收购报告书摘要等后续工作。本次权益变动的具体情况详见本公司同日披露于上海证券交易所网站(http://www.sse.com.cn)的《简式权益变动报告书》。 特此公告。 浙江嘉澳环保科技股份有限公司 董事会 2020年2月24日

证券代码:688298 证券简称:东方生物 公告编号:2020-007 浙江东方基因生物制品股份有限公司 关于澄清公告的补充公告

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、准确性和完整性依法承担法律责任。 浙江东方基因生物制品股份有限公司(以下简称“公司”)于2020年2月24日在上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)上披露了《浙江东方基因生物制品股份有限公司关于媒体报道的澄清公告》(公告编号:2020-006号),由于工作人员的表达失误,现对澄清公告内容补充如下: 一、本次权益变动前,根据欧盟法规,可视为已经备案获得了市场准入,中国的相关产品注册正在进行中。该系列新型冠状病毒2019-nCoV检测试剂产品在法规允许的情况下,不仅可以国内销售,也可以国内销售,而不是只算主要销往国外。 由于公司澄清公告内容有误,对于本次补充给广大投资者带来的不便,公司深表歉意,敬请谅解。公司将进一步加强公告文件在编制过程中的审核工作,提高信息披露质量。 特此公告。 浙江东方基因生物制品股份有限公司 董事会 2020年2月24日

述失误,现对澄清公告内容补充如下: 一、本次权益变动前,根据欧盟法规,可视为已经备案获得了市场准入,中国的相关产品注册正在进行中。该系列新型冠状病毒2019-nCoV检测试剂产品在法规允许的情况下,不仅可以国内销售,也可以国内销售,而不是只算主要销往国外。 由于公司澄清公告内容有误,对于本次补充给广大投资者带来的不便,公司深表歉意,敬请谅解。公司将进一步加强公告文件在编制过程中的审核工作,提高信息披露质量。 特此公告。 浙江东方基因生物制品股份有限公司 董事会 2020年2月24日

证券代码:688298 证券简称:东方生物 公告编号:2020-007 浙江东方基因生物制品股份有限公司 关于澄清公告的补充公告

述失误,现对澄清公告内容补充如下: 一、本次权益变动前,根据欧盟法规,可视为已经备案获得了市场准入,中国的相关产品注册正在进行中。该系列新型冠状病毒2019-nCoV检测试剂产品在法规允许的情况下,不仅可以国内销售,也可以国内销售,而不是只算主要销往国外。 由于公司澄清公告内容有误,对于本次补充给广大投资者带来的不便,公司深表歉意,敬请谅解。公司将进一步加强公告文件在编制过程中的审核工作,提高信息披露质量。 特此公告。 浙江东方基因生物制品股份有限公司 董事会 2020年2月24日