

财通多策略稳健增长债券型证券投资基金
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：中国工商银行股份有限公司

重要提示

本基金的募集申请已于2012年3月31日获中国证监会证监许可【2012】427号文核准。本基金基金合同于2012年7月13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。

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，投资人根据所持有份额享受基金的收益，但同时也要承担相应的投资风险。投资有风险，投资人认购（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。基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素变化对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险及本基金的特有风险等。

本基金以“每三年为一个单位运作周期”的滚动方式运作（参见本基金合同中相关内容），通过积极主动的投资管理，有效控制投资风险，并通过精选风险资产品种进行投资，力争持续稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。

本基金属于债券型基金，不保证本金安全，也不保证最低收益，是证券投资基金中的较低风险品种，其预期的风险水平和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则，在投资人作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负责。

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预示其未来表现。

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13日,有关财务数据和净值表现截止日为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

设立日期：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 2 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：

张亦博 本基金基金经理

澳大利亚莫纳什大学风险管理学硕士，特许金融分析师（CFA）。历任德邦证券有限责任公司研究所研究员，东吴证券股份有限公司资产管理总部债券研究员、债券投资经理助理，华宝证券有限责任公司资产管理部固定收益投资经理。2015年8月加入财通基金管理有限公司。

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；

张亦博先生，固定收益部基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

名称：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

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

（二）主要人员情况

截至 2016 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 198 人，平均年龄 30 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。

（三）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 2016 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 555 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《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 49 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）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

官方微信号：ctfund88

2、代销机构

（1）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

法定代表人易会满

传真：010-66107914

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

（2）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

（3）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

（4）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

公司网址：www.nbc.com.cn

（5）杭州银行股份有限公司

注册地址：中国杭州市庆春路 46 号

办公地址：中国杭州市庆春路 46 号

法定代表人：吴太普

联系人：严峻

电话：0571-85108195

客服电话：0571-96532、4008888508

公司网址：www.hzbank.com.cn

（6）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

（7）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

（8）嘉兴银行股份有限公司

注册地址：建国南路 409 号

办公地址：建国南路 409 号

法定代表人：许洪明

联系人：陈兢

电话：0573-82082676

传真：0573-82062161

客服电话：0573-96528

公司网站：www.bojx.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

（10）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568990

客服电话：400-8888-888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（11）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

(12) 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

(13) 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

(14) 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

(15) 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

(16) 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

(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

（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

（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

（20）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址:上海市中山南路318号2号楼21层-29层

法定代表人:潘鑫军

联系人:吴宇

电话:021-63325888

传真:021-63326173

客服电话:95503

公司网址:www.dfzq.com.cn

(21) 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

(22) 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

(23) 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

(24)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

(25)中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19/20 层

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 588 号恒鑫大厦主楼 19/20 层

法定代表人：沈强

联系人：周妍

电话：0571-86078823

传真：0571-85783771

客户服务热线：0571-96598

网址：www.bigsun.com.cn

(26) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 楼

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客服电话：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

(27) 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

(28) 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

(29)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

(30) 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

(31) 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

（32）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

（33）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

（34）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:周熾旻

电话:0571-28829790, 021-60897869

传真:0571-26698533

客服电话:4000-766-123

公司网址:www.fund123.cn

(35) 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

(36) 天相投资顾问有限公司

注册地址:北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址:北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人:林义相

联系人:林爽

电话:010-66045608

传真:010-66045527

客服电话:010-66045678

天相投顾网址:www.txsec.com

天相基金网网址:www.jjm.com.cn

(37) 和讯信息科技有限公司

注册地址:北京市朝阳区朝外大街 22 号泛利大厦 10 层

办公地址:上海市浦东新区东方路 18 号保利广场 E 座 18 楼

法定代表人：王莉

联系人：周轶

电话：021-20835789

传真：021-20835879

客服电话：400-920-0022

公司网站：<http://licaike.hexun.com/>

（38）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

（39）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

（40）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

(41) 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

(42) 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

(43) 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/>

(44) 申万宏源西部证券有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客服电话：400-800-0562

网址：www.hysec.com

(45) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室

办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人：吴雪秀

传真：(010)88312877

联系人：段京璐

电话：(010)88312877

客服电话：400-001-1566

公司网址：www.yilucaifu.com

(46) 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

(47) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心
3/4 楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心
3/4 楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0752-2119700

传真：0752-2119660

客服电话：95564

网址：www.lxzq.com.cn

(48) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208

法定代表人：罗细安

传真：010-67000988-6000

联系人：李皓

电话：010-67000988

客服电话：400-001-8811

公司网址：www.zcvc.com.cn

(49) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603

法定代表人：董浩

传真：010-56580660

联系人：于婷婷

电话：010-56409010

客服电话：400-068-1176

公司网址：www.jimufund.com

(50) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 8 号华融大厦 A 座 3 层

办公地址：北京市西城区金融大街 8 号华融大厦 A 座 3 层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

电话：010-58315221

传真：010-85556153

客服电话：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

(51) 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

(52) 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/>

(53) 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

(54) 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>

(55) 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

(56)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

(57)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

(58) 中信期货有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室/14 层

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室/14 层

法定代表人：张皓

传真：0755-83217421

客服电话：400-990-8826

公司网站：<http://www.citicsf.com/>

(59)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

(60) 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

(61) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大姐东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大姐东方君座 D 座

法定代表人：庞介民

电话：0471-3953168

传真：0471-3979545

客服电话：400-196-6188

公司网址：<http://www.cnht.com.cn/>

(62) 上海朝阳永续基金销售有限公司

注册地址：浦东新区上丰路 977 号 1 幢 B 座 812 室

办公地址：上海市浦东新区张江高科碧波路 690 号 4 号楼 2 层

法定代表人：廖冰

联系人：高嘉琦

电话：021-80234888*6816

传真：021-80234898

客服电话：400-998-7172

网址：<http://f.998fund.com/>

(63) 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

(64)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>

(65)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.gjq.com.cn

(66)苏州银行股份有限公司

注册地址：苏州工业园区钟园路 728 号

办公地址：苏州工业园区钟园路 728 号

联系人：葛晓亮

电话：0521-69868519

传真：0512-69868370

客服电话：4008289188

公司网址：www.suzhoubank.com

(67)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

(68)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

(69)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

(70)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

(71)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：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

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：徐艳、蒋燕华

业务联系人：蒋燕华

四、基金名称

财通多策略稳健增长债券证券投资基金

五、基金的类型

债券型开放式证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金在有效控制风险的前提下，通过积极主动的投资管理，力争持续

稳定地实现超越业绩比较基准的组合收益。

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，包括股票（包含中小板、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。

本基金主要投资于国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换债券（含分离交易可转债）、短期融资券、中期票据、资产支持证券、债券回购等固定收益品种。本基金可以参与一级市场新股申购或增发新股，以及在二级市场上投资股票、权证等权益类资产。

本基金的投资组合比例为：债券等固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的 80%；股票、权证等权益类品种投资比例不超过基金资产的 20%。本基金持有的全部权证市值不超过基金资产净值的 3%，并保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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。

八、投资策略

本基金在严格控制风险的前提下，通过积极主动的投资品种精选力争获取较高收益。首先把基金合同约定的可投资资产划分为安全资产（包括除可转债以外的各固定收益品种）和风险资产（包括股票、权证以及可转债），再对以上两大资产类别进行动态配置。

本基金为达到投资目标，从投资环境的现状和发展出发，从投资人的投资需求出发，以“每三年为一个单位运作周期”的方式，实施滚动开放式运作。在每个单位运作周期内，通过有效的风险控制，力争满足投资人持续稳定地获得稳健收益的需求。

本基金自基金合同生效日起满 3 年的期间为本基金第一个单位运作周期，第一个单位运作周期期满当日为第一个折算日（请参考本基金合同第二部分释义中的“单位运作周期”及“折算日”），自第一个单位运作周期到期日后的第一个工作日起满 3 年的期间为本基金第二个单位运作周期，第二个单位运作周期期满当日为第二个折算日，自第二个单位运作周期到期日后的第一个工作日起满 3 年的期间为本基金第三个单位运作周期，第三个单位运作周期期满当日为第三个折算日，以此类推，形成“每三年为一个单位运作周期”的滚动运作方式。在两个相邻的单位运作周期之间，基金管理人须确保本基金连续运作，持续经营。

折算日折算规则为基金管理人将对基金份额持有人所持有的基金份额，以折算日的基金份额净值为基础，在其持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，变更登记为基金份额净值为 1.00 元的基金份额，基金份额数按折算比例相应调整。（折算日实施的具体日期前 2 日在指定媒体进行公告）。

1、资产配置策略

本基金主要通过以下两个策略进行资产配置：第一，以广义动态固定比例投资组合保险策略（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance）为基本策略，动态调整安全资产与风险资产的投资比例，力争在有效控风险的前提下，实现稳健的组合收益；第二，实施时间不变性投资组合保险策略（TIPP, Time Invariant Portfolio Protection），通过定期强制实施收益分配锁定部分阶段收益，不断提高单位运作周期到期时的目标价值。

广义动态 CPPI 策略是在风险控制基础上实现收益的基础；而 TIPP 策略是在依据 CPPI 策略进行投资运作而获得收益后，通过强制分红及时锁定部分收益的制度保证。两个策略相辅相成，以共同实现收益稳健增长的目标。

（1）广义动态 CPPI 策略

根据 CPPI 策略的基本原理，首先将基金资产分为两部分：第一部分为

根据预定到期日的预设最低目标价值，将基金的大部分资产投资于安全资产以获得稳定收益，以此来控制投资风险；第二部分是将其余部分的基金资产投资于风险资产，以期获得超额收益。在运作中，基金管理人根据组合安全垫的大小，以及制定的风险乘数，确定风险资产的配置比例上限，并根据对市场的主动预判，在配置比例上限以内动态调整安全资产与风险资产的投资比例。

本基金将以广义动态 CPPI 策略代替传统的 CPPI 策略，是对安全资产组合采取更为主动的“动态久期”和“动态品种优化”策略，以提高基金整体组合的预期收益。按照广义动态 CPPI 策略，对安全资产和风险资产的配置过程具体分为以下四个步骤：

第一步：计算安全底线的值。

根据单位运作周期到期日投资组合的目标价值和合理的贴现率，计算投资组合的安全底线的值。

为提高收益，本基金以广义动态 CPPI 策略代替传统的 CPPI 策略，即以“动态久期”代替“久期匹配”，以“动态品种优化”代替“买入并持有”，在不增加投资组合的整体风险的前提下，力争通过更为积极的动态管理增加安全垫厚度，从而相应提高风险资产的配置比例上限，提高组合预期收益。

首先，本基金管理人的研究部将综合分析宏观面的各个因素，包括宏观经济运行态势、货币政策动向、资金面情况等各宏观因素的分析，每季度对未来一个季度债券市场的总体收益率水平变化进行评估，并将评估报告提交本基金管理人的投资决策委员会，作为确定组合久期的决策依据。投资决策委员会以研究部提交的债券市场评估报告为参考依据，确定下一季度安全资产组合的久期范围，由基金经理严格按照该久期范围的约束进行安全资产组合的管理。一般情况下，本基金采取“久期匹配”策略，即保持安全资产组合久期与单位运作周期的剩余期限大致相等；但当预期债券市场整体收益率面临较大上行风险时，本基金将适时将安全资产组合久期降低至单位运作周期的剩余期限以下，以规避利率风险，并在债券市场收益率启稳后，力争在更

高的市场收益率水平上重新实施“久期匹配”策略。

其次，本基金将以“动态品种优化”策略代替“买入并持有”策略，由基金经理根据对类属资产和个券的相对投资价值评估，构建并动态调整安全资产组合中的类属资产配置和具体投资品种构成，以不断提高组合收益率。

相对于传统的 CPPI 策略，广义动态 CPPI 策略对安全资产组合的管理更为积极主动，对组合的动态化监控要求更高，因此，本基金管理人特开发了广义动态 CPPI 组合管理系统，对基金在单位运作周期的整体组合的资产配置状况进行全程动态化的监控和管理。

第二步：计算投资组合的安全垫（Cushion），即投资组合净值超过安全底线的数额。

第三步：确定风险资产的配置比例上限。

根据组合安全垫和风险资产的风险特性，确定安全垫的放大倍数——风险乘数，然后根据安全垫和风险乘数计算风险资产的配置比例上限。

风险乘数主要根据对权益类市场的下行风险评估而确定，本基金对于风险乘数采取定期调整的方法进行确定。

首先，本基金管理人的研究部采用定性和定量相结合的分析方法，每季度对未来一个季度的权益类市场、基金当前的风险资产组合、拟构建的风险资产组合的下行风险进行评估，并将风险评估报告提交本基金管理人的投资决策委员会，作为确定风险乘数的决策依据。其中，定量分析手段主要是为本基金设计的波动率监测工具，综合运用历史法、幂指数加权法、隐含波动率方法、GARCH 方法等度量市场和基金组合的收益标准差。定性分析主要是通过自上而下和自下而上相结合的基本面分析和市场面分析，对未来一定时期内权益类资产市场的下行风险进行总体评估。

投资决策委员会以研究部提交的风险评估报告为参考依据，确定下一季度的风险乘数上限，由基金经理严格按照该指标的约束进行组合管理。在特殊情况下，当市场发生重大突发事件，或预期将产生剧烈波动时，本基金将对风险乘数上限进行及时调整。一般情况下，本基金的风险乘数不超过 4。

第四步：动态调整安全资产和风险资产的配置比例。

基金经理根据对市场的预判，在已确定的风险资产的配置比例上限的约束下，进行灵活的资产配置，力争实现基金资产的稳定增值。

（2）TIPP 策略

当单位运作周期内基金资产获得一定收益后，为了提前锁定部分收益，本基金在广义动态 CPPI 策略的基础上引入 TIPP 策略。

TIPP 策略改进了 CPPI 策略中安全底线的调整方式，每当基金组合收益率达到一定的比率，单位运作周期到期时的目标价值将按照一定比例进行向上调整。这样无论以后市场如何变化，当前投资者所获的部分收益在期末都能得到一定保证。

本基金将以每季度进行强制分红的方式实施 TIPP 策略。在每季度末，当每份基金份额可分配收益超过 0.01 元，本基金即进行收益分配（具体参见“基金的收益与分配”中的约定）。收益分配结束后，本基金的目标价值自动提升。

本基金将严格按照广义动态 CPPI 策略实施动态资产配置，并在实现阶段性收益后，实施 TIPP 策略及时锁定部分收益，力争实现收益的稳健增长。

2、安全资产投资策略

本基金将采用宏观环境分析和微观市场定价分析两个方面进行安全资产的投资，主要投资策略包括债券投资组合策略和动态品种优化策略。

（1）债券投资组合策略

1) 组合久期匹配与动态调整策略

本基金以风险控制为基本目标，在一般情况下本基金保持安全资产的组合久期与单位运作周期的剩余期限相匹配，以控制债券投资的利率风险，保证本基金的安全资产组合收益的稳定性。

本基金以广义动态 CPPI 策略代替传统的 CPPI 策略，将以“动态久期”代替“久期匹配”策略。当本基金管理人判断债券市场整体收益率面临较大上行风险时，本基金可适时将安全资产的组合久期降低至单位运作周期的剩余期限以下，以规避利率风险，并在债券市场收益率启稳后，争取在更高的市

场收益率水平上，重新将安全资产的组合久期与单位运作周期的剩余期限进行匹配。

2) 收益率曲线策略

在组合久期不变的条件下，针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构，在期限结构配置上适时采取子弹型、哑铃型或阶梯型等策略，进一步优化组合的期限结构，以期在收益率曲线调整的过程中增强基金的收益。

(2) 动态品种优化策略

本基金以广义动态 CPPI 策略代替传统的 CPPI 策略，将以“动态品种优化”策略代替“买入并持有”策略，本基金依据对类属资产和个券的相对投资价值评估，构建并动态调整安全资产组合中的类属资产配置和具体投资品种构成，以不断提高组合收益率。

1) 类属资产配置策略

通过分析各类属资产的相对收益和风险因素，确定不同债券种类的配置比例。主要决策依据包括对未来宏观经济和利率环境的研究和预测、利差变动情况、市场容量、信用等级情况和流动性情况等。通过情景分析的方法，判断各个债券类属的预期持有期回报，在不同债券类属之间进行配置。

2) 个券选择策略

在个券选择过程中，本基金将根据市场收益率曲线的定位情况和个券的市场收益率情况，综合判断个券的投资价值，选择风险收益特征最匹配的品种，构建具体的个券组合。

3、风险资产投资策略

(1) 基于可转债的收益增强策略

可转债同时具备了普通股票所不具备的债性特征和普通债券不具备的股性特征：当其正股下跌时，可转债的价格可以受到债券价值的支撑；当其正股上涨时，可转债的内含看涨期权可使其分享股价上涨带来的收益。可转债是本基金的重要风险资产品种，本基金将通过可转债来实施收益增强策

略。

本基金将首先选择那些转股溢价率和纯债溢价率呈现“双低”特征的可转债品种，较低的转股溢价率保证了可转债在其正股上涨时的涨幅同步性较强，而较低的纯债溢价率则使其正股下跌时的最大损失率也较低。对这些具备“双低”特征的可转债，本基金将进一步对其正股的投资价值进行深入分析，选择那些正股具有投资价值的可转债进行重点投资。

当市场上存在足够数量的具备上述特征的可转债品种时，本基金将在风险资产组合中重点配置该类可转债，充分利用该类可转债的优良特征，实施下行风险可控的积极收益增强策略。

（2）二级市场股票投资策略

本基金以价值投资为基本投资理念，结合定性分析与定量分析的结果，以价值选股、组合投资为原则，选择具备估值吸引力、增长潜力显著的公司股票构建本基金的股票投资组合。

本基金将通过选择高流动性股票保证组合的高流动性，并通过分散投资降低组合的个股集中度风险，以保证在股票市场系统风险增加时，可实现股票组合的快速变现，并及时转入安全资产组合，规避市场系统风险。

（3）新股申购策略

本基金将充分考虑新股中签率、锁定期、上市后表现的预期等因素，有效识别并防范风险，深入发掘新股内在价值，参与新股申购。本基金对于通过参与新股申购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，决定持有的时间或者卖出。

（4）权证投资策略

本基金在权证投资方面主要运用的策略包括：价值发现策略和套利交易策略等。作为辅助性投资工具，本基金将结合自身资产状况进行审慎投资，力图获得最佳风险调整收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

每个单位运作周期起始日的3年期银行定期存款税后收益率+0.5%

本基金的每个单位运作周期为三年，以三年期银行定期存款税后收益率+0.5%作为本基金的业绩比较基准，在投资期限上较为类似，并且能够使本基金投资者判断本基金的风险收益特征。

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

本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期的风险水平和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

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2016年7月18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	项目	金额(元)	占基金总资产的
---	----	-------	---------

号			比例（%）
1	权益投资	4,232,100.00	6.94
	其中：股票	4,232,100.00	6.94
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	46,373,518.80	76.05
	其中：债券	46,373,518.80	76.05
	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	9,104,859.19	14.93
8	其他资产	1,268,109.69	2.08
9	合计	60,978,587.68	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	2,707,500.00	5.28
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		
J	金融业	1,524,600.00	2.97
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	4,232,100.00	8.25

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	300159	新研股份	150,000	2,707,500.00	5.28
2	601788	光大证券	90,000	1,524,600.00	2.97

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	10,163,714.00	19.81
2	央行票据	—	—
3	金融债券	10,315,000.00	20.10

	其中：政策性金融债	10,315,000.00	20.10
4	企业债券	20,865,304.80	40.66
5	企业短期融资券	5,029,500.00	9.80
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	46,373,518.80	90.38

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	150218	15国开18	100,000	10,315,000.00	20.10
2	011599807	15广汇汽车SCP004	50,000	5,029,500.00	9.80
3	122392	15恒大02	45,000	4,630,050.00	9.02
4	019535	16国债07	45,000	4,480,650.00	8.73
5	010107	21国债(7)	40,000	4,323,200.00	8.43

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	26,925.24
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,237,673.48
5	应收申购款	3,510.97
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	1,268,109.69
---	----	--------------

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

1、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
2012年7月13日至 2012年12月31日	1.30%	0.04%	2.30%	0.01%	-1.00%	0.03%
2013年1月1日至 2013年12月31日	0.88%	0.21%	4.93%	0.02%	-4.05%	0.19%
2014年1月1日至 2014年12月31日	15.26%	0.31%	4.93%	0.01%	10.33%	0.30%

2015年1月1日至 2015年12月31日	7.63%	0.27%	4.44%	0.01%	3.19%	0.26%
2016年1月1日至 2016年6月30日	-1.31%	0.22%	1.91%	0.01%	-3.22%	0.21%
2012年7月13日至 2016年6月30日	25.11%	0.25%	19.88%	0.01%	5.23%	0.24%

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)本基金业绩比较基准为：每个单位运作周期起始日的3年期银行定期存款税后收益率+0.5%。

（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

财通多策略稳健增长债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2012年7月13日-2016年6月30日）



注：(1)本基金合同生效日为2012年7月13日；

(2) 根据《基金合同》规定，本基金债券等固定收益类资产占基金资产： $\geq 80\%$ ；股票、权证等权益类占基金资产： $0-20\%$ ；权证占基金资产净值： $0-3\%$ ；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值： $\geq 5\%$ 。本基金建仓期自2012年7月13日起至2013年1月13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；

(3) 根据《基金合同》规定，本基金第一个单位运作周期期满日为2015年7月13日，

以期满日后第一个工作日为单位运作周期起始日3年期银行定期存款税后收益率重新设定业绩比较基准。

十三、基金的费用与税收

（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。

（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 0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8 \% \div \text{当年天数}$$

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 0.2% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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 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—8 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、“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2016年6月30日。

6、“十、基金的业绩”部分

（1）更新了基金业绩表现数据。

7、“二十二、其他应披露事项”部分

（1）更新了2016年1月14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

二〇一六年八月二十日