

上海莱士血液制品股份有限公司 关于公司2017年1-3月证券投资情况的专项说明

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》有关规定的要求，公司董事会对2017年1-3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”）进行的研究分析和论证，2015年1月22日，公司通过深交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，均价为 11.86 元/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，公司通过深圳证券交易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）；实现投资收益 66,839.28 万元。

截至 2017 年 3 月 31 日，公司共持有万丰奥威 41,250,428 股，持股成本合计 26,219.96 万元，累计实现公允价值变动损益 66,387.26 万元，投资收益 67,043.08 万元（其中，2017 年 1-3 月实现公允价值变动损益 11,096.37 万元）。

2、富春环保

经公司及董事会战略委员会对浙江富春江环保热电股份有限公司（“富春环保”）进行的分析和论证，基于对富春环保未来发展前景和在环保行业发展的大背景下该公司投资价值的肯定，公司于 2015 年 6 月 11 日通过深交所大宗交易系统购入富春环保股票 1,000 万股，均价为 19.80 元/股，使用自有资金人民币 19,800.00 万元；

2015 年 9 月 17 日，公司再次通过深交所大宗交易系统购入富春环保股票 2,000 万股，均价为 9.00 元/股，使用自有资金人民币 18,000.00 万元。

截至 2016 年 12 月 31 日，公司已全部出售所持富春环保 3,000 万股，累计实现投资收益 1,133.02 万元。

3、天治星辰 5 号

2016 年 4 月 6 日，公司召开了第四董事会第一次会议，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设立的天治星辰 5 号资产管理计划（“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 1,500 万股，均价为 34.38 元/股，交易总金额为 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 6,055.35 万元。

截至 2017 年 3 月 31 日，天治星辰 5 号共持有兴源环境 18,002,754 股，累计实现公允价值变动损益 37,594.96 万元，投资收益 60.71 万元（其中，2017 年 1-3 月实现公允价值变动损益-3,595.93 万元）。

天治星辰 5 号约定的存续期间为 12 个月，截至本报告披露日，天治星辰 5 号约定的续存期已到期，由于所购买的股票标的目前处于停牌状态，将待标的股票复牌后根据合同约定执行卖出。

风险揭示：

公司参与认购本资产管理计划的普通级份额，鉴于本资产管理计划的结构化设计特征，公司将根据资管合同约定承担因资管存续期间净值波动而导致追加资金的义务。

由于本资管计划内含杠杆机制的设计，普通级份额的净值变动幅度大于优先级份额的变动幅度，在组合出现亏损的情况下，普通级委托人的本金会先于优先级委托人遭受损失。鉴于优先级份额、普通级份额的资金合并运作，普通级委托人的损失相对于组合的损失会产生杠杆放大效应。

资产管理计划终止时且全部资产管理计划完成清算时（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资产管理计划清算完毕为止。按照合同约定履行差额补足义务并承担无限连带责任。

此外，由于各种原因及其他或有风险的存在，包括政策风险、经济周期风险、

利率风险、流动性风险、投资管理风险等，本资管计划既有盈利的可能，也存在亏损的可能，且根据相关法律法规规定，资管计划不承诺保本和最低收益。

4、汇博 10 号

2016 年 11 月 23 日，公司召开了第四董事会第九次（临时）会议，审议通过了《关于使用自有闲置资金参与集合资产信托计划的议案》，同意公司使用 1.50 亿元自有闲置资金参与认购信托计划劣后信托单位 15,000 万份。公司于 2016 年 11 月 7 日，使用 1.50 亿元自有闲置资金作为劣后方参与爱建国际信托有限公司根据信托合同设立的爱建民生汇博 10 号集合资金信托计划（“汇博 10 号”）劣后级份额，优先级资金：劣后级资金为 1：1，本次信托计划规模为人民币 3.00 亿元。该信托计划使用 3.00 亿元对云南国际信托有限公司（“云南信托”）设立的云南信托聚利 21 号单一资金信托（“聚利 21 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沪、深交易所上市交易的 A 股股票、现金及等价物（银行活期存款、货币市场基金、债券逆回购）及信托业保障基金。

聚利 21 号于 2016 年 11 月 30 日，通过深交所大宗交易系统购入兴源环境股票 630 万股，均价为 45.85 元/股，交易总金额为 28,885.50 万元。

截至 2017 年 3 月 31 日，聚利 21 号共持有兴源环境 630 万股，累计实现公允价值变动损益 4,428.90 万元（其中，2017 年 1-3 月实现公允价值变动损益 -1,260.00 万元）。

风险揭示：

公司参与认购本信托计划的劣后级份额，鉴于本信托计划的结构化设计特征，公司将根据信托合同约定承担因信托存续期间净值波动而导致追加资金的义务。

本信托计划所投资的单一信托投资于某只标的股票，由于市场或单一信托的流行不足和其他不可抗力因素导致单一信托财产净值巨幅波动从而导致在本信托计划信托单位净值触及或低于预警线/止损线后受托人根据信托合同约定进行预警、平仓等操作时不能将所持有的非现金资产迅速变现的风险，从而影响信托计划收益或导致受益人无法如期获得现金形式的信托利益。

公司作为劣后级受益人按照信托文件约定享有较高信托利益的同时，承受较高的本金损失风险，即在信托计划触及止损线等约定情形下，受托人将采取措施处置信托财产，可能导致劣后级受益人发生本金重大损失风险。

由于信托计划所间接投资的证券连续跌停等不可控事件造成受托人不能及

时变现信托计划项下的财产时，可能导致信托财产受到损失。

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。

此外，受多项因素影响，包括证券市场价格波动、经济周期、投资操作水平、国家政策变化、投资管理等，本信托计划既有盈利的可能，亦存在亏损的可能，且根据相关法律法规规定，信托计划不承诺保本和最低收益。

5、金鸡报晓 3 号

2017 年 3 月 21 日，公司召开了第四董事会第十四次（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，独立董事就该事项进行了认真审议后发表了独立意见。

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（“厦门信托”）根据信托合同设立的厦门信托金鸡报晓 3 号集合资金信托计划（“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。

风险揭示：

公司将认购本信托计划的劣后级份额，鉴于本信托计划的结构化设计特征，公司将根据信托合同约定承担因信托存续期间净值波动而导致追加资金的义务。

公司作为劣后级受益人按照信托文件约定享有较高信托利益的同时，承受较高的本金损失风险，即在信托计划触及止损线等约定情形下，受托人将采取措施处置信托财产，可能导致劣后级受益人发生本金重大损失风险。

由于本信托计划内含杠杆机制为优先级信托资金：劣后级信托资金为 2：1，其杠杆比例高于 1：1，劣后级份额的净值变动幅度大于优先级份额的变动幅度，在组合出现亏损的情况下，劣后级委托人的本金会先于优先级委托人遭受损失。鉴于优先级份额、劣后级份额的资金合并运作，劣后级委托人的损失相对于组合

的损失会产生杠杆放大效应。

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。

此外，受多项因素影响，包括证券市场价格波动、经济周期、投资操作水平、国家政策变化、投资管理等，本信托计划既有盈利的可能，亦存在亏损的可能，且根据相关法律法规规定，信托计划不承诺保本和最低收益。

6、截至 2017 年 3 月 31 日，公司共使用 104,519.96 万元进行风险投资，累计实现公允价值变动损益 108,411.12 万元，实现投资收益 68,236.81 万元（其中，2017 年 1-3 月实现公允价值变动损益 6,240.44 万元）。

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。

特此说明。

上海莱士血液制品股份有限公司

董事会

二〇一七年四月二十九日