

融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

重要提示

融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金（以下简称本基金）经中国证券监督管理委员会（以下简称中国证监会）下发的《关于准予融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1428号文）准予募集注册。基金合同于2016年11月8日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。基金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。

投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

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和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。

本基金资产投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资者结构、投资标的构成、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的买者自负原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2017年11月7日，有关财务数据截止日为2017年9月30日，净值表现截止日为2017年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日

2016年11月8日

二、基金管理人概况

（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（NikkoAssetManagementCo.,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 AllenYan（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

王浩宇先生，香港城市大学和巴黎第九大学金融数学硕士、中国人民大学数学学士，金融风险管理师（FRM），8年证券投资从业经历，具有基金从业资格及香港证监会颁发的1,4,9号牌的从业资格。曾任职于国家外汇管理局中央外汇业务中心，担任投资部组合经理。2015年7月加入融通基金管理有限公司，现任融通丰利四分法（QDII-FOF）、融通沪港深智慧生活灵活配置混合基金的基金经理。

（2）历任基金经理情况

自2016年11月8日起至2017年12月5日，由商小虎先生、王浩宇先生共同担任本基金的基金经理。

自2017年12月6日起至今，由王浩宇先生担任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司境外公募基金投资决策委员会成员：常务副总经理颜锡廉先生，基金经理王浩宇先生，基金经理胡允畧先生，基金交易部总经理谭奕舟先生，风险管理部总经理马洪元先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人的情况

（一）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)67595096

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。

中国建设银行于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，中国建设银行资产总额216,920.67亿元，较上年末增加7,283.62亿元，增幅3.47%。上半年，中国建设银行实现利润总额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，中国建设银行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。中国建设银行在英国《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。

（二）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。

原珏，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。

（三）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

（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、其他销售机构

（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

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

客户服务电话：95533

（2）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

客服电话：95588

（3）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

客服电话：95566

（4）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

客服电话：95555

（5）平安银行股份有限公司

注册地址：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：（0755）25859591

传真：（0755）25879453

客服热线：40066-99999

（6）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路 18 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：牛锡明

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：陈铭铭

客户服务电话：95559

(7) 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

开放式基金咨询电话：021-962888

(8) 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

电话：(010) 65557062

传真：(010) 65550827

客户服务电话：95558

(9) 渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河东区海河东路 218 号

法定代表人：李伏安

联系人：王宏

电话：022-58316666

客服电话：95541

(10) 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

(11) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：高国富

客户服务电话：95528

网址：www.spdb.com.cn

(12) 包商银行股份有限公司

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;

(13) 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。

（14）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 座楼

法定代表人：其实

电话：021-54509998

传真：021-64385308

联系人：高莉莉

客服热线：4001818188

公司网站：1234567.com.cn

（15）浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址：杭州市文二西路 1 号 903 室

办公地址：杭州市余杭区五常街道同顺路 18 号

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：吴强

客服热线：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

（16）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

电话：020-89629099

传真：020-89629011

联系人：黄敏嫦

客服热线：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

（17）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

电话：010-57418813

传真：010-57569671

联系人：崔丁元

客服热线：4008936885

公司网站：www.qianjing.com

（18）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

(19) 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

传真：010-58325282

联系人：文雯

客服热线：400-166-1188

公司网站：http://8.jrj.com.cn/

(20) 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 楼

办公地址：上海市徐汇区虹梅路 1801 号凯科国际大厦 7 楼

法定代表人：金佶

电话：021-33323999

传真：021-33323837

联系人：陈云卉

客服热线：400-821-3999

公司网站：tty.chinapnr.com

(21) 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：TANYIKUAN

电话：0755-89460500

传真：0755-21674453

联系人：叶健

客服热线：400-684-0500

公司网站：www.ifastps.com.cn

(22) 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 1501-1504

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：梁云波

电话：0592-3122757

传真：0592-3122701

客户服务电话：400-918-0808

公司网站：www.xds.com.cn

(23) 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：齐小贺

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

（24）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：吕慧

电话：（021）58788678

（25）上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

办公地址：上海市浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

电话：021-20213600

传真：021-68596916

联系人：张茹

客服热线：400-700-9665

公司网站：www.ehowbuy.com

（26）北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

电话：010-59601366-7024

传真：010-62020355

联系人：李静如

客服热线：4008188000

公司网站：<http://www.myfund.com/>

（27）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：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室

法定代表人：林义相

电话：010-66045777

传真：010-66045518

联系人：谭磊

客服热线：010-66045678

公司网站：www.txsec.com

（28）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

(29) 诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址: 上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址: 上海市杨浦区秦皇岛路32号c栋

法定代表人: 汪静波

电话: 021-38509735

传真: 021-38509777

联系人: 李娟

客服热线: 400-821-5399

公司网站: www.noah-fund.com

(30) 上海陆金所资产管理有限公司

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

(31) 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1002室

地址: 北京市朝阳区建外大街22号返利大厦10层

法定代表人: 王莉

电话: 8610-85650628

传真: 8610-65884788

网址: <http://www.hexun.com/>

(32) 一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址: 北京市西城区阜成门大街2号1幢A2008室

办公地址: 北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人: 吴雪秀

联系人: 段京璐

电话: 010-88312877

传真: 010-88312099

客户服务电话: 400-001-1566

网址: www.yilucaifu.com

(33) 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

(34) 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

（35）上海万得投资顾问有限公司

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：021-51327185

传真：021-50710161

联系人：姜吉灵

客服热线：400-821-0203

（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：沈继伟

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：曹怡晨

客服热线：400-067-6266

公司网站：<http://a.leadfund.com.cn>

（37）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

（38）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

（39）天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

电话：010-59013828

传真：010-59013707

联系人：王芳芳

客服热线：010-59013842

公司网站: <http://www.wanjiawealth.com/>

(40) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

办公地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

法定代表人: 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/

(41) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

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 做 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

(42) 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

(43) 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: 021-51327185

传真: 021-50710161

联系人: 姜吉灵

客服热线: 400-821-0203

网址: www.520fund.com.cn

(44) 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: 400-8888-108

(45) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：涂洋

电话：（021）23219275

客服电话：4008888001

（46）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

法人代表：李长伟

联系人：王婧

电话：010-88321613

客服热线：0871-68898130

（47）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

（48）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）86281305

客服电话：4008222111

（49）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：曹实凡

联系人：周一涵

电话：（021）38637436

客服电话：95511 转 8

（50）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：周青

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

（51）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：021-53686262

客户服务电话：4008-918-918

（52）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

法定代表人：叶顺德

联络人：田芳芳

电话：（010）83561072

客服电话：400698989

（53）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）33388229

客服热线：95523 或 4008895523

（54）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：0991-7885083

客户服务电话：400-800-0562

（55）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：钟伟镇

传真：（021）38676767

客服电话：4008888666

（56）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：马静懿

电话：（010）60838995

客服电话：4008895548

（57）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

（58）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

（59）信达证券股份有限公司

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：张志刚

联系人：尹旭航

电话：（010）63080994

客服电话：4008008899

（60）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：96518

（61）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：秦雨晴

电话：021-20315255

客户服务电话：95538

（62）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

（63）第一创业证券股份有限公司

联系地址：广东省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：李晓伟

电话：（0755）23838751

客服电话：4008881888

（64）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

（65）安信证券股份有限公司

办公地址：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：王连志

联系人：杨天枝

电话：（0755）82558336

客服热线：4008001001

（66）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：李芳芳

电话：（021）22169130

客服电话：95525

（二）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) 出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

经办律师：安冬、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

(四) 审计基金财产的会计师事务所

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

联系电话：(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

融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金

六、基金类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金重点投资于属于智慧生活主题的公司，在合理控制投资风险的基础上，力争把握该主题公司的投资机会，获取基金资产的长期稳健增值。

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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、沪港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称港股通标的股票）、固定收益类资产（包括国债、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、资产支持证券、债券回购、银行存款等）、股指期货与权证等金融衍生工具、现金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，基金管理人将在履行适当程序并经基金托管人确认后，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%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的0-95%，投资于港股通标的股票的比例占基金资产的0-95%），权证投资占基金资产净值的比例为0-3%。本基金投资于智慧生活主题相关上市公司的证券资产的比例不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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%。

未来若中国证监会允许内地投资者、基金通过内地其他证券交易所和香港联合交易所建立的技术连接机制

买卖规定范围内的香港联合交易所上市公司股票（包括该机制未来任何替代或修正机制的启动），且法律法规允许本基金通过前述机制买卖规定范围内的香港依法发行上市的股票，在履行适当程序后，则本基金可以直接投资相应范围内的香港上市股票，无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金的资产配置策略主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。

在资产配置中，本基金主要考虑宏观经济指标，包括 PMI 水平、GDP 增长率、M2 增长率及趋势、PPI、CPI、利率水平与变化趋势、宏观经济政策等，来判断经济周期目前的位置以及未来将发展的方向。

在经济周期各阶段，综合对所跟踪的宏观经济指标和市场指标的分析，本基金对大类资产进行配置的策略为：在经济的复苏和繁荣期超配股票资产；在经济的衰退和政策刺激阶段，超配债券等固定收益类资产，力争通过资产配置获得部分超额收益。

2、股票投资策略

（1）智慧生活主题的界定

本基金定义的智慧生活，其核心是通过利用新一代信息技术来改变人们相互交互的方式，全面提升人们在衣、食、住、行、健康、教育、环保等物质生活和精神生活方面的质量。智慧具体体现为：更透彻的感知、更全面的互联互通、更深入的智能化。如今信息基础架构与高度整合的基础设施，再加上物联网、云计算、SOA 等技术的完美结合，使得政府、企业和市民可以做出更明智的决策，提升我们的生活品质。

本基金将重点关注以下投资领域：智能穿戴、智慧农业、智慧家居、智慧社区、智慧交通、智慧医疗、智慧环保、智慧教育等。具体来看：

衣，包括智能穿戴等。指应用穿戴式技术对日常穿戴进行智能化设计、开发出可以穿戴的设备，实现人和这些设备的交流互动，建立关系，使人的生活更加信息化，智能化。

食，包括智能农业等。指将物联网技术运用到传统农业中去，使传统农业更具有智慧，实现农业可视化远程诊断、远程控制、灾变预警等智能管理。

住，包括智能家居、智慧社区等。智能家居是将家居生活有关的设施集成，构建高效的住宅设施与家庭日程事务的管理系统，提升家居的安全性、便利性、舒适性和艺术性。智慧社区是指充分借助互联网、物联网，形成基于海量信息和智能过滤处理的新的生活、产业发展、社会管理等模式，面向未来构建全新的城区（社区）形态，并将各社区连成片实现整个城市的智慧化管理和运行，进而为城市中的人创造更美好的生活，促进城市的和谐、可持续成长。

行，包括智慧交通等，指辅助实现交通的智能监管和调控的公司，它综合运用信息技术、电子控制、影像处理等多种技术，能快速准确实现交通信息采集、处理、决策、指挥调度。

健康，包括智慧医疗等，是指利用物联网技术，打造健康档案区域医疗信息平台，实现患者与医务人员、医疗机构、医疗设备之间的互动，最终实现实时、智能化、自动化、互联互通的动态服务。

环保，智慧环保是数字环保概念的延伸和拓展，是借助物联网技术，把感应器和装备嵌入到各种环境监控对象（物体）中，通过超级计算机和云计算将环保领域物联网整合起来，可以实现人类社会与环境业务系统的整合，以更加精细和动态的方式实现环境管理和决策的智慧。

教育，智慧教育是为了促进人的发展，全面提高教育质量与效益，运用先进的信息技术，对教育过程的各种信息与情境进行感知、识别、分析、处理，为教育参与者提供快速反馈、决策支持、路径指引和资源配送的教育方式。

随着经济的发展和技术的进步，影响人们生活方式的行业范围也会发生变化，本基金不断对智慧生活主题进行跟踪研究，适时调整智慧生活投资主线的界定。

（2）智慧生活子行业的配置

本基金的投资和智慧生活密切相关，将在综合考虑宏观经济状况、政府产业政策、行业生命周期等因素的情况下，将股票资产在各产业、各行业间灵活动态配置。

1) 宏观经济状况

本基金将分析和预测众多宏观经济数据，包括 GDP、CPI、社会融资总量、利率水平等等，结合国家财政政策、货币政策等，选择合适的时点灵活投资。本基金也将着眼于国际视野，密切关注有利于人类智慧生活的新技术的发展，在结合市场对智慧生活发展需求的基础上，挑选出在当前宏观环境下景气度高并有成长潜力的行业进行投资。

2) 政府产业政策

国家和地方政府在为了实现一定的经济和社会目标的情况下会对相关产业的发展进行支持和干预。通过这样的手段，相关行业能得到较快的发展。尤其是在目前我国产业结构调整的大背景下，在国家倡导下发展的为智慧发展做贡献的行业很可能将有更多成长机会。因此本基金将紧密跟踪政府产业政策的导向，顺应我国产业发展的趋势，投资受益最大的行业。

3) 行业生命周期

行业生命周期理论为本基金判断一个行业以及其下各个细分子行业处在成长、成熟还是衰退的状态奠定理论基础。本基金将在具体分析行业的市场增长率、产品品种、竞争壁垒、技术变革、用户需求的状况下选择成长性良好，或者处于培育期但是发展前景广阔的行业进行投资。

(3) 个股精选策略

在行业配置的基础上，本基金将对国内 A 股和港股通标的的具体上市公司的基本状况和投资价值进行定性和定量的分析，精选出极具竞争力的公司进行投资。

1) 基本状况

本基金将通过公司的毛利、管理销售费用率、产品周期等的分析来研究公司的基本面和财务状况，通过上下游分析、股权结构分析、股东与管理团队分析、公司历史发展和未来战略规划分析来研究公司的竞争力和核心价值，然后挑选出具有产品研发能力、具有运营优势、内部治理严谨、商业模式有亮点的公司进行投资。

2) 投资价值

本基金将考察自由现金流 (FCF)、市盈率 (P/E)、市净率 (P/B)、企业价值/息税前利润 (EV/EBIT)、收入增长率、净利润增长率等一系列指标，通过折现模型、相对估值模型等分析公司的价值，本基金将投资于业绩有前景、估值水平有吸引力的投资标的，并随时灵活调整股票池。

3) 除了投资于国内 A 股市场，本基金可通过沪港股票市场交易互联互通机制以及其他经中国证监会允许的基金可以使用的内地其他证券交易所与香港联合交易所建立的技术连接机制投资于香港股票市场，不使用合格境内机构投资者(QDII)境外投资额度进行境外投资。

本基金将充分考量宏观因素(GDP/CPI 等)、估值因素(PE/EarningsGrowth 等)、政治因素等对国内 A 股和港股通标的的股票的影响，结合估值/资金利差等指标，依据基金合同约定的投资范围制定并适时调整国内 A 股和港股通标的的股票两地股票配置比例及投资策略。

3、债券投资策略

在债券投资上，本基金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。

4、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

5、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

6、金融衍生工具投资策略

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。若法律法规或监管机构以后允许基金投资如期权、互换等其他金融衍生品种，本基金将以风险管理和组合优化为目的，根据届时法律法规的相关规定参与投资。

十、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率 50%+中债综合全价（总值）指数收益率 40%+中证香港 100 指数收益率 10%。

选择该业绩比较基准的理由主要如下：

- 1、沪深 300 指数的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。
- 2、中债综合全价（总值）指数能够较好的反映债券市场变动的全貌，适合作为本基金债券投资的比较基准。
- 3、中证香港 100 指数样本覆盖了整个香港市场 80%左右的市值，是香港市场首个选样范围跨两板的指数，具有很高的市场代表性和良好的可投资性。

如果指数编制单位停止计算编制这些指数或更改指数名称，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。

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，而无须召开基金份额持有人大会。

十一、基金的风险收益特征

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和货币市场基金，但低于股票型基金，属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。本基金如果投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

十二、基金的投资组合报告

本基金托管人中国建设银行根据基金合同规定，于 2017 年 12 月 4 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 2017 年 9 月 30 日。

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	134,881,426.37	94.82
---	------	----------------	-------

	其中：股票	134,881,426.37	94.82
--	-------	----------------	-------

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	6,563,136.37 4.61
8 其他资产	799,098.90 0.56
9 合计	142,243,661.64 100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 134,881,426.37 元，占期末基金资产净值比例为 95.28%。

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

本基金本报告期末未持有境内股票。

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
------	---------	--------------

工业	16,380,935.01	11.57
----	---------------	-------

信息技术	17,050,552.05	12.04
------	---------------	-------

日常消费品	6,541,192.48	4.62
-------	--------------	------

原材料	20,214,940.79	14.28
-----	---------------	-------

金融	42,420,031.70	29.97
----	---------------	-------

非日常生活消费品	15,129,912.62	10.69
----------	---------------	-------

能源	17,143,861.72	12.11
----	---------------	-------

合计	134,881,426.37	95.28
----	----------------	-------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	H02899	紫金矿业	3,718,000	8,466,216.16	5.98
---	--------	------	-----------	--------------	------

2	H00297	中化化肥	6,446,000	7,777,209.87	5.49
---	--------	------	-----------	--------------	------

3	H01766	中国中车	1,200,000	7,075,968.48	5.00
---	--------	------	-----------	--------------	------

4	H00934	中石化冠德	1,522,000	6,802,140.06	4.81
---	--------	-------	-----------	--------------	------

5	H00291	华润啤酒	364,000	6,541,192.48	4.62
---	--------	------	---------	--------------	------

6	H01033	中石化油服	5,310,000	6,135,904.66	4.33
---	--------	-------	-----------	--------------	------

7	H00665	海通国际	1,581,000	6,044,906.07	4.27
---	--------	------	-----------	--------------	------

8	H02333	长城汽车	718,500	5,860,614.82	4.14
---	--------	------	---------	--------------	------

9	H01970	IMAXCHINA	288,800	5,791,010.67	4.09
---	--------	-----------	---------	--------------	------

10	H06030	中信证券	393,000	5,736,683.41	4.05
----	--------	------	---------	--------------	------

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。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

在法律法规允许的范围内，本基金可基于谨慎原则运用股指期货等相关金融衍生工具对基金投资组合进行管理，以套期保值为目的，对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险，提高投资效率。本基金主要采用流动性好、交易活跃的衍生品合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

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。

11.投资组合报告附注

11.1 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形：

中信证券：2017年5月25日，中信证券公告收到中国证监会《行政处罚事先告知书》（处罚字[2017]57号）。依据《证券公司监督管理条例》第八十四条第（七）项的规定，中国证监会拟决定：责令中信证券改正，给予警告，没收违法所得人民币61,655,849.78元，并处人民币308,279,248.90元罚款。但我们认为，中信证券的处罚带来的影响有限，基本面仍然较为稳健。1）罚款针对历史事件，属中国证监会针对2015年违规融资融券的罚款；2）海通等其他国内券商亦有受罚，属于行业性的问题；3）违规问题已被处罚，并妥善解决。目前公司合法合规，运营正常。

11.2 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。

11.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 -

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 797,197.59

4 应收利息 1,900.31

5 应收申购款 1.00

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 799,098.90

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。

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。

基金合同生效日为 2016 年 11 月 8 日,基金业绩截止日为 2017 年 6 月 30 日。

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	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	—	—
2016 年 11 月 8 日(基金合同生效日)起至 2016 年 12 月 31 日	0.36%	0.09%	-1.92%	0.45%	2.28%	-0.36%
2017 年上半年	-0.78%	0.43%	6.22%	0.32%	-7.00%	0.11%

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/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 9、因投资相关规定范围内的香港联合交易所上市的股票而产生的各项合理费用；
- 10、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

(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%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

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：

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

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托

管人协商解决。

上述一、基金费用的种类中第 3—10 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（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 2017 年 6 月 21 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、在重要提示部分，增加了特有风险说明，明确了更新招募说明书内容的截止日期和有关财务数据的截止日期；
- 2、在第三部分、基金管理人部分，根据最新资料更新了主要人员情况；
- 3、在第四部分、基金托管人部分，对基金托管人的情况根据最新资料进行了更新；
- 4、对第五部分、相关服务机构部分进行了更新；
- 5、对第八部分、基金份额的申购、赎回与转换部分进行了更新；
- 6、对第九部分、基金的投资部分，对本基金 2017 年第 3 季度报告中的投资数据进行了列示；
- 7、对第十部分、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；
- 8、对第二十二部分、其他应披露事项部分，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 12 月 23 日