（接B69版）

法定代表人：王锋
联系人：张云飞
电话：13016933367
客服电话：025-66996699
网站：www.snjjin.com
48、西藏东方财富证券股份有限公司
住所：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼
办公地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城10栋楼
法定代表人：陈宏
联系人：付佳
电话：17717379005
客服电话：95357
网站：www.18.cn
49、江苏汇林保大基金销售有限公司
住所：南京市高淳区经济开发区古檀大道47号
办公地址：南京市鼓楼区中山北路105号中环国际1413室
法定代表人：吴言林
联系人：孙平
电话：13564999938
客服电话：025-66046166
网站：www.huilinbd.com
50、深圳前海财厚基金销售有限公司
住所：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：广东省深圳市南山区高新南十道深圳湾科技生态园三区11栋A座3608室
法定代表人：杨艳平
联系人：莫婉
电话：13923830997
客服电话：400-1286-800
网站：www.caiho.cn
51、喜鹊财富基金销售有限公司
住所：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
办公地址：西藏拉萨市柳梧新区柳梧大厦1513室
法定代表人：陈皓
联系人：张萌
电话：18600730680
客服电话：400-6997-719
网站：www.xiquefund.com
52、中证金牛（北京）投资咨询有限公司
住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
联系人：沈晨
电话：010-59336544
客服电话：4008-909-998
网站：www.jnlc.com
53、大秦金石基金销售有限公司
住所：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室
办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人：袁顺明
联系人：朱海涛
联系电话：021-20324158
传真：021-20324199
客服电话：400-928-2266
网址：www.dtfunds.com
54、泰诚财富基金销售（大连）有限公司
住所：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
联系人：徐江
电话：18840800358
客服电话：400-0411-001
网址：www.haojiyoujijin.com

注：为维护投资者利益，东方基金管理有限责任公司已暂停泰诚财富基金销售（大连）有限公司、大秦金石基金销售有限公司办理本公司旗下基金的认购、申购、定期定额投资及转换等业务。已通过泰诚财富基金销售（大连）有限公司、大秦金石基金销售有限公司购买本公司基金的投资者，当前持有基金份额的赎回业务暂不受影响。

（三）登记机构
名称：东方基金管理有限责任公司
住所：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
办公地址：北京市西城区锦什坊街28号1-4层
法定代表人：崔伟
联系人：肖阳辉
电话：010-66295871
传真：010-66578680
网址：www.orient-fund.com或www.df5888.com

（四）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
联系人：陆奇
电话：021-31358666
传真：021-31358600
经办律师：黎明、陆奇

（五）审计基金财产的会计师事务所
名称：立信会计师事务所（特殊普通合伙）
住所：上海市南京东路61号4楼
办公地址：北京市海淀区西四环中路16号院7号楼10层
法定代表人：朱建弟
联系人：朱锦梅
电话：010-68286868
传真：010-88210608
经办注册会计师：朱锦梅、高慧丽

五、基金名称和基金类型
（一）本基金名称：东方盛世灵活配置混合型证券投资基金
（二）本基金类型：混合型
（三）基金运作方式：契约型，开放式

六、基金投资目标和投资方向
（一）投资目标
严格控制投资风险，采取灵活动态的资产配置策略，力争为投资人提供长期稳健的回报。
（二）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（含中小企业私募债券）、资产支持证券、货币市场工具、股指期货与权证等金融衍生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相关规定)。
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。
基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为0%－95%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例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。

七、基金的投资策略
本基金采用灵活的类别资产配置，并在此基础上精选具有投资价值的股票和债券，在严格控制风险的基础上，获得基金的长期稳定的投资回报。
（一）类别资产配置
在类别资产的配置上，本基金结合宏观经济因素、市场估值因素、政策因素、市场情绪因素等分析各类资产的市场趋势和收益风险水平，进而对股票、债券和货币市场工具等类别的资产进行动态调整。
1、宏观经济因素。主要分析对证券市场的基本面产生普遍影响的宏观经济指标。包括：GDP增长率、工业增加值、CPI、PPI水平及其变化趋势、市场利率水平及其变化趋势、M1、M2值及其增加量等；
2、市场估值因素。包含纵向比较股票市场的整体估值水平、横向比较股票、债券之间的相对收益水平、上市公司盈利水平及其盈利预期、市场资金供求关系变化等；
3、政策因素。研究与证券市场紧密相关的各种宏观调控政策，包括产业发展政策、区域发展政策、货币政策、财政政策、房地产调控政策等；
4、市场情绪因素，包含新开户数、股票换手率、市场成交量、开放式基金股票持仓比例变化等。
综合上述因素的分析结果，本基金给出股票、债券和货币市场工具等资产的最佳配置比例并实时进行调整。
（二）股票投资策略
在灵活配置类别资产的基础上，本基金通过分析股票市场的中长期趋势并结合股票市场短期特征，选取具备中长期投资价值的个股和当前股票市场中具备潜在投资价值的行业和个股。
1、行业配置策略
本基金将采用“自上而下”的行业配置方法，通过对国家宏观经济走势、国家产业政策导向、经济结构转型方向、行业自身生命周期与行业技术创新情况等的深入研究，综合评判行业的成长性和投资价值。同时，根据上述因素的变化对行业进行动态筛选和配置。
2、个股配置策略
（1）价值投资策略
价值投资策略是通过寻找价值被低估的股票进行投资，以谋求估值反转带来的收益。通过运用多项指标如PE、PB、EV/EBITDA等进行相对估值，通过与国内同行业其它公司估值水平以及国外同行业公司相对估值水平等进行估值比较，找出价值被相对低估的公司。
（2）趋势投资策略
公司的经营业绩成长和公司投资价值的提升决定了公司股票价格的长期趋势；同时由于受到当期各种外部因素的影响，股票价格还具有中、短期趋势，表现为股价相对长期趋势的估值偏离和估值修复过程。由于市场反应不足或反应过度，股票价格的涨跌往往表现出一定的惯性。因此，可通过基本面分析、行为金融分析和事件分析，利用股价中、短期趋势的动态特征，进行股票的买入和卖出操作，从而提高单只股票的投资收益。
（三）债券投资策略
1、久期调整策略
本基金将根据对影响债券投资的宏观经济状况和货币政策等因素的分析判断，形成对未来市场利率变动方向的预期，进而主动调整所持有的债券资产组合的久期值，达到增加收益或减少损失的目的。当预期市场总体利率水平降低时，本基金将延长所持有的债券组合的久期值，从而可以在市场利率实际下降时获得债券价格上升所产生的资本利得；反之，当预期市场总体利率水平上升时，则缩短组合久期，以避免债券价格下降带来的资本损失，获得较高的再投资收益。
2、期限结构策略
在目标久期确定的基础上，本基金将通过对债券市场收益率曲线形状变化的合理预期，调整组合的期限结构策略，适当的采取子弹策略、哑铃策略、梯式策略等，在短期、中期、长期债券间进行配置，以从短、中、长期债券的相对价格变化中获取收益。当预期收益率曲线变陡时，采取子弹策略；当预期收益率曲线变平时，采取哑铃策略；当预期收益率曲线不变或平行移动时，采取梯形策略。
3、类属债券配置策略
根据债券的发行主体、风险来源、收益率水平、市场流动性等因素，本基金将市场主要细分为一般债券（含国债、央行票据、政策性金融债等）、信用债券（含公司债券、企业债券、非政策性金融债券、短期融资券、地方政府债券、资产支持证券等）、附权债券（含可转换公司债券、可分离交易公司债券、含回售及赎回选择权的债券等）三个子市场。本基金将通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况等因素进行综合分析，在目标久期控制及期限结构配置基础上，采取积极投资策略，确定类属债券的最优配置比例。
（1）一般债券投资策略
在目标久期控制及期限结构配置基础上，对于国债、中央银行票据、政策性金融债，本基金主要通过跨市场套利等策略获取套利收益。同时，由于国债及央行票据具有良好的流动性，能够为基金的流动性提供支持。
（2）信用债券投资策略
信用评估策略：信用债券的信用利差与债券发行人所在行业特征和自身情况密切相关。本基金将通过行业分析、公司资产负债分析、公司现金流分析、公司运营管理分析等调查研究，分析违约风险即合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估。
回购策略：回购放大是一种杠杆投资策略，通过质押组合中的持仓债券进行正回购，将融得资金购买债券，获取回购利率和债券利率的利差，从而提高组合收益水平。影响回购放大策略的关键因素有两个：其一是利差，即回购资金成本与债券收益率的关系，只有当债券收益率高于回购资金成本时，放大策略才能取得正的回报；其二是债券的净价在放大操作期间出现上涨，则可以获取价差收益。在收益率曲线陡峭或预期利率下行的市场情况下，在防范流动性风险的基础上，适当运用回购放大策略，可以为基金持有人争取更多的收益。
（3）附权债券投资策略
本基金在综合分析可转换公司债券的债性特征、股性特征等因素的基础上，利用BS公式或二叉树定价模型等量化估值工具评定其投资价值，重视对可转换债券对应股票的分析与研究，选择那些公司和行业景气趋势回升、成长性好、安全边际较高的品种进行投资。对于含回售及赎回选择权的债券，本基金将利用债券市场收益率数据，运用期权调整利差（OAS）模型分析含赎回或回售选择权的债券的投资价值，作为此类债券投资的主要依据。
4、权证投资策略
本基金在进行权证投资时，将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型，深入分析标的资产价格及其市场隐含波动率的变化，寻求其合理定价水平。全面考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，谨慎投资，追求较稳定的当期收益。
5、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、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，通过信用研究和流动性管理，选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。
6、中小企业私募债券投资策略
在控制信用风险的基础上，本基金对中小企业私募债投资，主要通过期限和品种的分散投资控制流动性风险。以买入持有到期为主要策略，审慎投资。
针对内嵌转股选择权的中小企业私募债，本基金通过深入的基本面分析及定性定量研究，自下而上精选个债，在控制风险的前提下，谋求内嵌转股权潜在的增强收益。
基金投资中小企业私募债券，基金管理人将根据审慎原则，制订严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案，并经董事会批准，以防范信用风险、流动性风险等各种风险。
7、股指期货投资策略
本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

八、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×30%＋中债总全价指数收益率×70%
选择该业绩比较基准的理由主要如下：
本基金的投资目标是力争为投资人提供长期稳健的回报，以“沪深300指数收益率×30%＋中债总全价指数收益率×70%”作为业绩比较基准可以较好地反映本基金的投资目标。
若今后法律法规发生变化或未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准。业绩比较基准的变更须经基金管理人和基金托管人协商一致并及时公告，无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的风险收益特征
本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等风险水平的投资品种。

十、基金投资组合报告
本基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。
基金托管人根据本基金合同规定，已复核了本投资组合报告中的财务指标、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至2020年3月31日（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	35,727,297.88	18.61
	其中：股票	35,727,297.88	18.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	63,563,560.79	33.11
	其中：债券	63,563,560.79	33.11
	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	40,000,000.00	20.84
	其中：买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	32,324,079.25	16.84
8	其他资产	20,341,721.98	10.60
9	合计	191,956,659.90	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、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,874,966.34	10.67
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	2,812,147.31	1.51
G	交通运输、仓储和邮政业	2,247,131.25	1.21
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	6,548,500.00	3.52
K	房地产业	4,227,000.00	2.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,552.98	0.01
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	35,727,297.88	19.19

（三）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	600519	贵州茅台	5,000	5,555,000.00	2.98
2	600104	上汽集团	220,000	4,510,000.00	2.42
3	600383	金地集团	300,000	4,227,000.00	2.27
4	601318	中国平安	50,000	3,458,500.00	1.86
5	603866	桃李面包	65,048	3,218,575.04	1.73
6	601398	工商银行	600,000	3,090,000.00	1.66
7	603939	益丰药房	30,000	2,793,000.00	1.50
8	600585	海螺水泥	50,000	2,755,000.00	1.48
9	601816	京沪高铁	384,125	2,247,131.25	1.21
10	000858	五粮液	15,000	1,728,000.00	0.93

（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	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	215,164.60	0.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,009,000.00	5.38
	其中：政策性金融债	10,009,000.00	5.38
4	企业债券	12,031,000.00	6.46
5	企业短期融资券	30,147,000.00	16.19
6	中期票据	10,161,000.00	5.46
7	可转债（可交换债）	1,000,396.19	0.54
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	63,563,560.79	34.14

（五）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	101562013	15阳泉MTN001	100,000	10,161,000.00	5.46
2	011901672	19北京能源SCP009	100,000	10,060,000.00	5.40
3	011902050	19鲁交SCP006	100,000	10,055,000.00	5.40
4	012000104	20大同煤矿SCP002	100,000	10,032,000.00	5.39
5	108602	国开1704	100,000	10,009,000.00	5.38

（六）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。
（七）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。
（八）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。
（九）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。
（十）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。
（十一）投资组合报告附注
1、本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明
本基金所持有的工商银行(601398)，其浙江分行等多个分支机构被中国银行业监督管理委员会浙江监管局等地方监管机构处以多起罚款，主要违法违规事实涉及信贷违规、销售违规等。
以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。
本基金所持有的国君转债（113013.SH），其发行人为国泰君安证券股份有限公司。2019年3家相关营业部受到当地证监局的行政监管措施，主要违规事实涉及员工替客户办理证券交易操作、违规为客户提供融资便利及未有效实施印鉴管理；此外，发行人子公司国泰君安期货因客户回访制度不完善被上海证监局采取责令整改的行政监管措施；2020年一季度，因发行人深圳红荔西路证券营业部未报备分支机构负责人而受到中国证券监督管理委员会深圳监管局出具警示函的行政监管措施。
以上事项不会对公司本年度经营业绩产生重大负面影响。
本基金决策依据及投资程序：
① 研究员对宏观经济、证券市场、行业和公司的发展变化进行深入而有效的研究，形成有关的各类报告，为本基金的投资管理提供决策依据。
② 投资决策委员会定期召开会议，讨论本报告期内本基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定范围形成本基金的资产配置比例指导意见。
③ 基金经理根据投资决策委员会的决议，参考上述报告，并结合自身的分析判断，形成基金投资计划，主要包括行业配置和投资组合管理。
④ 交易部依据基金经理的指令，制定交易策略，统一进行具体品种的交易；基金经理必须遵守投资组合决定权和交易下单权产格分离的规定。
⑤ 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出市场风险防范措施，监察稽核部、风险管理部对投资组合计划的执行过程进行日常监督和量化风险控制。
本基金投资工商银行主要基于以下原因：公司是国内四大国有银行之一，业务结构稳健，PB估值便宜且股息率高，具备配置价值。
本基金投资国君转债主要基于以下原因：公司是国内券商龙头，证券业务资质齐全，行业竞争能力强，业务布局清晰，具备配置价值。
除上述情况外，本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未发现存在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。
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。
3、报告期末其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	69,673.18
2	应收证券清算款	18,829,321.62
3	应收股利	-
4	应收利息	1,442,727.18
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,341,721.98

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	113013	国君转债	117,630.00	0.06
2	123011	德尔转债	109,086.70	0.06
3	128057	博杰转债	91,784.00	0.05
4	127012	招路转债	75,726.00	0.04
5	110051	中天转债	35,241.00	0.02
6	113021	中信转债	29,295.00	0.02
7	110052	贵广转债	21,375.00	0.01
8	127011	中鼎转2	14,155.20	0.01
9	127006	敦东转债	758.59	0.00

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	601816	京沪高铁	2,247,131.25	1.21	新股锁定限售

十一、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）基金的净值表现
本报告期内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
2016.04.15-2016.12.31	2.16%	0.11%	-0.57%	0.29%	2.73%	-0.18%
2017.01.01-2017.12.31	6.51%	0.14%	3.01%	0.20%	3.50%	-0.06%
2018.01.01-2018.12.31	2.06%	0.28%	-3.99%	0.39%	6.05%	-0.11%
2019.01.01-2019.12.31	9.89%	0.32%	10.99%	0.36%	-1.10%	-0.04%
2020.01.01-2020.3.31	-2.07%	0.65%	-1.11%	0.53%	-0.96%	0.12%

（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

十二、费用概览
（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/期货交易费用；
7、基金的银行汇划费用；
8、基金的账户开户费用、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。
上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。
（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
本基金的管理费每日按前一日基金资产净值的0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：
H＝E×0.60%÷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五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
本基金的托管费每日按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：
H＝E×0.20%÷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五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3－9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。
（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。

十三、对招募说明书更新部分的说明
本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》及其他有关规定以及《东方强化收益债券型证券投资基金基金合同》及其他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进行了更新，主要内容如下：
（一）在“重要提示”部分，更新了“招募说明书有关财务数据的截止日期”及“其他内容的截止日期”。
（二）在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关内容。
（三）在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人的相关内容。
（四）在“第五部分 相关服务机构”中，更新了相关服务机构的信息。
（五）在“第八部分 基金的投资”部分，更新了“投资组合报告”的内容，基金的投资组合报告截止日期更新为2020年3月31日，该部分内容均按有关规定编制，并经本基金托管人复核，但未经审计。
（六）在“第九部分 基金的业绩”部分，更新了“基金的净值表现”和“本基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，该部分内容均按照有关规定编制，并经本基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。
（七）在“第二十一部分 其他应披露事项”部分，更新了自上次招募说明书（更新）截止日2019年4月15日，至本次招募说明书（更新）截止日2020年4月15日之间的信息披露事项。
上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查阅本更新招募说明书详细内容，可登录东方基金管理有限责任公司网站www.orient-fund.com。

东方基金管理有限责任公司
2020年5月

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。

证券代码：600604 900902　证券简称：市北高新 市北B股　公告编号：2020-024

上海市北高新股份有限公司2019年年度权益分派实施公告

重要内容提示：
● 每股分配比例
A股每股现金红利0.012元，B股每股现金红利0.001695美元
● 相关日期

股份类别	股权登记日	最后交易日	除权（息）日	现金红利发放日
A股	2020/6/3	-	2020/6/4	2020/6/4
B股	2020/6/8	2020/6/3		2020/6/19

● 差异化分红送转：否

一、通过分配方案的股东大会届次和日期
本次利润分配方案经公司2020年5月7日的2019年年度股东大会审议通过。
二、分配方案
1.发放年度：2019年年度
2.分派对象：
截至股权登记日下午上海证券交易所收市后，在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司（以下简称“中国结算上海分公司”）登记在册的本公司全体股东。
3.分配方案：
本次利润分配以方案实施前的公司总股本1,873,304,804股为基数，每股派发现金红利0.012元（含税），共计派发现金红利22,479,657.65元。
三、相关日期

股份类别	股权登记日	最后交易日	除权（息）日	现金红利发放日
A股	2020/6/3	-	2020/6/4	2020/6/4
B股	2020/6/8	2020/6/3		2020/6/19

四、分配实施办法
1.实施办法
（1）无限售条件流通股的红利委托中国结算上海分公司通过其资金清算系统向股权登记日上海证券交易所收市后登记在册并在上海证券交易所各会员办理了指定交易的股东派发。已办理指定交易的投资者可于红利发放日在其指定的证券营业部领取现金红利，未办理指定交易的股东红利暂由中国结算上海分公司保管，待办理指定交易后再进行派发。
（2）派送红股或转增股本的，由中国结算上海分公司根据股权登记日上海证券交易所收市后登记在册股东持股数，按比例直接计入股东账户。
2.自行发放对象
公司控股股东上海市北高新（集团）有限公司的现金红利，由本公司直接发放。
3.扣税说明
A股股东的现金红利发放
(1) 对于持有A股的自然人股东和证券投资基金，根据《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税［2015］101号）和《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知（财税［2012］85号）》的有关规定，公司暂不扣缴个人所得税，实际派发每股现金红利人民币0.012元。自然人股东及证券投资基金在股权登记日后转让股票时，中国结算上海分公司根据其持股期限计算应纳税额，由证券公司等股份托管机构从个人资金账户中扣收并划付中国结算上海分公司，中国结算上海分公司于次月5个工作日内划付本公司，公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报纳税。具体实际税负为：持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额，实际税负为20%；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额，实际税负为10%；持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。
(2)对于持有A股限售股的自然人股东和证券投资基金，根据《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2012]85号）的有关规定，解禁后取得的股息红利，按照该通知规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息红利暂减按50%计入应纳税所得额，适用20%的税率计征个人所得税，即按10%的税率代扣代缴所得税，税后每股实际派发现金红利为人民币0.0108元。
(3)对于合格境外机构投资者（QFII）股东，公司根据国家税务总局《关于中国居民企业向QFII支付股息、红利、利息代扣代缴企业所得税有关问题的通知》（国税函[2009]47 号）的有关规定，按照10%的企业所得税率代扣企业所得税，扣税后实际派发现金红利为每股人民币0.0108元。
(4)对于香港市场投资者投资上海证券交易所本公司A股股票（“沪股通”），公司根据《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》（财税［2014］81号）的有关规定，按照10%的税率代扣所得税，扣税后实际派发每股现金红利人民币0.0108元。
(5)对于其他机构投资者和法人股东，公司不代扣代缴企业所得税，其股息红利所得税 由其自行缴纳，实际派发现金红利为税前每股人民币0.012元。
B股股东的现金红利发放
B股股东的现金红利由本公司委托中国结算上海分公司发放，B股现金红利以美元支付。根据《境内上市外资股规定实施细则》的规定，美元与人民币汇率按公司2019年年度股东大会决议日下一工作日（2020年5月8日）中国人民银行公布的美元兑换人民币中间价（1:7.0788）折算，每股现金红利0.001695美元（含税）。
（1）非居民企业股东，根据国家税务总局2009年7月24日发布的《关于非居民企业取得B股等股票股息征收企业所得税问题的批复》（国税函[2009]394号）的有关规定，公司在向B股非居民企业股东发放2019年度现金红利时，按10%的税率代扣代缴企业所得税，扣税后每股实际发放的现金红利为0.001526美元；
（2）居民自然人股东，根据2015年9月7日财政部发布的《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税［2015］101号）和2012年11月16日财政部发布的《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》（财税[2012]85号）的规定，公司派发股息红利时，暂不扣缴个人所得税，待个人转让股票时，中国结算上海分公司根据其持股期限计算应纳税额，由证券公司等股份托管机构从个人资金账户中扣收并划付登记结算公司，中国结算上海分公司于次月5个工作日内划付本公司，本公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳。
（3）外籍自然人股东，根据财政部、国家税务总局1994年5月13日发布的《关于个人所得税若干政策问题的通知》（财税字[1994]20号）的规定，外籍个人从外商投资企业取得的股息、红利所得暂免征收个人所得税，按照每股现金红利0.001695美元发放。
五、有关咨询办法
联系人：胡申 姚挺
联系地址：上海市江场三路262号1楼
联系部门：董事会办公室
联系电话：021-66528130 传真：021-56770134
特此公告。

上海市北高新股份有限公司
董事会
2020年5月29日

本公司及董事会全体成员保证公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

证券代码：002792　证券简称：通宇通讯　公告编号：2020-032

广东通宇通讯股份有限公司2019年年度股东大会决议公告

特别提示：
1、本次股东大会无否决议案或修改议案的情况；
2、本次股东大会不涉及变更以往股东大会已通过的决议。
一、会议召开和出席情况
1、会议召开时间
（1）现场会议时间：2020年5月28日（星期四）14:30；
（2）网络投票时间：2020年5月28日。
其中，通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为2020年5月28日上午9:30—11:30，下午13:00—15:00；通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为：2020年5月28日上午9:15至下午15:00期间的任意时间。
2、召开地点：广东省中山市火炬开发区东镇东二路1号公司会议室
3、召开方式：现场表决与网络投票相结合的方式
4、召集人：公司董事会
5、主持人：董事刘木林先生
6、本次股东大会的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和《广东通宇通讯股份有限公司章程》的规定。
二、会议出席情况
股东出席的总体情况：
通过现场和网络投票的股东6人，代表股份131,146,670股，占上市公司总股份的38.8191%。
其中：通过现场投票的股东5人，代表股份128,636,750股，占上市公司总股份的38.0762%。
通过网络投票的股东1人，代表股份2,509,920股，占上市公司总股份的0.7429%。
中小股东出席的总体情况：
通过现场和网络投票的股东3人，代表股份2,516,620股，占上市公司总股份的0.7449%。
其中：通过现场投票的股东2人，代表股份6,700股，占上市公司总股份的0.0020%。
通过网络投票的股东1人，代表股份2,509,920股，占上市公司总股份的0.7429%。
受新型冠状病毒肺炎疫情影响，为维护股东及参会人员健康安全，部分股东及股东代表、部分董事、监事及高级管理人员通过腾讯会议系统以视频方式出席、列席现场会议。
北京市中伦（深圳）律师事务所兰天阳律师、郭嘉昀律师通过腾讯会议系统以视频方式列席现场会议并进行见证。
三、议案审议和表决情况
本次股东大会以现场投票和网络投票相结合的表决方式审议通过了以下议案：
议案1.00《关于2019年度