

上海莱士血液制品股份有限公司 关于公司2018年1-9月证券投资情况专项说明的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

根据深圳证券交易所《股票上市规则》及《中小企业板信息披露业务备忘录第2号—定期报告披露相关事项》等有关规定的要求，公司董事会对2018年1-9月证券投资情况进行了认真核查，现将有关情况说明如下：

一、证券投资审议批准情况

2015年1月5日，公司召开第三届董事会第二十二次（临时）会议，审议通过了《公司关于进行风险投资事项的议案》，同意公司在充分保障公司日常经营性资金需求，不影响公司正常生产经营并有效控制风险的前提下，拟使用自有资金最高不超过（含）人民币10.00亿元用于风险投资，使用期限为2年，该额度可以在2年内循环使用。该事项于2015年1月20日经公司2015年第一次临时股东大会审议通过。

2016年2月4日及2016年2月22日，公司分别召开了第三届董事会第三十一次（临时）会议及2016年第一次临时股东大会，审议通过了《关于公司上调风险投资额度及投资期限的议案》，同意公司为进一步提升资金使用效率、资金收益水平、增强公司盈利能力，将投资最高额度由原最高不超过（含）10.00亿元调整为不超过（含）40.00亿元；使用期限由原2年调整为自2016年2月22日起3年。

二、证券投资情况

1、万丰奥威

基于公司及董事会战略委员会对浙江万丰奥威汽轮股份有限公司（“万丰奥威”，证券代码：002085）进行的研究分析和论证，2015年1月22日，公司通过深圳证券交易所大宗交易系统购入万丰奥威股票1,900万股，均价为26.10元/股，共

计使用自有资金人民币49,590.00万元。

2015年8月31日，万丰奥威实施了2015年上半年度权益分派：以资本公积向全体股东每10股转增12股，除权后公司共计持有万丰奥威股票4,180万股。

2016年2月23日、25日、26日、29日、3月1日，公司通过二级市场合计购入万丰奥威股票2,325,214股，均价为27.97元/股，共计使用自有资金人民币65,045,038.99元。截至2016年3月1日合计持有万丰奥威股票44,125,214股。

2016年5月4日，万丰奥威实施了2015年度权益分派：向全体股东以未分配利润每10股派发现金红利0.50元（含税）、送红股2股（含税），以资本公积金向全体股东每10股转增8股，除权后公司共计持有万丰奥威股票88,250,428股。

2016年10月25日及10月26日，公司通过深交所大宗交易系统分别卖出万丰奥威3,000万股（均价为21.60元/股）、1,700万股（均价为21.39元/股），截至2016年10月26日合计持有万丰奥威股票41,250,428股，实现投资收益66,839.28万元。

2017年5月22日，万丰奥威实施了2016年度权益分派：向全体股东以未分配利润每10股派发现金红利1.00元（含税）、送红股2股（含税），不以公积金转增股本，除权后公司共计持有万丰奥威股票49,500,513股。

2017年6月13日、14日、15日、16日、19日、20日、21日及22日，公司通过二级市场合计购入万丰奥威股票20,058,971股，均价为15.95元/股，共计使用自有资金人民币31,991.47万元。截至2017年6月22日合计持有万丰奥威股票69,559,484股。

2018年5月22日，万丰奥威实施了2017年度权益分派：向全体股东以未分配利润每10股派发现金红利3.00元（含税）。

2018年8月14日、8月22日、8月23日、8月24日、8月27日、8月28日、8月29日及8月30日，公司通过二级市场合计卖出万丰奥威股票27,359,484股，均价7.26元/股。

截至2018年9月30日，公司共持有万丰奥威42,200,000股，累计实现公允价值变动收益-5,311.22万元，累计实现投资收益66,469.54万元（其中，2018年1月1日至9月30日实现公允价值变动收益-71,611.27万元，实现投资收益-976.44万元）。

2、天治星辰5号

2016年4月6日，公司召开了第四届董事会第一次会议，审议通过了《关于使用自有闲置资金参与资产管理计划事项的议案》，同意公司使用3.00亿元自有闲置资金作为劣后方参与认购股票型资产管理计划普通级份额。公司于2016年4月7日，使用3.00亿元自有闲置资金作为劣后方参与认购由天治基金管理有限公司设立的天治星辰5号普通级份额，优先级份额和普通级份额认购比例为1:1，本次资管计划资产规模为人民币6.00亿元。该资管计划是通过对沪深二级市场股票、固定收益类产品等的积极投资，在控制风险的前提下，谋求最大限度地资产增值。

天治星辰5号于2016年4月11日，通过深交所大宗交易系统购入兴源环境科技股份有限公司（“兴源环境”，股票代码：300266）股票1,500万股，均价为34.38元/股，交易总金额为人民币51,570.00万元。

2016年6月1日，兴源环境实施了2015年度权益分派：向全体股东每10股派0.20元人民币现金（含税），同时以资本公积金向全体股东每10股转增1股，除权后公司共计持有兴源环境股票1,650万股。

2016年6-9月，公司通过二级市场累计购入兴源环境1,502,754股，均价为40.29元/股，交易总金额为人民币6,055.35万元。截至2016年9月底合计持有兴源环境股票18,002,754股。

天治星辰5号约定的存续期间为12个月，已于2017年4月到期。按照约定，由于天治星辰5号到期时，所购买的兴源环境股票处于停牌状态，待兴源环境股票复牌后第一个工作日执行卖出。

2017年5月18日，兴源环境股票复牌，天治星辰5号通过深交所大宗交易系统卖出兴源环境18,002,754股，均价为47.60元/股；2018年8月，公司收到天治星辰5号资产管理计划二次清算款7.49万元。截至2018年9月30日，天治星辰5号已清算完毕，累计实现投资收益28,066.48万元。

3、金鸡报晓3号

2017年3月21日，公司召开了第四届董事会第十四次（临时）会议，审议通过了《关于公司拟使用自有闲置资金参与集合资金信托计划的议案》，同意公司使用3.33亿元自有闲置资金参与认购集合资金信托计划劣后级份额。公司于2017年3月22日，使用3.33亿元自有闲置资金参与认购厦门国际信托有限公司根据信托合同设立的金鸡报晓3号劣后级份额，优先级信托资金：劣后级信托资金为2：

1, 本次信托计划规模为人民币9.99亿元。该信托计划使用9.99亿元对云南信托设立的云南信托聚利43号单一资金信托（“聚利43号”）进行投资。该单一信托按照其信托合同的约定专项投资于①股票；②债券；③基金；④货币市场工具及银行存款；⑤信托业保障基金。

上述信托计划期限为24个月，自信托计划成立之日起计算。该期限为本信托计划的预计存续期限，如在该期限内出现合同规定的终止情形，则本信托计划将提前终止；如果该期限届满时信托计划存在非货币形态的信托财产，则信托计划期限自动延长至信托计划项下信托财产全部变现且变现所得全部进入信托专户之日。

上述信托计划存续期间受托人以货币形态的信托财产扣除应由信托财产承担的税费、信托费用和对第三人负债后的剩余部分为限向优先级受益人分配信托收益，受益人可获得分配的信托收益的实际金额根据合同规定的计算方法确定。信托计划存续期间，不向劣后级受益人分配信托利益；信托计划终止后，在优先级受益人的信托资金本金得到足额返还且其预期信托收益得到足额分配时，根据合同的约定分派顺序以剩余信托财产为限向劣后级受益人分配信托利益。

上述信托计划终止时且全部信托计划完成清算时（包括提前终止）获取的财产及收益不足以覆盖优先级委托人的资金本金、按照合同预定的预期年化收益率计算的收益及各项费用，则差额义务补足人应向优先级委托人履行差额付款补足义务，差额付款人其所承担的差额付款义务至信托计划清算完毕为止。按照合同约定履行差额补足义务并承担无限连带责任。

聚利43号于2017年5月18日，通过深交所大宗交易系统购入兴源环境科技股份有限公司（“兴源环境”，股票代码：300266）股票18,002,754股，均价为47.60元/股，交易总金额为856,931,090.40元。

聚利43号于2017年6月5日、6日、7日、8日及12日，通过二级市场合计购入兴源环境股票897,226股，均价为49.81元/股，共计使用信托资金人民币4,469.07万元。截至2017年6月12日合计持有兴源环境股票18,899,980股。

2017年6月20日，兴源环境实施了2016年度权益分派：向全体股东以资本公积向全体股东每10股转增10股，以未分配利润每10股派发现金红利0.50元（含税），除权后聚利43号共计持有兴源环境股票37,799,960股。

2018年2月2日，金鸡报晓3号财产净值跌破止损线，按合同约定需追加补仓

资金，公司于2018年2月5日追加补仓资金8,635.00万元；因每日计提各项费用，所持有兴源环境股票仍处于停牌等因素，公司分别于2月7日、3月8日、4月4日、4月19日、5月4日及6月5日分别追加了补仓资金400.00万元、360.00万元、200.00万元、200.00万元、400.00万元及400.00万元。

2018年7月2日，兴源环境复牌，金鸡报晓3号财产净值低于止损线，按合同约定需追加补仓资金，公司于2018年7月3日追加补仓资金7,457.00万元。

2018年7月4日，金鸡报晓3号财产净值低于止损线，按合同约定需追加补仓资金，鉴于当时二级市场波动剧烈，二级市场走势存在较大不确定性，公司决定暂缓追加信托资金，公司持有的金鸡报晓3号认购的聚利43号持有的证券资产将按相关合同规定进行变现，直至信托计划资产全部变现为止。金鸡报晓3号财产净值低于止损线后，公司仍与信托计划优先级受益人、信托计划受托人等相关方做积极有效地沟通，寻求合理的方式或途径降低公司的损失，维护公司的利益。公司作为金鸡报晓3号信托计划差额义务补足人需为金鸡报晓3号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付履行差额补足义务。

截至2018年7月13日，金鸡报晓3号已按相关合同规定实现信托计划资产全部变现，公司作为金鸡报晓3号差额义务补足人于2018年7月13日支付15,820.56万元，为金鸡报晓3号优先级委托人的信托本金及预期收益或信托计划相关费用未足额支付部分履行了差额补足义务。金鸡报晓3号于2018年7月13日提前终止。

根据信托利益分配报告，金鸡报晓3号累计实现投资收益约为-60,673.40万元（其中2017年实现投资收益102.28万元，2018年实现投资收益-60,775.68万元）。根据企业会计准则及其他相关规定，2018年处置交易性金融资产时应转回以前年度已确认的公允价值变动收益，故2018年持有的兴源环境股票实现公允价值变动收益-11,897.72万元。金鸡报晓3号信托计划终止对2018年度损益影响为产生投资收益-60,775.68万元和公允价值变动收益-11,897.72万元。

4、持盈78号

2017年11月20日，公司以通讯方式召开了第四届董事会第二十二次（临时）会议，审议通过了《关于公司拟使用自有闲置资金参与集合资金信托计划的议案》，同意公司分别使用2.50亿元及1.80亿元自有闲置资金参与认购陕国投 持盈78号证券投资集合资金信托计划及陕国投 持盈79号证券投资集合资金信托计划劣后

级份额，独立董事就该事项进行了认真审议后发表了独立意见。

2017年11月21日，公司使用2.50亿元自有闲置资金参与认购持盈78号部分份额，持盈78号信托计划规模总额为人民币5.00亿元，上海莱士认购其中的2.50亿元。

上述信托计划为指定用途的集合资金信托计划，按照其信托合同约定投资于在上海证券交易所、深圳证券交易所上市的沪深A股股票、货币基金、国债逆回购、银行存款、信托业保障基金（按最新监管政策执行）。如法律法规规定受托人需取得特定资质后方可投资某产品，则受托人须在获得相应资质后开展此项业务。

上述信托计划由我公司按照信托合同的约定向受托人提供投资建议。上述信托计划期限为24个月，自信托计划成立之日起计算。信托成立满6个月后经上海莱士申请受托人同意后可以提前终止，并至少需提前十个工作日提出申请。受托人同意后，应至少提前五个工作日通知全体委托人。如发生信托文件规定的信托计划提前或延期终止情形时，信托计划予以提前或延期终止。

上述信托计划存续期间，除信托计划终止日对应的信托利益支付日外的每个信托利益支付日；受托人以现金类信托财产为限，按照以下顺序进行分配：①支付本信托计划项下应由信托财产承担的各项税费；②支付本信托合同约定应由信托财产承担的费用；③向受益人分红，分红方式以信托合同约定为准。

上述信托计划在信托计划终止时，受托人以信托财产为限，按照以下顺序进行分配：①支付本信托计划项下应由信托财产承担的各项税费；②支付本信托合同约定应由信托财产承担的费用；③以信托财产为限向全体受益人分红，具体以本信托合同约定为准；④以信托财产为限向全体受益人额外分红，具体以信托合同约定为准；⑤以信托财产为限向受益人分配信托利益，受益人的信托利益=信托计划终止时该受益人调整后持有的信托单位份额×信托计划终止时调整后的信托单位净值。

按照双方约定，公司自愿为受益人A的信托本金及全部分红信托收益提供差额补足义务。即信托计划终止日（含提前终止日，且最迟不晚于信托计划成立日起24个月，以较早日期为准）扣除信托计划应付未付费用和其他负债后的信托计划的现金资产不能满足委托人A的信托本金及全部分红信托收益的分配，则差额义务补足人应向受益人A履行差额付款补足义务。

2017年11月23日，持盈78号通过深交所大宗交易系统购入万丰奥威股票2,295万股，均价为15.90元/股，交易总金额为36,490.50万元。

持盈78号于2017年12月21日、25日、26日及27日，通过二级市场合计购入万丰奥威股票6,714,077股，均价为17.83元/股，共计使用信托资金人民币11,973.17万元。

2018年3月2日，持盈78号共持有万丰奥威29,664,077股，对应万丰奥威当天收盘价12.41元/股，持盈78号财产净值跌破追加线，按照合同约定，公司需追加补仓资金，因所持有万丰奥威股票尚处于停牌期，持盈78号所持有的证券资产尚未进行变现，持盈78号于3月20日扣除了2018年一季度的相关费用后，财产净值已跌破止损线，按照合同约定，公司需追加补仓资金，公司于2018年4月19日追加补仓资金5,200.00万元。

2018年4月23日，持盈78号持有的万丰奥威股票复牌，公司当日盘中追加补仓资金1,200.00万元，并分别于4月24日、4月25日及4月26日追加补仓资金3,300.00万元、3,000.00万元及1,300.00万元，合计追加补仓资金14,000.00万元。

2018年7月4日，持盈78号财产净值跌破追加线，按照合同约定，公司需追加补仓资金，公司于2018年7月4日盘中追加补仓资金100.00万元，并分别于8月2日、8月3日、8月6日、8月8日、8月16日、8月17日、8月20日、8月24日、8月29日、8月31日及9月20日追加补仓资金220.00万元、100.00万元、520.00万元、1,280.00万元、470.00万元、770.00万元、360.00万元、100.00万元、320.00万元、100.00万元及100.00万元。

基于对二级市场不确定性因素的考虑，公司决定提前终止持盈78号。截至2018年9月21日，持盈78号已按相关合同规定实现信托计划资产全部变现，持盈78号于2018年9月25日提前终止。持盈78号信托计划终止日，信托计划资产净值足以覆盖受益人A的信托本金及全部分红信托收益，无需进行差额补足。

根据清算报告，持盈78号累计实现投资收益-26,539.63万元(其中2018年实现投资收益-26,539.63万元)。根据企业会计准则及其他相关规定，处置交易性金融资产时应转回以前年度已确认的公允价值变动收益，故2018年实现公允价值变动收益-4,635.03万元。持盈78号信托计划终止对2018年度损益影响为产生投资收益-26,539.63万元和公允价值变动收益-4,635.03万元。(最终金额以二次分配实际变现金额为准)

5、持盈79号

2017年11月20日，公司召开了第四届董事会第二十二次（临时）会议，审议通过了《关于公司拟使用自有闲置资金参与集合资金信托计划的议案》，同意公司分别使用2.50亿元及1.80亿元自有闲置资金参与认购陕国投 持盈78号证券投资集合资金信托计划及陕国投 持盈79号证券投资集合资金信托计划劣后级份额。

2017年11月20日，公司使用1.80亿元自有闲置资金参与认购持盈79号部分份额，持盈79号信托计划规模总额为人民币3.60亿元，上海莱士认购其中的1.80亿元。

2017年11月23日，持盈79号通过深交所大宗交易系统购入兴源环境股票1,258万股，均价为25.80元/股，交易总金额为32,456.40万元。

2018年2月2日，持盈79号财产净值跌破追加线，按照合同约定，公司需追加补仓资金，公司于2018年2月5日追加补仓资金2,380.00万元。

2018年7月2日，兴源环境复牌，持盈79号按照合同约定于停牌期间采用持有的所属行业指数计算的财产净值低于追加线，按合同约定需追加补仓资金，公司于2018年7月2日追加补仓资金3,710.00万元。

2018年7月3日，持盈79号财产净值跌破追加线，按照合同约定，公司需追加补仓资金，公司于2018年7月3日追加补仓资金230.00万元。

截至7月5日，持盈79号财产净值跌破平仓线，按合同约定，公司需追加补仓资金，鉴于当时二级市场波动剧烈，二级市场走势存在较大不确定性，公司决定暂缓追加信托资金，持盈79号持有的证券资产将按相关合同规定进行变现，直至信托计划资产全部变现为止。持盈79号财产净值低于平仓线后，公司仍与信托计划委托人A、信托计划受托人等相关方做积极有效地沟通，寻求合理的方式和途径降低公司的损失，维护公司的利益。公司作为持盈79号次级受益人还需为持盈79号受益人A的信托本金及全部分红信托收益履行差额补足义务。

截至7月13日，持盈79号已按相关合同规定实现信托计划资产全部变现，持盈79号于2018年7月13日提前终止。持盈79号信托计划终止日，信托计划资产净值足以覆盖受益人A的信托本金及全部分红信托收益，无需进行差额补足。

根据清算报告，持盈79号累计实现投资收益-22,732.33万元（其中2018年实现投资收益-22,732.33万元）。根据企业会计准则及其他相关规定，2018年处置

交易性金融资产时应转回以前年度已确认的公允价值变动收益，故2018年实现公允价值变动损益-1,509.60万元。持盈78号信托计划终止对2018年度损益影响为产生投资收益-22,732.33万元和公允价值变动收益-1,509.60万元。(最终金额以二次分配实际变现金额为准)

6、截至2018年9月30日，公司仍持有万丰奥威42,200,000股，公司参与的风险投资金额为35,315.42万元，累计实现公允价值变动损益-5,311.22万元，实现投资收益-10,608.91万元(其中，2018年1-9月实现公允价值变动收益-89,653.61万元，实现投资收益-111,016.60万元)。(以上2018年度财务数据未经审计)

三、风险控制措施

公司制订了《风险投资管理制度》等投资决策制度，对公司风险投资的原则、范围、权限、内部审核流程、内部报告程序、资金使用情况的监督、责任部门及责任人等方面均作了详细规定，能有效防范投资风险、同时公司将加强市场分析和调研，切实执行内部有关管理制度，严控风险，未发现有违反相关制度的行为。

公司严格按照《风险投资管理制度》的相关规定进行风险投资，股东大会对风险投资总额度及使用期限的授权。在股东大会总授权额度的范围内，公司进行风险投资时，均召开了董事会进行审议形成决议，同时独立董事就风险投资事项出具相应的独立意见。

鉴于目前的国内外经济环境以及近期的证券市场表现，本着理性投资、审慎决策的原则，根据公司内控制度及相关规定的要求，公司拟计划未来不再增加新的证券投资，原有的证券投资也将在未来适当的时机逐步实现退出，公司的战略和发展仍将聚焦于血液制品主营业务的深耕和精琢。

自公司进行风险投资以来，相关投资审议程序完整，投资决定审慎。

特此说明。

上海莱士血液制品股份有限公司

董事会

二〇一八年十月二十九日