

(上接B47版)

本基金将在债券市场宏观分析基础上,结合蒙特卡罗模拟等数量化方法,对资产支持证券进行定价,评估其内在价值进行投资。

6. 现金流管理
在现金流管理上,本基金通过对未来现金流的预测进行现金流预算管理,及时满足本基金运作的流动性需求。

5. 投资限制
组合限制
本基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 股票资产占基金资产的比例为80%-95%;
(2) 本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期在一年以内的政府债券;

(3) 本基金持有一家上市公司发行的证券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(4) 本基金管理人管理的本基金持有一家上市公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的3%;
(6) 本基金管理人管理的本基金持有的同一权证,不得超过该权证的10%;
(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的5%;

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的10%;
(9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;

(10) 本基金持有的同一信用级别资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;

(11) 本基金管理人管理的本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(12) 本基金对资产支持证券信用评级为BBB(或以下)的资产支持证券,基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;

(13) 本基金在全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;
(14) 本基金总资产不得超过基金净资产的140%;

(15) 本基金在任何交易日终,持有的卖出期货合约价值不得超过基金持有的股票总市值的20%;本基金在任何交易日终,持有的买入股指期货合约价值,不得超过基金资产净值的10%;

本基金在任何交易日终,持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和,不得超过基金资产净值的95%;其中,有价证券指股票、债券(不含到期日在一年以内的政府债券)、权证、资产支持证券、买入返售金融资产(不含质押式回购)等;所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于股票投资比例的有关规定;

(16) 法律法规及中国证监会的规定和《基金合同》约定的其他投资比例限制。
因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人以外的因素致使本基金投资比例不符合上述投资比例的,基金管理人应当在10个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定;在此期间,基金的投资范围、投资策略应符合基金合同约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

如果法律法规对上述投资组合比例限制进行变更的,以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制,如适用于本基金,基金管理人履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制。

2. 禁止行为
为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

(1) 承销证券;
(2) 违反规定向他人贷款或提供担保;
(3) 从事承担无限责任的投资;

(4) 向其基金管理人、基金托管人出资;
(5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其他重大利害关系的公司发行的证券或承销承销的证券,或者从事其他重大关联交易,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先的原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平价格执行。

行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会至少应每年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门调整上述规定的,本基金的投资按照调整后的规定执行。

9. 部分基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准:95%×中证500价格指数收益率+5%×人民银行一年定期存款基准利率(税后)

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,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的指数时,本基金经基金管理人和基金托管人协商一致,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,且无需召开基金份额持有人大会,如果本基金业绩比较基准所参照的指数在未来不再发布时,基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,经基金托管人同意并报监管部门备案履行适当程序后,选取相似的或可替代的指数作为业绩比较基准的参照指数,且无需召开基金份额持有人大会,调整业绩比较基准应经基金托管人同意,报中国证监会备案,并在中国证监会指定媒介上公告。

10. 基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,具有较高预期收益、较高预期风险的特征,其风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

11. 部分基金的投资组合报告(未经审计)
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,按照法律法规、基金合同及基金托管人的要求,对基金财产进行投资,并履行信息披露义务,基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,按照法律法规、基金合同及基金托管人的要求,对基金财产进行投资,并履行信息披露义务。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则,按照法律法规、基金合同及基金托管人的要求,对基金财产进行投资,并履行信息披露义务。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

1.2.2 报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合
本基金本报告期末持有港股股票。

1.2.3 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明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

1.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末持有债券。

1.4 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明细
本基金本报告期末持有债券。

1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期末持有资产支持证券投资。

1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末持有贵金属。

1.7 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权证投资明细
本基金本报告期末持有权证。

1.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
1.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
1.8.2 本基金投资股指期货的投资策略

1.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1.9.1 本期国债期货投资政策
在报告期内,本基金未投资于国债期货。该策略符合基金合同的约定。

1.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
本基金本报告期末无国债期货持仓和损益明细。

1.9.3 本期国债期货投资政策
本报告期末本基金没有投资国债期货。

1.10 投资组合报告附注
1.10.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况,在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

1.11 其他资产明细

Table with 3 columns: 序号, 名称, 金额(元)

1.12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

1.13 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未存在流通受限情况。

1.14 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

10. 基金的业绩
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,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。投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金自设立日为2016年8月30日,基金合同生效之日起的投资业绩及与同期业绩比较基准的对比如下表所示:

(一)截止2017年6月30日基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比:

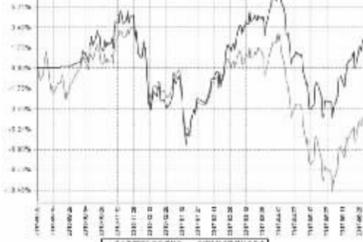
Table with 5 columns: 阶段, 基金净值增长率①, 基金净值增长率标准差②, 比较基准收益率③, 比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

注:本基金的业绩比较基准:中证500价格指数收益率*95%+人民银行一年定期存款基准利率(税后)*5%

(二)自基金合同生效以来基金资产净值变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

注:本基金的业绩比较基准:中证500价格指数收益率*95%+人民银行一年定期存款基准利率(税后)*5%

本基金成立于2016年8月30日,按基金合同约定,自基金合同生效日起6个月内为建仓期,本基金在建仓期结束时及截止报告期末各项投资比例已达到基金合同规定的比例要求。



基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势对比图

证券代码:603801 证券简称:志邦股份 公告编号:2017-037

志邦厨柜股份有限公司关于使用募集资金现金管理部分产品到期赎回的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告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。

志邦厨柜股份有限公司(以下简称“公司”或“志邦厨柜”)于2017年8月2日召开的2017年第一次临时股东大会审议通过了《关于使用部分闲置募集资金进行现金管理的议案》,同意公司在确保不影响募集资金投资项目正常运营的情况下,使用不超过30,000万元的暂时闲置募集资金,用于购买安全性高、流动性好的保本型理财产品,使用期限为自公司董事会审议通过之日起12个月。在上述使用期限及额度范围内,资金可循环滚动使用,具体详见公司于2017年7月18日披露的《关于使用部分闲置募集资金进行现金管理的公告》(公告编号:2017-006)。

一、公司及全资子公司使用闲置募集资金进行现金管理到期赎回的情况
2017年9月1日,公司购买了招商银行股份有限公司合福理财产品推出的“招商银行结构性存款CHF00183”,具体详见《关于使用闲置募集资金进行现金管理的进展公告》(2017-029号);公司已于2017年10月10日到期赎回上述理财产品,收回本金3,000万元,获得理财收益人民币10.64万元。

2017年9月29日,全资子公司合肥志邦家居有限公司购买了徽商银行合肥蜀山支行推出的“本利盈”系列组合投资CA170640,具体详见《关于使用闲置募集资金进行现金管理的进展公告》(2017-027号)。子公司已于2017年10月11日到期赎回上述理财产品,收回本金5,000万元,获得理财收益人民币21.06万元。本次赎回情况如下:

Table with 8 columns: 购买主体, 合作方, 产品名称, 类型, 投资规模, 起始日期, 终止日期, 赎回金额, 实际年化净收益率(%)

二、截至本公告日,公司及全资子公司使用闲置募集资金购买的在存续期内的理财产品情况
单位:人民币(万元)

Table with 8 columns: 序号, 合作方, 产品名称, 类型, 投资规模, 起始日期, 终止日期, 理财参考年化净收益率(%)

注:上述理财产品的购买情况请详见公司 2017-019 号、2017-027 号、2017-034号公告。

三、资金管理的情况说明
(一)基本说明
公司及全资子公司所购买的银行理财产品使用的资金为暂时闲置的募集资金,办理的银行理财产品不需要提供履约担保。

(二)敏感性分析
公司及全资子公司开展的银行理财业务,并非以中长期投资为目的,只针对流动资金出现银行账户资金短期闲置时,通过办理银行短期理财产品,取得一定理财收益,其账户资金以保障经营收支为前提,不会对公司及全资子公司现金流带来不利影响。

(三)风险控制分析
公司及全资子公司办理的银行理财产品管理规范,对理财产品的风险控制严格,本次资金管理着重考虑收益和风险是否匹配,把资金安全放在第一位,将及时关注资金管理资金的相关情况,确保理财资金到期收回。

四、根据公司2017年第一次临时股东大会批准的募集资金理财额度不超过人民币30,000万元的规定,截止本公告日,公司及全资子公司使用闲置募集资金购买的在存续期内的理财产品本金金额合计20,500万元。本次赎回完成后,公司及全资子公司可用于现金管理的募集资金余额仍为9,500万元。特此公告。

志邦厨柜股份有限公司 董事会 2017年10月12日

证券代码:603801 证券简称:志邦股份 公告编号:2017-038

志邦厨柜股份有限公司关于使用自有资金委托理财部分产品到期赎回的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告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。

厦门金狮厨柜股份有限公司(以下简称“公司”或“志邦厨柜”)于2017年7月7日召开的2017年第二次临时股东大会审议通过了《关于使用部分闲置自有资金进行委托理财的议案》,拟使用部分闲置自有资金不超过人民币50,000万元购买保本型理财产品,使用期限为自公司董事会审议通过之日起12个月,具体信息

一、本次委托理财到期赎回的基本情况
公司于2017年7月使用部分闲置自有资金10,000,000.00元购买“利多多多结构性存款定期持有期J9090”保本型银行理财产品,详细内容见上海证券交易所网站(www.sse.com.cn)披露的《厦门金狮厨柜股份有限公司关于使用部分闲置自有资金进行委托理财的公告》(公告编号:2017-029)。

上述委托理财产品已经到期,公司收回本金10,000,000.00元,并收到委托理财收益99,000.00元。

二、本次购买的理财产品情况
为提高资金使用效率及资金收益率,在不影响公司主营业务正常开展,确保公司经营资金需求的前提下,公司于2017年10月11日使用部分闲置自有资金15,000,000.00元投资保本型银行理财产品,具体情况如下:

Table with 5 columns: 发行机构, 产品名称, 产品类型, 投资金额(元), 产品期限, 年化收益率(%)

三、风险控制分析
投资产品及委托对象方面,公司财务部将本着严格控制风险的原则,对理财产品进行严格的评估、筛选,购买投资期限不超过12个月的安全性高、流动性好的保本型理财产品。

四、根据公司2017年第一次临时股东大会批准的自有资金理财额度不超过人民币50,000万元的规定,截止本公告日,公司及全资子公司使用闲置自有资金购买的在存续期内的理财产品本金金额合计30,800万元。本次赎回完成后,公司及全资子公司可用于委托理财的自有资金本金余额为10,200万元。特此公告。

志邦厨柜股份有限公司 董事会 2017年10月12日

证券代码:603180 证券简称:金牌厨柜 公告编号:2017-051

厦门金牌厨柜股份有限公司关于使用闲置自有资金委托理财产品到期回收及继续进行委托理财的进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告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。

厦门金牌厨柜股份有限公司(以下简称“公司”)第二届董事会第十五次会议和2017年第二次临时股东大会审议通过了《关于使用部分闲置自有资金进行委托理财的议案》,拟使用部分闲置自有资金不超过人民币50,000万元购买保本型理财产品,使用期限为自公司董事会审议通过之日起12个月,具体信息

一、本次委托理财到期回收的基本情况
公司于2017年7月使用部分闲置自有资金10,000,000.00元购买“利多多多结构性存款定期持有期J9090