财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要

2019年第1号

基金管理人：财通证券资产管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

【重要提示】

财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2018年1月8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】79号文准予募集注册。本基金的基金合同于2018年8月10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产生的流动性风险，流动性风险指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险；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基金份额数不得达到或超过基金份额总数的40%，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40%的除外。

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2月9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。

裴根财先生，董事，1966年2月出生，中共党员，国际金融学硕士。历任浙江证券营业总部总经理助理，浙江证券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，财通证券有限责任公司总经理助理兼经纪业务总部总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事、财通证券股份有限公司总经理助理。

夏理芬先生，董事，1968年7月生，中共党员，经济学学士、工商管理硕士，高级经济师。曾任中信金通证券有限责任公司总经理助理、合规总监、运营管理部总经理，中信证券（浙江）有限责任公司执行总经理、合规总监、江西分公司总经理。现任财通证券资产管理有限公司董事、财通证券股份有限公司首席风险官。

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，自2018年3月15日起任财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，自2018年5月22日起任财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金基金经理，自2018年5月29日起任财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。

5、固收公募业务投资决策委员会成员

委员：马晓立（总经理）
宫志芳（基金经理）
李杰（固收公募投资部总监）

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）
于洋（权益公募投资部基金经理）
王丝语（权益研究部副总监）

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：中国工商银行股份有限公司
住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
首次注册登记日期：1984年1月1日
注册资本：人民币35,640,625.71万元
法定代表人：易会满
基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号
联系人：郭明
电话：（010）66105799

2、主要人员情况

截至2018年6月，中国工商银行资产托管部共有员工212人，平均年龄33岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自1998年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2017年末，中国工商银行共托管证券投资基金815只。自2003年以来，中国工商银行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的51项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

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
网上直销交易平台联系人：陈浩
电话：（0571）89720139
传真：（0571）85104360
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

（1）中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
联系人：杨菲
电话：（010）66107900
传真：（010）66107914
客服电话：95588
网址：www.icbc.com.cn

（2）财通证券股份有限公司
注册地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601–1615,1701–1716室
办公地址：浙江省杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心201,501,502,1103,1601–1615,1701–1716室
法定代表人：陆建强
联系人：章力彬
电话：（0571）87825100
客服电话：95336
网址：www.ctsec.com

（3）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2层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦金座
法定代表人：其实
联系人：胡阀
电话：（021）54509988
传真：（021）64385308
客服电话：4001818188
网址：www.1234567.com.cn

（4）华金证券股份有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路759号30层
法定代表人：宋卫东
联系人：秦臻
电话：021–20655593
客服电话：400–8211–357
网址：www.huajinsc.cn

（5）上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区欧阳路196号26号楼2楼41号
办公地址：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦9楼
法定代表人：杨文斌
联系人：高源
电话：021–36696312
客服电话：4007009665
网址：www.ehowbuy.com

（6）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室
办公地址：浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座2楼
法定代表人：陈柏青
联系人：宋畅
电话：（0571）26888888–37494
客服电话：4000–766–123
网址：www.fund123.cn

（7）北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008–1012
办公地址：北京市海淀区丹棱街6号中关村金融大厦10层1008号
法定代表人：赵荣春
联系人：崔丁元
电话：（010）57418813
传真：（010）57569671
客服电话：4008936885
公司网址：www.qianjing.com

（8）南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1–5号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1–5号
法定代表人：刘汉青
联系人：王锋
电话：025–66996699–887226
客服电话：95177
网址：www.snjijin.com

（9）天津国美基金销售有限公司
注册地址：天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1–28层2801
办公地址：天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1–28层2801
法定代表人：丁东华
联系人：牛淑新
电话：010–59287859
客服电话：4001110889
网址：www.gomefund.com

（10）北京植信基金销售有限公司
注册地址：北京市密云县盛南路8号院2号楼106室–67
办公地址：北京朝阳区四惠盛世龙源国食苑10号楼
法定代表人：于龙
联系人：张喆
电话：010–56075718
客服电话：4006802123
网址：www.zhixin–inv.com

（11）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
办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元
法定代表人：郑毓栋
联系人：陈铭洲
电话：18513699505
客服电话：4006180707
网址：www.hongdianfund.com

（12）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
办公地址：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
法定代表人：李昭琛
联系人：李唯
电话：86–10–62675369
客服电话：010–62675369
网址：https://trade.xincai.com/web/promote

（13）上海大智慧基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
法定代表人：申健
联系人：施燕华
电话：18901685505
客服电话：021–20219997
网址：http://www.gw.com.cn/

（14）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
办公地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2–45室
法定代表人：钱昊旻
联系人：毛健
电话：18618204816
客服电话：4008909998
网址：www.jnlc.com

（15）珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室–3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1201–1203室
法定代表人：肖雯
联系人：邱湘湘
电话：020–89629099
客服电话：020–89629066
网址：www.yingmi.cn

（16）上海云湾基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区金桥路27号13号楼2层
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区金桥路27号13号楼2层
法定代表人：戴新装
联系人：王宁
电话：18756535850
客服电话：400–820–1515
网址：www.zhengtongfunds.com

（17）中民财富基金销售（上海）有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
办公地址：上海市黄浦区中山南路100号7层05单元
法定代表人：弭洪军
联系人：黄鹏
电话：18521506916
客服电话：4008765716
网址：www.cmiwm.com

（18）北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市背景经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市背景经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
法定代表人：周斌
联系人：陈霞
电话：15249236571
客服电话：400–8980–618
网址：www.chtfund.com

（19）上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址：上海市浦东新区浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
联系人：党敏
电话：17717603276
客服电话：4008202899
网址：http://www.erichfund.com/

（20）苏州财路基金销售有限公司
注册地址：苏州高新区华佗路99号6幢1008室
办公地址：苏州高新区华佗路99号6幢1008室
法定代表人：高志华
联系人：喻明明
电话：15151469818
客服电话：400–0512–800
网址：www.cai6.com

（21）北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
联系人：侯芳芳
电话：010–61840688
客服电话：400–159–9288
网址：danjuanapp.com/

（22）上海中正达广基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室
法定代表人：黄欣
联系人：戴珉微
电话：021–33768132–801
客服电话：400–6767–523
网址：http://www.zzwealth.cn/

（23）北京唐鼎耀华基金销售有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
法定代表人：张冠宇
联系人：王丽敏
电话：010–85932810
客服电话：400–819–9868
网址：www.tdyhfund.com

（24）浙江同花顺基金销售有限公司
注册地址：杭州市文二西路1号903室
办公地址：杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼4楼
法定代表人：凌顺平
联系人：吴强
电话：（0571）88911818
传真：（0571）86800423
客服电话：4008–773–772
网址：www.5ifund.com

（25）通华财富（上海）基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦7楼
法定代表人：沈丹义
联系人：翟良柱
电话：15618836518
客服电话：400–101–9301
网址：www.tonghuafund.com

（26）上海挖财基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：上海市浦东区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼5楼
法定代表人：冷飞
联系人：孙琦
电话：021–50810673
客服电话：021–50810673
网址：www.wacaijijin.com

（27）凤凰金信（银川）基金销售有限公司
注册地址：宁夏银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402办公用房
办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院18号楼
法定代表人：张旭
联系人：汪莹
电话：010–58160084
客服电话：400–810–5919
网址：www.fengfd.com

（28）乾道盈泰基金销售(北京)有限公司
注册地址：北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
办公地址：北京市西城区德外大街合生财富广场
法定代表人：董云巍
联系人：张璐
电话：18335772997
客服电话：400–088–8080
网址：www.qiandaojr.com

（29）上海万得基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路33号11楼B座
办公地址：上海市浦东新区浦明路1500号
法定代表人：王延富
联系人：徐亚丹
电话：021–20700800
客服电话：400–799–1888
网址：www.520fund.com.cn

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

财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金

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国内依法发行上市的债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、国债期货、货币市场工具以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金不参与一级市场新股申购或增发新股，也不直接从二级市场上买入股票、权证，但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易可转债而产生的权证。因上述原因持有的股票和权证，本基金应在其可交易之日起的10个交易日内卖出。

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，在每次开放期前一个月、开放期及开放期结束后一个月的期间内，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取价值相对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）可转换债券投资策略

可转换债券兼具股票资产与债券资产的特点，具有抵御下行风险、分享股价上涨收益的优势。本基金着重对可转换债券对应的基础股票进行分析与研究，重点关注盈利能力或成长前景较好的上市公司的转债，确定不同市场环境下可转换债券股性和债性的相对价值，同时考虑到可转换债券的发行条款、安全边际、流动性等特征，选择合适的投资品种，分享正股上涨带来的收益。

（3）可交换债券投资策略

本基金将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债的战略结构性投资机遇，适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会，选择最具吸引力标的进行配置。

（4）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

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	基金投资	–	–
3	固定收益投资	1,116,716,614.10	97.00
	其中：债券	1,046,716,614.10	90.92
	资产支持证券	70,000,000.00	6.08
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	6,261,053.15	0.54
8	其他资产	28,242,177.28	2.45
9	合计	1,151,219,844.53	100.00

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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、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	–	–
	其中：政策性金融债	–	–
4	企业债券	661,268,884.00	87.19
5	企业短期融资券	102,777,700.00	13.55
6	中期票据	276,011,000.00	36.39
7	可转债（可交换债）	6,659,030.10	0.88
8	同业存单	–	–
9	其他	–	–
10	合计	1,046,716,614.10	138.01

注：由于四舍五入的原因金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	122392	15恒大02	500,000	50,220,000.00	6.62
2	124201	PR南高速	1,200,000	48,492,000.00	6.39
3	124952	14马高新	600,000	36,888,000.00	4.86
4	124947	14西港债	600,000	36,636,000.00	4.83
5	1480265	14象山债	500,000	31,515,000.00	4.16

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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	149808	借呗55A1	700,000	70,000,000.00	9.23

注：本基金本报告期末只持有上述一只资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

10、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11、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）其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	45,574.94
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	–
4	应收利息	28,196,602.34
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	其他	–
8	合计	28,242,177.28

（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

（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。

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、本报告期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

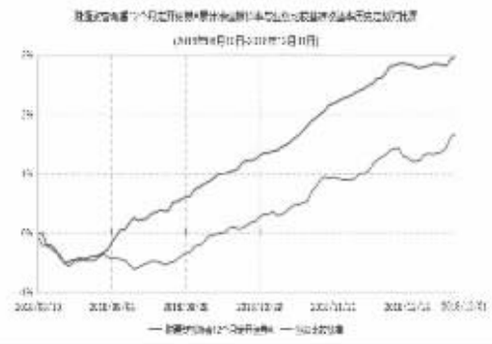
财通资管鸿睿12个月定开债券A净值表现

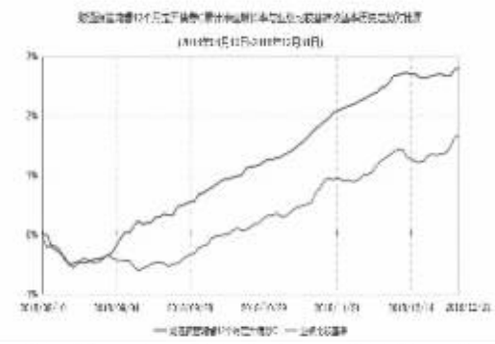
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
2018.8.10–2018.12.31	2.98%	0.05%	1.68%	0.06%	1.30%	–0.01%
过去三个月	2.34%	0.03%	1.99%	0.05%	0.35%	–0.02%
合同生效日至今（2018.12.31）	2.98%	0.05%	1.68%	0.06%	1.30%	–0.01%

财通资管鸿睿12个月定开债券C净值表现

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
2018.8.10–2018.12.31	2.82%	0.05%	1.68%	0.06%	1.14%	–0.01%
过去三个月	2.24%	0.03%	1.99%	0.05%	0.25%	–0.02%
合同生效日至今（2018.12.31）	2.82%	0.05%	1.68%	0.06%	1.14%	–0.01%

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8月10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6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。本报告期本基金处于建仓期内。

3、自基金合同生效至报告期末，财通资管鸿睿12个月定开债券A基金份额净值增长率为2.98%，同期业绩比较基准收益率为1.68%；财通资管鸿睿12个月定开债C基金份额净值增长率为2.82%，同期业绩比较基准收益率为1.68%。

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）C类基金份额的销售服务费；
（4）《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
（5）《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；
（6）基金份额持有人大会费用；
（7）基金的证券、期货交易费用；
（8）基金的银行汇划费；
（9）基金的开户费用、账户维护费用；
（10）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0.7%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.7%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资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0.15%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.15%÷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。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金资产中一次性支取。

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）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类基金份额的基金资产净值的0.40%的年费率计提。C类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

H＝E×0.40%÷当年天数
H为每日C类基金份额应计提的基金销售服务费
E为前一日C类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，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销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。

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

（:4）上述“一、基金费用的种类”中第4–10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。

（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A类基金份额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A类基金份额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A类基金份额的适用下表一般申购费率：

A类基金份额		
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

C类基金份额不收取申购费。

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