

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金  
更新招募说明书摘要  
(2016 年第 1 号)

基金管理人：融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  
日 期：二〇一六年三月

## 重要提示

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”或“基金”）由融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金通过转型变更而来。依据融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金持有人大会决议，同意将融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金变更为融通通泽灵活配置混合型证券投资基金，对基金的运作方式进行调整，并按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金的名称、申购赎回安排、费用及其他部分条款进行相应修改，融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金到期日的下一日起，即 2014 年 8 月 30，《融通通泽灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。中国证监会对本基金募集的准予注册，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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素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，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等等。

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与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

投资有风险，投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。投资者购买本基金份额的行为视为同意基金合同的约定。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2016 年 3 月 15 日，有关财务数据截止日为 2015 年 12 月 31 日。

## 一、 基金合同生效日

2014 年 9 月 2 日

## 二、 基金管理人

### (一)、基金管理人概况

名称： 融通基金管理有限公司

注册地址： 深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

设立日期： 2001年5月22日

法定代表人： 高峰

办公地址： 深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

电话： (0755) 26948070

联系人： 刘宏

目前公司股东及出资比例为： 新时代证券有限责任公司 60%、日兴资产管理有限公司 (Nikko Asset Management Co., Ltd.) 40%。

### (二)、主要人员情况

#### 1、现任董事情况

董事长高峰先生，金融学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任大鹏证券投行部高级经理、业务董事，平安证券投行部副总经理，北京远略投资咨询有限公司总经理，深圳新华富时资产管理有限公司总经理。2015 年 7 月起至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，民进会员，注册会计师，现任吉林大学经济学院教授。历任电力部第一工程局一处主管会计，吉林大学教师、讲师、教授。2011 年 1 月至今，任公司独立董事。

独立董事田利辉先生，金融学博士后、执业律师，现任南开大学金融发展研究院教授。历任密歇根大学戴维德森研究所博士后研究员、北京大学光华管理学院副教授、南开大学金融发展研究院教授。2011 年 1 月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，法学博士，现任清华大学法学院教授、法学院副院长、博士研究生导师、中国证券法学研究会和中国保险法学研究会副会长。2012 年 1 月至今，任公司独立董事。

董事马金声先生，高级经济师，现任新时代证券有限责任公司名誉董事长。历任中国人民银行办公厅副主任、主任，金银管理司司长，中国农业发展银行副行长，国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长，华林证券有限责任公司党委书记。2007 年至今，任公司

董事。

董事黄庆华先生,工科学士,现任上海宜利实业有限公司总裁助理兼投资管理部总经理。历任上海宜利实业有限公司投资管理部经理助理、新时代证券有限责任公司经纪事业部综合管理处主管。2015 年 2 月至今,任公司董事。

董事 David Semaya (薛迈雅) 先生,教育学硕士,现任日兴资产管理有限公司执行董事长,三井住友信托银行有限公司顾问。历任日本美林副总,纽约美林总监,美林投资管理有限公司首席运营官、代表董事和副总、代表董事和主席,巴克莱全球投资者日本信托银行有限公司总裁及首席执行官,巴克莱全球投资者(英国)首席执行官,巴克莱集团、财富管理(英国)董事及总经理。2015 年 6 月至今,任公司董事。

董事 Allen Yan (颜锡廉) 先生,工商管理硕士,现任融通基金管理有限公司常务副总经理兼融通国际资产管理有限公司总经理。历任富达投资公司(美国波士顿)分析员、富达投资公司(日本东京)经理、日兴资产管理有限公司部长。2015 年 6 月至今,任公司董事。

董事孟朝霞女士,经济学硕士,现任融通基金管理有限公司总经理。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2015 年 2 月至今,任公司董事。

## 2、现任监事情况

监事刘宇先生,金融学硕士、计算机科学硕士,现任公司监察稽核部总经理。历任国信证券股份有限公司投资银行部项目助理、安永会计师事务所高级审计员、景顺长城基金管理有限公司法律监察稽核部副总监。2015 年 8 月起至今任公司监事。

## 3、公司高级管理人员情况

董事长高峰先生,简历同上。

总经理孟朝霞女士,经济学硕士。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理,泰康养老保险股份有限公司副总经理,富国基金管理有限公司副总经理。2014 年 9 月至今任公司总经理。

常务副总经理颜锡廉(Allen Yan) 先生,工商管理硕士。历任美国富达投资公司财务分析员,日本富达投资公司财务经理,日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。2011 年至今任公司常务副总经理。

副总经理刘晓玲女士,金融学学士。历任博时基金管理有限公司零售业务部渠道总监,富国基金管理有限公司零售业务部负责人,泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监。2015 年 9 月起至今任公司副总经理。

督察长涂卫东先生,法学硕士。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司公务员,曾在证监会法律部和基金监管部工作,曾是证监会公职律师。2011 年至今任公司督察长。

#### 4、基金经理

##### (1) 现任基金经理情况

余志勇先生,金融学硕士,14 年证券从业经验,具有基金从业资格。先后任职于湖北省农业厅、闽发证券,2004 年加入招商证券股份有限公司研究发展中心,从事房地产行业研究工作。2007 年加入融通基金管理有限公司,曾任研究部行业研究员、行业组长。

##### (2) 历任基金经理情况

自 2013 年 8 月 30 日起至 2014 年 7 月 22 日期间,由周珺先生担任本基金的基金经理。

自 2014 年 7 月 23 日起至 2014 年 10 月 15 日期间,由周珺先生和丁经纬先生共同担任本基金的基金经理。

自 2014 年 10 月 16 日起至 2015 年 2 月 24 日期间,由丁经纬先生担任本基金的基金经理。

自 2015 年 2 月 25 日起至 2015 年 3 月 28 日期间,由丁经纬先生和余志勇先生共同担任本基金的基金经理。

自 2015 年 3 月 29 日起至今,由余志勇先生担任本基金的基金经理。

#### 5、投资决策委员会成员

公司公募基金投资决策委员会成员:投资总监商小虎先生,研究策划部总经理、基金经理邹曦先生,权益投资部副总监、基金经理刘格菘先生,基金交易部副经理谭奕舟先生,风险管理部副经理马洪元先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

### 三、 基金托管人

#### 1、基金托管人基本情况

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:姜建清

注册资本:人民币 349,018,545,827 元

联系电话:010-66105799

联系人：洪渊

## 2、主要人员情况

截至 2015 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 203 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。

## 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、安心账户资金、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 2015 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 428 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 45 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。

## 四、相关服务机构

### （一）基金份额发售机构

#### 1、直销机构

##### （1）融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及深圳小组

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14 层

邮政编码：518053

联系人：陈思辰

电话：（0755）26948034

客户服务中心电话：400-883-8088（免长途通话费用）、（0755）26948088

##### （2）融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及北京小组

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座1241-1243单元

邮政编码：100140

联系人：魏艳薇

电话：（010）66190989

（3）融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及上海小组

办公地址：上海市世纪大道8号国金中心汇丰银行大楼6楼601—602

邮政编码：200120

联系人：杨雁

联系电话：（021）38424950

（4）融通基金管理有限公司网上直销

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

邮政编码：518053

联系人：殷洁

联系电话：（0755）26947856

## 2、代销机构

（1）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏琪

电话：（021）38676161

客服电话：4008888666

（2）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

法定代表人：曾小普

联系人：俞驰

电话：（0791）86283080

客服电话：4008222111

（3）第一创业证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民

联系人：吴军

电话：（010）63197785

客服电话：4008881888

（4）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市江汉区新华路特8号

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：（021）68751929

客服电话：95579或4008-888-999

（5）东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：（0431）85096517

客服电话：4006000686

（6）华安证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

联系人：范超

电话：（0551）65161821

客服电话：95318，4008096518

（7）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：王春峰

联系人：胡天彤

电话：022-28451709

客服电话：4006515988

（8）平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦4036号16-20

法定代表人：谢永林

联系人：周一涵



电话：（0755）22621866

客服电话：95511-8

（9）信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：鹿馨方

联系电话：010-63080994

客服电话：4008008899

（10）国都证券有限责任公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：常喆

联系人：黄静

电话：（010）84183389

客服电话：400818811

（11）中信证券股份有限公司

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

法定代表人：王东明

联系人：侯艳红

电话：（010）60838995

客服电话：4008895548

（12）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

法定代表人：杨宝林

联系人：赵艳青

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

（14）恒泰证券股份有限公司

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人：庞介民

联系人：魏巍

电话：0471-4974437

客服电话：（0471）4961259

（15）长城证券股份有限公司

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层

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

电话：（0755）83516289

客服电话：4006666888

（16）申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

电话：（021）33388215

客服电话：95523或4008895523

（17）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

法定代表人：许建平

联系人：李巍

电话：010-88085858

传真：010-88085195

客户服务电话：400-800-0562

（18）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：陆晓

电话：（0512）62938521

客服电话：40086015555

（19）山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：邓颖赞

联系电话：（0351）8686796

客服电话：95573

（20）新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法人代表：刘汝军

联系人：田芳芳

电话：（010）83561072

客服电话：400-698-9898

（21）中信期货有限公司

注册地址：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

电话：0755-82791065

联系人：吴川

客服热线：4009908826

（22）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

电话：010-85679888-6035

联系人：秦朗

客服电话：4009101166

（23）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

电话：028-86690057

联系人：刘婧漪

客服电话：4006-600109

（24）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦38-45层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

电话：（0755）82960167

客服电话：95565

（25）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66 号4 号楼

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

电话：（010）85130236

客服电话：400-8888-108

（26）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闸路1508号3楼

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨

电话：（021）22169081

传真：（021）22169134

客服热线：400-8888-788、10108998、95525

（27）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2-6层

法定代表人：陈有安

电话：（010）66568450

传真：（010）66568536

联系人：邓颜

客服热线：400-8888-888

（28）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

电话：021-20315255

联系人：马晓男

客户服务电话：95538

(29) 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

法定代表人：余维佳

电话：023-63786141

联系人：张煜

客服电话：4008096096

(30) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16—26层

法定代表人：何如

联系人：周杨

电话：(0755) 82130833

客服电话：95536

(31) 中国工商银行股份有限公司

住所：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：姜建清

联系人：杨菲

客户服务电话：95588

传真：010-66107914

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

(32) 招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：0755-83198888

客服电话：95555

网址：[www.cmbchina.com](http://www.cmbchina.com)

(33) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：范一飞

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476497

联系人：汤征程

联系电话：021-68475521

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

(34) 渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河西区马场道201-205 号

法定代表人：李伏安

联系人：王宏

电话：(022) 58316666

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

(35) 宁波银行股份有限公司

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路700号24层

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

(36) 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

联系人：童彩平

电话：0755- 33227950

传真：0755-82080798

网址：[www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)及[www.jjmmw.com](http://www.jjmmw.com)

(37) 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195号3C座9楼

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

电话：（021）54509988

传真：（021）64383798

网址：www.1234567.com.cn

(38) 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

电话：（021）58870011

网址：www.ehowbuy.com

(39) 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

法定代表人：陈柏青

联系人：徐映绯

电话：0571-28829790，021-60897869

传真：0571-26698533

客服电话：4000-766-123

网址：<http://www.fund123.cn/>

(40) 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：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

联系电话：（010）66045608

客服电话：（010）66045678

传真：010-66045521

天相投顾网址：<http://www.txsec.com>

天相基金网网址：[www.jjm.com.cn](http://www.jjm.com.cn)

(41) 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：吕慧

电话：(021) 58788678

传真：(021) 8788678-8101

网址：[www.erichfund.com](http://www.erichfund.com)

(42) 中期时代基金销售(北京)有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层

办公地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层

法人代表：路瑶

联系人：朱剑林

电话：400-8888-160

传真：010-59539866

网址：[www.cifcofund.com](http://www.cifcofund.com)

(43) 厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504

法定代表人：陈洪生

联系人：李智磊

联系电话：0592-3122679

传真：0592-3122701

客服热线：0592-3122716

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

(44) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址：上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19层

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830



联系人：陈云卉

客服热线：400-820-2819

公司网站：www.fund.bundtrade.com

(45) 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

联系人：文雯

电话：010-83363101

(46) 深圳富济财富管理有限公司

办公地址：深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室

法定代表人：齐小贺

电话：0755-83999907

联系人：马力佳

(47) 上海陆金所资产管理有限公司（仅代销前端）

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

客户服务电话：4008219031

(48) 珠海盈米财富管理有限公司（仅代销前端）

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

传真：020-89629011

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

客服热线：020-89629066

## (二)、注册登记机构

名称：融通基金管理有限公司

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

设立日期：2001 年 5 月 22 日

法定代表人：高峰

电话：0755-26948075

联系人：杜嘉

### **(三)、律师事务所**

名称：广东嘉得信律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

法定代表人：闵齐双

联系人：崔卫群

经办律师：闵齐双 崔卫群

电话：0755-33382888（总机） 0755-33033936（直线） 13480989076

传真：0755-33033086

### **(四)、会计师事务所**

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司（特殊普通合伙）

注册地址：上海市陆家嘴环路 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（邮编：200021）

法人代表：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：陈玲、俞伟敏

## **五、 基金的名称**

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金

## **六、 基金的类型**

契约性开放式

## **七、 基金的投资目标**

本基金在追求本金安全的基础上，通过大类资产配置与个券选择，采用数量化手段严格控制本基金的下行风险，力争在减小波动性的同时在有效时间内为基金份额持有人谋求资产的稳定增值。

## 八、 基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市交易的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、一级市场新股或增发的股票、权证、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类资产、现金及到期日在一年以内的政府债券，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）。

根据相关法律法规，在遵循本基金投资目标，且对投资者利益无实质不利影响的前提下，本基金可将证券投资基金纳入投资范围，本基金投资于证券投资基金的投资策略、投资限制及估值方法等以届时有效的法律法规及业务规则为准，无需召开份额持有人大会。

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并经托管人确认后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，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%。

如法律法规或中国证监会允许，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

## 九、 基金的投资策略

本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、公司价值评估以及组合风险管理全过程中。

### i、大类资产配置策略

本基金在资产配置中贯彻“自上而下”的策略，根据宏观经济环境，主要包括国内生产总值、经济增长率、失业率、通货膨胀率、财政收支、国际收支、固定资产投资规模、货币政策和利率走势等指标，并通过战略资产配置策略和战术资产配置策略的有机结合，持续、动态、优化确定投资组合的资产配置比例。

### ii、股票投资策略

本基金在股票投资策略上强调行业子类配置和精选个股的有机结合，通过基金经理的战略性选股思路以及投研部门的支持，筛选出最具战略性配置价值的股票。

#### 1、战略选股策略

本基金尊重历史统计规律，在充分借鉴国际经济和产业发展路径的基础上，把握中国经济增长结构及各经济增长动力的变迁趋势，在剖析各产业的竞争结构、盈利模式、周期性

和景气度的基础上判断各行业子类未来成长前景,并以此为主要依据精选出具有战略性意义的行业子类。

管理人在具有战略性意义的行业子类中选择出盈利能力较强且具有良好的长期成长前景的价值成长企业作为投资标的。重点把握三类投资机会:预期空间大波动性小的品种、预期空间大波动性也大的品种、预期空间较确定但波动性小的品种。本基金重点投资于管理人看好且善于把握的投资机会或投资品种,并且基于投资收益在时间分布和结构分布两方面的有偏特性,再加上人力的有限性,本基金财产所选择的战略投资模式只投资于有限的品种。

管理人运用定性和定量相结合的方法选择出潜在的重点投资标的,选股方法主要包含:

(1) 定性指标:经营模式、行业地位、人(管理层过往业绩评估、公司核心竞争力评估)、财(管理能力评估)、物(市场空间、科技创新能力评估)、环境(行业环境和政策环境评估)、市场经济专利(区域垄断、政策垄断、资源垄断、技术优势、营销优势、品牌优势)以及公司分红派息政策;与此同时,我们还运用企业生命周期识别系统识别企业所处生命周期。

(2) 定量指标:盈利性(边际利润率变动分析、净资产收益率变动分析、经营成本比较分析)、成长性(销售收入及息税前利润变动分析)、安全性(现金流量分析、负债率分析)等。

(3) 对于潜在的重点投资标的,管理人将组织内、外部各种研究资源进行深入研究和跟踪调研。重点公司调研研究主要关注管理层诚信度及管理能力、治理结构、公司分红政策、行业中的公司比较、未来股本扩张规划以及未来增长是否明确、是否可持续等关键要素。

## 2、持股与风险管理策略

(1) 在买入时机把握上,根据系统风险和个股风险评判,在安全边际较高的时机买入;

(2) 在持股方面,管理人通过行业子类估值比较、历史估值比较、全市场估值比较和绝对估值比较,并将“风险调蓄”技术运用于个股,把股票价格运行风险分为高风险和低风险两种状态,通过评估判定个股所处风险状态,作为确定个股投资权重的辅助性参考指标,评估备选重点公司的估值风险和股票价格运行风险状况,并以此确定个股配置权重。

### iii 债券投资策略

在债券投资上,我们贯彻“自上而下”的策略,采用三级资产配置的流程。

#### 1、久期管理

根据对利率趋势的判断以及收益率曲线的变动趋势确定各类债券组合的组合久期策略。

## 2、类属配置与组合优化

根据品种特点及市场特征，将市场划分为企业债、银行间国债、银行间金融债、可转换债券、央行票据、交易所国债六个子市场。在几个市场之间的相对风险、收益（等价税后收益）进行综合分析后确定各类别债券资产的配置。具体而言考虑市场的流动性和容量、市场的信用状况、各市场的风险收益水平、税收选择等因素。

## 3、通过因素分析决定个券选择

从收益率曲线偏离度、绝对和相对价值分析、信用分析、公司研究等角度精选有投资价值的投资品种。本基金财产力求通过绝对和相对定价模型对市场上所有债券品种进行投资价值评估，从中选择暂时被市场低估或估值合理的投资品种。

本基金重点关注：期限相同或相近品种中，相对收益率水平较高的券种；到期期限、收益率水平相近的品种中，具有良好流动性的券种；同等到期期限和收益率水平的品种，优先选择高票息券种；预期流动性将得到较大改善的券种；公司成长性良好的可转债品种；转债条款优厚、防守性能较好的可转债品种。

## 十、 业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：年化收益率 8%

选择该业绩比较基准的理由主要如下：

本基金为混合型基金，力争为投资者获取 8% 的年化回报，因此，以年化收益率 8% 作为本基金业绩比较基准，能够较好反映本基金的投资目标。

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业绩基准时，经与基金托管人协商一致，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。

## 十一、 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与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

## 十二、 基金投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的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 2015 年 12 月 31 日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	91,403,126.10	3.82
	其中：股票	91,403,126.10	3.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,366,206,600.00	57.07
	其中：债券	1,366,206,600.00	57.07
	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	593,701,610.55	24.80
	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	325,963,039.29	13.62
8	其他资产	16,480,448.57	0.69
9	合计	2,393,754,824.51	100.00

2、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	70,107,360.67	2.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	195,136.20	0.01
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	7,336,208.18	0.31
J	金融业	12,450,000.00	0.52
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	109,392.21	0.00
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	982,724.40	0.04
S	综合	-	-
	合计	91,403,126.10	3.82

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	300463	迈克生物	233,333	27,390,960.87	1.15
2	300443	金雷风电	65,566	12,675,219.12	0.53
3	600837	海通证券	600,000	9,492,000.00	0.40
4	002157	正邦科技	400,000	8,040,000.00	0.34
5	300436	广生堂	94,594	7,891,977.42	0.33
6	002217	合力泰	300,000	5,085,000.00	0.21
7	300271	华宇软件	100,000	4,748,000.00	0.20
8	600439	瑞贝卡	500,000	3,550,000.00	0.15
9	002127	新民科技	162,700	3,045,744.00	0.13
10	601688	华泰证券	150,000	2,958,000.00	0.12

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	519,892,600.00	21.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	620,912,000.00	25.98
6	中期票据	225,402,000.00	9.43
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,366,206,600.00	57.17

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	020080	15 贴现 06	3,960,000	389,703,600.00	16.31
2	101551055	15 大连万达 MTN001	2,000,000	204,680,000.00	8.56
3	011501003	15 中石油 SCP003	2,000,000	200,100,000.00	8.37
4	011534008	15 东航股 SCP008	1,200,000	119,976,000.00	5.02
5	011513003	15 招商局 SCP003	1,000,000	100,320,000.00	4.20

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

(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。

(2) 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

10、 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

(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。

(3) 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

11、 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报告期内被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

海通证券股份有限公司（以下简称“本公司”或“公司”）于 2015 年 11 月 26 日收到中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《调查通知书》（稽查总队调查通字 153122 号）。因公司涉嫌违反《证券公司监督管理条例》相关规定，根据《中华人民共和国证券法》的有关规定，中国证监会决定对公司进行立案调查。

海通证券上海建国西路营业部和杭州解放路营业部对杭州恒生网络技术服务有限责任公司 HOMS 系统（以下简称 HOMS 系统）开放专线接入，其中第一条专线于 2014 年 3 月由零售与网络金融部、信息技术管理部、合规与风险管理总部平行审核后接入上线。第二条专线于 2015 年 2 月由零售与网络金融部、合规与风险管理总部、信息技术管理部平行审核后接入上线。对于上述外部接入第三方交易终端软件，海通证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。

截止调查日,海通证券客户中,有 120 个使用 HOMS 系统接入的主账户。对上述客户,海通证券未按要求采集客户交易终端信息,未能确保客户交易终端信息的真实性、准确性、完整性、一致性、可读性,未采取可靠措施采集、记录与客户身份识别有关的信息。海通证券通过添加白名单方式允许客户使用 HOMS 系统进行交易,缺少实质性审核。在客户回访方面,海通证券虽然对客户进行了回访,但在回访时没有对客户交易委托电话、IP、MAC 等与客户进行全面核对。使用 HOMS 系统进行分仓交易的账户由于操作子账户多,主账户的交易较为频繁、异常,明显不同于其他普通账户,但海通证券没有对该等账户重点关注,缺少有效监督。海通证券在未采集、上述客户身份识别信息的情况下,未实施有效的了解客户身份的回访、检查等程序。

综上,海通证券未按照《证券登记结算管理办法》第二十四条,《关于加强证券期货经营机构客户交易终端信息等客户信息管理的规定》第六条、第八条、第十三条,《中国证监会关于加强证券经纪业务管理的规定》第三条第(四)项,《中国证券登记结算有限责任公司证券账户管理规则》第五十条的规定对客户的身分信息进行审查和了解,违反了《证券公司监督管理条例》第二十八条第一款的规定,构成《证券公司监督管理条例》第八十四条第(四)项所述的行为,获利 2865.3 万元。时任海通证券零售与网络金融部总经理丁学清及邹二海、信息技术管理部总经理沈云明、合规与风险管理总部副总经理宋世浩是直接负责的主管人员,宁波百丈东路营业部前台负责人高宏杰、宁波百丈东路营业部总经理方贤明、杭州解放路营业部副总经理汪峥为其他直接责任人员。根据当事人违法行为的事实、性质、情节和社会危害程度,依据《证券公司监督管理条例》第八十四条的规定,我会拟决定:一、对海通证券责令改正,给予警告,没收违法所得 28,653,000 元,并处以 85,959,000 元罚款;二、对丁学清给予警告,并处以 10 万元罚款;三、对邹二海给予警告,并处以 10 万元罚款;四、对高宏杰给予警告,并处以 10 万元罚款;五、对汪峥给予警告,并处以 5 万元罚款;六、对方贤明给予警告,并处以 5 万元罚款;七、对沈云明给予警告,并处以 5 万元罚款;八、对宋世浩给予警告,并处以 5 万元罚款。

#### 华泰证券

2015 年 9 月 10 日,公司收到中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》(处罚字[2015]72 号),华泰证券涉嫌违法违规的事实如下:2013 年 7 月 29 日,华泰证券威宁路营业部应客户上海朝兴置业有限公司(以下简称朝兴置业)的要求,与杭州恒生网络技术服务有限公司(以下简称恒生网络)共同测试 HOMS 系统接入华泰证券软件系统。系统连通后,在朝兴置业未使用的情况下,华泰证券并未切断其与 HOMS 系统的连接端口,也未对此专线

设置相应监控。2014 年 10 月至 12 月期间，华泰证券在对于自身交易系统没有采取预防措施的情况下，让浙江核新同花顺网络信息股份有限公司（以下简称同花顺）工程人员在华泰证券机房安装了资产管理模块。对于上述外部接入的第三方交易终端软件，华泰证券未进行软件认证许可，未对外部系统接入实施有效管理，对相关客户身份情况缺乏了解。

依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（四）项的规定，我会拟决定：一、对华泰证券责令改正，给予警告，没收违法所得 18,235,275.00 元，并处以 54,705,825.00 元罚款；二、对胡智给予警告，并处以 10 万元罚款；三、对陈栋给予警告，并处以 10 万元罚款。

基金管理人对上述股票的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

(2) 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

## 12、其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	257,112.52
2	应收证券清算款	2,685,671.13
3	应收股利	-
4	应收利息	13,537,664.92
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,480,448.57

## 13、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。

## 14、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	300463	迈克生物	27,390,960.87	1.15	新股锁定
2	300443	金雷风电	12,675,219.12	0.53	新股锁定
3	300436	广生堂	7,891,977.42	0.33	新股锁定

### 十三、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。

自基金合同生效以来，本基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较如下：

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
2013年8月30日至 2013年12月31日	-3.80%	0.44%	2.72%	0.00%	-6.52%	-0.44%
2014年1月1日至 2014年12月31日	11.99%	1.20%	8.00%	0.02%	3.99%	1.20%
2015年1月1日至 2015年12月31日	-0.60%	0.62%	8.00%	0.00%	-8.06%	0.62%

### 十四、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、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## (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

融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金到期日的下一日起,融通通泽一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型为“融通通泽灵活配置混合型证券投资基金”,本基金转型后根据以下原则收取管理费、托管费。

#### 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

存续期内,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

存续期内,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—7 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)、费用调整**

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在至少一种指定媒体上公告。

#### **(五)、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。

基金财产投资的相关税收,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。

### **十五、对招募说明书更新部分的说明**

招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求、对本基金管理人于2016年4月11日刊登的本基金招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、在“三、基金管理人”部分,对“(二)主要人员情况”中的人员信息进行了更新,主要人员情况中更新了现任监事情况、基金经理情况和投资决策委员会成员组成情况;

2、在“五、相关服务机构”部分,更新了直销机构、代销机构和会计师事务所的相关信息;

3、在“七、基金的存续”部分,更新了“(一)基金份额的变更登记”的相关情况;

4、在“九、基金的投资”部分,更新了“基金投资组合报告”的内容,更新数据为本基金2015年第4季度报告中的投资组合数据;

5、在“十、基金的业绩”部分,按规定要求对基金的投资业绩数据进行了列示,已经基金托管人复核;

6、在“二十二、其他应披露事项”部分,对本基金自上次更新招募说明书披露日至2016年3月15日期间的公告信息进行了列示。

融通基金管理有限公司

二〇一六年四月十一日