海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金更新招募说明书摘要

（2019年第1号）

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:杭州银行股份有限公司

重要提示

本基金经2018年9月6日中国证券监督委员会证监许可【2018】1460号文准予注册募集。本基金的基金合同于2019年1月18日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读本招募说明书、基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,并承担基金投资中出现的各类风险。投资者应充分考虑自身的风险承受能力,对于申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。

基金的过往业绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本招募说明书所载内容截止日为2019年7月18日,有关财务数据和净值表现截止日为2019年6月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

一、基金管理人概况

名称:海富通基金管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人:杨仓兵

成立时间:2003年4月18日

电话:021-38650999

联系人:吴晨莺

注册资本:3亿元人民币

股权结构:海通证券股份有限公司51%、法国巴黎资产管理BE控股公司49%。

二、主要人员情况

杨仓兵先生,董事长。历任安徽省农业科学院计财科副科长,安徽示康药业有限公司财务部经理,海通证券有限公司计划资金部资金科科长、计划资金部总经理助理、计划资金部副总经理,上海海振实业发展有限公司总经理,海通证券股份有限公司计划财务部副总经理。自2015年10月至2019年3月任海通证券股份有限公司资金管理总部总经理。2016年10月起兼任海通证券资产管理有限公司董事。2018年5月至2019年3月兼任海富通基金管理有限公司监事长。2019年3月至2019年4月任海富通基金管理有限公司董事。2019年4月起任海富通基金管理有限公司董事长。

任志强先生,董事,总经理,硕士。曾任南方证券有限公司上海分公司研究部总经理助理、南方证券研究所综合管理部副经理,华宝信托投资有限责任公司研究发展中心总经理兼投资管理部总经理,华宝信托投资有限责任公司总裁助理兼董事会秘书,华宝证券经纪有限公司董事、副总经理。华宝兴业基金管理有限公司基金经理、投资总监、副总经理,华宝兴业资产管理(香港)有限公司董事长。2017年6月加入海富通基金管理有限公司,现任海富通基金管理有限公司董事、总经理。2018年3月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司执行董事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事长。2019年2月起兼任海富通资产管理(香港)有限公司董事长。

吴淑琨先生,董事,管理学博士。历任南京大学副教授,海通证券股份有限公司研究所宏观研究部经理、所长助理、机构业务部副总经理、企业及私人客户服务部副总主持、企业金融部总经理。现任海通证券股份有限公司战略发展部总经理。

芮政先先生,董事,理学学士。历任上海警备区教导大队训练处教员,上海社会科学院人口与发展研究所助理研究员,海通证券有限责任公司监察室专务、二科副科长,海通证券股份有限公司人力资源开发部劳资科科长、干部科科长、总经理助理兼干部科科长,海通证券股份有限公司人力资源部总经理助理。2008年10月起担任海通开元投资有限公司监事。2014年11月起至今任海通证券股份有限公司人力资源部副总经理,2015年11月起兼任海通证券股份有限公司纪委委员,2016年11月起兼任海通创新资本管理有限公司董事。2017年12月起兼任海通证券股份有限公司监事。

Ligia Torres(陶乐斯)女士,董事,法国与墨西哥双重国籍,双硕士学位,曾任职于东方汇理银行、渣打银行和欧洲联合银行,1996年加入法国巴黎银行集团工作,2010年3月至2013年6月任法国巴黎银行财产管理部英国地区首席执行官,2010年10月至今任法国巴黎银行英国控股有限公司董事,2013年7月至今任法国巴黎资产管理公司亚太区CEO。

Alexandre Werno(韦历山)先生,董事,法国籍,金融硕士学位。2007年9月至2013年4月在法国兴业投资银行全球市场部任执行董事、中国业务开发负责人职务;2013年5月至2017年11月先后任华宝兴业基金管理有限公司总经理高级顾问、常务副总经理职务;2017年11月至今任法国巴黎资产管理亚洲有限公司亚太区战略合作总监。

张馨先生,独立董事,博士。历任厦门大学经济学院财金系教授及博士生导师、副院长兼系主任、厦门大学经济学院院长。2011年1月至今退休。

杨文斌(Philip YOUNG Wen Binn)先生,独立董事,管理学硕士(MBA)。历任美国大陆银行(芝加哥,台北)放贷经理,中华开发金控(台湾)资本市场经理,国际投资信托(台湾)执行副总经理,美银信托(香港)副总经理,日本野村资产管理(香港)投资总监,安泰人寿大中华地区投资总监,日本万通人寿投资总监及常务董事,中国平安保险集团资产管理公司投资总监。2006年7月至2009年4月任中国太平洋人寿保险股份有限公司与中国太平洋(集团)股份有限公司投资总监。2009年4月至2012年11月任太平洋资产管理有限公司投资总监。

刘正东先生,独立董事,法律硕士。历任上海市人民检察院铁路运输分院助理检察员,上海市虹桥律师事务所律师。1998年11月至2018年6月任上海市君悦律师事务所主任、高级合伙人。2018年6月起至今任上海市君悦律师事务所首席合伙人、合伙人会议主席。

陈静女士,独立董事,硕士。历任中国海洋石油总公司财务部干部,中外运-敦豪有限公司财务部经理,华盛顿普华会计师事务所(现普华永道)审计师,世界银行集团华盛顿总部高级会计官员、高级金融官员,中国证监会规划委高级顾问委员兼会计部副主任,中国投资有限责任公司财务部副总监、董事总经理。2014年5月起至今任瑞士合众集团中国董事会成员。

曹志刚先生,监事长,经济学硕士。历任海通证券股份有限公司风险控制总部(稽核部)二级部经理、稽核部总经理助理,自2018年3月至今任稽核部副总经理。2016年11月起至今任海通吉禾股权投资基金管理有限责任公司和海通创意资本管理有限公司监事。

Bruno Weil(魏海诺)先生,监事,法国籍,博士。历任巴黎银行东南亚负责人、亚洲融资项目副经理,法国巴黎银行跨国企业全球业务客户经理、亚洲金融机构投行业务部负责人、零售部中国代表,南京银行副行长。现任法国巴黎银行(中国)副董事长。

俞涛先生,监事,博士,CFA。先后就职于上投摩根基金管理有限公司、摩根资产管理(英国)有限公司。曾任上投摩根基金管理有限公司业务发展部总监。2012年11月加入海富通基金管理有限公司,历任产品与创新总监。2015年12月起任海富通基金管理有限公司总经理助理。

胡正万先生,监事,硕士。先后就职于成都机车车辆厂、四川省证券股份有限公司、富国基金管理有限公司。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任基金会计、高级注册登记专员、注册登记负责人、基金运营副总监。2015年7月起任海富通基金管理有限公司基金运营总监。

奚万荣先生,督察长,经济学硕士,中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管,海通证券股份有限公司内部审计。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任监事、监察稽核总监、总经理助理。2015年7月起,任海富通基金管理有限公司督察长。2015年7月至2018年7月兼任上海富诚海富通资产管理有限公司监事。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

陶网雄先生,副总经理,硕士。历任中国电子器材华东公司会计科长、上海中土实业发展公司主管会计、海通证券股份有限公司财务副经理。2003年4月加入海富通基金管理有限公司,2003年4至2006年4月任公司财务部负责人,2006年4月起任财务总监。2013年4月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。2018年7月起兼任上海富诚海富通资产管理有限公司董事。

何树方先生,副总经理,博士。历任山东济宁市财政贸易委员会副科长,魁北克蒙特利尔大学研究助理(兼职),魁北克公共退休金管理投资公司分析师,基金经理助理,富国基金管理有限公司总经理助理,2011年6月加入海富通基金管理有限公司,任总经理助理。2014年11月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。

陈轶平先生,博士,CFA。历任Mariner Investment Group LLC 数量金融分析师、瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益交易组合研究支持部副董事,2011年10月加入海富通基金管理有限公司,历任债券投资经理、基金经理、现金管理部副总监、债务基金部总监,现任固定收益投资副总监。2013年8月起任海富通货币基金经理。2014年8月起兼任海富通季季增利理财债券基金经理。2014年11月起兼任海富通上证可质押城投债ETF(现为海富通上证城投债ETF)基金经理。2015年12月起兼任海富通稳固收益债券基金经理。2015年12月至2017年9月兼任海富通稳进增利债券(LOF)基金经理。2016年4月起兼任海富通一年定开债券基金经理。2016年7月起兼任海富通富祥混合基金经理。2016年8月起兼任海富通瑞丰一年定开债券(现为海富通瑞丰债券)基金经理。2016年8月至2017年11月兼任海富通瑞益债券基金经理。2016年11月起兼任海富通美元债(QDII)基金经理。2017年1月起兼任海富通上证周期产业债ETF基金经理。2017年2月起兼任海富通瑞利债券基金经理。2017年3月至2018年6月兼任海富通富源债券基金经理。2017年3月起兼任海富通瑞合纯债基金经理。2017年5月起兼任海富通富睿混合基金经理。2017年7月起兼任海富通瑞福一年定开债券(现为海富通瑞福债券)、海富通瑞祥一年定开债券基金经理。2017年7月至2018年12月兼任海富通欣悦混合基金经理。2018年4月起兼任海富通恒丰定开债券基金经理。2018年10月起兼任海富通上证10年期地方政府债ETF基金经理。2018年11月起兼任海富通弘丰定开债券基金经理。2019年1月起兼任海富通上清所短融债券基金经理。

陆丛凡先生,硕士。曾任瑞银企业管理(上海)有限公司固定收益定量分析师,2015年4月加入海富通基金管理有限公司。2015年6月至2019年7月任海富通固定收益部基金经理助理。2019年7月起任海富通上证城投债ETF、海富通上证10年期地方政府债ETF、海富通上清所短融债券的基金经理。

投资决策委员会常设委员有:任志强,总经理;胡光涛,总经理助理;王智慧,总经理助理;孙海忠,总经理助理兼固定收益投资总监;杜晓海,量化投资部总监;王金祥,研究部总监;陈轶平,固定收益投资副总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的,则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称:杭州银行股份有限公司(以下简称"杭州银行")

住所:杭州市下城区庆春路46号

办公地址:杭州市下城区庆春路46号

法定代表人:陈震山

成立时间:1996年9月25日

组织形式:股份有限公司

注册资本:伍拾壹亿叁仟零贰拾万零肆佰叁拾贰元人民币

存续期间:持续经营

批准设立机关及批准设立文号:中国人民银行 银复[1993]254号

基金托管资格批文及文号:证监许可【2014】337号

三、相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

名称:海富通基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人:杨仓兵

全国统一客户服务号码:40088-40099(免长途话费)

联系人:暴潇菡

电话:021-38650797

传真:021-33830160

2、其他销售机构

(1)海通证券股份有限公司

注册地址:上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人:周杰

办公地址:上海市广东路689号海通证券大厦

客户服务电话:95553或4008888001

联系人:李笑鸣

网址:www.htsec.com

(2)申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

法定代表人:李梅

办公地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

客户服务电话:95523或4008895523

联系人:陈飙

网址:www.swhysc.com

(3)申万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人:韩志谦

办公地址:新疆乌鲁木齐高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

客户服务电话:4008000562

联系人:王怀春

网址:www.hysec.com

(4)中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人:张佑君

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

客户服务电话:95548

联系人:王一通

网址:www.cs.ecitic.com

(5)中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法定代表人:姜晓林

办公地址:青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东座5层

客户服务电话:95548

联系人:刘晓明

网址:www.zxwt.com.cn

(6)中信期货有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305、14层

法定代表人:张皓

办公地址: 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座13层1301-1305室、14层

客户服务电话:4009908826

联系人:刘宏莹

网址:www.citicsf.com

(7)西部证券股份有限公司

注册地址:陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室

法定代表人:刘建武

办公地址:陕西省西安市新城区东新街319号8幢10000室

客户服务电话:95582

联系人:梁承华

(8)网址:www.west95582.com上海天天基金销售有限公司

注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼二层

地址:上海市徐汇区徐家汇街道宛平南路88号金座26楼

法定代表人:其实

客户服务电话:400-1818-188

联系人:王超

网址: www.1234567.com.cn

(9)上海联泰基金销售有限公司

法定代表人:燕斌

注册地址: 中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室

客服电话:400-118-1188

联系人:陈东

网址:www.66liantai.com

(10)上海基煜基金销售有限公司

注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)

地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路1800号2号楼6153室(上海泰和经济发展区)

法定代表人:王翔

客服电话:400-820-5369

联系人:李鑫

网址:www.jiyufund.com.cn

(11)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路1333号14楼09单元

地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元

法定代表人:郭坚

客服电话:4008 6666 18

联系人:程晨

网址:https://www.lu.com

(12)中证金牛(北京)投资咨询有限公司

注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

法定代表人:彭运年

客服电话:4008-909-998

联系人:王莅晨

网址:http://www.jnlc.com/

(13)北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

地址:北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2地块新浪总部科研楼5层518室

法定代表人:李昭琛

客服电话:4006900000

联系人:吴翠

网址:http://finance.sina.com.cn/fund/

(14)北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

地址:北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

法定代表人:江卉

客服电话:95118 / 400-098-8511

联系人:韩锦星

网址:京东金融APP

(15)珠海盈米基金销售有限公司

注册地址: 珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

法定代表人:肖雯

客服电话:020-89629066

联系人:吴煜浩

网址:www.yingmi.cn

(16)北京虹点基金销售有限公司

注册地址:北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603

法定代表人:郑毓栋

客服电话:400-618-0707

联系人:陈铭洲

网址:www.hongdianfund.com

(17)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

注册地址:浙江省杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1幢202室

地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

客户服务电话:4000-766-123

联系人:李雁雯

网址:蚂蚁财富APP

(18)江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

地址:南京市高淳区经济开发区古檀大道47号

法定代表人:吴言林

客服电话:025-66046166

网址:www.huilinbd.com

二、登记机构

名称:海富通基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人:杨仓兵

电话:021-38650980

传真:021-38650777-980

联系人:吴磊

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:俞卫锋

电话:021-31358666

传真:021-31358600

联系人:陈颖华

经办律师:黎明、陈颖华

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:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:李丹

经办注册会计师:薛竞、都晓燕

电话:(021) 23238888

传真:(021) 23238800

联系人:都晓燕

四、基金的名称

本基金的名称:海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金。

五、基金的类型

基金类型:契约型、开放式。

六、基金的投资目标

本基金将紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,力争本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.25%,年化跟踪误差不超过3%。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数成份债券和备选成份债券。

为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的债券(其他短期融资券和超短期融资券、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、央行票据、中期票据、地方政府债等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具以及法律法规或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的相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

在建仓完成后,本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%。本基金持有现金或者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、应收申购款等。

八、基金额投资策略

一、投资策略

(一)分层抽样策略

本基金为指数基金,将采用分层抽样复制法对标的指数进行跟踪。

分层抽样复制法指的是采用一定的抽样方法从构成指数的成份债券中抽取若干成份券构成用于复制指数跟踪组合的方法。采取该方法可以在控制跟踪误差的基础上,进一步减少了组合维护及再平衡的所需的费用。

本基金将首先通过对标的指数中各成份债券的信用评级、历史流动性及收益率等进行分析,初步选择流动性较好的成份券作为备选,其次将通过对标的指数按照久期、剩余期限、信用等级、到期收益率以及债券发行主体等进行分层抽样,以使构建组合与标的指数在以上特征上尽可能相似,达到复制标的指数、降低交易成本的目的。

由于采用抽样复制,本基金组合中的个券只数、权重与标的指数可能存在差异。此外本基金在控制跟踪误差的前提下,可通过风险可控的积极管理获得超额收益,以弥补基金费用等管理成本,控制与标的指数的偏离度。

(二)替代性策略

当由于市场流动性不足或因法规规定等其他原因,导致标的指数成份券及备选成份券无法满足投资需求时,基金管理人可以在成份券及备选成份券外寻找其他债券构建替代组合,对指数进行跟踪复制。

替代组合的构建将以债券流动性为约束条件,按照与被替代债券久期相近、信用评级相似、到期收益率及剩余期限基本匹配为主要原则,控制替代组合与被替代债券的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

(三) 债券投资策略

对于非成份券的债券,本基金综合运用久期调整、收益率曲线策略、类属配置等组合管理手段进行日常管理。另外,本基金债券投资将适当运用杠杆策略,通过债券回购融入资金,然后买入收益率更高的债券以获得收益。

(1)久期管理策略是根据对宏观经济环境、利率水平预期等因素,确定组合的整体久期,有效控制基金资产风险。

(2)收益率曲线策略是指在确定组合久期以后,根据收益率曲线的形态特征进行利率期限结构管理,确定组合期限结构的分布方式,合理配置不同期限品种的配置比例。

(3)类属配置包括现金、不同类型固定收益品种之间的配置。在确定组合久期和期限结构分布的基础上,根据各品种的流动性、收益性以及信用风险等确定各子类资产的配置权重,即确定债券、存款、回购以及现金等资产的比例。

(四)资产支持证券投资策略

对于资产支持证券,本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素,研究资产支持证券的收益和风险匹配情况,在严格控制风险的基础上选择投资对象,追求稳定收益。

二、投资决策和程序

1、决策依据

有关法律、法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责制定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策;基金经理负责日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

3、投资程序

研究支持、投资决策、组合构建、交易执行、投资绩效评估及组合维护等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究支持:研究团队依托基金管理人整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果,开展指数跟踪、流动性分析、误差及其归因分析等工作,撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会依据研究团队提供的研究报告,定期或遇重大事项时召开投资决策会议,决定相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数情况,结合研究支持,基金经理以抽样复制标的指数成份债券及成份债券权重的方法构建组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,降低买入成本、控制投资风险。

(4)交易执行:交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)投资绩效评估:风险管理部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检视投资策略,进而调整投资组合。

(6)组合维护:基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份债券基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理体制和程序做出调整,并在基金招募说明书中列示。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:上海清算所中高等级短期融资券指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(税后)×5%。

本基金投资于上海清算所中高等级短期融资券指数成份债券和备选成份债券的资产比例不低于基金资产净值的80%,且不低于非现金基金资产的80%;此外,本基金持有现金或者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%。选用以上业绩比较基准可以有效评估本基金投资组合业绩,反映本基金的风格特点。

上海清算所中高等级短期融资券指数系银行间市场清算所股份有限公司开发管理的中国信用债指数,其成份券为在银行间市场流通的、剩余期限7天以上、主体评级AA+级以上、无信用展望负面、无降级记录的短期融资券和超短期融资券。

本基金标的指数变更的,相应更换基金名称和业绩比较基准,并在报中国证监会备案后及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于债券型基金,其预期收益及预期风险水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

本基金属于指数基金,采用分层抽样复制策略,跟踪上海清算所中高等级短期融资券指数,其风险收益特征与标的指数所表征的债券市场组合的风险收益特征相似。

十一、基金的投资组合报告

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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月31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至2019年6月30日("报告期末")。

1 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	666,431,500.00	98.84
	其中:债券	666,431,500.00	98.84
	资产支持证券	-	-
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	159,006.45	0.02
7	其他资产	7,693,485.69	1.14
8	合计	674,283,992.14	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	40,424,000.00	6.60
	其中:政策性金融债	40,424,000.00	6.60
4	企业债券	20,093,000.00	3.28
5	企业短期融资券	576,781,500.00	94.12
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	29,133,000.00	4.75
9	其他	-	-
10	合计	666,431,500.00	108.75

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150208	15国开08	400,000	40,424,000.00	6.60
2	011802328	18珠海华发SCP004	300,000	30,171,000.00	4.92
3	011802274	18皖出版SCP004	300,000	30,168,000.00	4.92
4	011900259	19越秀集团SCP001	300,000	30,069,000.00	4.91
5	011901002	19南方水泥SCP004	300,000	30,018,000.00	4.90

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交易情况说明

9.1 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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金合同,本基金不参与股指期货交易。

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

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

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。

10.3 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

11 投资组合报告附注

11.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情形。

11.2本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	61,268.19
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,632,217.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,693,485.69

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处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2019年6月30日。

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。投资有风险,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。

(一)本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

1、海富通上清所短融债券A :

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019年1月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日	1.28%	0.02%	1.58%	0.02%	-0.30%	0.00%

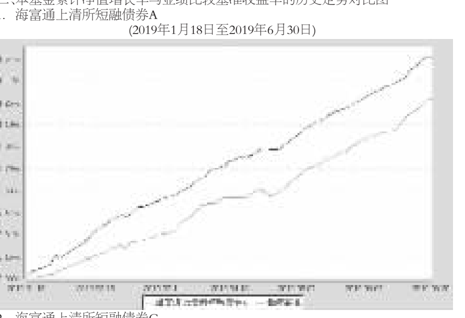
2、海富通上清所短融债券C :

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2019年1月18日(基金合同生效日)至2019年6月30日	0.98%	0.02%	1.03%	0.01%	-0.05%	0.01%

二、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

1. 海富通上清所短融债券A

(2019年1月18日至2019年6月30日)



2. 海富通上清所短融债券C

(2019年3月11日至2019年6月30日)

注:1、本基金合同于2019年1月18日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定,本基金自基金合同生效起6个月内为建仓期。截止本报告期末,本基金尚处于建仓期。

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、C 类基金份额的销售服务费;

4、基金的标的指数使用许可费;

5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;

7、基金份额持有人大会费用;

8、基金的相关账户的开户及维护费用;

9、基金的证券交易费用;

10、《基金合同》生效后的基金的银行汇划费用;

11、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0.25%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,在每月初5个工作日内、由基金管理人出具资金划拨指令,基金托管人复核无误后划付。若遇法定节假日、休息日等,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0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,在每月初5个工作日内、由基金管理人出具资金划拨指令,基金托管人复核无误后划付。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3、C类基金份额的销售服务费

本基金 A 类基金份额不收取销售服务费,C 类基金份额的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值的0.2%年费率计提。C类基金份额销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.2%÷当年天数

H 为C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

C类基金份额的销售服务费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,在每月初5个工作日内、由基金管理人出具资金划拨指令,基金托管人复核无误后划付。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

4、基金合同生效后的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数许可使用协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

基金合同生效不满12个月的,免收指数许可使用费;此后指数许可使用费按前一日的基金资产净值的0.02%的年费率计提。

计算方法如下:

H=E×年费率/当年天数

H 为每日应计提的指数许可使用费

E 为前一日的基金资产净值

自基金成立一年后的下一季度(自然季度)起,指数许可使用费收取下限为每季度(自然季度)4万元,即不足4万元时按照4万元收取。基金成立满一年之日所在季度,当季指数许可使用费的计算方法如下:

当季指数许可使用费=max(40000元×基金当季存续天数÷当季天数,当季累计计提的指数许可使用费)。

指数许可使用费每日计算,逐日累计,按季支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初10个工作日内、按双方协商一致的方式支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。

上述"一、基金费用的种类"中第5-11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3、《基金合同》生效前的相关费用;

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

一、"三、基金管理人"部分:

1.更新了基金管理人概况的相关信息。

2.更新了杨仓兵先生、任志强先生、陈轶平先生的简历。

3.增加了芮政先生、杨文斌(Philip YOUNG Wen Binn)先生、刘正东先生、陈静女士、曹志刚先生、胡正万先生、陆丛凡先生的简历。

4.删除了张文伟先生、杨明先生、杨国平先生、Marc Bayot(巴约特)先生、郑国汉先生的简历。

二、"四、基金托管人"部分,更新了基金托管人的相关信息。

三、"五、相关服务机构"部分,对部分场外销售机构的相关信息进行了更新。

四、"六、基金的募集"部分,更新了募集结束后的相关信息。

五、"七、基金合同的生效"部分,更新了相关信息。

六、"八、基金份额的申购与赎回"部分,更新了相关信息。

七、"九、基金的投资"和"十、基金的业绩"部分,根据2019年第二季度报告,更新了基金投资组合报告和基金业绩的内容,相关数据截止期为2019年6月30日。

八、"二十、基金托管协议的内容摘要"部分,更新了托管协议当事人的相关信息。

九、本基金增加了收取销售服务费的C类份额,根据最新的基金合同修改了相应的信息。

海富通基金管理有限公司

2019年8月31日

凯迪生态环境科技股份有限公司

证券代码:000939 证券简称:凯迪生态 公告编号:

2019 半年度 报告摘要

一、重要提示

本半年度报告摘要来自半年度报告全文,为全面了解本公司的经营成果、财务状况及未来发展规划,投资者应当到证监会指定媒体仔细阅读半年度报告全文。

董事、监事、高级管理人员异议声明

姓名	职务	内容和原因
王海鸥	董事	详见同日披露的关于第九届董事会第十一次会议决议的公告
王伟	董事	详见同日披露的关于第九届董事会第十一次会议决议的公告
须峰	独立董事	详见同日披露的关于第九届董事会第十一次会议决议的公告

声明

董事王海鸥、王伟,独立董事须峰,无法保证本报告内容的真实、准确、完整,理由详见同日披露的关于第九届董事会第十一次会议决议的公告,请投资者特别关注。

所有董事均亲自出席了审议本次半年报的董事会会议

非标准审计意见提示

□ 适用 √ 不适用

董事会审议的报告期普通股利润分配预案或公积金转增股本预案

□ 适用 √ 不适用

公司计划不派发现金红利,不送红股,不以公积金转增股本。

董事会决议通过的本报告期优先股利润分配预案

□ 适用 √ 不适用

二、公司基本情况

1、公司简介

股票简称	凯迪生态	股票代码	000939
股票上市交易所	深圳证券交易所		
联系人和联系方式	董事会秘书	证券事务代表	
姓名	陈义龙		
办公地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区江夏大道特一号凯迪大厦702		
电话	027-67869270		
电子信箱	chenyilong@kaidihi.com		

2、主要财务数据和财务指标

公司是否需追溯调整或重述以前年度会计数据

□ 是 √ 否

	本报告期	上年同期	本报告期比上年同期增减
营业收入(元)	1,191,680,147.65	1,395,428,797.17	-14.60%
归属于上市公司股东的净利润(元)	-974,988,924.59	-961,492,150.74	-1.40%
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润(元)	-974,370,698.85	-964,467,490.76	-1.03%
经营活动产生的现金流量净额(元)	41,946,341.67	-361,864,401.08	111.59%
基本每股收益(元/股)	-0.25	-0.24	-4.17%
稀释每股收益(元/股)	-0.25	-0.24	-4.17%
加权平均净资产收益率	-58.08%	-11.28%	-46.80%
	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减
总资产(元)	32,304,861,124.76	32,628,674,849.88	-0.99%
归属于上市公司股东的净资产(元)	1,195,197,063.20	2,166,208,642.29	-44.83%

3、公司股东数量及持股情况

单位:股

报告期末普通股股东总数			79,373	报告期末表决权恢复的优先股股东总数(如有)		0
前10名股东持股情况						
股东名称	股东性质	持股比例	持股数量	持有有限售条件的股份数量	质押或冻结情况	
					股份状态	数量
阳光凯迪新能源集团有限公司	境内非国有法人	29.08%	114,272,152	562,332,152	质押	1,121,284,186
					冻结	1,121,284,186
中国华电集团资本控股有限公司	国有法人	10.18%	400,000,000	0		
华宝信托有限责任公司	国有法人	5.47%	215,053,762	0		
方正富邦基金-民生银行-中国民生信托-中国民生信托·至信266号凯迪生态定向增发集合资金信托计划	其他	4.93%	193,548,386	0		
武汉金湖科技有限公司	境内非国有法人	3.76%	147,642,128	147,642,128	冻结	147,600,000
中国华融资产管理股份有限公司	国有法人	2.81%	110,496,170	110,496,170		
光大兴陇信托有限责任公司-光大信托-云信凯1号证券投资单一资金信托	其他	1.82%	71,432,062	0		
中山证券-招商银行-中山证券启航3号定增集合资产管理计划	其他	1.71%	67,112,674	0		
中国证券金融股份有限公司		1.56%	61,331,580	0		
安徽省铁路发展基金股份有限公司		1.40%	54,985,660	0		
上述股东关联关系或一致行动的说明	凯迪生态与阳光凯迪、武汉金湖为关联法人,除此之外,未知上述其他股东之间是否存在关联关系或属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人情况。					
参与融资融券业务股东情况说明(如有)	阳光凯迪普通账户持有无限售流通股558,952,034股,通过担保交易账户持有21,437,334股,合计持有无限售流通股580,389,368股。					

4、控股股东或实际控制人变更情况

控股股东报告期内变更

□ 适用 √ 不适用

公司报告期控股股东(大股东)未发生变更。

实际控制人报告期内变更

□ 适用 √ 不适用

公司报告期实际控制人未发生变更。

5、公司优先股股东总数及前10名优先股股东持股情况表

□ 适用 √ 不适用

公司报告期无优先股股东持股情况。

6、公司债券情况

公司是否存在公开发行并在证券交易所上市,且在半年度报告批准报出日未到期或到期未能全额兑付的公司债券

是

三、经营情况讨论与分析

1、报告期经营情况简介

公司是否需要遵守特殊行业的披露要求

否

2018年5月初公司中票兑付违约,债务危机爆发,企业信用评级被下调,融资通道关闭,到期债务无力偿还,各方债权人维权诉求及诉讼接踵而至,凯迪生态及电厂银行账户被冻结,大部分电厂生产陷入停滞,持续经营存在风险;2019年上半年,公司生产经营仍然面临重大考验。

(一)2019年上半年经营情况概述

截至2019年6月底,公司发电装机达到185万千瓦,其中已投运生物质发电厂47家,已投运生物质机组的总装机容量1392MW。报告期内,公司发电量完成年累计14.35亿千瓦时;营业收入(合并)11.92亿元;营业成本(合并)21.88亿元;利润总额-9.78亿元;归属母公司净利润-9.75亿元。

(二)2019年上半年重点工作总结

1.重整工作。2019年5月21日,公司2018年度股东大会审议通过了《关于凯迪生态开展司法重整工作相关事宜的提案》。根据上述决议,公司正稳步推进相关工作。

2.生产恢复。债务危机爆发后,公司以推动电厂生产恢复为第一要务,积极展开与各电厂债权人、燃料供应方及地方政府等各方的沟通、协商,部分生物质电厂恢复生产、封闭运行。

2、涉及财务报告的相关事项

(1)与上一会计期间财务报告相比,会计政策、会计估计和核算方法发生变化的情况说明

□ 适用 √ 不适用

公司报告期无会计政策、会计估计和核算方法发生变化的情况。

(2)报告期内发生重大会计差错更正需追溯重述的情况说明

□ 适用 √ 不适用

公司报告期无重大会计差错更正需追溯重述的情况。

(3)与上一会计期间财务报告相比,合并报表范围发生变化的情况说明

□ 适用 √ 不适用

公司报告期无合并报表范围发生变化的情况。

证券代码:000939 证券简称:*ST凯迪 编号:2019-106

凯迪生态环境科技股份有限公司关于第九届董事会第十一次会议决议的公告

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

一、董事会会议召开情况

1、凯迪生态环境科技股份有限公司(以下简称"凯迪生态"或"公司")于2019年8月27日向全体董事发出了召开第九届董事会第十一次会议的通知。

2、会议于2019年8月30日以通讯表决形式召开。

3、会议应参加表决的董事8人,实际表决的董事8人。

4、本次会议由董事长陈义龙先生主持。

5、本次会议的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和公司章程的规定。

二、董事会会议表决情况

1、审议通过了《2019年半年度报告全文及摘要》

表决结果:同意5票,反对2票,弃权1票。

董事王海鸥投反对票,反对理由:1、因凯迪生态2017年、2018年审计报告均被会计师出具无法表示意见,2017年、2018年内部控制报告均被出具否定意见,本董事无法保证凯迪生态2019年半年报中经营情况、负债情况以及财务数据真实、准确、完整。

2、针对公司大股东及其他关联方资金占用问题,公司2019年半年度报告中包含"公司报告期不存在控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金"的表述,与深交所、湖北证监局的相关文件和公司前期公告不符。

董事王伟投弃权票,弃权理由:1.该报告基于2017年和2018年"无法表示意见"的审计报告数据编写,本人无法保证其内容真实、准确、完整;2.报告中:"4.关联债权债务往来"武汉金湖科技有限公司减资款是否存在非经营性资金占用,勾选为"否",与《湖北证监局关于对公司采取责令改正措施的决定》(【2018】30号)中认定为非经营性资金占用不符,报告存在误导性陈述。

独立董事须峰投反对票,反对理由:本人无法保证半年度报告内容的真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。主要理由包括:其一,本人无法判断公司仍以持续经营为基础编制财务报表的合理性,也不能认同在"第五节重要事项"之"六 董事会对上年度'非标准审计报告'相关情况的说明"中关于越南EPC项目结算差异、格薪源重大会计差错更正等事项的说明;其二,本人不能保证"关联债权债务往来"的真实、准确、完整,不能认同"公司报告期不存在控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金"的表述,并且认为中盈长江尚未完全履行业绩补偿的行为损害了中小股东权益;其三,因为2017年、2018年财务报表均被出具无法表示意见,2019 年半年度财务报表未经审计,本人无法保证财务报表的真实、准确、完整。

三、备查文件

经与会董事签字的董事会决议。

特此公告。

凯迪生态环境科技股份有限公司

董事会

2019年8月30日

凯迪生态环境科技股份有限公司独立董事关于大股东及其他关联方占用公司资金、公司对外担保情况的专项说明和独立意见

一、独立董事何威风的独立意见

根据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》,基于独立判断的立场,作为凯迪生态环境科技股份有限公司(下称"凯迪生态"或"公司")的独立董事,现就2019年半年报所涉大股东及其他关联方占用公司资金、公司对外担保情况发表独立意见如下:

根据中国证监会《关于规范上市公司与关联方资金往来及上市公司对外担保若干问题的通知(证监发[2003]56号)》、证监会、银监会《关于规范上市公司对外担保行为的通知(证监发[2005]120号)、证监会《关于执行证监发[2005]120号文有关问题的说明(上市部函[2006]25号)》以及《防范控股股东及关联方资金占用管理制度》等的规定,经与公司沟通、确认,本人认为公司编制的2019年半年度报告等相关材料能够表明大股东及其关联方的资金往来、债权债务关系等情况,公司无违规对外担保。

二、独立董事王学军的独立意见

根据《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《关于在上市公司建立独立董事制度的指导意见》、《深圳证券交易所股票上市规则》及《公司章程》,基于独立判断的立场,作为凯迪生态环境科技股份有限公司(下称"凯迪生态"或"公司")的独立董事,现就2019年半年报所涉大股东及其他关联方占用公司资金、公司对外担保情况发表独立意见如下:

根据中国证监会《关于规范上市公司与关联方资金往来及上市公司对外担保若干问题的通知(证监发[2003]56号)》、证监会、银监会《关于规范上市公司对外担保行为的通知(证监发[2005]120号)、证监会《关于执行证监发[2005]120号文有关问题的说明(上市部函[2006]25号)》以及《防范控股股东及关联方资金占用管理制度》等的规定,经与公司沟通、确认,本人认为公司编制的2019年半年度报告等相关材料能够表明大股东及其关联方的资金往来、债权债务关系等情况,公司无违规对外担保。

三、独立董事须峰的独立意见

根据中国证监会《关于规范上市公司与关联方资金往来及上市公司对外担保若干问题的通知(证监发[2003]56号)》、证监会、银监会《关于规范上市公司对外担保行为的通知(证监发[2005]120号)、证监会《关于执行证监发[2005]120号文有关问题的说明(上市部函[2006]25 号)》以及《防范控股股东及关联方资金占用管理制度》等的规定,本人作为凯迪生态环境科技股份有限公司(下称"凯迪生态"或"公司")的独立董事,针对公司大股东及其他关联方资金占用和公司对外担保情况,本人的独立意见如下:

针对公司大股东及其他关联方资金占用情况,本人不认同公司2019年半年报中"公司报告期不存在控股股东及其关联方对上市公司的非经营性占用资金"的表述,因为该表述与深圳交易所、湖北证监局的相关文件和公司的历史公告不符,并且《大股东及其他关联方资金占用情况的专项说明》(大华核字[2019]003904号)涉及的巨大的2018年偿还累计发生额未经董事会、股东大会批准,有销账嫌疑。

针对公司对外担保情况,因为公司2017年、2018年财务报表均被出具无法表示意见的审计报告,2017年、2018年均被出具否定意见的内部控制审计报告,2019年半年度财务报表和内部控制未经审计,本人无法判断公司对外担保情况的真实、准确、完整。

2019年8月30日