财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2019年第1号

【本基金不向个人投资者销售】

基金管理人：财通证券资产管理有限公司
基金托管人：浙商银行股份有限公司

二〇一九年四月

【重要提示】

财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经2018年1月18日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2018】153号文准予募集注册。本基金的基金合同于2018年3月15日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

在本基金的封闭期，基金份额持有人面临不能赎回基金份额的风险。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险；基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；由于基金投资者连续大量赎回基金、基金管理人运用流动性管理工具产生的流动性风险；交易对手违约风险；投资国债期货的特定风险；投资本基金特有的其他风险等等。本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

本基金单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过基金份额总数的50%，本基金不向个人投资者销售。

投资有风险，投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书、基金合同等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。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。

本招募说明书所载内容截止至2019年3月14日，基金投资组合报告截止至2018年12月31日（财务数据未经审计）。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：财通证券资产管理有限公司
住所：浙江省杭州市上城区白云路26号143室
办公地址：浙江省杭州市上城区四宜路22号四宜大院B幢
邮政编码：310002
法定代表人：马晓立
成立时间：2014年12月15日
注册资本：人民币贰亿元整
存续期间：持续经营
联系人：张婧
电话：（021）20568361
股东情况：财通证券股份有限公司持有公司100%的股权。

公司前身是财通证券股份有限公司资产管理部，经中国证监会《关于核准财通证券股份有限公司设立资产管理子公司的批复》（证监许可[2014]1177号）批准，由财通证券股份有限公司出资2亿元，在原财通证券股份有限公司资产管理部的基础上正式成立。

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

马晓立先生，董事长，1973年10月出生，中共党员，经济学硕士。历任联合证券研究所行业部经理，中信证券研究所总监、执行总经理，中信证券交易与衍生产品部执行总经理，财通证券股份有限公司资产管理部总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事长、总经理兼公募基金管理业务主要负责人。

裘根财先生，董事，1966年2月出生，中共党员，经济学硕士，中国国籍，无境外永久居留权。曾任浙江证券营业总部总经理助理、上海昆山路证券营业部总经理，方正证券机构管理部、营销中心总经理，华西证券杭州学院路证券营业部总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事，兼任财通证券总经理助理、中国证券业协会经纪业务委员会委员、浙江证券业协会经纪业务委员会副主任。

夏理芬先生，董事，1968年7月生，中共党员，工商管理硕士，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任浙江省国际信托投资公司义乌证券交易营业部经理，西湖证券营业部总经理，金通证券股份有限公司总裁办公室主任、运营管理部总经理，中信金通证券有限责任公司运营管理部总经理、总经理助理、合规总监，中信证券（浙江）公司合规总监、执行总经理兼江西分公司总经理，中信证券股份有限公司江西分公司总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事，兼任财通证券总经理助理兼首席风险官、财通（香港）董事、财通基金管理有限公司董事长、浙江证券业协会合规风控专业委员会主任委员、中国证券业协会风险管理委员会委员、浙江中信金通教育基金会理事兼秘书长。

钱慧女士，董事，1978年1月出生，中共党员，上海财经大学经济学硕士，国际注册内部审计师/会计师。曾任东方证券股份有限公司稽核总部、合规与风险管理部高级主管；东方证券资产管理有限公司督察长兼合规与风险管理部总监。现任财通证券资产管理有限公司董事，常务副总经理、首席风险官、合规负责人。

沈立强先生，董事，1956年7月出生，中共党员，大学本科学历，高级会计师。从事金融工作40余年，曾任中国工商银行浙江省分行副行长、党委委员，浙江省分行营业部总经理、党委书记，浙江省分行党委副书记，河北省分行行长、党委书记，上海市分行行长、党委书记，工银瑞信基金管理有限公司董事长。现任财通证券资产管理有限公司董事、上海市银行博物馆馆长。

2、基金管理人监事

夏志凡先生，职工监事，1983年11月出生，中共党员，经济学学士。历任阳光人寿保险股份有限公司人力资源经理，平安国际融资租赁有限公司人力资源部人才绩效室总监，平安商业保理有限公司人事行政部总监。现任财通证券资产管理有限公司职工监事、人力资源部总监兼综合办公室负责人。

3、经营管理层人员

马晓立先生，总经理（简历请参见上述关于董事长的介绍）。

李红芸女士，副总经理，1971年8月出生，中共党员，经济学学士，会计师。历任财通证券有限责任公司会计核算部负责人，财通证券有限责任公司计划财务部总经理助理、副总经理，财通证券股份有限公司资产管理部副总经理，现任财通证券资产管理有限公司董事会秘书、副总经理兼财务总监。

钱慧女士，常务副总经理（简历请参见上述关于董事的介绍）。

周志远先生，副总经理，1983年9月出生，中国民主建国会党员，硕士研究生。历任天安保险股份有限公司资产管理部金融工程兼债券交易，中欧基金管理有限公司高级债券交易员，国联安基金管理有限公司债券研究员、基金经理助理、基金经理，财通证券资产管理有限公司固定收益部负责人。现任财通证券资产管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

陈希希，基金经理，金融学学士。2010年10月至2012年9月担任日信证券股份有限公司固定收益部债券交易员，2012年10月至2014年12月担任财通证券股份有限公司资产管理部高级债券交易员，2014年12月至2015年7月担任财通证券资产管理有限公司固定收益部高级债券交易员，2015年7月至2017年7月期间担任财通证券资产管理有限公司固定收益部投资主办。

5、固收公募业务投资决策委员会成员

委员：马晓立（总经理）
李杰（固收公募投资部总监）
宫志芳（固收公募投资部基金经理）

6、权益公募业务投资决策委员会成员

委员：姜永明（总经理助理兼权益投资总监）
王丝语（权益研究部副总监）
于洋（权益公募投资部基金经理）

7、上述人员之间无近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：浙商银行股份有限公司
住所：浙江省杭州市庆春路288号
法定代表人：沈仁康
联系人：项星星
电话：0571-88267931
传真：0571-88268688
成立时间：1993年04月16日
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币18,718,696,778元
存续期间：持续经营
批准设立机关和批准设立文号：中国银行业监督管理委员会银监复【2004】91号
基金托管资格批文及文号：《关于核准浙商银行股份有限公司证券投资基金托管资格的批复》；证监许可【2013】1519号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。本行经国家外汇管理局批准，可以经营结汇、售汇业务。

2、主要人员情况

沈仁康先生，浙商银行党委书记、董事长、执行董事。硕士研究生。沈先生曾任浙江省青田县委常委、副县长，县委副书记、代县长、县长；浙江省丽水市副市长，期间兼任丽水经济开发区管委会党工委书记，并同时担任浙江省丽水市委常委；浙江省丽水市委副书记，期间兼任市委政法委书记；浙江省衢州市委副书记、代市长、市长。

徐仁艳先生，浙商银行党委副书记、执行董事、行长。研究生、高级会计师、注册税务师。徐先生曾任中国人民银行浙江省分行会计处财务科副科长、科长、会计处副处长，中国人民银行杭州中心支行会计财务处副处长、处长，中国人民银行杭州中心支行党委委员、副行长。

（二）、发展概况及财务状况

浙商银行是中国银保监会批准的12家全国性股份制商业银行之一，总行设在浙江省杭州市，是唯一一家总部位于浙江的全国性股份制商业银行，2004年8月18日正式开业，2016年3月30日在香港联交所上市（股份代号：2016）。截至2018年末，浙商银行在全国16个省（直辖市）和香港特别行政区设立了242家分支机构，实现了对长三角、环渤海、珠三角以及部分中西部地区的有效覆盖。2017年4月21日，首家控股子公司—浙银租赁正式开业。2018年4月10日，香港分行正式开业，国际化战略布局进一步提速。

开业以来，浙商银行立足浙江，稳健发展，已成为一家基础扎实、效益优良、成长迅速、风控完善的优质商业银行。截至2018年12月31日，浙商银行总资产1.65万亿元，客户存款余额9748亿元，客户贷款及垫款总额8654亿元，较上年末分别增长7.15%、13.26%、28.59%；不良贷款率1.20%，资产质量保持同业领先水平。在英国《银行家》(The Banker)杂志“2018年全球银行1000强(Top 1000 World Banks 2018)”榜单上，按一级资本位列第111位，较上年上升20位；按总资产位列第100位，较上年上升9位。中诚信国际给予浙商银行金融机构评级中最高等级AAA主体信用评级。

2018年，面对严峻复杂的形势，全行紧紧围绕“两最”总目标和全资产经营战略，主动调整优化业务结构，强化合规经营，坚持服务实体经济，严防金融风险，支持金融改革，扎实推进各项工作，保持稳健增长。2018年本集团实现归属于本行股东的净利润114.90亿元，增长4.94%，平均总资产收益率0.73%，平均权益回报率14.17%。营业收入390.22亿元，增长13.89%，其中：利息净收入263.86亿元，增长8.18%；非利息净收入126.37亿元，增长27.99%。营业费用121.42亿元，增长8.58%，成本收入比29.99%。计提信用减值损失（或资产减值损失）130.30亿元，增长38.99%。所得税费用22.90亿元，下降16.23%。

（三）、托管业务部的部门设置及员工情况

浙商银行资产托管部是总行独立的一级管理部门，根据业务条线下设业务管理中心、营销中心、运营中心、监督中心，保证了托管业务前、中、后台的完整与独立。截至2018年12月31日，资产托管部从业人员共36名。

浙商银行资产托管部遵照法律法规要求，根据业务的发展模式、运营方式以及内部控制、风险防范等各方面发展的需要，制定了一系列完善的内部管理制度，包括业务管理、操作规程、基金会计核算、清算管理、信息披露、内部稽核监控、内控与风险防范、信息系统管理、保密与档案管理、重大可疑情况报告及应急处理等制度，系统性地覆盖了托管业务开展的方方面面，能够有效地控制、防范托管业务的政策风险、操作风险和经营风险。

（四）、证券投资基金托管业务经营情况

中国证监会、银监会于2013年11月13日核准浙商银行开办证券投资基金托管业务，批准文号：证监许可[2013]1519号。

截至2018年12月31日，浙商银行托管证券投资基金62只，规模合计1411.43亿元，且目前已经与数十家公募基金管理公司达成托管合作意向。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构：

本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上直销交易平台。

名称：财通证券资产管理有限公司
住所：浙江省杭州市上城区白云路26号143室
杭州办公地址：浙江省杭州市上城区四宜路22号四宜大院B幢
上海办公地址：上海市浦东新区福山路500号城建国际中心28楼
法定代表人：马晓立
成立时间：2014年12月15日
杭州直销柜台联系人：毛亚婕、何倩男
电话：（0571）89720021、（0571）89720022
传真：（0571）85104360
上海直销柜台联系人：吴琳晓
电话：（021）20568211、（021）20568225
传真：（021）68753502
客户服务电话：95336
网址：www.ctzg.com

个人投资者可以通过基金管理人直销柜台、网上直销交易平台办理开户、本基金的认购、申购、赎回等业务，具体交易细则请参阅基金管理人网站。

2、其他销售机构

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销售本基金，并及时公告。

（二）登记机构

名称：财通证券资产管理有限公司
住所：浙江省杭州市上城区白云路26号143室
办公地址：浙江省杭州市上城区四宜路22号四宜大院B幢
法定代表人：马晓立
电话：（0571）89720155
联系人：刘博

（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：陆奇
经办律师：黎明、陆奇

（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
首席合伙人：李丹
电话：（021）23238888
传真：（021）23238800
联系人：李一
经办注册会计师：薛竞、李一

四、基金的名称

财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

在严格控制风险的基础上，把握市场机会，追求基金资产的稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可分离交易可转债的纯债部分、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货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相关规定。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，也不投资于可转换债券（可分离交易可转债的纯债部分除外）、可交换债券。

如法律法规或监管机构以后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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%，但应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，在每次开放期前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内，基金投资不受上述比例限制。在开放期，每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金持有的现金或者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；在封闭期，本基金不受前述5%的限制，但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

八、基金的投资策略

本基金将充分发挥基金管理人的投研能力，采取自上而下的方法对基金的大类资产进行动态配置，综合久期管理、收益率曲线配置等策略对个券进行精选，力争在严格控制基金风险的基础上，获取长期稳定超额收益。

1、资产配置策略

本基金将采用自上而下的方法，在充分研究基本宏观经济形势以及微观市场主体的基础上，对市场基本利率和债券、货币市场工具等投资品种收益率水平变化进行评估，并结合波动性以及流动性状况分析，针对不同行业、不同投资品种选择投资策略，以此做出最佳的资产配置及风险控制。

2、债券投资策略

（1）普通债券投资策略

1）久期控制：根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期，有效的控制整体资产风险。

2）期限结构配置：在确定组合久期后，基金管理人将针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，通过采用子弹策略、杠铃策略、梯子策略等，在长期、中期与短期债券间进行动态调整，从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

3）市场比较：不同债券子市场的运行规律不同，本基金在充分研究不同债券子市场风险—收益特征、流动性特性的基础上构建调整组合（包括跨市场套利操作），以提高投资收益。

4）相对价值判断：本基金将在相近的债券品种之间选择相对价值低估的债券品种进行投资。

5）信用风险评估：本基金将根据发债主体的经营状况与现金流等情况对其信用风险进行评定与估测，以此作为品种选择的基本依据。

（2）债券回购杠杆策略

本基金将在市场资金面和债券市场基本面分析的基础上结合个券分析和组合风险管理结果，积极参与债券回购交易，放大债券资产投资比例，追求债券资产的超额收益。

3、资产支持证券投资策略

本基金资产支持证券的投资将采用自下而上的方法，结合信用管理和流动性管理，重点考察资产支持证券的资产池现金流变化、信用风险情况、市场流动性等，采用量化方法对资产支持证券的价值进行评估，精选违约或逾期风险可控、收益率较高的资产支持证券项目，在有效分散风险的前提下为投资人谋求较高的投资组合回报率。

4、国债期货投资策略

本基金对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的，结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

5、开放期投资策略

开放期内，基金规模将随着投资人对本基金份额的申购与赎回而不断变化。因此本基金在开放期将保持资产适当的流动性，以应付当时市场条件下的赎回要求，并降低资产的流动性风险，做好流动性管理。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率

十、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，理论上其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

十一、基金的投资组合报告

以下投资组合报告数据截止至2018年12月31日。本报告财务资料未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中：股票	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,990,222,683.20	84.91
	其中：债券	1,990,222,683.20	84.91
	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	226,973,780.46	9.68
	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	81,555,980.60	3.48
8	其他各项资产	45,282,928.66	1.93
9	合计	2,344,035,372.92	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

（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）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股票。

3、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

4、报告期内股票投资组合的重大变动

（1）累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

（2）累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未投资股票。

（3）买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未投资股票。

5、期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,990,222,683.20	105.39
	其中：政策性金融债	1,990,222,683.20	105.39
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债(可交换债)	–	–
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	1,990,222,683.20	105.39

6、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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	180210	18国开10	4,300,000	443,459,000.00	23.48
2	170205	17国开05	2,800,000	282,856,000.00	14.98
3	180208	18国开08	2,600,000	264,758,000.00	14.02
4	180212	18国开12	2,500,000	252,750,000.00	13.38
5	170209	17国开09	1,800,000	182,790,000.00	9.68

7、期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

9、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。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行股指期货投资。

11、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

12、投资组合报告附注

（1）报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

（2）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。

（3）期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,106.12
2	应收证券清算款	498,135.24
3	应收股利	0.00
4	应收利息	44,781,687.30
5	应收申购款	0.00
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	45,282,928.66

（4）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。

（5）期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期内未进行股票投资。

十二、基金的业绩

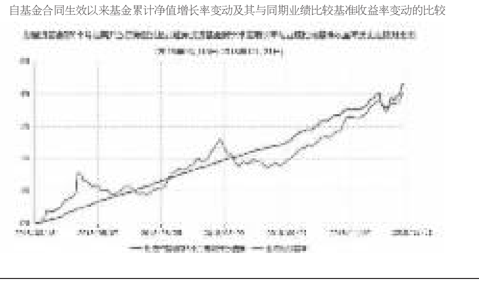
基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

以下基金业绩数据截至2018年12月31日，所载财务数据未经审计。

1、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2018.3.15–2018.12.31	4.33%	0.04%	4.05%	0.07%	0.28%	-0.03%
过去三个月	1.71%	0.07%	1.99%	0.05%	-0.28%	0.02%
自基金合同生效起至今（2018.12.31）	4.33%	0.04%	4.05%	0.07%	0.28%	-0.03%

2、自基金合同生效以来基金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



注：1、本基金合同于2018年03月15日生效，截止报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金已建仓完毕，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3、自基金合同生效至报告期末，财通资管睿智6个月定期开放债券基金份额净值增长率为4.33%，同期业绩比较基准收益率为4.05%。

十三、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、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、诉讼费和仲裁费；
（5）基金份额持有人大会费用；
（6）基金的证券、期货交易费用；
（7）基金的银行汇划费用；
（8）基金的开户费用、账户维护费用；
（9）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。

2、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0.3%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.3%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于次月前五个工作日内向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后从基金财产中一次性支付给基金管理人。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷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，逐日累计至每月月末，按月支付。由基金管理人于次月前五个工作日向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后内从基金财产中一次性支取。

若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

（3）上述“一、基金费用的种类”中第3—9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。

3、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。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

本基金对通过基金管理人直销柜台申购本基金的养老金客户与除此之外的其他投资者实施差别的申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金，包括全国社会保障基金、可以投资基金的地方社会保障基金、企业年金单一计划以及集合计划、企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划以及企业年金养老金产品。如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人可在招募说明书更新时或发布临时公告将其纳入养老金客户范围，并按规定向中国证监会备案。非养老金客户指除养老金客户外的其他投资者。

通过基金管理人直销柜台申购本基金的养老金客户适用下表特定申购费率，其他投资人申购本基金的适用下表一般申购费率：

申购金额（M）	一般申购费率	特定申购费率
M＜100万元	0.80%	0.32%
100万元≤M＜500万元	0.40%	0.16%
M≥500万元	每笔1000元	每笔1000元

本基金的申购费用应在投资人申购基金份额时收取，申购费用由投资人承担，不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

投资人可以多次申购本基金，申购费用按每笔申购申请单独计算。

因红利自动再投资而产生的基金份额，不收取相应的申购费用。

2、赎回费用

本基金赎回费率具体如下：

持有期限（Y）	赎回费率
Y＜7日	1.5%
7日≤Y＜30日	0.10%
Y≥30日	0

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取，赎回费用全额归入基金财产。

3、基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

4、基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划，定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后，对投资人适当调低基金申购费率、赎回费率。

（三）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。基金财产投资产生的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

十四、对招募说明书更新部分的说明

管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集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》及其他有关法律法规的要求，对本基金招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

1、“重要提示”部分增加了对基金合同生效日期的说明，更新了招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、“三、基金管理人”部分对基金管理人主要人员情况等内容进行了更新。

3、“四、基金托管人”部分对基金托管人基金基本信息、托管业务经营情况等内容进行了更新。

4、“九、基金的投资”部分新增了本基金投资组合报告，内容截止至2018年6月30日。

5、“十、基金的业绩”，更新业绩内容，截止至2018年6月30日。

6、“二十二、其它应披露事项”部分更新了本次招募说明书更新期间，涉及本基金的相关信息披露。

四川明星电力股份有限公司

2019第一季度报告

公司代码：600101　公司简称：明星电力

一、重要提示

1.1 公司董事会、监事会及董事、监事、高级管理人员保证季度报告内容的真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并承担个别和连带的法律责任。

1.2 公司全体董事出席董事会审议季度报告。

1.3 公司负责人秦怀平、主管会计工作负责人邹德成及会计机构负责人（会计主管人员）冯志保证季度报告中财务报表的真实、准确、完整。

1.4 本公司第一季度报告未经审计。

二、公司主要财务数据和股东变化

2.1 主要财务数据

单位：元　币种：人民币

	本报告期末	上年度末	本报告期末比上年度末增减(%)
总资产	3,198,805,550.54	3,160,550,632.09	1.21
归属于上市公司股东的净资产	2,270,133,056.04	2,231,809,011.05	1.72
	年初至报告期末	上年初至上年报告期末	比上年同期增减(%)
经营活动产生的现金流量净额	226,565,564.44	83,173,252.12	172.40
	年初至报告期末	上年初至上年报告期末	比上年同期增减(%)
营业收入	434,973,097.63	401,859,328.46	8.24
归属于上市公司股东的净利润	29,772,278.16	27,148,346.55	9.67
归属于上市公司股东的扣除非经常性损益的净利润	32,360,494.07	27,028,518.53	19.73
加权平均净资产收益率(%)	1.33	1.30	增加0.03个百分点
基本每股收益(元/股)	0.09	0.08	12.50
稀释每股收益(元/股)	0.09	0.08	12.50

非经常性损益项目和金额

√适用 □不适用

单位：元　币种：人民币

项目	本期金额	说明
非流动资产处置损益	-3,733,780.32	
计入当期损益的政府补助，但与公司正常经营业务密切相关，符合国家政策规定，按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	320,236.22	
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	940,452.48	其中，公司收到保险赔偿款79.54万元。
少数股东权益影响额（税后）	18.75	
所得税影响额	-115,143.04	
合计	-2,588,215.91	

2.2 截止报告期末的股东总数、前十名股东、前十名流通股东（或无限售条件股东）持股情况表

单位：股

股东总数（户）						35,781
前十名股东持股情况						
股东名称（全称）	期末持股数量	比例(%)	持有有限售条件股份数量	质押或冻结情况		股东性质
				股份状态	数量	
国网四川省电力公司	65,070,097	20.07	0	无	0	国有法人
遂宁兴业资产经营公司	18,486,534	5.70	0	无	0	国家
遂宁金源科技发展公司	18,312,969	5.65	0	无	0	国有法人
前海人寿保险股份有限公司–海利年年	16,259,527	5.02	0	无	0	境内非国有法人
阮彩友	2,294,450	0.71	0	无	0	境内自然人
阮海良	2,221,736	0.69	0	无	0	境内自然人
徐国滨	2,166,800	0.67	0	无	0	境内自然人
钱菊芳	2,041,200	0.63	0	无	0	境内自然人
中国建设银行股份有限公司–华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金	1,701,300	0.52	0	无	0	未知
周汉知	1,310,773	0.40	0	无	0	境内自然人

前十名无限售条件股东持股情况			
股东名称	持有无限售条件流通股的数量	股份种类及数量	
		种类	数量
国网四川省电力公司	65,070,097	人民币普通股	65,070,097
遂宁兴业资产经营公司	18,486,534	人民币普通股	18,486,534
遂宁金源科技发展公司	18,312,969	人民币普通股	18,312,969
前海人寿保险股份有限公司–海利年年	16,259,527	人民币普通股	16,259,527
阮彩友	2,294,450	人民币普通股	2,294,450
阮海良	2,221,736	人民币普通股	2,221,736
徐国滨	2,166,800	人民币普通股	2,166,800
钱菊芳	2,041,200	人民币普通股	2,041,200
中国建设银行股份有限公司–华夏中证四川国企改革交易型开放式指数证券投资基金	1,701,300	人民币普通股	1,701,300
周汉知	1,310,773	人民币普通股	1,310,773
上述股东关联关系或一致行动的说明	在公司前十名股东中，前三位国家股股东、法人股股东之间不存在关联关系，不属于《上市公司收购管理办法》规定的一致行动人；公司未知其他流通股股东之间是否存在一致行动人的情况。		
表决权恢复的优先股股东及持股数量的说明	不适用。		

2.3 截止报告期末的优先股股东总数、前十名优先股股东、前十名优先股无限售条件股东持股情况表

□适用 √不适用

三、重要事项

3.1 公司主要会计报表项目、财务指标重大变动的情况及原因

√适用 □不适用

（一）资产负债表项目

单位：元

项目	本报告期末	上年度末	变动比例(%)	主要原因
货币资金	703,291,643.90	494,142,017.65	42.33	上年度12月份未结算预付购电费，本报告期1月结算，转回预付账款，收到货币资金增加。
应收票据及应收账款	12,942,694.30	4,613,435.75	180.54	本报告期全资子公司遂宁市明星电气工程有限公司电气安装工程实施，应收账款增加。
预付款项	1,658,779.13	143,982,622.62	-98.85	上年度12月份未结算预付购电费，本报告期1月结算，转回预付账款。
其他流动资产	66,477.95	1,410,917.44	-95.29	本报告期增值税待抵扣进项税抵扣后减少。
少数股东权益	1,728,860.87	4,050,329.21	-57.32	一是本报告期陕西省金盾公路建设投资有限公司少数股东退出，该公司由控股子公司变更为全资子公司；二是本报告期公司挂牌转让了持有的控股子公司四川汇明矿业有限公司股权。

（二）利润表项目

单位：元

项目	本报告期	上年同期	变动比例(%)	主要原因
财务费用	-1,228,188.46	-576,150.40	-113.17	本报告期公司定期存款到期计息，利息收入增加。
投资收益	5,169,414.17	3,886,988.48	32.99	本报告期公司合营企业实现的净利润同比增加，公司按持股比例享有份额计算投资收益同比增加。
其他收益	320,236.22		100.00	本报告期全资子公司遂宁市明星自来水有限公司政府补助摊销同比增加。
?营业外收入	1,129,161.25	784,509.74	43.93	本报告期公司收到的保险赔偿款同比增加。
少数股东损益	469,344.22	-524,745.13	189.44	本报告期控股子公司甘孜州康定华龙水利电力投资开发有限公司实现的净利润同比增加，公司按持股比例享有份额计算增加。

（三）现金流量表项目

单位：元

项目	本报告期	上年同期	变动比例(%)	主要原因
经营活动产生的现金流量净额	226,565,564.44	83,173,252.12	172.40	本报告期结算预付购电费，转回预付账款，收到货币资金增加。
投资活动产生的现金流量净额	-17,415,938.19	-11,358,753.92	-53.33	本报告期子公司陕西省金盾公路建设投资有限公司少数股东退出。

3.2 重要事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

□适用 √不适用

3.3 报告期内超期未履行完毕的承诺事项

□适用 √不适用

3.4 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生重大变动的警示及原因说明

□适用 √不适用

公司名称:四川明星电力股份有限公司
法定代表人:秦怀平
日期:2019年4月25日

证券代码:600101　证券简称:明星电力　编号:临2019-014

四川明星电力股份有限公司
第十届董事会第三十六次会议决议公告

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。

四川明星电力股份有限公司（简称“公司”）于2019年4月15日以电子邮件的方式向董事、监事和高级管理人员发出了召开第十届董事会第三十六次会议的通知和会议资料，第十届董事会第三十六次会议于2019年4月25日在公司召开。8名董事全部出席了会议，公司监事和高级管理人员列席了本次会议，会议的召开符合《公司法》、公司《章程》的有关规定。

会议由秦怀平董事长主持，审议并通过了《2019年第一季度报告全文及正文》。

表决结果：同意8票，反对0票，弃权0票。

详见上海证券交易所网站www.sse.com.cn。

四川明星电力股份有限公司董事会
2019年4月25日

证券代码:600101　证券简称:明星电力　编号:临2019-015

四川明星电力股份有限公司
第九届监事会第二十五次会议决议公告

本公司监事会及全体监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。

四川明星电力股份有限公司（简称“公司”）于2019年4月15日以电子邮件的方式向监事和相关高级管理人员发出了召开第九届监事会第二十五次会议的通知和会议资料，第九届监事会第二十五次会议于2019年4月25日在公司召开。5名监事全部出席了会议，相关高级管理人员列席了本次会议。会议的召开符合《公司法》、公司《章程》的有关规定。

会议由监事会主席何永祥先生主持，审议并通过了《2019年第一季度报告全文及正文》。

根据《证券法》和《上海证券交易所股票上市规则》的有关要求，公司监事会对董事会编制的2019年第一季度报告进行了审核，并发表如下审核意见：

（一）公司2019年第一季度报告的编制和审议程序符合法律、法规、公司《章程》和公司内部管理制度的各项规定；

（二）公司2019年第一季度报告的内容和格式符合中国证监会和上海证券交易所的各项规定，所包含的信息从各个方面真实地反映了公司2019年第一季度的经营管理和财务状况；

（三）在发表本意见前，未发现参与公司2019年第一季度报告编制和审议的人员有违反保密规定的行为。

表决结果：同意5票，反对0票，弃权0票。

四川明星电力股份有限公司
监事会
2019年4月25日

上投摩根天添宝货币市场基金劳动节假期前暂停申购及转换转入业务的公告

公告送出日期：2019年4月26日

1.公告基本信息

基金名称	上投摩根天添宝货币市场基金	
基金简称	上投摩根天添宝货币	
基金主代码	000712	
基金管理人名称	上投摩根基金管理有限公司	
公告依据	法律法规、基金合同和上海证券交易所及深圳证券交易所发布的《关于调整2019年劳动节休市安排的通知》	
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2019年4月30日
	暂停转换转入起始日	2019年4月30日
	暂停申购及转换转入的原因说明	为保护基金份额持有人的利益
下属分级基金的基金简称	上投摩根天添宝货币A类	上投摩根天添宝货币B类
下属分级基金的交易代码	000712	000713
该分级基金是否暂停申购及转换转入	是	是

2.其他需要提示的事项

根据上海证券交易所及深圳证券交易所发布的《关于调整2019年劳动节休市安排的通知》，2019年5月1日（星期三）至5月5日（星期日）休市，5月6日（星期一）起照常开市。

为保护基金份额持有人的利益，根据法律法规和基金合同的相关规定，上投摩根基金管理有限公司决定2019年4月30日暂停上投摩根天添宝货币市场基金（以下简称“本基金”）的申购和其他基金转换为本基金的基金转换业务。本基金转换为其他基金的转换业务、赎回业务等其他业务以及我司管理的其他开放式基金的各项交易业务仍照常办理。自2019年5月6日起，本基金所有销售网点恢复办理本基金的正常申购、转换转入业务，届时不再另行公告。

请投资人及时做好交易安排，避免因交易跨越假期带来不便及资金在途的损失。如有疑问，请拨打客户服务热线：400 889 4888，或登录网站www.cifm.com获取相关信息。

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司
2019年4月26日

上投摩根货币市场基金劳动节假期前暂停申购及转换转入业务的公告

公告送出日期：2019年4月26日

1.公告基本信息

基金名称	上投摩根货币市场基金	
基金简称	上投摩根货币	
基金主代码	370010	
基金管理人名称	上投摩根基金管理有限公司	
公告依据	法律法规、基金合同和上海证券交易所及深圳证券交易所发布的《关于调整2019年劳动节休市安排的通知》	
暂停相关业务的起始日及原因说明	暂停申购起始日	2019年4月30日
	暂停转换转入起始日	2019年4月30日
	暂停申购及转换转入的原因说明	为保护基金份额持有人的利益
下属分级基金的基金简称	上投摩根货币A	上投摩根货币B
下属分级基金的交易代码	370010	370010
该分级基金是否暂停申购及转换转入	是	是

2.其他需要提示的事项

根据上海证券交易所及深圳证券交易所发布的《关于调整2019年劳动节休市安排的通知》，2019年5月1日（星期三）至5月5日（星期日）休市，5月6日（星期一）起照常开市。

为保护基金份额持有人的利益，根据法律法规和基金合同的相关规定，上投摩根基金管理有限公司决定2019年4月30日暂停上投摩根货币市场基金（以下简称“本基金”）的申购和其他基金转换为本基金的基金转换业务。本基金转换为其他基金的转换业务、赎回业务等其他业务以及我司管理的其他开放式基金的各项交易业务仍照常办理。自2019年5月6日起，本基金所有销售网点恢复办理本基金的正常申购、转换转入业务，届时不再另行公告。

请投资人及时做好交易安排，避免因交易跨越假期带来不便及资金在途的损失。如有疑问，请拨打客户服务热线：400 889 4888，或登录网站www.cifm.com获取相关信息。

特此公告。

上投摩根基金管理有限公司
2019年4月26日

东方金账簿货币市场证券投资基金劳动节前暂停申购及转换转入业务的公告

公告送出日期：2019年4月26日

1. 公告基本信息

基金名称		东方金账簿货币市场证券投资基金	
基金简称		东方金账簿货币	
基金主代码		400005	
基金管理人名称		东方基金管理有限责任公司	
公告依据		《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》、《东方金账簿货币市场证券投资基金招募说明书》及相关法律法规	
暂停相关业务的起始日、金额及原因说明	暂停申购起始日	2019年4月29日	
	暂停大额申购起始日	–	
	暂停转换转入起始日	2019年4月29日	
	暂停大额转换转入起始日	–	
	暂停赎回起始日	–	
	暂停转换转出起始日	–	
	暂停定期定额投资起始日	–	
	限制申购金额（单位：人民币元）	–	
	限制转换转入金额（单位：人民币元）	–	
	暂停申购（转换转入）的原因说明	《国务院办公厅关于调整2019年劳动节假期安排的通知》（国办发明电〔2019〕3号）及沪深证券交易所休市安排，保护投资者利益。	
下属分级基金的基金简称		东方金账簿货币A	东方金账簿货币B
下属分级基金的交易代码		400005	400006
该分级基金是否暂停申购（转换转入）		是	是
下属分级基金的限制申购金额（单位：人民币元）		–	–
下属分级基金的限制转换转入金额（单位：人民币元）		–	–

注：1、本基金暂停办理申购及转换转入业务期间，对于暂停申购前已开通定期定额投资业务的投资者，照常受理其投资业务。暂停申购前未开通定期定额业务的投资者，暂停受理定期定额开户和投资业务。转换转出及赎回等其他业务仍照常办理。

2、请投资者及早做好交易安排，避免因交易跨越劳动节假期带来的不便及资金损失。投资者所享有的基金份额收益将根据中国证监会《货币市场基金监督管理办法》（中国证监会令第120号）第十五条的规定办理。

3、投资者如有疑问，请拨打本公司客户服务热线400 628 5888，或登陆本公司网站www.orient-fund.com、www.df5888.com获取相关信息。

2. 其他需要提示的事项

–

东方基金管理有限责任公司
2019年4月26日

东方金账簿货币市场证券投资基金劳动节后恢复申购及转换转入业务的公告

公告送出日期：2019年4月26日

1. 公告基本信息

基金名称		东方金账簿货币市场证券投资基金	
基金简称		东方金账簿货币	
基金主代码		400005	
基金管理人名称		东方基金管理有限责任公司	
公告依据		《东方金账簿货币市场证券投资基金基金合同》、《东方金账簿货币市场证券投资基金招募说明书》及相关法律法规。	
恢复相关业务的日期及原因说明	恢复申购日	2019年5月6日	
	恢复转换转入日	2019年5月6日	
	恢复大额转换转入日	–	
	恢复大额申购日	–	
	恢复赎回日	–	
	恢复转换转出日	–	
	恢复定期定额投资日	–	
	恢复申购（转换转入）的原因说明	《国务院办公厅关于调整2019年劳动节假期安排的通知》（国办发明电〔2019〕3号）及沪深证券交易所休市安排，保护投资者利益。	
下属分级基金的基金简称		东方金账簿货币A	东方金账簿货币B
下属分级基金的交易代码		400005	400006
该分级基金是否恢复申购（转换转入）		是	是

注：投资者如有疑问，请拨打本公司客户服务热线400 628 5888，或登陆本公司网站www.df5888.com获取相关信息。

2.其他需要提示的事项

–

东方基金管理有限责任公司
2019年4月26日