

**财通多策略精选混合型证券投资基金  
更新招募说明书摘要  
(2016年第2号)**

**基金管理人：财通基金管理有限公司**

**基金托管人：中国光大银行股份有限公司**

## 重要提示

本基金经2015年5月21日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]944号文准予募集注册。本基金基金合同于2015年7月1日正式生效。

基金管理人保证本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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者认购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书,全面认识本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资者自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险,包括市场风险、管理风险、估值风险、流动性风险、本基金的特定风险和其他风险等。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。基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。

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。

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并不构成对本基金业绩表现的保证。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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。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日为2016年7月1日,有关财务数据截止日为2016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

本基金管理人为财通基金管理有限公司，基本信息如下：

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

成立日期：2011 年 6 月 21 日

法定代表人：阮琪

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币贰亿元

联系人：刘未

联系电话：021-2053 7888

股权结构：

股 东	出资额 (万元人民币)	出资比例 (%)
财通证券股份有限公司	8,000	40
杭州市实业投资集团有限公司	6,000	30
浙江升华拜克生物股份有限公司	6,000	30
合 计	20,000	100

### (二) 主要人员情况

#### 1、董事会成员：

阮琪先生，董事长，工商管理硕士，高级会计师。历任浙江省杭州市财政局综合计划处副处长，处长兼杭州市财政局国债服务部主任，社会保障处处长，财通证券股份有限公司副总经理，现任财通证券股份有限公司总经理。

刘未先生，董事，浙江大学经济学硕士。历任财通证券经纪有限责任公司营业部总经理，财通证券经纪有限责任公司经纪业务管理部总经理，原财通证券有限责任公司（现财通证券股份有限公司）基金筹建部负责人，财通基金管理有限公司副总经理、常务副总经理，现任财通基金管理有限公司总经理。

骆旭升先生，董事，技术经济及管理研究生，高级工程师。历任杭州武林实业总公司副总经理，杭州轻工控股（集团）有限公司科技处副处长，原杭州市工业资产经营投资集团有限公司（现杭州市实业投资集团有限公司）副总经理、总经理。

吴梦根先生，董事，EMBA，高级经济师。历任湖州市经济体制改革委员会副主任，升华集团控股有限公司副总经理、总经理，浙江升华拜克生物股份有限公司董事长、副董事长，现任升华集团控股有限公司董事、总裁，升华集团德清华源颜料有限公司副董事长。

朱颖女士，独立董事，高级会计师，复旦大学会计专业硕士学历。中国注册会计师协会专家库专家，上海市徐汇区金融办上市专家顾问，上海立信会计学院兼职教授、硕士生导师等。现任立信会计师事务所高级合伙人。

姚先国先生，独立董事，经济学硕士。历任浙江大学对外经济贸易学院、经济学院教授、常务副院长，浙江大学公共管理学院教授、院长，浙江大学公共政策研究院院长。

朱洪超先生，独立董事，法律硕士。历任上海市第一律师事务所律师，上海市联合律师事务所主任，上海仲裁委员会委员、仲裁员，中华全国律师协会理事。

## 2、职工监事：

杨铁军先生，职工监事，监察稽核部总监、法学硕士。执业律师，历任金元比联基金管理有限公司监察稽核部副总监、财通基金管理有限公司监察稽核部副总监，现任财通基金管理有限公司监察稽核部总监。

## 3、经营管理层人员：

刘未先生，总经理（简历同上）。

王家俊先生，常务副总经理，中山大学高级工商管理硕士。历任东方证券遵义路营业部市场部经理，汇添富基金南方大区经理及券商渠道负责人、南方分公司总经理、全国渠道销售总监兼华东分公司总经理、财通基金副总经理兼市场总监。现任财通基金管理有限公司常务副总经理。

#### 4.督察长

黄惠女士，工商管理硕士、EMBA。历任张家界旅游股份有限公司董事会秘书，方正证券有限责任公司北京代表处主任，中国证券投资者保护基金有限公司高级经理。现任财通基金管理有限公司督察长、工会委员会主席。

#### 5、基金经理

焦庆先生，哈尔滨工业大学管理学博士。历任深圳飞亚达集团华东区域经理、市场部副总经理，西部证券资产管理部煤炭、电力设备研究员，天治基金煤炭、商业高级研究员，上海泽熙投资煤炭、新能源高级研究员，上海聚益投资研究副总监。曾任财通基金管理有限公司研究部总监助理、副总监。现任基金投资部基金经理。

姚思劼先生，复旦大学理学学士、管理学硕士。2011年7月加入财通基金管理有限公司，历任财通基金管理有限公司助理研究员、研究员，研究行业覆盖汽车、机械、公用事业等，重点关注高端装备制造等战略新兴产业，现任基金投资部基金经理。

#### 6、投资决策委员会成员：

刘未先生，总经理；

王家俊先生，常务副总经理；

吴成勇先生，总经理助理、投资总监；

金梓才，基金投资部副总监。

陆玲玲女士，研究部副总监；

7、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：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

设立日期：1992 年 8 月 18 日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行，银复 1992[152]号

组织形式：股份有限公司

注册资本：404.3479 亿元人民币

法定代表人：唐双宁

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75 号

投资与托管部总经理：曾闻学

托管部门联系人：李宁

电话：(010) 63636363

传真：(010) 63639132

网址：www.cebbank.com

## (二) 主要人员情况

法定代表人唐双宁先生，历任中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长、中国人民银行沈阳市分行行长，中国人民银行信贷管理司司长、货币金银局局长、银行监管一司司长，中国银行业监督管理委员会副主席，中国光大（集团）总公司董事长、党委书记等职务。现任十二届全国人大农业与农村委员会副主任，十一届全国政协委员，中国光大集团股份公司董事长、党委书记，中国光大集团有限公司董事长，兼任中国光大银行股份有限公司董事长、党委书记，中国光大控股有限公司董事局主席，中国光大国际有限公司董事局主席。

行长张金良先生，曾任中国银行财会部会计制度处副处长、处长、副总经理兼任 IT 蓝图实施办公室主任、总经理，中国银行北京市分行行长、党委书记，中国银行副行长、党委委员。现任中国光大集团股份公司党委委员，兼任中国光大银行行长、党委副书记。

曾闻学先生，曾任中国光大银行办公室副总经理，中国光大银行北京分

行副行长。现任中国光大银行股份有限公司投资托管部总经理。

### (三) 基金托管业务经营情况

截至 2016 年 6 月 30 日,中国光大银行股份有限公司托管国投瑞银创新动力股票型证券投资基金、国投瑞银景气行业证券投资基金、国投瑞银融华债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫资源优选混合型证券投资基金(LOF)、摩根士丹利华鑫基础行业证券投资基金、工银瑞信保本混合型证券投资基金、博时转债增强债券型证券投资基金、大成策略回报股票型证券投资基金、大成货币市场基金、建信恒稳价值混合型证券投资基金、光大保德信量化核心证券投资基金、光大保德信添天利季度开放短期理财债券型证券投资基金、国联安双佳信用分级债券型证券投资基金、泰信先行策略开放式证券投资基金、招商安本增利债券型证券投资基金、中欧新动力股票型证券投资基金(LOF)、国金通用国鑫灵活配置混合型发起式证券投资基金、农银汇理深证 100 指数增强型证券投资基金、益民核心增长灵活配置混合型证券投资基金、建信纯债债券型证券投资基金、兴业商业模式优选股票型证券投资基金、工银瑞信保本 2 号混合型发起式证券投资基金、国金通用沪深 300 指数分级证券投资基金、中加货币市场基金、益民服务领先灵活配置混合型证券投资基金、建信健康民生混合型证券投资基金、鑫元一年定期开放债券型证券投资基金、江信聚福定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、国金通用鑫安保本混合型证券投资基金、鑫元合享分级债券型证券投资基金、鑫元半年定期开放债券型证券投资基金、东方红睿阳灵活配置混合型证券投资基金、建信信息产业股票型证券投资基金、泓德优选成长混合型证券投资基金、东方新策略灵活配置混合型证券投资基金、光大保德信鼎鑫灵活配置混合型证券投资基金、中融新动力灵活配置混合型证券投资基金、红塔红土盛金新动力灵活配置混合型证券投资基金、金鹰产业整合灵活配置混合型证券投资基金、国金通用鑫运灵活配置混合型证券投资基金、大成景裕灵活配置混合型证券投资基金、财通多策略精选混合型证券投资基金、鹏华添利宝货币市场基金、江信同福灵活配置混合型证券投资基金、



光大保德信耀钱包货币市场基金、大成景沛灵活配置混合型证券投资基金、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金、中加心享灵活配置混合型证券投资基金、建信稳定丰利债券型证券投资基金、南方弘利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元兴利债券型证券投资基金、博时安泰 18 个月定期开放债券型证券投资基金、建信安心保本五号混合型证券投资基金、银华添益定期开放债券型证券投资基金、中欧强盈定期开放债券型证券投资基金、华夏恒利 6 个月定期开放债券型证券投资基金、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金、博时安怡 6 个月定期开放债券型证券投资基金、江信汇福定期开放债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、工银瑞信瑞丰纯债半年定期开放债券型证券投资基金、富国泰利定期开放债券型发起式证券投资基金、大成景荣保本混合型证券投资基金、鹏华兴华定期开放灵活配置混合型证券投资基金共 64 只证券投资基金，托管基金资产规模 1,381.42 亿元。同时，开展了证券公司资产管理计划、专户理财、企业年金基金、QDII、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的保管业务。

### 三、相关服务机构

#### (一) 销售机构

##### 1、直销机构

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：阮琪

电话：021-2053 7888

传真：021-2053 7999

联系人：刘未

客户服务电话：4008 209 888

公司网址: [www.ctfund.com](http://www.ctfund.com)

官方微信号: ctfund88

## 2、代销机构

### (1) 中国光大银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

办公地址: 北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人: 唐双宁

客服电话: 95595

公司网址: [www.cebbank.com](http://www.cebbank.com)

### (2) 中国工商银行股份有限公司

注册地址: 北京市复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

传真: 010-66107914

客服电话: 95588

公司网址: [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

### (3) 中国农业银行股份有限公司

住所: 北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 9 层

法定代表人: 蒋超良

客服电话: 95599

公司网址: [www.abchina.com/cn](http://www.abchina.com/cn)

### (4) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

公司网址：[www.cmbc.com.cn](http://www.cmbc.com.cn)

(5) 交通银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址:上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人:胡怀邦

联系人：曹榕

电话：021-58781234

传真：021-58408842

客服电话:95559

公司网址:[www.bankcomm.com](http://www.bankcomm.com)

(6) 宁波银行股份有限公司

注册地址：浙江省宁波市宁南南路 700 号

办公地址：浙江省宁波市宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

电话：0574-89068340

客服电话：962528（上海、北京 962528）

公司网址：[www.nbcb.com.cn](http://www.nbcb.com.cn)

(7) 浙江民泰商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省温岭市三星大道 168 号

办公地址：浙江省温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

联系人：刘兴龙

电话：0571-88821178

客服电话：400-8896-521

公司网址：[www.mintaibank.com](http://www.mintaibank.com)

(8) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

联系人：汤征程

电话：021-68475888

客服电话：021-962888

公司网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

(9) 财通证券股份有限公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

电话：0571-87822359

传真：0571-87818329

客服电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

公司网址：[www.ctsec.com](http://www.ctsec.com)

(10) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

客服电话：400-8888-666

公司网址：www.gtja.com

(11) 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

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

电话：021-33389888

传真：021-33388224

客服电话：95523 或 4008895523

公司网址: www.swhysc.com

(12) 中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址:北京市朝阳区亮马桥 48 号中信证券大厦

法定代表人:王东明

联系人:陈忠

电话:010-60838888

客服电话:95558

公司网址: www.cs.ecitic.com

(13) 中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址:北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人:王常青

联系人:魏明

电话:010-85130588

传真:010-65182261

客服电话:400-8888-108

公司网址:www.csc108.com

(14) 国信证券股份有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层至 26 层

办公地址: 深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层至 26 层

法定代表人: 何如

联系人: 齐晓燕

电话: 0755-82130833

传真: 0755-82133952

客服电话: 95536

公司网址: www.guosen.com.cn

(15) 招商证券股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38-45 层

法定代表人: 宫少林

联系人: 林生迎

电话: 0755-82960223

传真: 0755-82943636

客服电话: 400-8888-111, 95565

公司网址: www.newone.com.cn

(16) 名称: 上海证券有限责任公司

住所: 上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

客户服务电话：4008918918、021-962518

网址：[www.962518.com/www.shzq.com](http://www.962518.com/www.shzq.com)

(17) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

客服电话：400-8001-001

公司网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(18) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

联系人：刘晨、李芳芳

电话：021-22169999

传真：021-22169134

客服电话：95525、400-8888-788

公司网址：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

(19) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

客服电话：400-8888-123

公司网址：[www.xyzq.com.cn](http://www.xyzq.com.cn)

(20) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：上海浦东新区世纪大道 1589 号长泰国际金融大厦 11 楼

法定代表人：朱科敏

联系人：梁旭

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

客服电话：400-8888-588

公司网址：[www.longone.com.cn](http://www.longone.com.cn)

(21) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

联系人：陈敏

电话：021-32229888

客服电话：021-63340678

公司网址：[www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

(22) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 号



法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

电话：0755-83516289

传真：0755-83515567

客服电话：400-6666-888

公司网址：[www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(23)东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市苏州工业园区翠园路 181 号

办公地址：江苏省苏州市苏州工业园区翠园路 181 号

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：0512-65581136

传真：0512-65588021

客服电话：0512-33396288

公司网址：[www.dwzq.com.cn](http://www.dwzq.com.cn)

(24) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼

第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户服务热线：0532-96577

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

(25) 信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：[www.cindasc.com](http://www.cindasc.com)

(26) 中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院 5 号楼

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：赵大建

传真：010-5643 7030

客服电话：4008895618

公司网站：[www.e5618.com](http://www.e5618.com)

(27) 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大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

联系人：沈雯斌

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

公司网站：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(28) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903～  
906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

联系电话：021-58870011

传真：021-68596916

客服电话：400-700-9665

公司网站：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(29) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市金山区廊下镇漕廊公路 7650 号 205 室

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴银城中路 68 号时代金融中心 8 楼 801

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38602377

传真：021-38509777

客服电话：400-821-5399

公司网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(30) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市翠柏路 7 号杭州电子商务产业园 2 楼

法定代表人：凌顺平

联系人：杨翼

联系电话：0571-88911818-8653

传真：0571-86800423

客服电话：0571-88920897

公司网站：www.ijijin.cn

(31) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

联系人：周瑾旻

电话：0571-28829790，021-60897869

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(32) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

办公地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn/www.jjmmw.com

(33) 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：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

联系人：颜玲

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话:400-1818-188

天天基金网址:www.1234567.com.cn

(34) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27/28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27/28 层

法定代表人：丁学东

存续期间：持续经营

电话：010-65051166

传真：010-65051156

公司网址：www.cicc.com.cn

(35) 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 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

传真：010-57569671

客服电话：400-893-6885

公司网址：www.qianjing.com

(36) 北京展恒基金销售有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区华严北里 2 号民建大厦 6 层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

电话：13520236631

客服电话：400-888-6661

公司网址：[www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(37) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路 45 号（锦昌大厦）1 幢 10 楼 1001 室

法定代表人：陈峥

客服电话：400-068-0058

公司官网：[www.jincheng-fund.com](http://www.jincheng-fund.com)

(38) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#

办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 16 层

法定代表人：杨懿

传真：010-58325282

联系人：文雯

电话：010-83363101

客服电话：400-166-1188

公司网址：<http://www.jrj.com.cn/>

(39) 中经北证（北京）资产管理有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 5 号楼 1 层

办公地址：北京市西城区车公庄大街 4 号 1 号楼 1 层

法定代表人：徐福星

传真：010-68292941

联系人：陈莹莹

电话：010-68998820-8306

客服电话：400-600-0030

公司网址：[www.bzfunds.com](http://www.bzfunds.com)

(40) 上海联泰资产管理有限公司

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

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 号楼 3 层

法定代表人： 燕斌

传真：021-52975270

联系人：凌秋艳

电话：021-52822063

客服电话：4000-466-788

公司网址：[www.66zichan.com](http://www.66zichan.com)

(41) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830

客服电话：400-820-2819

公司网址：<https://tty.chinapnr.com/>

(42) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客服电话：400-821-9031

公司网址：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(43) 泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：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

法定代表人：林卓

联系人：薛长平

电话：0411-88891212

传真：0411-88891212-122

客服电话：4006411999

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

(44)上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

联系人：李晓明

电话：021-63333319

传真：021-63332523

客服电话：400178000

(45)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 12 楼

B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：吴煜浩

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：[www.yingmi.cn](http://www.yingmi.cn)



(46)大泰金石投资管理有限公司

注册地址:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15层

法定代表人:袁顾明

联系人:朱真卿

电话:021-22267943

传真:021-22268089

客服电话:4009282266

网址:www.dtfunds.com

(47)北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室

办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层

法定代表人:梁越

联系人:张晔

电话:010-56810307

传真:010-56810630

客服电话:4008-980-618

网址:www.chtfund.com

(48)嘉实财富管理有限公司

注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元

办公地址:北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人:赵学军

联系人:于永健

电话:010-85097570

传真:010-85097308

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

(49) 西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

客服电话：95355

公司网址：www.swsc.com.cn

(50) 湘财证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋  
11 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋  
11 楼

法定代表人：林俊波

联系人：李欣

电话：021-68634510-888193

传真：021-68865680

客服电话：400-888-1551

公司网址：<http://www.xcsc.com/>

(51) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219290  
传真：021-23219000  
客服电话：95553  
公司网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(52) 德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼  
办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼  
法定代表人：姚文平  
传真：021-68767880  
客服电话：021-68761616  
公司网站：[www.tebon.com.cn](http://www.tebon.com.cn)

(53) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦  
办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦  
法定代表人：杨泽柱  
联系人：奚博宇  
电话：021-68751860  
传真：027-85481900  
客服电话：95579  
公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

(54) 西藏同信证券股份有限公司

注册地址：上海市永和路 188 弄 24 号楼  
办公地址：上海市永和路 188 弄 24 号楼  
法定代表人：贾绍君  
电话：021-36537924  
传真：021-36538467

客服电话：400-881-1177

公司网址：<http://www.xzsec.com/>

(55) 平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

联系人：吴琼

电话：0755-22621866

传真：0755-82400862

客服电话：95511

公司网址：<http://stock.pingan.com>

(56) 大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12、13 层

法定代表人：董祥

联系人：刘亮

电话：0351-7219862

传真：0351-7219891

公司网址：<http://www.dtsbc.com.cn/>

(57) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号

办公地址：福建省福州市湖东路 154 号

法定代表人：高建平

传真：0591-87841932

客服电话：95561

公司网址：[www.cib.com.cn](http://www.cib.com.cn)

## (58)上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533

传真：86-021-50583633

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

客户服务中心电话：400-067-6266

## (59)平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：谢永林

客服电话：95511

公司网址：<http://stock.pingan.com>

## (60)国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

客服电话：95310

公司网址：[www.gjzq.com.cn](http://www.gjzq.com.cn)

## (61)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：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层

联系人：赵源

电话：010-59336542  
传真：010-59336500  
客服电话：4008909998  
公司网址：www.jnlc.com

(62)奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室、1116室及1307室

联系人：叶健  
电话：0755-89460507  
传真：0755-21674453  
客服电话：400-684-0500  
公司网址：www.ifastps.com.cn

(63)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

注册地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504

办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504

联系人：陈承智  
电话：0592-3122673  
传真：0592-3122701  
客服电话：400-918-0808  
公司网址：www.xds.com.cn

(64)深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期

418 室

联系人：马力佳

电话：0755-83999907-815

传真：0755-83999926

客服电话：0755-83999907

公司网址：www.jinqianwo.cn

(65)华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市江东中路 228 号

法定代表人:周易（代为履行）

客服电话：95597

公司网址： www.htsc.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代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

电话：010-50938856

传真：010-50938907

联系人：崔巍

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：021-5115 0298

传真：021-5115 0398

联系人：刘佳

经办律师：廖海、刘佳

（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：毛鞍宁

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

邮政编码：200120

公司电话：（021）22288888

公司传真：（021）22280000

签章会计师：郭杭翔、蒋燕华

业务联系人：郭杭翔

#### 四、基金名称

财通多策略精选混合型证券投资基金

#### 五、基金的类型

混合型证券投资基金

#### 六、基金的投资目标

本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机



会，力争为基金份额持有人创造绝对收益和长期稳定的投资回报。

## 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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、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：股票资产比例为基金资产净值的 30%~95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产净值的 0%~70%；转换为上市开放式基金（LOF）后，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%。

## 八、投资策略

### 1、资产配置策略

本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。

本基金进行综合分析的各项指标和因素主要包括：基本面分析方面主要包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面分析方面主要包括存款准

准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等各项货币政策，财政支出总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策；金融市场分析方面主要包括市场投资者参与度、市场资金供求变化、市场估值水平等。

## 2、股票投资策略

本基金在不同市场环境下，将灵活运用成长、主题、定向增发、动量等多种投资策略。其中，成长策略重在自下而上的进行公司成长性基本面研究，主题策略重在自上而下的开展投资主题分析，定向增发策略重在关注与上市公司定向增发事件关联的投资机会，动量策略重在捕捉市场动量效应驱动的投资机会。本基金通过以上多种策略的综合运用，精选具有估值优势的个股建立投资组合。

### (1)成长策略

本基金对成长型公司的投资以新兴产业、处于周期性景气上升阶段的拐点行业以及持续增长的传统产业为重点，并精选其中行业代表性高、潜在成长性好、估值具有吸引力的个股进行投资。对于新兴产业，在对产业结构演变趋势进行深入研究和分析的基础上，准确把握新兴产业的发展方向，重点投资体现行业发展方向、拥有核心技术、创新意识领先并已经形成明确盈利模式的公司；对于拐点产业，依据对行业景气变化趋势的研究，结合投资增长率等辅助判断指标，提前发现景气度进入上升周期的行业，重点投资拐点行业中景气敏感度高的公司；对于传统产业，主要关注产业增长的持续性、企业的竞争优势、发展战略以及潜在发展空间，重点投资具有清晰商业模式、增长具有可持续性和不可复制性的公司。

### (2)主题策略

本基金通过对经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘潜在的投资主题，并选择那些受惠于投资主题的公司进行投资。首先，从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发，分析经济结构、产业结构或企业商业运作模式变化的根本性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素，从而前瞻性地发掘经济发展过程中的投资主题；其次，通过对投资主题的全面分析和评估，明确投资主题所对应的主题行业或主题板块，从而确定受惠于相关主题的公司，依据企业对投资主题

的敏感程度、反应速度以及获益水平等指标，精选个股；再次，通过紧密跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变化，不断地挖掘和研究新的投资主题，并对主题投资方向做出适时调整，从而准确把握新旧投资主题的转换时机，充分分享不同投资主题兴起所带来的投资机遇。

### （3）定向增发策略

定向增发是指上市公司向特定投资者（包括大股东、机构投资者、自然人等）非公开发行股票的方式。本基金将对进行非公开发行的上市公司进行基本面分析，结合市场未来走势进行判断，从战略角度评估参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水平，积极参与风险较低的定向增发项目。在定向增发股票锁定期结束后，本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。

### （4）动量策略

动量策略是指市场在一定时期内可呈现“强者恒强”的特征，通过买入过去一段时期的强势股可以获得超越市场平均水平的收益。本基金将综合分析各股票的市场价格动量特征，分析指标包括各股票的阶段累计收益率、换手率、市场交易活跃度、波动率，选择动量特征明显和价格趋势强劲的个股纳入投资组合，作为本基金的辅助投资策略。

## 3、固定收益类资产投资策略

固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

### （1）利率预期与久期控制策略

本基金密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略，如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

## (2) 个券选择策略

个券选择层面，对各信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后，进行个券选择。财务分析方面，以企业财务报表为依据，对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分；非财务分析方面（包括管理能力、市场地位和发展前景等指标）则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。

## (3) 时机策略

i. 价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性，建立债券的估值模型，对当日无交易的债券计算理论价值，买进价格低于价值的债券；相反，卖出价格高于价值的债券。

ii. 骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时，也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。

iii. 息差策略。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。

iv. 利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析，对利差水平的未来走势做出判断，从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

## 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。

## (四) 投资限制

### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

(1) 股票资产比例为基金资产净值的 30%~95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产净值的 0%~70%；

(2) 转换为上市开放式基金（LOF）后，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%；

(3) 本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；

(5) 本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%；

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；

(9) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的 20%；

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的 10%；

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%；

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出；

(13) 基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的

总量；

(14) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%；

(15) 本基金总资产不得超过基金净资产的 140%；

(16) 法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。法律法规另有规定的，从其规定。

本基金持有证券期间，如发生证券处于流通受限状态等非基金管理人原因导致基金投资比例不符合前述规定的，基金管理人应在上述情形消除后的 10 个交易日内调整完毕。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人应当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基金合同的有关约定。期间，基金的投资范围、投资策略应当符合《基金合同》的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制，但须提前公告，不需要经基金份额持有人审议。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

- (1) 承销证券；
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保；
- (3) 从事承担无限责任的投资；
- (4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；
- (5) 向其基金管理人、基金托管人出资；
- (6) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

(7) 依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。

运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当遵循基金份额持有人利益优先的原则，防范利益冲突，符合国务院证券监督管理机构的规定，并履行信息披露义务。

## 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率  $\times 55\%$  + 上证国债指数收益率  $\times 45\%$

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、基金的风险收益特征

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。

基金托管人中国光大银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年7月19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2016年6月30日。

#### 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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,483,513,877.24	88.31
	其中：股票	2,483,513,877.24	88.31
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	328,194,028.11	11.67



8	其他资产	664,249.02	0.02
9	合计	2,812,372,154.37	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	1,813,000.00	0.07
B	采矿业	—	—
C	制造业	1,199,988,208.38	43.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,778,803.51	0.57
E	建筑业	307,523,295.62	11.05
F	批发和零售业	50,926,880.47	1.83
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	455,669,463.75	16.37
J	金融业	81,759,309.24	2.94
K	房地产业	258,957,558.69	9.30
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	57,860,697.02	2.08
R	文化、体育和娱乐业	1,037,500.00	0.04
S	综合	52,199,160.56	1.88
	合计	2,483,513,877.24	89.23

### 2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

### 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	002426	胜利精密	23,034,397	210,995,076.52	7.58
2	002023	海特高新	11,500,460	199,302,971.80	7.16
3	002230	科大讯飞	5,721,551	186,694,209.13	6.71
4	601186	中国铁建	18,750,000	184,875,000.00	6.64
5	600604	市北高新	8,072,654	176,871,849.14	6.35
6	600588	用友网络	7,455,429	145,977,299.82	5.24
7	300020	银江股份	6,521,738	121,304,326.80	4.36
8	601390	中国中铁	16,731,016	116,615,181.52	4.19
9	002460	赣锋锂业	4,138,144	115,702,506.24	4.16
10	000768	中航飞机	5,740,528	113,030,996.32	4.06

### 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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	593,273.26
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	70,975.76
5	应收申购款	—

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	664,249.02

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002426	胜利精密	210,995,076.52	7.58	非公开发行
2	002023	海特高新	199,302,971.80	7.16	非公开发行
3	002230	科大讯飞	186,694,209.13	6.71	非公开发行
4	601186	中国铁建	184,875,000.00	6.64	非公开发行
5	600604	市北高新	176,871,849.14	6.35	非公开发行
6	600588	用友网络	145,977,299.82	5.24	非公开发行
7	300020	银江股份	121,304,326.80	4.36	非公开发行
8	601390	中国中铁	116,615,181.52	4.19	非公开发行
9	002460	赣锋锂业	115,702,506.24	4.16	非公开发行
10	000768	中航飞机	113,030,996.32	4.06	非公开发行

#### 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。

截至报告期末，本基金通过认购上市公司非公开发行股份持有光大证券股份有限公司(光大证券，601788.SH)4,886,988股，认购价格为16.37元/股，锁定期为12个月，占本基金期末资产净值的比例为2.94%；报告期内，本基金参与申购光大证券承销股票青岛康普顿科技股份有限公司(康普顿，603798.SH)首次公开发行股份，获配数量为1,590股，配售价格为14.33元/股，并以55.7730元/股的均价卖出。光大证券系本基金基金托管人关联方。上述交易未有影响基金份额持有人利益及与基金管理人、基金托管人利益冲突情况发生。

### 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、基金的上市初费和月费；
- 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。

#### (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：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的管理费

E 为前一日的基金资产净值

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 5 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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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。

托管费收入帐户：

户 名：基金托管费收入

账 号：10010117380000001

开户银行：中国光大银行（系统支付号 303100000006）

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项纳税主体，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的截止日期信息。

##### 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) 更新了基金托管人基本情况；
- (2) 更新了主要人员情况；
- (3) 更新了基金托管业务经营情况；
- (4) 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、“十、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2016年6月30日。

##### 6、“十一、基金的业绩”部分

(1) 更新了基金业绩表现数据。

##### 7、“二十三、其他应披露事项”部分

(1) 更新了 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 7 月 1 日期间涉及本基金的相关公告。

财通基金管理有限公司

二〇一六年八月十日