

**融通新蓝筹证券投资基金更新招募说明书摘要**

(2017年第2号)

**重要提示**

融通新蓝筹证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会证监基金字[2002]41号文核准公开发售。核准日期为2002年7月25日。本基金为契约型开放式基金,基金合同生效日为2002年9月13日。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

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。

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。

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50%,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50%的除外。

本招募说明书所载内容截止日为2017年9月12日,有关财务数据截止日为2017年6月30日,业绩表现截止日为2017年6月30日(财务数据未经审计)。

**一、基金合同生效日**

2002年9月13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

住所: 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) 26947517

联系人：赖亮亮

注册资本：12500万元人民币

股权结构：新时代证券股份有限公司 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，经济学博士，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，现任新时代证券股份有限公司名誉董事长。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1月至今，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、新时代证券股份有限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。

董事张帆先生,工商管理硕士,现任融通基金管理有限公司总经理。历任上海远东证券有限公司上海金桥路证券营业部总经理助理、经纪业务总部副总经理,新时代证券股份有限公司信阳北京大街证券营业部总经理、经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月起至今,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,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。

总经理张帆先生,工商管理硕士,现任融通基金管理有限公司总经理。历任上海远东证券有限公司上海金桥路证券营业部总经理助理、经纪业务总部副总经理,新时代证券股份有限公司信阳北京大街证券营业部总经理、经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月起至今,任公司总经理。

常务副总经理 Allen Yan (颜锡廉) 先生,工商管理硕士。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。2011年3月至今,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,曾在中国证监会法律部和基金监管部工作,曾是中国证监会公职律师。2011年3月至今,任公司督察长。

#### 4、基金经理

##### (1) 现任基金经理情况

张延闽先生，哈尔滨工业大学工学硕士、工学学士，7年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2010年2月加入融通基金管理有限公司，现任融通通乾研究精选灵活配置混合（由原通乾证券投资基金转型而来）、融通转型三动力灵活配置混合、融通新蓝筹混合基金的基金经理。

何龙先生，武汉大学金融学硕士、华中科技大学经济学学士，5年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2012年7月加入融通基金管理有限公司，历任金融研究员、策略研究员，现任融通新蓝筹混合的基金经理。

##### (2) 历任基金经理情况

自2002年9月13日至2004年7月20日，由詹凌蔚先生担任本基金的基金经理。

自2004年7月21日起至2007年9月27日，由刘模林先生担任本基金的基金经理。

自2007年9月28日起至2009年7月22日，由刘模林先生与戴春平先生共同担任本基金的基金经理。

自2009年7月23日起至2009年8月25日，由刘模林先生担任本基金的基金经理。

自2009年8月26日起至2010年4月22日，由刘模林先生和张敏先生共同担任本基金的基金经理。

自2010年4月23日起至2011年3月23日，由刘模林先生、张敏先生和汪忠远先生共同担任本基金的基金经理。

自2011年3月24日起至2011年4月5日，由刘模林先生和汪忠远先生共同担任本基金的基金经理。

自2011年4月6日起至2012年7月24日，由吴巍先生和汪忠远先生共同担任本基金的基金经理。

自2012年7月25日起至2014年10月29日，由吴巍先生、汪忠远先生和姚昆先生共同担任本基金的基金经理。

自2014年10月30日起至2015年8月28日，由姚昆先生担任本基金的基金经理。

自2015年8月29日起至2017年2月16日，由何龙先生担任本基金的基金经理。

自2017年2月17日起至今，由何龙先生和张延闽先生共同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：权益投资总监、基金经理邹曦先生，投资总监、基

金经理商小虎先生，研究部总经理、基金经理付伟琦先生，权益投资部总经理、基金经理张延闽先生，研究部总监、基金经理余志勇先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### 1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：田国立

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：田 青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939)，于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2017 年 6 月末，本集团资产总额 216,920.67 亿元，较上年末增加 7,283.62 亿元，增幅 3.47%。上半年，本集团实现利润总额 1,720.93 亿元，较上年同期增长 1.30%；净利润较上年同期增长 3.81%至 1,390.09 亿元，盈利水平实现平稳增长。

2016 年，本集团先后获得国内外知名机构授予的 100 余项重要奖项。荣获《欧洲货币》“2016 中国最佳银行”，《环球金融》“2016 中国最佳消费者银行”、“2016 亚太区最佳流动性管理银行”，《机构投资者》“人民币国际化服务钻石奖”，《亚洲银行家》“中国最佳大型零售银行奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构奖”。本集团在英国《银行家》2016 年“世界银行 1000 强排名”中，以一级资本总额继续位列全球第 2；在美国《财富》2016 年世界 500 强排名第 22 位。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII 托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营

处、监督稽核处等 10 个职能处室，在上海设有投资托管服务上海备份中心，共有员工 220 余人。自 2007 年起，托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计，并已经成为常规化的内控工作手段。

## 2、主要人员情况

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玕，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## 3、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2017 年二季度末，中国建设银行已托管 759 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行连续 11 年获得《全球托管人》、《财资》、《环球金融》“中国最佳托管银行”、“中国最佳次托管银行”、“最佳托管专家——QFII”等奖项，并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”。

## 四、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

1、直销机构情况

(1) 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

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北京分公司

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上海分公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 34 层 3405 号

邮政编码：200120

联系人：刘佳佳

联系电话：(021) 38424889

(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) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

联系人：王琳

电话：(010) 66275654

(2) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴路甲 23 号

法定代表人：周慕冰

联系人：吴双

电话：(010)68298560

客服电话：95599

(3) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

客服电话：95559

联系人：曹榕

电话：(021) 58781234

(4) 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

(5) 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：金煜

联系人：汤征程

联系电话：(021)68475888

(6) 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：易会满

联系人：刘秀宇

电话：(010) 66107909



(7) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：陈四清

联系人：顾林

电话：(010) 66594956

客户服务电话：95566

(8) 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

联系人：董云巍

客服电话：95568

(9) 北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人：张东宁

联系人：王曦

电话：(010) 66223584

(10) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：李庆萍

联系人：李博

电话：(010) 65541585

(11) 中国光大银行股份有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

联系人：李伟

电话：(010) 68098778

(12) 平安银行股份有限公司

办公地址：深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

电话：021-38637673

客户服务电话：95511-3

(13) 华夏银行股份有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：李民吉

联系人：陈宇

电话：(010) 85238423

(14) 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：刘宝凤

联系人：王宏

电话：(022) 58316666

(15) 中国邮政储蓄银行股份有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人：李国华

客服热线：95580

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

(16) 恒丰银行股份有限公司（仅代销前端）

住所：山东省烟台市芝罘区南大街 248 号

法定代表人：蔡国华

联系人：甘学芳

联系电话：0535—2118050

客服电话：400-813-8888

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

(17) 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

(18) 包商银行股份有限公司（仅代销前端）

注册地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街6号

办公地址：内蒙古包头市青山区钢铁大街6号

法定代表人：李镇西

联系人：张建鑫

电话：010-64816038

客户服务电话：95352

网址：www.bsb.com.cn

(19) 苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路728号

法定代表人：王兰凤

传真：0512-69868370

联系人：葛晓亮

电话：0512-69868519

客服热线：96067

网址：www.suzhoubank.com。

(20) 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

(21) 蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

住所：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6F

法定代表人：陈柏青

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

(22) 北京虹点基金销售有限公司（仅代销前端）

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：胡伟

电话：010-65951887

传真：010-65951887

联系人：葛亮

客服热线：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com/

(23) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路613号6幢551室

办公地址：上海市徐汇区龙田路195号3号楼C座9楼

法定代表人：其实

联系人：高莉莉

电话：(021)54509998

(24) 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

法定代表人：王莉

联系人：李延鹏

电话：0755-82721122-8625

客服电话：400-920-0022、021-20835588

(25) 中期资产管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层

法定代表人：朱剑林

联系人：朱剑林

电话：400-8888-160

传真：010-59539866

客服电话：95162、4008888160

(26) 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

法定代表人：闫振杰

联系人：王婉秋

电话：010-62020088

传真：010-62020355

客服电话：400-888-6661

(27) 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室

法人代表：罗细安

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

联系人：孙晋峰

(28) 深圳腾元基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)单元

法定代表人：曾革

联系人：鄢萌莎

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

客服电话：4006-877-899

(29) 浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市西湖区文二西路1号元茂大厦903室

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号楼2楼

法定代表人：易峥

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：4008-773-772

(30) 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：北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室

法定代表人：吴雪秀

传真：010-88312885

联系人：苏昊

客服电话：400-0011-566

(31) 嘉实财富管理有限公司（仅代销前端）

注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、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：景琪

电话：021-20289890

传真：021-20280110

客户服务电话：400-021-8850

(32) 中国国际期货有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层

办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人：王兵

联系人：赵森

电话：010-59539864

传真：010-59539806

客户服务电话：95162

(33) 北京钱景基金销售有限公司

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

联系人：魏争

电话：010-57418829

传真：010-57569671

客户服务电话：400-678-5095

(34)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)

(35)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](http://www.fund.bundtrade.com)

(36)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：李兴春

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：曹怡晨

客服热线：400-921-7755

公司网站：<http://a.leadfund.com.cn/>

(37)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

法定代表人：刘鹏宇

电话：0755-83999907-815

传真：0755-83999926

联系人：马力佳

客服热线：0755-83999907

公司网站：www.jinqianwo.cn

(38) 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

公司网站：www.lufunds.com

(39) 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廊公路7650号205室

办公地址：上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室

法定代表人：汪静波

联系人：贾雅楠

电话：(021)38509630

(40) 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

电话：010-83363101

联系人：文雯

公司网站：<http://8.jrj.com.cn/>

(41) 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

网址：www.yingmi.cn

(42) 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

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)

(43) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

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

(44) 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

法定代表人：张跃伟

联系人：胡雪芹

电话：021-2069-1806

客服热线：400-089-1289

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

(45) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村e世界A座1108室

法人代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客户服务电话：400-619-9059；

网址：www.hcjijin.com；

(46) 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：北京市朝阳区霄云路26号鹏润大厦B座9层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287984

传真：010-59287825

联系人：郭宝亮

客服热线：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

(47) 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：上海市浦东新区福山路33号8楼

法定代表人：王廷富

电话：021-5132 7185

传真：021-5071 0161

联系人：姜吉灵

客服热线：400-821-0203

网址：www.520fund.com.cn

(48) 上海中正达广投资管理有限公司

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

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

客服热线：400-6767-523

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

(49) 大泰金石基金销售有限公司

办公地址: 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 室

法定代表人: 袁顾明

联系人: 何庭宇

电话: 021-20324153

(50) 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

法定代表人: TAN YIK KUAN

电话: 0755-8946 0500

传真: 0755-2167 4453

联系人: 叶健

客服热线: 400-684-0500

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

(51) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司(仅代销前端)

注册地址: 北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

办公地址: 北京市亦庄经济技术开发区科创十一街 18 号京东集团总部 A 座 17 层

法定代表人: 陈超

电话: 4000988511/ 4000888816

传真: 010-89188000

联系人: 徐伯宇

客服热线: 95518

公司网站: [jr.jd.com](http://jr.jd.com)

(52) 深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

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

办公地址: 深圳市福田区深南大道 6019 号金润大厦 23A

法定代表人: 高锋

电话：0755-83655588

传真：0755-83655518

联系人：廖苑兰

客服热线：4008048688

公司网站：www.keynesasset.com

(53) 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：上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼

法定代表人：马刚

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客服热线：95156

网址：www.tonghuafund.com

(54) 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：朱雅崑

电话：(021) 38676161

客服电话：4008888666

(55) 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：刘畅

电话：(010) 85130236

客服电话：95587

(56) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：李颖

电话：(0755) 82130833

客服电话：95536

(57) 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

法定代表人：霍达

联系人：黄婵君

电话：(0755) 82960167

客服电话：4008888111、95565

(58) 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 号长江证券大厦

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

电话：(027) 68751860

客服电话：95579

(59) 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：方晓丹

电话：(0512) 65581136

客服电话：4008601555

(60) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：(020) 87555888-8333

客服电话：95575

(61) 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：陈共炎

联系人：辛国政

电话：(010) 66568292

客服电话：4008-888-8888

(62) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：王东明

联系人：周雪晴

电话：(010) 60838995

客服电话：4008895548

(63) 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、23、25-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

电话：(021) 63325888

客服电话：95503

(64) 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：邓颖贇

联系电话：(0351) 8686796

客服电话：95573

(65) 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：孙秋月

电话：(0532) 85023924

客服电话：95548

(66) 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：王星

电话：022-28451709

客服电话：4006515988

(67) 万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

电话：(020)38286651

客服电话：400-8888-133

(68) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：冯鹤年

联系人：韩秀萍

电话：(010)85252656

客户服务电话：4006198888

(69) 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16/17层

法定代表人：丁益

联系人：李嘉禾

电话：(0755)83516289

客服电话：4006666888

(70) 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

法定代表人：薛峰

联系人：李晓哲

电话：(021)22169081

客服电话：95525

(71) 平安证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦4036号16-20层

法定代表人：曹实凡

联系人：周一涵

电话：(0755)38631117

客服电话：95511-8

(72) 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：樊忠亚

电话：(0551) 65161675

客服电话：95318, 4008096518

(73) 国联证券股份有限公司

注册地址：无锡市金融一街8号

法定代表人：姚志勇

联系人：袁丽萍

电话：(0510) 82831662

客服电话：0510-82588168

(74) 金元证券股份有限公司

注册地址：海口市南宝路36号证券大厦4楼

法定代表人：陆涛

联系人：张霞

电话：(0755) 21516897

客服电话：4008888228

(75) 国都证券股份有限公司

联系地址：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：戈文

联系电话：(010) 84183389

电话：4008188118

(76) 第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人：刘学民

联系人：李若晨

电话：(010) 63197785



客服电话：95358，4008881888

(77) 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：李福春

联系人：安岩岩

电话：(0431) 85096517

客服电话：95360，4006000686

(78) 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：徐丽峰

联系人：周欣玲

电话：(0791) 86283080

客服电话：4008222111

(79) 恒泰证券股份有限公司

办公地址：内蒙古呼和浩特市赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座光大银行办公楼 14-18 楼

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：(0471) 4972343

客服电话：4001966188

(80) 华龙证券股份有限公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路 638 号兰州财富中心 21 楼

法定代表人：李晓安

联系人：刘宏波

电话：(0931) 8490208

客服电话：96668

(81) 兴业证券股份有限公司

联系地址：福州市湖东路 268 号证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

电话：(0591) 38507715

客服电话：95562

(82) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：涂洋

电话：(021) 23219275

客服电话：4008888001 95553

(83) 新时代证券股份有限公司

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：叶顺德

联络人：田芳芳

电话：(010) 83561146

客服电话：95399

(84) 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

法定代表人：牛冠兴

联系人：杨天枝

联系电话：(0755) 82558336

客服电话：4008001001

(85) 西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东大街 232 号信托大厦 16—17 层

法定代表人：刘建武

联系人：刘莹

电话：(029) 87406649

客服电话：95582

(86) 方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：高利

联系人：高洋

联系电话：(0731) 85832463

客服电话：95571

(87) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

联系人：杨鹏军

电话：(0551) 2207114

客服电话：95578

(88) 上海证券有限责任公司

注册地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

电话：(021) 68475888

客服电话：4008918918

(89) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路228号

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：(0755) 82492193

客服电话：95597

(90) 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

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：(010) 63080994

客服电话：4008008899

(91) 申万宏源证券有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

电话：(021) 33389888

客服电话：95523 或 4008895523

(92) 华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路 157 号 7-8 层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：(0591) 87383623

客服电话：96326

(93) 太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法定代表人：李长伟

联系人：王婧

电话：010- 88321613

客服电话：4006-650-999

(94) 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：韩志谦

联系人：李玉婷

电话：010-88085858

客户服务电话：400-800-0562

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

(95) 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

联系人：秦朗

电话：010-85679888-6035

客服电话：4009101166

(96) 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

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

客服电话：4006-600109

(97) 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

联系人：刘宏莹

电话：0755-82791065

客服热线：4009908826

(98) 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

联系人：张煜

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

(99) 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

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

电话：021-20315255

客户服务电话：95538

(100) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座28层

法定代表人：蒋煜

联系人：尚瑾

客服电话：4008188866

(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：075533382888（总机） 075533033936（直线） 13480989076

传真：075533033086

### （四）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：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

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、基金名称

融通新蓝筹证券投资基金

## 六、基金类型

契约型开放式

## 七、基金的投资目标

本基金为“新蓝筹”资本增值型基金，主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的“新蓝筹”上市公司。通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金份额持有人获取长期稳定的投资收益。

## 八、基金的投资方向

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市 的股票、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。对“新蓝筹”企业的投资不少于股票资产的 80%，同时将根据市场状况调整投资组合，把握投资机会，实现组合的进一步优化。

## 九、基金的投资策略

在对市场趋势判断的前提下，重视仓位选择和行业配置，同时更重视基本面分析，强调通过基本面分析挖掘个股。在正常市场状况下，股票投资比例浮动范围：30-75%；债券投资比例浮动范围：20-55%；权证投资比例浮动范围：0-3%；现金留存比例浮动范围：不低于 5%。

### 1、资产配置

贯彻“自上而下”的投资策略，结合宏观经济状况、资本市场的运行周期确定风险收益互补的股票资产和债券资产的投资比例。

### 2、行业资产配置

在“新蓝筹”投资理念的指导下，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，确定股票资产在不同行业的投资比例。

### 3、债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质，综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素；另一方面考虑宏观经济数据，包括通货膨胀率、商品价格和 GDP 增长等因素。

### 4、股票选择

股票投资中将以“新蓝筹”资本增值型投资为主导，把企业的未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。致力于建立完善的数理统计体系，利用数理分析方法检验不同的投资方法和投资思路，对市场运行特征进行跟踪，确保基金投资决策的科学性。同时重视对趋势的把握，顺势而为，灵活操作。

“新蓝筹”企业的主要选择标准是：

(1) 行业发展状况良好，企业处于成长阶段或成熟阶段的早期，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；过去三年或预期未来两年主营业务收入增长率平均大于 6%或者 GDP 增长率；

(2) 企业成长性较好，市场竞争能力强，主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性；

(3) 企业盈利能力较强，主营业务盈利水平较高；财务管理能力较强，现金收支安排有序，资产盈利水平较高；

(4) 企业财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

(5) 企业在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位；

(6) 企业管理层开拓进取，具备企业家素质，建立了科学的管理和组织架构。

## 5、权证投资策略

### (1) 投资策略

根据权证作为衍生品品种本身的特性和作用，本基金在权证投资上主要运用以下投资策略：基于标的证券未来合理估值范围分析及权证定量分析基础上的头寸保护策略及跨式权证投资策略；基于权证杠杆比率及 Delta 对冲比率分析基础上的权证替换投资策略；基于 Black-Scholes 等权证合理定价分析方法基础上的权证与标的证券的套利投资策略。

### (2) 风险控制措施

1) 实行投资授权控制，确保权证投资的审慎性。

2) 实行投资流程控制，在充分研究的基础上参与权证的投资。权证投资必须有公司内部研究报告的支持，研究报告需包含权证标的证券的投资价值分析以及权证投资价值金融工程定量分析。

3) 公司监察稽核部依据相关管理规定对权证投资管理过程的合规性进行检查。

## 6、资产支持证券的投资策略及风险控制措施

### A、投资策略

在确保与基金投资目标相一致的前提下，可本着谨慎和风险可控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于资产支持证券。

#### a、买入持有策略

可在与投资目标一致的前提下，买入并持有资产支持证券，以获取相应的利息收入。

#### b、利率预期策略



根据对利率趋势、提前还款率等的预期，预测资产支持证券收益率的变化趋势，从而决定对资产支持证券的买入或卖出。

c、信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估，分析预期违约率和违约损失率的变化趋势，评估其信用利差是否合理，并预测其变化趋势，通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

d、相对价值策略

通过计算资产支持证券的名义利差、静态利差及期权调整利差等指标，将资产支持证券的收益风险特征与其他资产类别和债券的收益风险比较，确定其是否具有相对价值，从而决定对其整体或个券的买入和卖出。

B、风险控制措施

a、通过严格的投资流程控制投资风险，基金经理及有关人员必须严格执行公司投资授权制度。

b、在投资资产支持证券时，首先应由固定收益研究员提出资产支持证券产品的风险收益报告和投资建议，基金经理根据投委会决定的资产配置计划和相应的投资权限，参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告，充分评估资产支持证券的风险收益特征，确定具体投资方案，在严格控制风险的前提下，谨慎进行投资。

c、基金交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险控制等。

d、固定收益小组对资产支持证券投资进行风险和绩效评估，密切跟踪影响基金所投资资产支持证券信用质量变化的各种因素，并在投资中进行相应操作，以规避信用风险的上升。

e、固定收益小组负责不断完善资产支持证券定价模型，并评估模型风险。密切跟踪影响资产支持证券收益率变化的各种因素，并评估其对资产支持证券持有期收益的影响，并进行相应的投资操作。

f、基金经理在投资决策时将评估资产支持证券的上市等流动性安排，并考虑其对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的资产支持证券具有适当的流动性。

g、基金经理将密切关注影响债务人提前偿还的各种因素，并评估其对资产支持证券投资价值的影响，并进行相应的投资决策。

h、将不断完善内部控制制度及相应技术手段，使基金相关操作以谨慎安全的方式进行，确保基金及持有人利益得到保障。

i、将严格审查所投资资产支持证券的法律文件,确保各业务环节都有适当的法律保障。

## 十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为“沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%”。

## 十一、基金的风险收益特征

在适度风险下追求较高收益。

## 十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于 2017 年 10 月 11 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 6 月 30 日。本报告中所列财务数据未经审计。

### 1.1 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	1,850,570,052.50	73.17
	其中:股票	1,850,570,052.50	73.17
2	固定收益投资	539,646,000.00	21.34
	其中:债券	539,646,000.00	21.34
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	125,198,247.96	4.95

7	其他各项资产	13,632,027.74	0.54
8	合计	2,529,046,328.20	100.00

### 1.2 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	59,300,000.00	2.35
C	制造业	916,921,377.30	36.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,689,684.38	1.02
E	建筑业	170,160,591.40	6.75
F	批发和零售业	351,025,903.60	13.93
G	交通运输、仓储和邮政业	9,976,680.00	0.40
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,639.62	0.00
J	金融业	236,304,714.60	9.38
K	房地产业	15,449,720.00	0.61
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,546,157.28	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	40,827,994.20	1.62
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	11,359,590.12	0.45
S	综合	-	-
	合计	1,850,570,052.50	73.46

### 1.3 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	601933	永辉超市	34,439,802	243,833,798.16	9.68

2	600742	一汽富维	9,002,657	172,040,775.27	6.83
3	600085	同仁堂	4,476,338	156,492,776.48	6.21
4	601668	中国建筑	15,488,564	149,929,299.52	5.95
5	601607	上海医药	3,711,638	107,192,105.44	4.26
6	601398	工商银行	19,436,840	102,043,410.00	4.05
7	002475	立讯精密	3,439,953	100,584,225.72	3.99
8	000333	美的集团	1,849,110	79,585,694.40	3.16
9	000568	泸州老窖	1,536,282	77,705,143.56	3.08
10	600028	中国石化	10,000,000	59,300,000.00	2.35

#### 1.4 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	539,646,000.00	21.42
	其中：政策性金融债	539,646,000.00	21.42
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	539,646,000.00	21.42

#### 1.5 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	170204	17 国开 04	1,800,000	179,226,000.00	7.11
2	130238	13 国开 38	500,000	50,375,000.00	2.00
3	120230	12 国开 30	500,000	50,005,000.00	1.98
4	120247	12 国开 47	400,000	40,044,000.00	1.59
5	130245	13 国开 45	300,000	30,390,000.00	1.21

**1.6 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。

**1.7 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。

**1.8 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。

**1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****1.9.1 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。

**1.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****1.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**1.10.2 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。

**1.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**1.11 投资组合报告附注**

1.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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。

1.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**1.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	920,862.55
2	应收证券清算款	332,461.54
3	应收股利	-
4	应收利息	12,241,281.60
5	应收申购款	137,422.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,632,027.74

**1.11.4 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。

**1.11.5 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。

**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。

本基金合同生效日为2002年9月13日,业绩表现截止日为2017年6月30日。本基金最近十年投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益	①-③	②-④

		②		率标准差		
				④		
2007 年度	116.27%	1.85%	114.93%	1.70%	1.34%	0.15%
2008 年度	-44.85%	1.53%	-50.30%	2.29%	5.45%	-0.76%
2009 年度	48.92%	1.58%	74.03%	1.50%	-25.11%	0.08%
2010 年度	-1.25%	1.13%	-8.57%	1.19%	7.32%	-0.06%
2011 年度	-23.04%	0.92%	-18.35%	0.98%	-4.69%	-0.06%
2012 年度	4.44%	0.94%	7.06%	0.96%	-2.62%	-0.02%
2013 年度	6.40%	1.06%	-4.97%	1.05%	11.37%	0.01%
2014 年度	19.20%	1.01%	40.22%	0.92%	-21.02%	0.09%
2015 年度	37.31%	2.16%	7.08%	1.87%	30.23%	0.29%
2016 年度	-34.31%	1.53%	-8.55%	1.05%	-25.76%	0.48%
2017 年上半年	8.73%	0.55%	7.44%	0.43%	1.29%	0.12%

注：截至 2009 年 12 月 31 日，本基金的业绩比较基准为：国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%；2010 年 1 月 1 日起 2015 年 9 月 30 日，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%，2015 年 10 月 1 日起至今，本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%。

#### 十四、费用概览

##### （一）与基金运作有关的费用

##### 1、与基金运作有关费用种类

- （1）基金管理人的管理费；
- （2）基金托管人的托管费；
- （3）证券交易费用；
- （4）基金信息披露费用；
- （5）基金份额持有人大会费用；
- （6）基金成立后与基金相关的会计师费和律师费；
- （7）按照国家有关规定可以列入的其他费用。

##### 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

基金管理人的管理费以基金资产净值的1.50%年费率计提。基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两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、休息日等，支付日期顺延。

#### (2) 基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费，按前一日的基金资产净值的2.50%的年费率计提。基金托管人的托管费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3) 上述1中(3)到(7)项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用实际支出金额支付，列入当期基金费用。

#### 3、不列入基金费用的项目

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资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

#### 4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费，无须召开基金份额持有人大会。最迟须于新的费率或收费方式实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介上公告。

#### (二) 与基金销售有关的费用

##### 1、申购费率

(1) 本基金的申购采用前端收费和后端收费两种收费模式，投资人可自行选择。申购费用用于基金管理人、基金销售机构的基金销售费用。

(2) 本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。本基金的前端申购费率，同时区分普通客户申购和养老金客户通过直销机构直销柜台前端申购。

上述养老金客户包括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等，具体包括：

- 1) 全国社会保障基金；
- 2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- 3) 企业年金单一计划以及集合计划；
- 4) 企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划。

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，本公司将在招募说明书更



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。

普通客户指除通过直销机构直销柜台申购的养老金客户以外的其他客户。

普通客户申购本基金前端基金份额的费率表如下：

申购金额 (M) (单位：元)	前端申购费率
M < 100 万	1.50%
100 万 ≤ M < 500 万	0.90%
500 万 ≤ M < 1000 万	0.30%
M ≥ 1000 万	单笔 1000 元

养老金客户通过直销机构直销柜台申购本基金前端基金份额的申购费为每笔 100 元。

(3) 本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同的费率水平。费率表如下：

持有时间 (T)	后端申购费率
T < 1 年	1.60%
1 年 ≤ T < 2 年	1.20%
2 年 ≤ T < 3 年	0.80%
3 年 ≤ T < 4 年	0.40%
T ≥ 4 年	0.00%

说明：上表中，1 年为 365 天。

## 2、赎回费率

本基金的赎回费率区分普通客户赎回和通过直销柜台赎回的养老金客户。

上述养老金客户包括基本养老保险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等，包括：

- (1) 全国社会保障基金；
- (2) 可以投资基金的地方社会保障基金；
- (3) 企业年金单一计划以及集合计划；

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，基金管理人届时将发布临时公告将其纳入养老金客户范围，在招募说明书更新时对其进行更新，并按规定向中国证监会备案。

普通客户指除通过直销柜台赎回的养老金客户以外的其他客户。

普通客户的赎回费率按照赎回总金额的 0.50% 收取，最低赎回费为 5 元。养老金客户特定赎回费率为原赎回费率的 40%，即特定赎回费 100% 计入基金财产。赎回费用由赎回人承担，赎回费的 40% 归基金财产。

## 3、转换费率

(1) 基金转换只允许在缴纳前端申购(认购)费用的基金份额之间或者缴纳后端申购(认购)费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端申购(认购)费用的基金份额转换为缴纳后端申购(认购)费用的基金份额,或将缴纳后端申购(认购)费用的基金份额转换为缴纳前端申购(认购)费用的基金份额。基金转换费用包括转换费和补差费。

(2) 转换费:按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

(3) 补差费:对于前端收费模式基金,转出基金的申购费率(或认购费率)高于转入基金的申购费率(或认购费率)时,补差费为0;转出基金的申购费率(或认购费率)低于转入基金的申购费率(或认购费率)时,按申购费率(或认购费率)的差额收取补差费。对于后端收费模式基金,补差费为0。

(4) 基金补差费的收取以该基金份额曾经有过的最高申(认)购费率为基础计算,累计不超过最高认购(申购)费率与最低认购(申购)费率的差额。

(5) 基金转换费由转换申请人承担,其中25%归转出基金基金财产,其余作为注册登记费和相关的手续费。基金补差费由转换申请人承担,作为相关的手续费。

4、基金管理人可以调整申购、赎回与转换费率,最新的申购、赎回与转换费率在招募说明书(更新)中列示。费率如发生变更,基金管理人最迟将于新的费率开始实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒介公告。

### (三) 基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律法规的规定,履行纳税义务。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于2015年4月24日刊登的本基金更新招募说明书进行了更新,主要更新内容如下:

1、在“第三节、基金管理人”部分,对“(一)基金管理人概况”和“(二)主要人员情况”进行了更新;

2、在“第四节、基金托管人”部分,对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况按照最新资料进行了更新;

3、在“第五节、相关服务机构”部分,更新了代销机构和注册登记人的相关信息;

4、对“第八节、基金份额的申购 赎回 转换”部分的内容进行了更新;

5、在“第九节、基金的投资”部分,对本基金2015年第2季度报告中的投资组合数据进行了列示;

6、在“第十节、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；

7、对“二十一节、对基金份额持有人的服务”部分的内容进行了更新；

8、在“第二十二节、其他应披露的事项”部分，对本报告期内的基金公告进行了列表说明。

融通基金管理有限公司

2017年10月26日