

上海莱士血液制品股份有限公司

关于公司2018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2018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”，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。

截至 2018 年 3 月 31 日，公司共持有万丰奥威 69,559,484 股，累计实现公允价值变动损益 28,111.89 万元，实现投资收益 67,445.98 万元（其中，2018 年 1-3 月实现公允价值变动损益-38,188.16 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。

截至 2018 年 3 月 31 日,天治星辰 5 号累计实现投资收益 28,058.99 万元。(具体金额以资产管理计划最终清算结果为准)。

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。

3、汇博 10 号

2016 年 11 月 23 日，公司召开了第四届董事会第九次（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 24 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设立的云南信托聚利 21 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，交易总金额为人民币 28,885.50 万元。

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 21 号共计持有兴源环境股票 1,260 万股。

2017 年 9 月 20 日，聚利 21 号通过二级市场卖出兴源环境股票 2 万股，均价 30.68 元/股，实现投资收益 15.51 万元。

汇博 10 号约定的存续期间为 12 个月，于 2017 年 11 月 25 日到期。2017 年 11 月 23 日，聚利 21 号通过深交所大宗交易系统卖出兴源环境 1,258 万股，均价为 25.80 元/股，2017 年实现税前投资收益约为 3,667.41 万元。（已完成清算）

截至 2018 年 3 月 31 日，汇博 10 号累计实现投资收益 3,667.41 万元。

4、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厦门信托金鸡报晓 3 号集合资金信托计划劣后级份额，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。

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。

截至 2018 年 3 月 31 日，聚利 43 号共持有兴源环境 37,799,960 股，累计实现公允价值变动损益-14,600.05 万元，实现投资收益 105.86 万元（其中，2018 年 1-3 月实现公允价值变动损益-26,497.77 万元，实现投资收益 3.58 万元）。

2018 年 2 月 2 日，聚利 43 号共持有兴源环境 37,799,960 股，对应兴源环境当天收盘价 19.99 元/股，金鸡报晓 3 号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，存在平仓风险。公司已于 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 日及 4 月 19 日分别追加了补仓资金 400.00 万元、360.00 万元、200.00 万元及 200.00 万元，合计追加补仓资金 9,795.00 万元。目前金鸡报晓 3 号财产净值已在预警线以上。

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。

5、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。

上述信托计划均为指定用途的集合资金信托计划，按照其信托合同约定均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。上述两个信托计划期限均为 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。

截至 2018 年 3 月 31 日，持盈 78 号共持有万丰奥威 29,664,077 股，累计实现公允价值变动损益-11,650.55 万元（其中，2018 年 1-3 月实现公允价值变动损益-16,285.58 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 号财产净值已跌破追加线，按照合同约定，公司需追加补仓资金，如果公司未在规定时间内足额追加信托资金，持盈 78 号持有的证券资产将按照合同规定按市价委托方式进行变现，直至信托财产现金资产不低于信托初始规模 50%。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，持盈 78 号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，如果公司未在规定时间内足额追加信托资金，持盈 78 号持有的证券资产将按照合同规定按市价委托方式进行变现，直至信托计划资产全部变现为止。公司已于 2018 年 4 月 19 日追加补仓资金 5,200.00 万元。

2018 年 4 月 23 日，万丰奥威复牌，公司当日盘中追加补仓资金 1,200.00 万元，并分别于 4 月 24 日及 4 月 25 日追加补仓资金 3,300.00 万元及 3,000.00 万元，使持盈 78 号财产净值在追加线以上，暂不需要追加信托资金。

风险揭示：

公司使用自有闲置资金参与认购持盈 78 号的部分份额。当市场和其他不可抗力因素导致在信托财产净值低于预警值、追加值或止损值后委托人有权追加增强信托资金。

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（包括买入卖出），可能出现委托人代表因判断错误或存在违约风险、信用风险造成其作出的投资建议不利于信托计划运行，及可能造成信托计划投资损失的风险。

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受益人 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。

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、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。

截至 2018 年 3 月 31 日，持盈 79 号共持有兴源环境 1,258 万股，累计实现公允价值变动损益-7,308.98 万元（其中，2018 年 1-3 月实现公允价值变动损益-8,818.58 万元）。

2018 年 2 月 2 日，持盈 79 号共持有兴源环境 1,258 万股，对应兴源环境当天收盘价 19.99 元/股，持盈 79 号财产净值已跌破追加线，按照合同约定，公司需追加补仓资金，如果公司未在规定时间内足额追加信托资金，持盈 79 号持有

的证券资产将按照合同规定按市价委托方式进行变现，直至信托财产现金资产不低于信托初始规模 50%。公司已于 2018 年 2 月 5 日追加补仓资金 2,380.00 万元，持盈 79 号于 3 月 20 日扣除了 2018 年一季度的相关费用后，目前持盈 79 号财产净值跌破预警线，暂不需要追加信托资金。

风险揭示：

公司使用自有闲置资金参与认购持盈 79 号的部分份额。当市场和其他不可抗力因素导致在信托财产净值低于预警值、追加值或止损值后委托人有权追加增强信托资金。

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（包括买入卖出），可能出现委托人代表因判断错误或存在违约风险、信用风险造成其作出的投资建议不利于信托计划运行，及可能造成信托计划投资损失的风险。

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受益人 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。

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。

7、截至 2018 年 3 月 31 日，公司共使用 146,286.43 万元进行风险投资，累计实现公允价值变动损益-5,447.69 万元，实现投资收益 100,411.27 万元（其中，2018 年 1-3 月实现公允价值变动损益-89,790.09 万元，实现投资收益 3.58 万元）。

8、截至 2018 年 4 月 25 日，本公司持有的交易性金融资产的公允价值合计为 19.12 亿元，与 2018 年 3 月 31 日的公允价值 22.38 亿元相比，减少 3.26 亿元，形成从 2018 年 4 月 1 日至 4 月 25 日的公允价值变动损失 3.26 亿元。

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

二〇一八年四月二十八日