

(上接B95版)

传真:(021-31358600)
联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛
四、审计基金财产的会计师事务所
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心14楼
执行事务合伙人:李丹
联系电话:(021-23238888
传真:(021-23238800)
联系人:魏佳亮
经办注册会计师:许璋琳、魏佳亮

第四部分 基金名称

国泰价值精选灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型和存续期限

- 1.基金类别:混合型证券投资基金
- 2.基金运作方式:契约型开放式
- 3.基金的存续期间:不定期

第六部分 投资目标

本基金主要依据价值投资经典指标,投资于具有良好盈利能力和价值被低估的股票,在严格控制风险的前提下,谋求基金资产的长期稳定增值。

第七部分 投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、可转债、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货,权证以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入本基金投资范围,其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为0%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。

第八部分 投资策略

1.资产配置策略
本基金将及时跟踪市场环境变化,根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化、证券市场运行状况、国际市场化情况等因素的深入研究,判断证券市场的发展趋势,综合评价各类资产的风险收益水平,制定股票、债券、现金等各类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围。

2.股票投资策略
本基金的能力圈股票筛选

(1)对于金融行业,选择过去三年的平均ROIC,ROE,股息率等财务指标筛选出盈利能力强的上市公司,构成具有盈利能力的股票备选池。在筛选具有盈利能力的股票时,本基金主要遵循以下标准:
1)对于金融行业,选择过去三年的平均ROIC,ROE,股息率等财务指标筛选出盈利能力强,ROIC,即投资资本回报率,计算公式为净利润/全部投入资本,其中全部投入资本=股东权益(不含少数股东权益)+负债合计-无息流动负债-无息长期负债,该指标主要用于衡量企业运用所有债权人及股东投入的企业获得现金盈利的能力,也用来衡量企业创造价值的潜力;

2)对于金融行业,选择过去三年的平均ROE,即净资产收益率,ROE,即净资产收益率,计算公式为净利润/除权后ROE,该指标反映股东权益的收益水平,指标越高越好,说明投资带来的收益越高;

3)波动一般股息率在100个名的个股,股息率(Dividend Yield),即当期股息(此处红利只指现金股息)除以当前股价,股息率是衡量企业是否具有投资价值的重要标尺之一。

(2)价值评估分析
本基金通过价值评估分析,选择价值被低估上市公司,形成优化的股

票池。价值评估分析主要运用国际化视野,采用专业的估值模型,合理使用估值指标,选择其中价值被低估的公司。具体采用的方法包括市盈率法、市净率法、市销率、PEG、EV/EBITDA、息贴贴现模型等。基金管理人根据不同行业产销率和市场特征灵活运用,努力从估值层面为持有人发掘价值。

(3)实地调研
对于本基金计划重点投资的上市公司,公司投资研究团队将实地调研上市公司,深入了解其管理团队能力、企业经营状况、重大投资项目进展以及财务数据真实性等。为了验证实地调研的准确性,投资研究团队还将通过上市公司的外部合作机构和相关行政管理部门进一步调研,对上述结论进行核实。

(4)投资组合建立和调整
本基金将在案头分析和实地调研的基础上,建立和调整投资组合。在投资组合管理过程中,本基金还将注重投资品种的交易活跃程度,以保证整体组合具有良好的流动性。

3.债券投资策略
本基金的债券资产投资主要以中长期利率趋势分析为基础,结合中短期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,通过收益率曲线配置等方法,实施积极的债券投资管理。

4.资产支持证券投资
本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还款、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

5.中小企业私募债投资策略
本基金在严格控制风险的前提下,综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征,选择具有相对优势的品种,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,谨慎进行中小企业私募债的投资。

6.非公开发行股票投资策略
本基金从发展前景和估值水平两个角度出发,通过定性和定量分析相结合的方法评价定向增发项目对上市公司未来价值的影响,结合定向增发发行价格与市场交易价格价差的大小,理性做出投资决策。

7.权证投资策略
本基金将在严格控制风险的前提下,主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础,在采用数量化模型分析其合理定价的基础上,把握市场的短期波动,进行积极操作,追求在风险可控的前提下稳健的收益。

8.股指期货投资策略
本基金在股指期货投资中将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,在风险可控的前提下,参与股指期货的投资。此外,本基金还将运用股指期货来管理特殊情况下的流动性风险。

9.国债期货投资策略
本基金投资国债期货,将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,充分考虑国债期货的流动性和风险收益特征,在风险可控的前提下,适度参与国债期货投资。

信息披露

本基金为混合型基金,其预期风险、预期收益高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高等预期风险和预期收益的产品。

第十一部分 基金投资组合报告

本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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截止2018年12月31日,本报告所列财务数据未经审计。

(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	254,319,414.67	89.81
	其中:股票	254,319,414.67	89.81
2	固定收益投资	840,159.00	0.30
	其中:债券	840,159.00	0.30
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--
6	银行存款和结算备付金合计	19,647,934.90	6.94
7	其他资产	8,380,687.42	2.96
8	合计	283,188,195.99	100.00

(二)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	--	--
C	制造业	174,153,920.87	61.96
D	电力、热力、燃气及生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	62,295,391.89	22.16
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	信息和金融业	--	--
I	信息技术、软件和信息技术服务业	12,752,900.90	4.54
J	房地产业	--	--
K	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	5,117,120.01	1.82
O	医药生物、医药和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社公工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	--	--
S	综合	--	--
	合计	254,319,414.67	90.48

(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例前十大股票投资明细

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	603883	老百姓	508,829	24,021,817.09	8.55
2	002250	联华科技	1,888,817	17,811,544.31	6.34
3	002563	森远股份	1,888,881	16,848,818.52	5.99
4	603737	三钢闽光	400,039	14,545,418.04	5.17
5	600271	航天信息	600,000	13,734,000.00	4.89
6	603179	新股份	788,236	12,723,763.38	4.53
7	300616	尚品宅配	204,632	12,435,486.64	4.42
8	603233	大参林	311,380	12,411,606.80	4.42
9	002831	裕同科技	288,800	11,569,328.00	4.12
10	603939	益丰药房	209,801	11,250,660.00	4.00

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	--	--	--
2	央行票据	--	--	--
3	金融债券	--	--	--
	其中:政策性金融债	--	--	--
4	企业债券	--	--	--
5	企业短期融资券	--	--	--
6	中期票据	--	--	--
7	可转换(可交换)债	840,159.00	0.30	
8	同业存单	--	--	--
9	其他	840,159.00	0.30	
10	合计	840,159.00	0.30	

证劵代码:002368 证劵简称:太极股份 公告编号:2019-021

太极计算机股份有限公司关于向银行申请2019年度综合授信额度的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2019年3月21日,太极计算机股份有限公司(以下简称“公司”)第八届董事会第二十次会议以9票赞成,0票反对,0票弃权审议通过《关于向银行申请2019年度综合授信额度的议案》,公司拟向银行申请授信总额度为79.86亿元的综合授信业务,具体情况如下:

金融机构名称	授信形式	方式	总额度(万元)
交通银行重庆支行	信用	流动资金贷款、保函、银行承兑汇票、开立进口信用证、开立进口远期信用证等	2800
北京银行中融支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	7000
浦发银行花园支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	3300
招商银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	1000
民生银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	2000
中国民生银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	3000
光大银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	1000
建设银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、应收账款保理等	3000
工商银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	1500
中国银行重庆支行	信用	保函、开立进口信用证、开立进口远期信用证等	1000
广发银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、商票保贴及贴现等	6000
中国邮储银行重庆分行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	2500
中国民生银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	6000
合计			71100

金融机构名称	授信形式	方式	总额度(万元)
浦发银行花园支行	信用	开立保函、银行承兑汇票等	500
北京银行中融支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等(包含在太极股份综合授信)	800
宁波银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	500
浦发银行花园支行	信用	开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	1500
广发银行重庆支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、商票保贴及贴现等	1000
光大银行重庆支行	担保	流动资金贷款等	500
合计			4500

金融机构名称	授信形式	方式	总额度(万元)
北京银行中融支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等(包含在太极股份综合授信)	200
广发银行北京支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	200
工商银行北京支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、商票保贴及贴现等	900
光大银行北京支行	担保	流动资金贷款等	300
合计			1200

金融机构名称	授信形式	方式	总额度(万元)
浦发银行花园支行	担保	流动资金贷款、银行保函、承兑等	150
宁波银行重庆支行	信用	流动资金贷款	300
招商银行北京万通中心智慧支行	信用	流动资金贷款	150
宁波银行重庆支行	信用	流动资金贷款、银行保函、承兑	300
广发银行重庆支行	担保	流动资金贷款、银行承兑汇票、商票保贴及贴现等	300
中国民生银行重庆支行	担保	流动资金贷款	950
中国电子科技服务有限公司	房产担保	流动资金贷款	2150
合计			910

北京大金信息智能技术股份有限公司:

金融机构名称	授信形式	方式	总额度(万元)
交通银行重庆支行	信用	流动资金贷款、保函、银行承兑汇票、开立进口信用证、开立进口远期信用证等	2300
北京银行中融支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	7000
浦发银行花园支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	3300
招商银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	1000
民生银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	2000
中国民生银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	3000
光大银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	1000
建设银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、应收账款保理等	3000
工商银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	1500
中国银行重庆支行	信用	保函、开立进口信用证、开立进口远期信用证等	1000
广发银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、商票保贴及贴现等	6000
中国邮储银行重庆分行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	2500
中国民生银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	6000
中国民生银行重庆支行	信用	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等	2500
合计			71100

北京大金信息智能技术股份有限公司:

金融机构名称	授信形式	方式	总额度(万元)
浦发银行花园支行	担保	开立保函、银行承兑汇票等	500
北京银行中融支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、应收账款保理等(包含在太极股份综合授信)	800
宁波银行重庆支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	500
浦发银行花园支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、信用证、应收账款保理等	1500
广发银行重庆支行	担保	流动资金贷款和开立保函、银行承兑汇票、商票保贴及贴现等	1000
光大银行重庆支行	担保	流动资金贷款等	500
合计			4500

除上述情况外,原告告知其他内容不变,对上述更正给投资者带来的不便,公司及审计机构深表歉意,今后公司将采取切实措施加强信息披露的审核工作,敬请广大投资者谅解。

特此公告。

太极计算机股份有限公司
董事会
2019年3月22日

证劵代码:002368 证劵简称:太极股份 公告编号:2019-024

太极计算机股份有限公司更正公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

太极计算机股份有限公司(以下简称“公司”)于2019年3月22日在巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)及《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上披露了《2018年年度报告》、《2018年审计报告》及《关于向银行申请2019年度综合授信额度的公告》(公告编号:2019-021),经事后审核发现,部分内容出现差错,现对该部分内容进行更正,以下更正不会对公司2018年度业绩造成影响,具体情况如下:

同时授权公司总裁吕瑞峰先生全权代表公司签署上述额度内的一切授信(包括但不限于授信、融资等)有关的合同、协议、凭证等各项法律文件,由此产生的法律、经济责任全部由公司承担。

本议案尚需提交股东大会审议。

特此公告。

太极计算机股份有限公司
董事会
2019年3月22日

证劵代码:002368 证劵简称:太极股份 公告编号:2019-024

太极计算机股份有限公司更正公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

太极计算机股份有限公司(以下简称“公司”)于2019年3月22日在巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)及《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上披露了《2018年年度报告》、《2018年审计报告》及《关于向银行申请2019年度综合授信额度的公告》(公告编号:2019-021),经事后审核发现,部分内容出现差错,现对该部分内容进行更正,以下更正不会对公司2018年度业绩造成影响,具体情况如下:

同时授权公司总裁吕瑞峰先生全权代表公司签署上述额度内的一切授信(包括但不限于授信、融资等)有关的合同、协议、凭证等各项法律文件,由此产生的法律、经济责任全部由公司承担。

本议案尚需提交股东大会审议。

特此公告。

太极计算机股份有限公司
董事会
2019年3月22日

证劵代码:002368 证劵简称:太极股份 公告编号:2019-024

太极计算机股份有限公司更正公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

太极计算机股份有限公司(以下简称“公司”)于2019年3月22日在巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)及《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上披露了《2018年年度报告》、《2018年审计报告》及《关于向银行申请2019年度综合授信额度的公告》(公告编号:2019-021),经事后审核发现,部分内容出现差错,现对该部分内容进行更正,以下更正不会对公司2018年度业绩造成影响,具体情况如下:

同时授权公司总裁吕瑞峰先生全权代表公司签署上述额度内的一切授信(包括但不限于授信、融资等)有关的合同、协议、凭证等各项法律文件,由此产生的法律、经济责任全部由公司承担。

本议案尚需提交股东大会审议。

特此公告。

太极计算机股份有限公司
董事会
2019年3月22日

证劵代码:002368 证劵简称:太极股份 公告编号:2019-024

太极计算机股份有限公司更正公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

太极计算机股份有限公司(以下简称“公司”)于2019年3月22日在巨潮资讯网(<http://www.cninfo.com.cn>)及《中国证券报》、《证券时报》、《证券日报》上披露了《2018年年度报告》、《2018年审计报告》及《关于向银行申请2019年度综合授信额度的公告》(公告编号:2019-021),经事后审核发现,部分内容出现差错,现对该部分内容进行更正,以下更正不会对公司2018年度业绩造成影响,具体情况如下:

同时授权公司总裁吕瑞峰先生全权代表公司签署上述额度内的一切授信(包括但不限于授信、融资等)有关的合同、协议、凭证等各项法律文件,由此产生的法律、经济责任全部由公司承担。

本议案尚需提交股东大会审议。