（上接 B34 版）

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 F 座 12B
法定代表人：曲馨月
联系人：周静华
传真：010-56176117
客服电话：400-100-3391
公司网址：www.bjdyfund.com
（114）天津万家财富资产管理有限公司
注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室
办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层
法定代表人：李修辞
联系人：王芳芳
电话：010-59013842
传真：021-38909635
客服电话：010-59013825
公司网址：http://www.wanjiawealth.com/
（115）中原银行股份有限公司
注册地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座
办公地址：河南省郑州市郑东新区 CBD 商务外环路 23 号中科金座
法定代表人：窦荣兴
联系人：赵栋一
电话：0371-85519823
传真：0371-85519869
客服电话：95186
公司网址：www.zybank.com.cn
（116）天津市凤凰财富基金销售有限公司
注册地址：天津生态城动漫中路 126 号动漫大厦 C 区 209（TG 第 123 号）
办公地址：天津市和平区南京路 181 号世纪都会 1606-1607
法定代表人：王正宇
联系人：杨雪研
电话：022-23297867
传真：022-23297867
客服电话：4007-066-880
公司网址：http://www.phoenix-capital.com.cn/
（117）上海爱建财富管理有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号 1806-13 室
办公地址：上海市肇嘉浜路 746 号爱建金融大厦 102 室
法定代表人：马金
联系人：蔡俊
电话：021-64382399
传真：64388012
客服电话：021-64393653
公司网址：www.ajcf.com.cn
（118）有鱼基金销售有限公司
注册地址：上海自由贸易试验区浦东大道 2123 号 3 层 3E-2655 室
办公地址：上海市徐汇区桂平路 391 号 A 座五层
法定代表人：林琼
联系人：徐海峥
电话：021-64389188
传真：021-64389188-102
客服电话：021-60907378
公司网址：www.youyufund.com
（119）北京恒宇天泽基金销售有限公司
注册地址：北京市延庆区延庆经济开发区百泉街 10 号 2 栋 883 室
办公地址：北京市东城区东滨河路乙 1 号航星园 8 号楼 9 层
法定代表人：梁越
联系人：王东
传真：010-56081694
客服电话：400-188-8848
公司网址：www.1314fund.com
（120）扬州国信嘉利基金销售有限公司
注册地址：江苏省扬州市广陵新城信息产业基地 3 期 20B 栋
办公地址：江苏省扬州市邗江区文昌西路 56 号公元国际大厦 320
法定代表人：刘晓光
联系人：苏曦
电话：0514-82099618
传真：021-68811007
客服电话：400-021-6088
公司网站：http://www.gxjlcn.com
（121）联储证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼
办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦 9 楼
法定代表人：吕春卫
联系人：丁倩云
电话：010-86499427
客服电话：400-620-6868
公司网站：www.lczq.com
（122）南京途牛基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号
办公地址：南京市玄武区玄武大道 699-1 号
法定代表人：宋时琳
联系人：张士帅
电话：025-86853969
传真：025-86853999
客服电话：4007-999-999 转 3
公司网站：http://jr.tuniu.com/
（123）深圳盈信基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦 8 楼 A-1
办公地址：辽宁省大连市中山区南山路 155 号南山 1910 小区 A3-1
法定代表人：苗宏升
联系人：葛俏俏
电话：0411-66889809
传真：0411-66889827
客服电话：4007-903-688
公司网站：www.fundying.com
（124）沈阳麟龙投资顾问有限公司
注册地址：辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街 18-2 号 B 座 601
办公地址：上海市青云路 158 号城建大厦 5 楼
法定代表人：朱荣晖
联系人：钱金菊
电话：021-5109-1679
传真：021-51091674
客服电话：024-62836088
公司网址：www.linlongtougu.com
（125）济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307
办公地址：北京市朝阳区太阳宫中路 16 号院 1 号楼 3 层 307
法定代表人：杨健
联系人：李海燕
电话：010-65309516
传真：010-65330699
客服电话：400-673-7010
公司网站：www.jianfortune.com
（126）江海证券有限公司
注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人：赵洪波
联系人：姜志伟
客服电话：400-666-2288
公司网站：www.jhzq.com.cn
（127）中山证券有限责任公司
注册地址：深圳南山区科技中一路华强高新发展大厦 7-8 楼
办公地址：深圳南山区科技中一路华强高新发展大厦 7-8 楼
法定代表人：黄扬录
联系人：罗艺琳
电话：0755-82570586
客服电话：95329
公司网站：http://www.zszq.com/

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构
名称：财通基金管理有限公司
住所：上海市虹口区吴淞路 619 号 505 室
办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 41 楼
法定代表人：刘未
电话：021-2053 7888
联系人：薛程
（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
法定代表人：韩炯
电话：021-3135 8666
传真：021-3135 8600
联系人：黎明
经办律师：吕红、黎明
（四）审计基金财产的会计师事务所
名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
执行事务合伙人：吴港平
住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼（东三办公楼）16 层
办公地址：上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
公司电话：（021）2228 8888
公司传真：（021）2228 0000
签章会计师：蒋燕华、蔡玉芝
业务联系人：蒋燕华

四、基金名称

财通价值动量混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型开放式证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金以价值投资为基础，辅以对市场运行规律的研判，动态调整投资组合，在严格控制风险并充分保证流动性的前提下，力求获取超越业绩比较基准的投资收益率。

七、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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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未来允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

股票资产占基金资产的 30%—80%，其中投资于价值公司股票池内的个股不少于股票资产的 80%；债券、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 0%—65%，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券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。

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。

八、投资策略

1、资产配置策略

本基金的资产配置策略分为两个层面：其一，评估不同投资品种的整体投资价值以进行战略资产配置；其二，依据动量特征进行战术资产配置。

（1）战略资产配置

本基金的战略资产配置分为两个步骤：首先，基于宏观经济的长期基本面研究，对各市场投资品种进行长期合理价值的评估；再将其与当前各市场的实际价格水平比较，评估各资产类别的相对投资价值，据此确定各资产类别的基准配置比例。

1）股票的长期合理价值评估

在对宏观经济长期基本面的深入研究基础上，对上市公司整体进行估值分析。估值将以绝对估值方法为主，如现金流贴现模型、股利贴现模型等，对股票市场进行整体的量化绝对估值；在绝对估值的基础上，将以市盈率、市净率等多种相对估值方法为辅，共同构成股票市场整体的价值评估体系。

2）债券的长期合理价值评估

本基金将以中长期国债收益率为债券市场基准，对债券市场整体价值进行评估。根据全球债券市场的历史发展经验，中长期国债的收益率中枢与中长期通胀率基本持平，因此对中长期通胀率的分析结果是本基金对债券市场的长期合理价值进行评估的首要依据。

除了长期通胀率这一决定因素外，宏观经济状态、金融机构经营结构变化、国际资本流动等因素将对债券的中长期收益率水平形成一定程度的影响，本基金将根据这些影响因素的变化对债券估值进行适度修正。

3）战略资产配置

在对中长期宏观经济基本面进行深入研究的基础上，本基金对股票市场与债券市场各自的长期合理价值进行评估，再将其与当前实际价格水平进行对比，以各大类资产的相对投资价值为依据，同时结合本基金的业绩比较基准，确定下一阶段基金组合中股票、债券以及货币市场工具三大资产类别的基准配置比例。

（2）战术资产配置

在确定的基准配置比例基础上，本基金将根据市场中短期的动量特征，对各资产类别的配置比例进行适度的动态调整。

本基金将动量特征划分为市场价格动量特征和基本面动量特征两个类别。针对市场价格动量，本基金将密切跟踪反应市场价格趋势及趋势稳定性的指标，包括股票市场整体的阶段累计收益率、换手率、市场交易活跃度、波动率等，作为对股票市场中短期运行趋势的判断依据。针对基本面动量，本基金将直接通过对宏观经济指标的变动趋势和政策面因素分析，考察宏观经济周期变化。

依据投资时钟理论，本基金对各资产类别进行战术调整时一般遵循如下规则：

经济周期阶段	经济表现	资产类别战术调整规则
衰退阶段	经济增长停滞，国家以宽松的货币政策刺激经济	降低股票资产配置，增加债券资产配置
复苏阶段	企业利润大幅上升，通胀率下降	增加股票资产配置，减少现金配置
过热阶段	通胀上升，国家开始实施紧缩货币政策	降低债券资产配置，适度增加现金配置
滞胀阶段	实际经济增长率小于潜在增长率，通胀继续上升	增加现金配置，减少股票和债券配置

2、股票投资策略

本基金股票投资策略充分贯彻“价值投资为基础，动量策略为辅助”的投资理念，分别在行业配置和个股精选两个层面进行基本面情况、估值以及动量效应的研究，挖掘出具有估值优势和动量效应的个股并构建股票投资组合。

(1)行业配置策略

本基金的行业配置分为两个层面：以对各行业长期价值水平判断为依据确定行业配置基准；在行业配置基准基础上，以行业动量特征对行业配置进行动态调整以增强行业配置收益。

1）行业配置基准

本基金制定行业配置基准的主要依据是对各行业长期投资价值的判断。本基金将主要以社会、经济、政治等大环境和行业自身长期竞争力作为行业估值的基础，在此基础上对各行业进行估值，并且根据不同宏观经济周期下的市场估值偏误确定行业配置基准。

I. 行业长期价值判断的基础

首先，社会、经济及政治等跨宏观经济周期因素是分析行业长期价值最重要的背景。本基金将从多个角度进行深入研究，辨别国内外发展历史的异同，同时结合产业链、竞争格局等长期产业分析方法，对产业的长期发展路径及价值中枢做出前瞻性判断。

其次，产业链及行业竞争力是评判行业长期价值的重要因素。

本基金认为，产业链充分揭示了行业间的供需及价格传导关系，对于产业链的研究将适用于分析龙头产业需求对上下游、互补品以及替代品的影响；也可以用于计算要素价格及税收变化对下游的成本冲击、价格传导等。

行业竞争力在很大程度上决定了一个行业的定价能力，这种定价能力跨越宏观周期，对行业长期价值产生影响。通过全面分析影响定价能力的产业相对集中度、产品创新能力、生产效率、替代品获取度、产品差异化等因素，可以判断行业能否在要素价格普遍上涨、资源税征收环境中很好转嫁成本，也可以提前发现生命周期处于快速成长阶段的行业（尤其是新兴产业）是否将面临因竞争者进入而导致毛利迅速下降的风险。

II. 行业估值

本基金将以上行业价值判断的定性分析结果转化为量化预期指标，融入到具体的行业估值过程中。对各行业的估值方法将以绝对估值方法为主，以市盈率、市净率等多种相对估值方法为辅，并对具有特殊属性的行业使用特定估值方法，共同构成行业评估体系。

2）基于动量的行业配置优化

在行业配置层面，动量策略将作为价值投资的有效补充。本基金将在行业配置基准的基础上，以行业动量特征对行业配置进行动态调整以增强行业配置收益。行业层面的动量特征有两类，即宏观经济周期动量特征和市场价格动量特征。

I. 宏观经济周期动量

在宏观经济周期的不同阶段，行业间的市场估值水平显示出巨大的差异性，以反映经济周期对各行业景气状况的不同影响程度和方式。本基金将前瞻性预判宏观经济周期趋势，力求挖掘市场估值偏误行业。

II. 市场价格动量

本基金将综合分析反映各行业的市场价格动量特征，分析指标包括各行业的阶段累计收益率、换手率、市场交易活跃度、波动率，以分析行业间在市场价格趋势、趋势的稳定性以及流动性方面的相对强弱，继而在行业配置基准的基础上对各行业的配置进行动态调整。

(2)个股精选策略

本基金将主要在前述遴选出的重点行业内进行个股精选，个股精选策略结合长期投资价值挖掘与中短期动量效应追踪：首先，通过实地调研等方式进行广泛和深入的研究，以确定具有长期投资价值的公司，形成价值股票池；在该股票池中，进一步挑选具备估值优势和中短期动量特征显著的个股。

1）价值股票池的构建

基金管理人将挖掘具有长期投资价值的上市公司股票构建价值股票池。上市公司价值判断将将以定量分析为基础，辅以定性分析进行研判。

I. 定量分析

上市公司价值判断的定量分析以估值为核心，同时兼顾上市公司的盈利能力和成长性。定量分析的维度包括上市公司的绝对估值、相对估值和成长性。

①绝对估值

基金管理人将定期或不定期对各行业内的重点上市公司进行绝对估值分析。绝对估值将采用现金流贴现模型、股利贴现模型等不同方法，对上市公司的长期合理价值进行评估，并选择评估时间点上市场价格没有显著高于长期合理价值的上市公司进入价值股票池。

②相对估值

对上市公司相对估值分析以市盈率为核心指标，以行业为可比范畴，重点选择静态市盈率或研究员预测的动态市盈率处于所在行业内较低的 50%范围的上市公司

③成长性

对上市公司成长性的评估以未来三年净利润增长率为核心指标，重点选择未来三年预测净利润年复合增长率高于其所在行业过去三年平均年复合增长率的上市公司。

本基金将初选出满足以上定量分析任一维度要求的个股，进行后续的定性分析。

II. 定性分析

针对以上初选出的个股，本基金将辅以定性分析，对上市公司核心竞争力、管理能力和治理结构进行评估。

①公司的核心竞争力

公司核心竞争力将主要分析规模、品牌、创新能力、特许资源、知识产权、专有技术、公司治理制度、成本控制手段、市场资源获取及整合能力等方面。同时，本基金还将重点关注公司的中长期持续增长能力或阶段性高速增长的能力。

②公司的管理能力和治理结构

考察公司是否具有优秀的公司管理层和良好的公司治理结构。本基金认为优秀的公司管理层能率领公司不断制定和调整发展战略，以保证企业资源的最佳配置和自身优势的充分发挥；同时良好的治理结构能促使公司管理层诚信尽职，重视股东利益并使得管理水平能充分适应企业经营规模的不断扩大。

作为定量分析的有效补充，定性分析将对定量分析初选出的个股执行“再筛选”，并形成最终的价值股票池。本基金管理人将定期或不定期对价值股票池进行动态调整。

2)动量特征跟踪

基金管理人将采用量化分析方法，对价值股票池中每只个股的动量特征进行跟踪和综合评估。对于价值股票池内个股的动量效应评估将在每季度定期或不定期进行。

本基金将重点配置于上述具有估值优势且动量效应显著的个股，并依据业绩比较基准中股票指数的行业权重，构建并动态调整股票投资组合。

3、固定收益证券投资策略

在固定收益证券组合的具体构造和调整上，本基金综合运用久期管理策略、收益率曲线策略、类属配置策略、套利和时机选择策略等组合管理手段进行日常管理。

（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。当预测利率上升时，适当缩短投资组合的目标久期，预测利率水平降低时，适当延长投资组合的目标久期。

（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。通过合理期限安排，在长期、中期和短期债券间进行动态调整，在保持组合一定流动性的同时，可以从长、中、短期债券的价格变化中获利。

（3）类属配置策略主要指债券资产在国债、金融债、央票、企业债、可转债等不同类属债券之间的配置。本基金通过对各类券种收益率曲线走势的分析和预测，对收益率曲线各种可能的变动情形进行持有期收益率压力测试，在此基础上选择既能匹配目标久期、同时又能获得最高持有期收益的类属债券配置比例。

（4）个券选择策略

本基金将积极参与国债、金融债、央行票据一级市场投标，增加盈利空间。在个券选择上加强单个债券的定价和收益率分析，通过在我国债券市场上寻找短期内定价错误的债券，进行有效的投资获取较高收益。借助金融工程技术，研究市场期限结构和债券定价模型，选择价格被低估的债券品种，获得超额收益。

（5）套利和时机选择策略

套利策略主要包括跨市场套利策略和跨品种套利策略等。跨市场套利策略是指由于不同市场上债券价格存在差异，根据债券在各市场上的流动性和收益特征，进行跨市场操作而套利；跨品种套利策略是指根据各细分市场中不同品种的风险参数、流动性补偿和收益特征，进行跨品种操作而套利。

时机选择策略主要包括骑乘策略和息差策略等。骑乘策略是指当收益率曲线比较陡峭时，即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。息差策略是指利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

（6）可转债投资策略

本基金采用期权定价模型等数量化估值工具，选择基础证券基本面优良的可转换债券，评定其投资价值并以合理价格买入并持有，充分享受股票的长期增长潜力和债券的安全收入优势。本基金持有的可转换债券可以转换为股票。

（7）资产支持证券投资策略

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。采用数量化的定价模型来跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。

4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资。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，结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标，选择权证的买入和卖出时机，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 × 60% + 上证国债指数收益率 × 40%

本基金选择该业绩基准，是基于以下因素：

(1)沪深 300 指数和上证国债指数编制方法合理、透明；

(2)沪深 300 指数和上证国债指数编制和发布有一定的历史，有较高的知名度和市场影响力；

(3)具有市场覆盖率，不易被操纵；

(4)本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。

沪深 300 指数由中证指数有限公司编制和计算。中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。关于指数值和成分股名单的所有知识产权归属中证指数有限公司。

上证国债指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上证指数的所有权归属上海证券交易所。

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基准的股票指数时，本基金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，而无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高预期收益的基金产品。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计，本投资组合报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日。

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	471,884,261.87	77.57
	其中：股票	471,884,261.87	77.57
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	135,734,686.76	22.31
8	其他资产	731,527.28	0.12
9	合计	608,350,475.91	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	308,445,691.97	50.97
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	163,438,569.90	27.01
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	471,884,261.87	77.98

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通过港股通机制投资的港股。

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	600845	宝信软件	1,987,935	48,724,286.85	8.05
2	002025	航天电器	1,235,044	33,815,504.72	5.59
3	002179	中航光电	759,100	33,400,400.00	5.52
4	300036	超图软件	1,382,500	30,622,375.00	5.06
5	300451	创业软件	1,720,320	30,191,616.00	4.99
6	002463	沪电股份	4,528,203	29,206,909.35	4.83
7	000063	中兴通讯	1,589,984	29,096,707.20	4.81
8	300394	天孚通信	1,445,784	28,987,969.20	4.79
9	000977	浪潮信息	1,185,070	28,536,485.60	4.72
10	002281	光迅科技	868,500	23,180,265.00	3.83

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合约。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金暂不投资股指期货。

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

本基金暂不投资国债期货。

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合约。

10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

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 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的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	677,779.91
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,610.54
5	应收申购款	27,136.83
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	731,527.28

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

11.6 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，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

本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）基金净值表现

本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

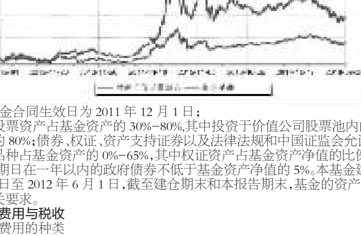
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2011年 12 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	0.00%	0.12%	-4.04%	0.74%	4.04%	-0.62%
2012年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	7.71%	0.98%	6.36%	0.77%	1.35%	0.21%
2013年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	4.24%	0.93%	-3.08%	0.84%	7.32%	0.09%
2014年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日	33.24%	0.99%	31.20%	0.73%	2.04%	0.26%
2015年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	69.89%	2.74%	7.74%	1.49%	62.15%	1.25%
2016年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-19.31%	1.57%	-5.13%	0.84%	-14.18%	0.73%
2017年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	15.76%	0.83%	9.59%	0.36%	6.17%	0.47%
2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	-15.60%	1.31%	-6.72%	0.69%	-8.88%	0.62%
2018年 7 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日	-5.24%	1.45%	-0.75%	0.82%	-4.49%	0.63%
2011年 12 月 1 日至 2018 年 9 月 30 日	91.27%	1.48%	38.76%	0.89%	52.51%	0.59%

注：(1)上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要低于所列数字；

(2)本基金选择沪深 300 指数作为股票投资部分的业绩基准，选择上证国债指数作为债券投资部分的业绩基准，复合业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 × 60%＋上证国债指数收益率 × 40%。

（二）自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通价值动量混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2011 年 12 月 1 日 -2018 年 9 月 30 日）



注：(1)本基金合同生效日为 2011 年 12 月 1 日；

(2)本基金股票资产占基金资产的 30%-80%，其中投资于价值公司股票池内的个股不少于股票资产的 80%；债券、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 0%-65%，其中权证资产占基金资产净值的比例为 0%-3%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期是 2011 年 12 月 1 日至 2012 年 6 月 1 日，截至建仓期末和本报告期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

十三、基金费用与税收

（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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
5、基金份额持有人大会费用；
6、基金的证券交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（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 1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 1.5\% \div$ 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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 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、公休假等，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 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% \div$ 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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述一、基金费用的种类中第 3—7 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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（五）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

1、“重要提示”部分
（1）更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现截止日。
2、“三、基金管理人”部分
（1）更新了主要人员情况。
3、“四、基金托管人”部分
（1）更新了主要人员情况；
（2）更新了基金托管业务经营情况；
（3）更新了基金托管人的内部控制制度。
4、“五、相关服务机构”部分
（1）更新了代销机构方面信息。
5、“八、基金份额的申购与赎回”部分
（1）更新了申购费用和赎回费用。
6、“九、基金的投资”部分
（1）更新了基金投资组合报告，报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日。
7、“十、基金的业绩”部分
（1）更新了基金的业绩。
10、“二十二、其他应披露事项”部分
（1）更新了 2018 年 6 月 23 日至 2018 年 12 月 7 日期间涉及本基金的相关公告。

财通基金管理有限公司
二〇一九年一月十二日

证券代码：300666　证券简称：江丰电子　公告编号：2019-004

宁波江丰电子材料股份有限公司
关于股东和董事减持股份的预披露公告

公司股东、董事张辉阳先生和股东上海智鼎博能投资合伙企业（有限合伙）、上海智兴博辉投资合伙企业（有限合伙）保证向本公司提供的信息内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司及董事会全体成员保证公告内容与信息披露义务人提供的信息一致。

特别提示：

持本公司股份 6,131,472 股（占公司总股本比例 2.80%）的股东张辉阳先生、持本公司股份 18,227,072 股（占公司总股本比例 8.33%）的股东上海智鼎博能投资合伙企业（有限合伙）和持本公司股份 5,629,678 股（占公司总股本比例 2.57%）的股东上海智兴博辉投资合伙企业（有限合伙）拟自本公告披露之日起以大宗交易及集中竞价方式分别减持本公司股份不超过 1,532,860 股（占公司总股本比例 0.70%）、4,556,760 股（占公司总股本比例 2.08%）和 1,407,410 股（占公司总股本比例 0.64%），合计减持本公司股份不超过 7,497,030 股（占公司总股本比例 3.43%）。其中通过大宗交易方式减持的，将于本公告披露之日起 3 个交易日后进行，且任意连续 90 个自然日内通过大宗交易减持股份的总数，不超过公司股份总数的 2%；通过集中竞价交易方式进行减持的，将于本公告披露之日起 15 个交易日之后进行，且任意连续 90 个自然日内通过交易所集中竞价交易减持股份的总数，不超过公司股份总数的 1%。

宁波江丰电子材料股份有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）于近日分别收到股东张辉阳先生、上海智鼎博能投资合伙企业（有限合伙）（以下简称“智鼎博能”）和上海智兴博辉投资合伙企业（有限合伙）（以下简称“智兴博辉”）的《关于减持江丰电子股份计划的告知函》。根据《深圳证券交易所创业板上市公司规范运作指引》、《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》、《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等有关规定，现将有关情况公告如下：

一、减持股东的基本情况

股东名称	持股数量(股)	占公司总股本比例	备注
张辉阳	6,131,472	2.80%	张辉阳先生系公司董事
智鼎博能	18,227,072	8.33%	智鼎博能实际控制人为张辉阳先生
智兴博辉	5,629,678	2.57%	智兴博辉实际控制人为张辉阳先生

二、本次减持计划的主要内容

（一）本次减持计划相关内容

1、减持原因：自身资金需求。

2、股份来源：公司首次公开发行前已发行的股份。

3、减持数量及比例：上述股东本次拟减持股份合计不超过 7,497,030 股，占公司总股本比例 3.43%。其中，通过集中竞价方式减持的，连续 90 个自然日不超过公司总股本的 1%；通过大宗交易方式减持的，连续 90 个自然日不超过公司总股本的 2%。

上述股东的具体减持计划如下：

股东名称	拟减持股份数量(股)	拟减持数量占公司总股本比例	拟减持股数占该股东总持股比例
张辉阳	1,532,860	0.70%	25.00%
智鼎博能	4,556,760	2.08%	25.00%
智兴博辉	1,407,410	0.64%	25.00%
合计	7,497,030	3.43%	-

注：本公告若出现合计数与各分项数据之和尾数不符的，均为四舍五入原因所致。

4、减持方式：集中竞价交易及大宗交易方式。

5、减持期间：拟自本公告披露之日起 3 个交易日后 6 个月内（根据法律法规禁止减持的期间除外），其中：通过大宗交易方式减持的，将于本公告披露之日起 3 个交易日后进行；通过集中竞价交易方式进行减持的，将于本公告披露之日起 15 个交易日之后进行。

6、减持价格：根据减持时的市场价格及交易方式确定。

（二）股东承诺与履行情况

上述股东在公司《首次公开发行股票并在创业板上市招股说明书》和《首次公开发行股票并在创业板上市之上市公告书》中，所做的承诺及其履行情况如下：

1、公司股东智鼎博能、智兴博辉、张辉阳承诺如下：

（1）自公司股份上市之日起 12 个月内，本企业 / 本人不转让或者委托他人管理本机构 / 本人所直接或间接持有的公司本次发行前已发行的股份，也不由公司回购本机构 / 本人直接或者间接持有的公司本次发行前已发行的股份。

（2）本机构 / 本人直接、间接持有的本次发行前已发行的公司股份在承诺的锁定期满后减持的，将提前五个交易日向公司提交减持原因、减持数量、未来减持计划、减持对公司治理结构及持续经营影响的说明，并由公司在减持前三个交易日予以公告。

（3）本机构 / 本人在上述锁定期满后两年内减持本企业直接、间接持有的公司股份合计不超过本企业在公司首次公开上市之日持股数量的 100%，且减持价格不低于本次发行的发行价，如自公司首次公开发行股票至上述减持公告之日公司发生过派息、送股、资本公积转增股本等除权除息事项的，发行价格和减持数量应相应调整。

（4）上述锁定期届满后，在满足以下条件的前提下，方可进行减持：①上述锁定期届满且没有延长锁定期的相关情形，如有锁定延长期，则顺延；②如发生需向投资者进行赔偿的情形，本企业 / 本人已经承担赔偿责任。

（5）本企业 / 本人减持公司股票时，将依照《公司法》、《证券法》、中国证监会和深交所的相关规定执行。

2、除上述承诺外，公司董事张辉阳先生还承诺：

（1）公司上市后 6 个月内如公司股票连续 20 个交易日的收盘价均低于本次发行的发行价，或者上市后 6 个月期末收盘价低于本次发行的发行价，本人持有的公司股票将在上述锁定期限届满后自动延长 6 个月的锁定期（若上述期间公司发生派发股利、送红股、转增股本或配股等除息、除权行为的，则发行价以经除息、除权等因素调整后的价格计算）；所持公司股票在锁定期满后两年内减持的，减持价格不低于发行价；在延长锁定期内，不转让或者委托他人管理本人直接或者间接持有的公司公开发行股票前已发行的股份，也不由公司回购本人直接或者间接持有的公司公开发行股票前已发行的股份。

（2）在本人于公司担任董事期间，每年转让的股份不超过本人直接和间接持有的公司股份总数的 25%；离职后半年内，不转让本人直接和间接持有的公司股份。

（3）本人不因职务变更、离职等原因，而放弃履行上述承诺。

截至本公告披露之日，张辉阳先生、智鼎博能和智兴博辉均严格履行了上述承诺，未出现违反上述承诺的行为。

三、相关风险提示

1、在按照上述计划减持公司股份期间，张辉阳先生、智鼎博能和智兴博辉将严格遵守《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《深圳证券交易所创业板上市公司规范运作指引》、《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》、《深圳证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》等相关规定，并依据计划进展情况及时履行相关信息披露义务。

2、张辉阳先生、智鼎博能和智兴博辉将根据市场环境、公司股价情况等情形决定是否实施本次股份减持计划。本次减持计划存在减持时间、数量、价格的不确定性，也存在是否按期实施完成的不确定性。

3、张辉阳先生、智鼎博能和智兴博辉均不属于公司控股股东或实际控制人，本次减持不会导致上市公司控制权发生变更，不会对公司治理结构及持续经营产生影响。

四、备查文件

1、张辉阳先生出具的《关于减持江丰电子股份计划的告知函》；

2、上海智鼎博能投资合伙企业（有限合伙）出具的《关于减持江丰电子股份计划的告知函》；

3、上海智兴博辉投资合伙企业（有限合伙）出具的《关于减持江丰电子股份计划的告知函》。

特此公告。

宁波江丰电子材料股份有限公司董事会
2019 年 1 月 11 日

证券代码：603006　证券简称：联明股份　公告编号：2019-003

上海联明机械股份有限公司
关于控股股东部分股权解除质押及再质押的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容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。

上海联明机械股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 1 月 10 日收到控股股东上海联明投资集团有限公司（以下简称“联明集团”）关于部分股权解除质押及再质押的通知，具体情况如下：

一、部分股份解除质押具体情况

2017 年 12 月 18 日，联明集团将其持有的公司 9,350,000 股有限售条件流通股质押给南京银行股份有限公司上海分行（以下简称“南京银行上海分行”），以为其融资提供股权质押担保；其后分别于 2018 年 7 月 6 日和 2018 年 10 月 22 日补充质押了公司 3,300,000 股有限售条件流通股和公司 3,350,000 股有限售条件流通股，前述三次质押共计 16,000,000 股有限售条件流通股。

2019 年 1 月 9 日，联明集团解除了部分质押给南京银行上海分行的公司 9,350,000 股有限售条件流通股，剩余仍有 6,650,000 股有限售条件流通股质押给南京银行上海分行。

2019 年 1 月 10 日，联明集团解除了上述剩余质押给南京银行上海分行的公司 6,650,000 股有限售条件流通股（占公司总股本的 3.46%），并在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了股权质押登记解除手续。

联明集团本次质押解除后，累计质押本公司股份 66,080,000 股，占其持有公司股份总数的 57.67%，占公司总股本的 34.36%。

二、股份再次质押具体情况

2019 年 1 月 10 日，联明集团将其持有的公司 25,600,000 股有限售条件流通股（占公司总股本的 13.31%）质押给南京银行上海分行，质押期限为 2018 年 12 月 19 日至 2021 年 12 月 19 日，并于 2019 年 1 月 10 日在中国证券登记结算有限责任公司办理了股权质押登记。

截至本公告日，联明集团持有公司股份 114,589,588 股（其中 84,000,000 股为限售流通股），占公司总股本的 59.58%。联明集团本次质押后，累计质押本公司股份 91,680,000 股，占其持有公司股份总数的 80.01%，占公司总股本的 47.67%。

三、股份质押情况说明

联明集团本次股权质押主要为联明集团融资提供股权质押担保，还款来源包括但不限于联明集团的营业收入、营业利润、投资收益等，联明集团具备资金偿还能力，由此产生的质押风险在可控范围之内，不会导致公司实际控制权发生变更。根据质押合同，本次质押设置预警线和平仓线，若公司股价下跌，触发预警线或平仓线时，联明集团将采取包括但不限于提前还款、追加股票质押等措施应对上述风险。

特此公告。

上海联明机械股份有限公司
董事会
二〇一九年一月十一日

证券代码：300733　证券简称：西菱动力　公告编号：2019-004

成都西菱动力科技股份有限公司
持股 5%以上股东减持股份预披露公告

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。

特别提示：

持本公司股份 8,402,240 股（占本公司总股本比例 5.25%）的股东万丰锦源控股集团有限公司（简称“万丰锦源”）计划减持本公司股份 8,402,240 股（占本公司总股本比例 5.25%）：通过集中竞价方式减持，将于本减持计划公告之日起 15 个交易日之后的 6 个月内进行；通过大宗交易方式减持，将于本减持计划公告之日起 3 个交易日后进行。

近日，公司收到公司股东万丰锦源的《关于股份减持计划的告知函》，具体情况如下：

一、股东的基本情况

1、股东的名称：万丰锦源

2、股东持有股份的总数量、占公司总股本的比例：截止本公告日，万丰锦源持有公司股票 8,402,240 股，占公司总股本比例 5.25%。

二、本次减持计划的主要内容

1、本次拟减持的原因：万丰锦源战略发展需要

2、股份来源：首次公开发行前股份

3、减持方式：集中竞价或大宗交易方式

4、减持数量、占公司总股本的比例：8,402,240 股，占本公司总股本比例 5.25%。通过集中竞价方式减持，任意连续 90 个自然日内不超过公司股份总数的 1%；通过大宗交易方式减持，任意连续 90 个自然日内不超过公司股份总数的 2%。

5、减持期间：通过集中竞价方式减持，将于本减持计划公告之日起 15 个交易日之后的 6 个月内进行；通过大宗交易方式减持，将于本减持计划公告之日起 3 个交易日后进行。

6、价格区间：根据减持时的二级市场价格及交易方式确定，减持价格不低于发行价。

三、本次拟减持事项是否与相关股东此前已披露的意向、承诺一致

万丰锦源在《首次公开发行股票并在创业板上市招股说明书》及《首次公开发行股票并在创业板上市上市公告书》中承诺：

自公司股票上市之日起十二个月内，不转让或者委托他人管理本企业直接或间接持有的公司股份，也不由公司回购本企业持有的公司股份；本公司在《关于股票锁定的承诺》中承诺的锁定期满后，本公司若拟减持所持公司的股份，在符合相关规定及承诺的前提下，本公司将综合考虑二级市场的股价表现，实施减持行为。本公司减持时，减持行为将通过集中竞价、大宗交易及协议转让等法律法规、交易所规定的合法方式进行。本公司所持股票在锁定期满后，本公司将通过证券交易所集中竞价交易、大宗交易等法律法规允许的方式按照届时的市场价格或大宗交易确定的价格进行减持。本公司所持股票在锁定期满后一年内的减持数量不超过上市前所持股份数量的 100%。公司上市后，本公司在减持时将提前三个交易日履行公告义务。

截止本公告日，万丰锦源履行了上述承诺，不存在违反上述承诺的情形。

四、相关风险提示

（一）万丰锦源将根据市场以不低于发行价的价格进行减持，公司将按规定对万丰锦源减持计划的实施进展情况进行披露。

（二）万丰锦源不属于公司控股股东、实际控制人，减持后将不会导致公司控制权发生变更。

五、备查文件

1、《万丰锦源控股集团有限公司关于股份减持计划的告知函》。

特此公告。

成都西菱动力科技股份有限公司
董事会
2019年1月11日

证券代码：002879　证券简称：长缆科技　公告编号：2019-005

长缆电工科技股份有限公司
关于使用闲置自有资金进行现金管理的进展公告

本公司及全体董事会成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

长缆电工科技股份有限公司（以下简称“公司”）于 2018 年 6 月 28 日召开第三届董事会第四次会议、第三届监事会第四次会议以及于 2018 年 7 月 16 日召开的 2018 年第一次临时股东大会审议通过了《关于使用闲置自有资金进行现金管理的议案》，同意使用不超过 18,000 万元人民币的闲置自有资金进行现金管理，用于购买发行主体是商业银行的安全性高、满足保本要求、产品发行主体能够提供保本承诺以及流动性好的低风险理财产品，上述额度自公司股东大会审议通过之日起 12 个月内可循环滚动使用。《关于使用闲置自有资金进行现金管理的公告》已于 2018 年 6 月 29 日刊登在《证券时报》、《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》及巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）上。

根据以上决议，公司于近日与广发银行股份有限公司长沙高科支行签订了《广发银行“薪加薪 16 号”人民币结构性存款合同》（网上银行签订电子版合同），决定使用闲置自有资金 8,600 万元办理结构性存款产品业务，具体情况如下：

一、本次购买保本型理财产品的基本情况
1、产品名称：广发银行“薪加薪 16 号”人民币结构性存款
2、产品编号：XJXCKJ5430
3、产品类型：保本浮动收益型
4、启动日：2019 年 01 月 08 日
5、到期日：2019 年 04 月 08 日
6、预期最高年化收益率：2.60%或 4.44%
7、投资金额：8,600 万
8、资金来源：闲置自有资金

二、关联关系说明

公司与广发银行股份有限公司长沙高科支行不存在关联关系。

三、需履行的审批程序

《关于使用闲置自有资金进行现金管理的议案》已经由公司第三届董事会第四次会议、第三届监事会第四次会议以及 2018 年第一次临时股东大会审议通过。

本次现金管理的额度均在审批额度内，无需提交董事会或股东大会审议。

四、风险及控制措施

1、投资风险

（1）现金管理产品主要受货币政策、财政政策等宏观政策及相关法律法规政策发生变化的影响，存有一定的系统性风险。

（2）相关工作人员的操作风险。

2、针对投资风险，公司将采取以下措施控制风险：

（1）公司将严格遵守审慎投资原则，严格筛选投资对象，选择安全性高、流动性好的理财产品进行投资。

（2）公司将实时分析和跟踪产品的净值变动情况，如评估发现存在可能影响公司资金安全的风险因素，将及时采取相应措施，控制投资风险。

（3）公司审计部负责审计、监督理财产品的资金使用与保管情况，定期对所有理财产品项目进行全面检查，并根据谨慎性原则，合理地预计各项投资可能发生的收益和损失。

（4）董事会应当对投资理财资金使用情况进行监督，公司独立董事、监事会有权对资金使用情况进行监督与检查，必要时可以聘请专业机构进行审计。

（5）公司将根据深圳证券交易所的有关规定，及时履行信息披露义务。

五、对公司经营的影响

在保证公司正常经营资金需求和资金安全的前提下，合理利用部分闲置自有资金进行现金管理，不会影响公司日常经营资金需求及主营业务的正常开展，有利于提高公司的资金使用效率，为公司及股东谋取更多的投资回报。

六、公告日前十二个月内公司使用闲置自有资金购买理财产品的情况

（一）使用闲置自有资金进行现金管理的收益情况

截至本公告日，公司在过去十二个月内使用闲置自有资金购买银行理财产品，累计收益为 3,406,582.53 元。具体情况如下：

序号	受托方	产品名称	金额（万元）	起息日期	到期日期	是否赎回	投资收益(元)
1	广发银行股份有限公司长沙开福支行	广发银行“薪加薪 16 号”人民币结构性存款	5,000	2018年 03 月 30 日	2018年 06 月 29 日	是	604,589.04
2	上海浦东发展银行股份有限公司长沙分行	上海浦东发展银行利多多对公结构性存款 2018 年 JG619 期	2,000	2018年 04 月 09 日	2018年 06 月 29 日	是	207,555.56
3	兴业银行股份有限公司长沙分行	企业金融结构性存款	3,000	2018年 04 月 08 日	2018年 07 月 09 日	是	362,958.90
4	北京银行股份有限公司长沙分行	稳健系列人民币 76 天期限银行间保证收益理财产品	3,500	2018年 04 月 13 日	2018年 06 月 28 日	是	298,794.52
5	广发银行股份有限公司长沙开福支行	广发银行“薪加薪 16 号”人民币结构性存款	5,100	2018年 07 月 17 日	2018年 09 月 28 日	是	456,960
6	上海浦东发展银行股份有限公司长沙分行	上海浦东发展银行利多多对公结构性存款 2018 年 JG1239 期	2,000	2018年 07 月 17 日	2018年 09 月 28 日	是	165,666.67
7	兴业银行股份有限公司长沙分行	企业金融结构性存款	3,500	2018年 07 月 17 日	2018年 09 月 28 日	是	308,000.00
8	上海浦东发展银行股份有限公司长沙分行	上海浦东发展银行利多多对公结构性存款公司 18JG1898 期	2,000	2018年 09 月 29 日	2018年 12 月 28 日	是	158,222.22
9	兴业银行股份有限公司长沙分行	兴业银行“金雪球一优选”保本开放式人民币理财产品	8,750	2018年 09 月 29 日	2018年 12 月 26 日	是	843,835.62

（二）尚未到期理财产品情况

截至本公告日，公司使用自有资金购买理财产品未到期的本金总金额为 11,800 万元（含本次公告金额），具体情况如下：

序号	受托方	产品名称	金额（万元）	起息日期	到期日期	是否到期	投资收益（元）
1	上海浦东发展银行股份有限公司长沙分行	上海浦东发展银行利多多公司 19JG0022 期人民币对公结构性存款	3,200	2019年 01 月 04 日	2019年 04 月 03 日	否	--
2	广发银行股份有限公司长沙高科支行	广发银行“薪加薪 16 号”人民币结构性存款	8,600	2019年 01 月 08 日	2019年 04 月 08 日	否	--

七、备查文件

广发银行“薪加薪 16 号”人民币结构性存款合同、风险揭示书及说明书

特此公告！

长缆电工科技股份有限公司董事会
2019 年 01 月 11 日