



Disclosure 信息披露

2019年3月12日 星期二
zqsb@stcn.com (0755)83501750

B23

(上接B22版)

股票作为增强股票库,力争在最佳时机选择增强股票库中估值合理、基本面优良且具有持续成长潜力的股票进行适度的仓位配置,以获取超额收益。
4)其他增强策略。本基金将及时把握一级市场新申购、增发或配股在内的盈利机会,提升投资组合的有效性。
(2)组合调整策略
本基金为开放式基金,由于基金开放日基金的中断、赎回、转换业务,标的指数成份股及基金成份股定期或不定期调整、成份股权重调整、成份股投资受限等因素的影响,使得跟踪组合需要定期和不定期进行个股或权重股的调整。

(3)跟踪误差、跟踪偏离度控制策略
本基金为指数增强型基金,将通过适度的主动投资获取超越标的指数的超额收益,同时也将因承担相应的主动风险而导致较大的跟踪误差。因此,本基金将每日跟踪基金组合与指数表现的偏离度,每月末定期分析基金组合与标的指数的表现差异的累积偏差,跟踪误差变化情况及其原因,并根据跟踪误差的来源和其可控性,有针对性的进行管理,实现有效控制跟踪误差。

3.债券投资策略
本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上,使基金资产得到更加合理有效的利用,从而提高投资组合收益。为此,本基金将以市场利率趋势研判为主,基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析,在保证流动性和风险可控的前提下,灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略、相对价值策略和利差套利策略等对债券组合进行主动投资。
4.股指期货投资策略
本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性较好、交易活跃的股指期货合约,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

5.权证投资策略
本基金将以价值分析为基础,采用权证定价模型其合理定价的基础上,充分考虑量可投资品种的收益率、流动性及风险收益特征,通过资产配置、品种与类属选择,力求规避投资风险、追求稳定的风险调整后收益。
6.中小企业私募债券投资策略
与传统的信用债券相比,中小企业私募债券由于以非公开方式进行发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特征。本基金对中小企业私募债券的投资将着力分析个券的实际信用风险,并寻求足够的安全补偿,增加基金收益。本基金管理人将对个券信用资质进行详尽的分析,从动态的角度分析发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,进而预测信用水平的变化趋势,决定投资策略。

7.资产支持证券投资策略
本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线变动分析、收益率利差分析和公司基本面分析,把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

十一、基金投资组合报告
基金管理人的董事会及董事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。
基金托管人招商银行股份有限公司,根据本基金合同规定,复核了本投资组合报告,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本投资组合报告所载数据取自本基金2018年第4季度报告,所载数据截至2018年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	53,924,098.50	92.43
其中:股票	53,924,098.50	92.43	
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
其中:债券	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,399,562.18	7.54
8	其他资产	19,564.86	0.03
9	合计	58,343,325.54	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	1,731,245.00	3.00
C	制造业	21,411,820.52	37.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	967,557.00	1.68
E	建筑业	2,411,284.00	4.18
F	批发和零售业	889,135.00	1.54
G	交通运输、仓储和邮政业	5,476,183.00	9.49
H	住宿和餐饮业	303,858.00	0.53
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,350,234.98	2.34
J	金融业	10,920,891.00	18.92
K	房地产业	4,704,956.00	8.15
L	租赁和商务服务业	1,589,280.00	2.75
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	533,014.00	0.92
S	综合	-	-
合计	-	52,289,458.50	90.60

2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,634,640.00	2.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
合计	-	1,634,640.00	2.83

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601186	中国铁建	181,000	1,967,470.00	3.41
2	601288	东部出行	473,400	1,794,240.00	2.95
3	601328	交通银行	291,100	1,685,669.00	2.92
4	601398	工商银行	316,200	1,672,698.00	2.90
5	600000	中信证券	100,500	1,609,005.00	2.79
6	000002	万科A	67,400	1,605,468.00	2.78
7	600048	保利地产	135,500	1,597,545.00	2.77
8	601888	中国能建	26,400	1,589,280.00	2.75
9	600585	海螺水泥	54,200	1,586,976.00	2.75
10	600028	中国石化	284,700	1,437,735.00	2.49

3.2积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量	公允价值	公允价值占基金资产净值比例(%)
1	601633	长城汽车	291,900	1,634,640.00	2.83

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资,也无期间损益。

9.2 本基金股指期货投资的投资政策

本基金将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约,力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位调整的频率、交易成本和带来的跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包含国债期货。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资,也无期间损益。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金投资范围不包含国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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、处罚的情况。

11.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	17,404.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	19,564.86
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	19,564.86

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

11.5.1 期末被指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

十二、基金业绩

基金管理人承诺以诚实信用、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,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平低于所列数据。

本基金合同生效日2018年7月26日,基金业绩截止日2018年12月31日。

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-③	②-④
2018年07月26日至2018年09月30日	1.86%	0.26%	-4.96%	1.36%	6.82%
2018年10月01日至2018年12月31日	-11.69%	1.44%	-12.19%	1.58%	0.50%
自基金合同生效日至2018年12月31日	-10.05%	1.10%	-16.54%	1.48%	-0.38%

基金过往业绩并不预示其未来表现。

十三、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.标的指数许可使用费;

4.《基金合同》生效前与基金相关的信息披露费;

5.《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师费、诉讼费和仲裁费;

6.基金份额持有人大会费用;

7.基金的证券/期货交易费用;

8.基金的银行汇划费用;

9.基金的开户费用和账户维护费;

10.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

(二)基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.06%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 1.06\%$ 当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理人双方核对无误后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.15\%$ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

证券代码:000669 证券简称:金鸿控股 公告编号:2019-020
债券代码:112276 债券简称:15金鸿债

渤海证券股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2015年公司债券重大事项受托管理事务临时报告

渤海证券股份有限公司(以下简称“渤海证券”)作为中油金鸿能源投资股份有限公司2015年公司债券(债券简称:15金鸿债,债券代码:112276)的受托管理人,持续密切关注对债券持有人权益有重大影响的事项。本报告根据《公司债券发行与交易管理办法》、《深圳证券交易所公司债券上市规则(2015年修订)》、《公司债券受托管理人执业行为准则》等相关规定,本期债券《受托管理协议》的约定及金鸿控股集团股份有限公司(以下简称“发行人”)的《金鸿控股集团股份有限公司关于“15金鸿债”违约处置进展公告》等信息披露文件编制。

本报告不构成对投资者进行或不进行某项行为的推荐意见,投资者应对相关事宜做出独立判断,而不应将本报告中的任何内容直接以作为渤海证券所作的承诺或声明。

本次公司债券的重大事项

根据发行《2019年3月6日的《金鸿控股集团股份有限公司关于“15金鸿债”违约处置进展公告》(公告编号:2019-014),发行人披露的“15金鸿债”违约处置进展情况如下:

(一)其他相关债券违约及后续处置情况

2019年1月15日,发行人未能按照约定将“16中油金鸿MTN001”兑付资金按时足额划至托管机构,已构成实质违约。

2019年1月16日,中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议召开,会议表决通过了议案一、议案二、议案三、修订议案一、修订议案二和修订议案三共六项议案。

2019年1月26日,发行人披露《关于“16中油金鸿MTN001”(代码:101662006)的债务清偿方案》,从债务清偿期限、监管资金账户、增信措施、违约责任、承诺与保证及其他条款进行了约定。

2019年1月28日,发行人披露《发行人就“16中油金鸿MTN001”(代码:101662006)2019年第一次中期持有人会议已通过部分议案的答复》,对于本次持有人会议通过的全部6项议案表示同意,并分别于2019年1月25日和2019年2月13日召开董事会、股东大会审议通过了相关议案。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据2019年度第一次持有人会议决议的公告》,公告编号:2019-014。

2019年2月15日,发行人披露《金鸿控股集团股份有限公司关于中油金鸿能源投资股份有限公司2016年度第一期中票票据201