

融通通利系列证券投资基金
更新招募说明书摘要
(2018 年第 2 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：二〇一八年十一月

融通通利系列证券投资基金更新招募说明书摘要 （2018年第2号）

重要提示

融通通利系列证券投资基金（以下简称“本系列基金”）是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）2003年8月6日证监基金字[2003]94号文件“关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复”批准募集设立，本系列基金的基金合同生效日为2003年9月30日。

本系列基金包含三个子基金，分别是：融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金。

本系列基金各子基金的单一投资者持有基金份额数均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。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

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，并依照《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。

本招募说明书所载内容截止日为2018年9月30日，有关财务数据截止日为2018年9月30日，净值表现数据截止日为2018年6月30日（本报告中财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日

2003年9月30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。

董事王利先生，工学学士，现任新时代证券股份有限公司总经理助理兼公司内核负责人、场外市场部负责人。历任中石化齐鲁分公司财务部会计，上海远东证券有限公司总经理助理兼稽核

部总经理，新时代证券股份有限公司总经理助理兼合规管理部、法律事务部总经理。2018年2月至今，任公司董事。

董事杨宗兵先生，中国语言文学博士后，现任明天控股有限公司干部与业务管理中心副总裁。历任安徽省池州市第八中学高中语文教师，中国图书进出口(集团)总公司党委组织部部长，新兴际华集团有限公司党群工作部部长、党委书记、董事、集团党委副书记、机关党委书记（副厅级）。2018年3月至今，任公司董事。

董事王裕闵先生，工商管理学硕士，现任日兴资产管理有限公司副总裁、全球投资主管兼首席投资官（国际），兼任ARK Investment Management GP LLC 董事会列席代表。历任M&T Bank 分析员，FGIC（GE Capital 通用资本的子公司）交易员，General Reinsurance 基金经理，CGA Investment Management 高级基金经理，Structured Credit Partners LLC 联合创始人兼首席投资官，Wachovia Corporation 董事总经理兼全球结构信贷产品主管、董事总经理兼全球市场和投资银行业务亚洲主管，宏利资产管理（Manulife Asset Management）香港亚洲固定收益产品主管，日兴资产管理有限公司首席投资官（国际），日兴资产管理有限公司全球投资主管兼首席投资官（国际）。2018年3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。

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，曾是中国证监会公职律师。2011年3月至今，任公司督察长。

4、本系列基金基金经理

（1）融通债券投资基金

A、现任基金经理情况

王超先生，金融工程硕士，经济学、数学双学士，11年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司固定收益部总监。历任深圳发展银行（现更名为平安银行）债券自营交易盘投资与理财投资管理经理。2012年8月加入融通基金管理有限公司，现任融通债券、融通四季添利债券（LOF）、融通岁岁添利定期开放债券、融通增鑫债券、融通增益债券、融通增裕债券、融通通泰保本混合、融通现金宝货币、融通稳利债券、融通汇财宝货币、融通易支付货币基金的基金经理。

B、历任基金经理情况

自2003年9月30日起至2004年7月20日，由徐荔蓉先生担任本基金的基金经理。

自2004年7月21日起至2008年3月30日，由陶武彬先生担任本基金的基金经理。

自2008年3月31日起至2012年8月29日，由乔羽夫先生担任本基金的基金经理。

2012年8月30日，由乔羽夫先生和张李陵先生共同担任本基金的基金经理。

自2012年8月31日起至2013年12月18日，由张李陵先生担任本基金的基金经理。

自2013年12月19日起至2013年12月26日，由张李陵先生和韩海平先生共同担任本基金的基金经理。

自2013年12月27日起至2014年1月6日，由张李陵先生、韩海平先生及王超先生共同担任本基金的基金经理。

自2014年1月7日起至2015年6月23日，由韩海平先生和王超先生共同担任本基金的基金经理。

自2015年6月24日起至今，由王超先生担任本基金的基金经理。

（2）融通深证100指数基金

A、现任基金经理情况

何天翔先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学理学学士，10年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司量化投资部副总监。曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师。2010年3月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资经理，现任融通深证100指数、融通军工分级、融通证券分级、融通新趋势灵活配置混合、融通通瑞债券、融通人工智能主题指数(LOF)基金的基金经理。

B、历任基金经理情况

自2003年9月30日起至2009年5月14日，由张野先生担任本基金的基金经理。

自2009年5月15日起至2010年4月16日，由郑毅先生和王建强先生共同担任本基金的基金经理。

自2010年4月17日起至2011年6月10日，由王建强先生担任本基金的基金经理。

自2011年6月11日起至2011年12月7日，由王建强先生和陶武彬先生共同担任本基金的基金经理。

自2011年12月8日起2014年10月24日，由王建强先生担任本基金的基金经理。

自2014年10月25日起2015年1月8日，由王建强先生和何天翔先生共同担任本基金的基金经理。

自2015年1月9日起至今，由何天翔先生担任本基金的基金经理。

（3）融通蓝筹成长混合基金

A、现任基金经理情况

薛冀颖先生，清华大学工学博士、西安电子科技大学工学学士，7年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任鹏华基金管理有限公司研究员。2014年9月加入融通基金管理有限公司，现任融通蓝筹成长混合基金的基金经理。

B、历任基金经理情况

自2003年9月30日起至2007年3月1日，由易万军先生担任本基金的基金经理。

自2007年3月2日起至2011年3月23日，由陈鹤明（曾用名陈晓生）先生及严菲女士共同担任本基金的基金经理。

自2011年3月24日起至2015年6月18日，由严菲女士担任本基金的基金经理。

自2015年6月19日起至今，由薛冀颖先生担任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

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

公司固定收益公募基金投资决策委员会成员：固定收益投资总监、基金经理张一格先生，固定收益部总监、基金经理王超先生，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、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

1、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：郭明

2、主要人员情况

截至 2018 年 6 月，中国工商银行资产托管部共有员工 212 人，平均年龄 33 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、基本养老保险、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 2018 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 874 只。自 2003 年以来，中国工商银行连续十五年获得香港《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 61 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）基金份额销售机构

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：北京市西城区太平桥大街 84 号丰汇时代大厦东翼 5 层 502-507 房间

邮政编码：100032

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：韦荣涛

联系电话：（0755）26947504

2、代销机构：

（1）中国工商银行股份有限公司

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

电话：（010）66107909

传真：（010）66107914

联系人：刘秀宇

（2）中国建设银行股份有限公司（除融通债券C类）

办公地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：田国立

客户服务电话：95533

传真：（010）67598409

联系人：王琳

（3）交通银行股份有限公司（除融通债券C类）

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：彭纯

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

联系人：陈铭铭

客户服务电话：95559

（4）招商银行股份有限公司（除融通债券C类）

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

电话：（0755）83198888

传真：（0755）83195049

客服电话：95555

（5）中信银行股份有限公司（除融通债券C类）

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

（6）中国光大银行股份有限公司（仅代销前端、除融通债券C类）

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：李晓鹏

电话：（010）68098778

传真：（010）68560661

联系人：李伟

客户服务电话：95595

（7）中国民生银行股份有限公司（除融通债券C类）

办公地址：北京市东城区正义路甲4号

法定代表人：洪崎

客户服务电话：95568

电话：（010）58560666 转 8988

传真：（010）58560794

联系人：董云巍

（8）北京银行股份有限公司（除融通债券C类）

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

法定代表人：张东宁

代销联系人：王曦

电话：（010）66223584

传真：（010）66226045

客服热线：95526

（0）华夏银行股份有限公司（仅代销前端、除融通债券C类）

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：李慧

电话：010-85238670

客服热线：95577

（10）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

开放式基金咨询电话：962888

开放式基金业务传真：（021）68476111

联系人：张萍

联系电话：（021）68475888

客服热线：962888

（11）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

（12）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

电话：（022）58316666

联系人：王宏

客户服务电话：400-888-8811

（13）中国邮政储蓄银行股份有限公司（仅代销前端、除债券A/B、债券C）

办公地址：北京市西城区金融大街3号

法定代表人：李国华

客服电话：95580

（14）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

（15）恒丰银行股份有限公司（仅代销前端、除债券C）

办公地址：烟台市南大街248号

法定代表人：蔡国华

电话：4008138888

（16）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

（17）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

（18）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

（19）深圳前海微众银行股份有限公司（除融通债券A/B、蓝筹成长）

地址：广东省深圳市南山区田厦金牛广场A座36楼、37楼

法定代表人：顾敏

客户服务电话：400-999-8800；

网址：www.webank.com

（20）兴业银行股份有限公司（仅代销深证100A/B）

办公地址：福建省福州市鼓楼区湖东路154号

法定代表人：高建平

联系电话：0591-87824863

客服热线：95561

公司网址：www.cib.com.cn

（21）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

（22）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：上海市浦东南路1118号鄂尔多斯大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

联系人：张茹

联系电话：（021）58870011

传真：（021）68596916

（23）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

（24）上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16楼

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16楼

法定代表人：张跃伟

客服电话：400-089-1289

联系人：周嫵旻

(25) 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

(26) 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1号楼12层1208号

法定代表人：罗细安

客服电话：400-001-8811

(27) 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

(28) 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号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元

法定代表人：赵学军

客服电话：400-021-8850

(29) 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

办公地址：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：卓紘晶

联系人：王妮萍

电话：0755-33376853

传真：0755-33065516

客服电话：4006-877-899

(30) 一路财富（北京）基金销售股份有限公司

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：刘栋栋

电话：010-88312877

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

网址：www.yilucaifu.com

(31) 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

法定代表人：王兵

客服电话：95162

(32) 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

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-88911818-8001

(33) 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

（34）上海汇付基金销售有限公司

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

（35）上海利得基金销售有限公司

公司地址：上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼
联系电话：021-50583533
传真：86-021-50583633
客服热线：4000676266
公司网站：www.leadfund.com.cn

（36）深圳众禄基金销售股份有限公司

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8号HALO广场4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

（37）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

（38）深圳富济基金销售有限公司

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

（39）上海陆金所基金销售有限公司（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：胡学勤
联系人：程晨
电话：021-20665952
客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（40）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

（41）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

法定代表人：汪静波

联系人：方成

电话：021-38602377

传真：021-38509777

（42）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

法定代表人：王莉

地址：北京市朝阳区建外大街22号返利大厦10层

客服热线：400-920-0022、021-20835588

公司网站：licaike.hexun.com

（43）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

（44）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

（45）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：上海市浦东新区浦明路1500号万得大厦11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

（46）上海中正达广基金销售有限公司

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

（47）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

网址：<http://www.dtfunds.com>

（48）奕丰基金销售有限公司

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：深圳市南山区海德三道航天科技广场A座17楼1704室

法定代表人：TEO WEE HOWE

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

（49）北京肯特瑞基金销售有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

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：江卉

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

（50）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

（51）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

（52）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

（53）北京植信基金销售有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号

法定代表人：于龙

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

传真：010-67767615

客户服务电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

（54）深圳市锦安基金销售有限公司（仅代销前端）

注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局综合

办公楼A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：广东省深圳市福田区新世界中心4楼

法定代表人：李学东

电话：0755-84669000

传真：0755-23982839

联系人：夏用功

客服热线：400-0719-888

公司网站：<http://www.ananjj.cn>

（55）上海联泰基金销售有限公司

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座3层

邮编：200335

法定代表人：燕斌

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

公司网址：www.66liantai.com

（56）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/

（57）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/>

（58）上海华夏财富投资管理有限公司（仅代销前端）

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人：毛淮平
电话：010-88066632
传真：010-63136184
联系人：仲秋玥
客服热线：400-817-5666
公司网站：www.amcfortune.com

（59）大河财富基金销售有限公司（仅代销前端）

注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号
办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路110-134号富中国际广场1栋20层1.2号
法定代表人：王荻
联系人：方凯鑫
电话：0851-88405606
传真：0851-88405599
客户服务电话：0851-88235678
网址：www.urainf.com

（60）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14号1幢11层1103号
办公地址：北京市朝阳区麦子店西街3号新恒基大厦15层
法定代表人：姜新
电话：010-65807865
传真：010-65807864
联系人：郭爱丽
客服热线：010-59539901
公司网站：cifcofund.com

（61）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层
法定代表人：钱昊旻
电话：010-59336539
传真：010-59336500
联系人：徐英
客服热线：4008-909-998
网址：www.jnlc.com

（62）上海挖财基金销售有限公司（仅代销前端）

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室
法定代表人：冷飞
电话：021-50810687
传真：021-58300279
联系人：李娟
客服热线：021-50810673
网址：www.wacaijijin.com

（63）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
电话：010-61840688
传真：010-61840699

联系人：戚晓强

客服热线：4000618518

公司网站：<https://danjuanapp.com/>

（64）金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

办公地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

法定代表人：夏予柱

电话：010-68091380

传真：010-68091380

联系人：胡明哲

客服热线：400-106-0101

公司网站：www.jhjfund.com

（65）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

电话：（021）62580818

客服热线：400-8888-666

（66）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

客户服务电话：95587

（67）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）82134993

客服热线：800-8108-868 95536

（68）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楼

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：霍达

联系人：黄蝉君

电话：（0755）82943511

客服热线：95565、400-8888-111

（69）广发证券股份有限公司（除融通债券C类）

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

客服热线：95575

（70）中信证券股份有限公司

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

法定代表人：王东明

联系人：马静懿

电话：（010）60838995

客服热线：0755-23835888

（71）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）66568450

客服热线：400-8888-888

（72）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

客服热线：400-8888-001、95553

（73）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

客服热线：95523 或 4008895523

（74）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路268号证券大厦

法定代表人：兰荣

联系人：乔琳雪

电话：0591-38281963

客服热线：95562

（75）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省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：（021）68751860

客服热线：400-8888-999、95579

（76）安信证券股份有限公司（除融通债券C类）

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

电话：（0755）82558038

客服热线：4008001001

（77）万联证券有限责任公司（除融通债券C类）

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：4008888133

（78）民生证券股份有限公司（除融通债券C类）

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

法人代表：冯鹤年

联系人：韩秀萍

电话：（010）85127622

客服热线：400-6198-888

（79）国元证券股份有限公司

注册地址：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

客服热线：95578

（80）渤海证券股份有限公司（除融通债券C类）

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

客服热线：400-651-5988

（81）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

（82）山西证券股份有限公司（除融通债券C类）

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

电话：0351-8686796

客户服务电话：95573

（83）东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：（0512）65581136

客服热线：4008601555

（84）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：张晓辰

电话：（010）63080994

客户服务电话：400-800-8899

（85）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、23层、25-29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

电话：（021）63325888

客服热线：95503

（86）方正证券股份有限公司（除融通债券C类）

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：丁敏

电话：（0731）85832463

客服热线：0731-95571

（87）长城证券股份有限公司（除融通债券C类）

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）83516094

客服热线：400-6666-888

（88）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）22169081

客服热线：95525

（89）东北证券股份有限公司（除融通债券C类）

注册地址：长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

电话：（0431）85096517

客服电话：95360

（90）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

客户服务电话：4008-918-918

（91）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

联系人：田芳芳

电话：（010）83561146

客服热线：400-6989-898

（92）国联证券股份有限公司（除融通债券C类）

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）2831662

客服热线：（0510）82588168

（93）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路荣超大厦4036号16-20

法定代表人：曹实凡

联系人：周一涵

电话：021-38637436

客服热线：95511-8

（94）华安证券股份有限公司

注册地址：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

（95）国都证券股份有限公司（除融通债券C类）

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：戈文

电话：（010）84183389

客服热线：400-818-8118

（96）恒泰证券股份有限公司（除融通债券C类）

注册地址：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

联系电话：（0471）4972343

客服电话：400-196-6188

（97）国盛证券有限责任公司

注册地址：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

联系：0791-86283080

客服热线：4008222111

（98）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

（99）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：（0755）25831754

客服热线：4008881888，95358

（100）金元证券股份有限公司（除融通债券 C 类）

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

客服热线：4008-888-228

（101）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

客户服务电话：99582

（102）华福证券有限责任公司（除融通债券 C 类）

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

客户服务电话：96326

（103）华龙证券股份有限公司（除融通债券 C 类）

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

业务联系人：刘宏波

联系电话：（0931）4890208

客服电话：96668

（104）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

法人代表：杨宝林

联系人：孙秋月

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

（105）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

客服电话：4006-650-999

（106）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

（107）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

（108）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

（109）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

（110）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

（111）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：史俊杰

客服电话：4008188866

（112）中国民族证券有限责任公司

办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼

法定代表人：何亚刚

联系人：丁敏

电话：（0731）85832463

客服电话：400-889-5618

备注：除上述产品代销外还代销融通深证100C的机构名单：上海挖财基金销售有限公司、蚂蚁（杭州）基金销售有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、金惠家保险代理有限公司。

3、融通深证100指数基金H类别基金份额销售机构

融通深证100指数基金H类别基金份额销售机构的具体情况请参见招募说明书补充文件或基

金管理人届时发布的公告。

（二）注册登记人

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
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
法定代表人：高峰
联系人：杜嘉
电话：（0755）26948075
传真：（0755）26935011
客服热线：400-883-8088，（0755）26948088
网址：www.rtfund.com

（三）律师事务所和经办律师

名称：广东嘉得信律师事务所
注册地址：深圳市红岭中路国信证券大厦 12 楼
办公地址：深圳市红岭中路国信证券大厦 12 楼
法定代表人：闵齐双
联系人：尹小胜
经办律师：闵齐双 刘少华 尹小胜 崔卫群
电话：（0755）33382888（总机）（0755）33033096（直线）13480989076
传真：（0755）33033086

（四）会计师事务所和经办注册会计师

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、基金的名称

融通通利系列证券投资基金

六、基金的类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

（一）融通债券基金

融通债券基金为开放式债券投资基金，在强调本金安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

（二）融通深证 100 指数基金

融通深证 100 指数基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 指数的有效跟踪，谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为投资者带来稳定回报。

如果深证 100 指数被停止发布、或由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数的情形下，或者证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，基金管理人可以相应变更基金的投资目标、投资范围和投资策略。

（三）融通蓝筹成长混合基金

融通蓝筹成长混合基金主要投资于具有较高内在投资价值的优质蓝筹公司和具有很强的核心竞争优势、业绩能够持续增长或具有增长潜力的成长型公司。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，追求资产的长期增值。

八、基金的投资方向

（一）融通债券基金

主要投资于低信用风险和中低流动性风险的债券组合，而利率风险则根据组合优化的需要分布在高中低等不同的风险等级上。

（二）融通深证 100 指数基金

主要投资于深证 100 指数成份股和债券。

（三）融通蓝筹成长混合基金

融通蓝筹成长混合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的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。融通蓝筹成长混合基金严格限定将相当比例的基金资产投资于符合蓝筹成长投资标准的投资对象；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

A、融通债券基金

（一）投资策略

本基金以组合优化为基本策略，利用收益曲线模型和债券品种定价模型，在获取较好的稳定收益的基础上，捕捉市场出现的中短期投资机会。根据投资决策的过程，具体如下：

1、总体资产配置自上而下

利率是债券市场的主导因素，本基金将在宏观研究的基础上对未来利率变化趋势进行预测，形成债券投资决策的最根本依据；利率期限结构对未来利率的变动具有重要参考和预测功能，本系列基金将基于实时的期限结构变化，给出利率变动预警信号。总体资产配置中将根据宏观经济和期限结构的有关研究成果，设定债券组合的久期，控制整体的利率风险。此外，结合市场特征，充分考虑流动性风险、信用风险等其他风险指标，对银行间国债市场、银行间金融债市场、交易所国债市场和交易所企业债市场给予不同的久期进行资产配置。

本基金将保留适量的现金以应付赎回或开展逆回购，以便获得较高的收益。

2、类属配置组合优化

在总体资产配置之下，对类属配置采取给定久期的凸度优化、收益率优化、交易量优化等多种优化组合策略，最终优化的比例是一个多目标规划的结果。

债券市场存在无效之处，本基金将结合收益曲线模型和收益率优化模型把握市场出现的短暂机会，提高组合的投资收益。

3、单个品种合理定价

本基金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合理的定价，基于对每个品种的绝对和相对定价，进行债券品种的投资价值分析。

4、风险控制之下追求收益最大

目前我国债券投资的风险主要来自于利率风险，本基金将通过组合的久期管理来控制债券组合的利率风险，然后通过凸度优化和收益率优化等追求收益的最大化。

可转债的投资风险主要来源于股价的波动，在投资可转债的总体比例上，本基金将根据 VaR 风险控制模型进行调控。在可转债品种的选择上，本基金将主要通过股票定价模型和行业研究员对股票的评级等综合判断其股票投资价值，力争实现较高的收益。

（二）投资决策

1、决策依据

- （1）国家有关法律、法规和基金合同的规定；
- （2）国家宏观经济环境及其对债券市场的影响；
- （3）国家货币政策、财政政策以及证券市场政策；
- （4）发债公司财务状况、行业处境、经济和市场的需求状况及其当前市场价格；
- （5）货币市场、资本市场资金供求状况及未来走势。

2、决策程序

（1）确定投资策略

基金经理在宏观、债券以及金融工程研究员提供的研究报告和模型的基础上完成最终的投资策略报告，并上报投资决策委员会审批。投资决策委员会修改批准后，交由风险管理委员会备案监督，并由基金经理进行具体实施。

（2）进行资产配置

基金经理将根据上述研究报告和投资策略报告，对基金资产在每个市场进行合理的配置，为每个债券组合设计合理的久期，并根据基金投资风格对每个市场组合进行不同的风险设置。

（3）建立投资组合

运用组合优化模型构建初始比例，然后根据市场的变动情况及时对组合进行调整。但是调整的幅度不得超越整体的投资策略和资产配置策略。

（4）组合监控与调整

组合监控与调整的理由主要来自于两个方面，一是可能出现市场失效，例如出现了极具吸引力的短线买入或者卖出机会；二是风险控制的需要，由专门的风险管理小组对持仓和交易进行监控，基金经理或者风险管理小组发现组合局部或者整体风险超标时，基金经理应立即对组合进行调整。

（5）风险报告与业绩分析

风险监控小组每日对债券组合进行监控，出具风险监控报告，同时还定期将对融通债券基金的业绩进行归因分析，找出基金投资管理的长处和短处，为未来的管理提供客观的依据。

（三）资产支持证券的投资策略、风险控制措施及投资比例

1、投资策略

基金管理人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。

（1）买入持有策略

基金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。

（2）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。

（3）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。

（4）相对价值策略

基金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。

2、风险控制措施

（1）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投资授权制度。

（2）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。

（3）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。

（4）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。

（5）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。

（6）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。

（7）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。

（8）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。

（9）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。

3、本基金可投资资产支持证券。

（1）持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例不得超过该资产支持证券规模的10%。

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

(3) 与基金管理人管理的其它基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。

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

(5) 因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述第(2)项和第(4)项规定的比例，基金管理人将在10交易日内调整完毕。

(6) 投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。本基金应投资于信用级别为BBB以上（含BBB）的资产支持债券。在持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

(四) 投资组合管理

本成分基金投资于国债、金融债和企业债（包括可转债），投资组合必须符合以下规定：

1、投资于债券的比例不低于本成分基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于本成分基金资产净值的20%；

2、本成分基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

3、持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年之内的政府债券的比例不低于本成分基金资产净值的5%；

4、本成分基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过成分基金资产净值的15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

5、本成分基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

6、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素使基金投资不符合上述1至2项规定的比例的，基金管理人应当在法规规定期限内进行调整。

B、融通深证100指数基金

(一) 投资策略

本基金以基金非债券资产90%以上的资金对深证100指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的50%，相对于深证100指数的日跟踪误差不超过0.5%。因基金规模或市场变化导致投资组合不能满足上述比例不在限制之内，但基金管理人应在合理期限内进行调整，以达到上述标准。

(二) 投资决策

1、决策依据

- (1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；
- (2) 宏观经济形势及前景, 经济政策趋向；
- (3) 本基金跟踪误差的控制管理；
- (4) 行业及上市公司基本面研究；
- (5) 提前或延后指数成份股的变更。根据指数编制规则, 预测指数成份股可能发生的变动以及对股价的影响, 提前或延后调整成份股。

2、决策程序

(1) 研究部提供宏观分析、利率和通货膨胀分析、深证100指数成份股公司的研究报告；金融工程小组利用模型进行历史模拟和风险测算。在此基础上进行投资论证，做出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置决策依据。

(2) 基金经理根据研究部提交的投资建议初步决定下一阶段的资产配置提案报投资决策委员会。

(3) 投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案，形成资产配置计划书。

(4) 基金经理根据投资决策委员会的决策，制定相应的指数投资和债券投资组合方案并报投资决策委员会备案。对超出基金经理权限的单项投资决策须报投资决策委员会审议批准。

(5) 基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至交易部。

(6) 交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

(7) 金融工程小组负责对基金组合的跟踪误差和风险进行评估，定期提交组合跟踪误差和风险监控报告。在跟踪误差超过一定范围时，通知基金经理和相关部门，及时进行投资组合的调整。

(8) 投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。

(三) 资产支持证券的投资策略、风险控制措施及投资比例

同融通债券基金。

(四) 投资组合管理

本成分基金主要投资于股票、国债等。投资组合必须符合以下规定：

- 1、投资于股票、债券的比例不低于本成分基金资产总值的 80%；
- 2、持有一家上市公司的股票，不得超过本成分基金资产净值的 10%；
- 3、本成分基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家上市公司发行的证券，不得超过该证券的 10%；

- 4、现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%；

- 5、本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受该比例限制；

- 6、本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%；但完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合可不受该比例限制；

- 7、本成分基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过成分基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

- 8、本成分基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

- 9、遵守中国证监会规定的其他比例限制；

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素使基金投资不符合上述第 1 至 3 项、第 5 项、第 6 项规定的比例的，基金管理人应当在法规规定期限内进行调整。

C、融通蓝筹成长混合基金

(一) 投资策略

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

在蓝筹成长型投资理念的指导下，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

本基金为蓝筹成长型基金。其股票投资主要包括两部分：一部分为蓝筹股投资，另一部分为成长型投资。对蓝筹上市公司或成长型上市公司的投资均不得低于股票投资总额的 30%。

本基金投资的蓝筹公司具有以下主要特点：

- (1) 行业地位突出，收益稳定，属于相对成熟、稳定的行业；
- (2) 业绩优异，盈利能力强，由于投资回报高而具备投资价值；
- (3) 股本较大，市值以及权重较大、市场地位突出；
- (4) 市场形象良好，这源自于稳定可观的公司收益及投资回报，良好的股价走势（慢牛特

征、抗跌性较强）等等；

本基金投资的成长型上市公司具有以下主要特点：

（1）公司发展前景好，主营产品或服务的市场有充分的成长空间，销售增长率或收益增长率高；

（2）公司是中小型公司，有优于同行其他公司的某种竞争优势；

（3）公司具有高成长潜力，已建立并形成较好的发展基础；

（4）公司处于技术（方法）革新时期，有较强的管理层，具有较大发展空间。

5、权证投资

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。

（二）投资决策

1、决策依据

（1）国家宏观经济环境；

（2）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

（3）货币政策、利率走势；

（4）地区及行业发展状况；

（5）上市公司研究；

（6）证券市场的走势。

2、决策程序

（1）研究部提供宏观分析、行业分析、企业分析及市场分析的研究报告，并在此基础上进行投资论证，作出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置的决策依据。

（2）基金经理根据研究部提交的投资建议决定本基金下一阶段的仓位和资金分布，形成资产配置提案报投资决策委员会。

（3）投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案，形成资产配置计划书。

（4）基金经理根据投资决策委员会的决策，制定相应的投资组合方案并报投资决策委员会备案。对超出基金经理权限的单项投资决策须报投资决策委员会审议批准。

（5）基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至交易部。

（6）交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

（7）投资决策委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。

（三）资产支持证券的投资策略、风险控制措施及投资比例

同融通债券基金。

（四）投资组合管理

本成分基金可投资于股票、国债、金融债、企业债（包括可转债）和权证。投资组合必须符合以下规定：

1、投资于股票、债券的比例不低于本成分基金资产总值的80%，投资于国家债券的比例不低于本成分基金资产净值的20%；

2、持有一家上市公司的股票，不得超过本成分基金资产净值的10%；

3、本成分基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家发行的证券，不得超过该证券的10%；

4、本成分基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的3%；本成分基金与由本基金管理人管理的其他基金持有的同一权证不得超过该权证流通量的10%。

5、持有现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年之内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；

6、本基金管理人管理的全部开放式基金(包括开放式基金以及处于开放期的定期开放基金)持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的15%；

7、本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上

上市公司可流通股票的 30%；

8、本成分基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过成分基金资产净值的 15%；因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定的，基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资；

9、本成分基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的，可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的投资范围保持一致；

10、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素使基金投资不符合上述第 1 至 4 项、第 6 项、第 7 项规定的比例的，基金管理人应当在法规规定期限内进行调整。

十、基金的业绩比较标准

融通债券基金业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率。

自 2015 年 10 月 1 日起“融通债券投资基金”的业绩比较基准由原来的“中信标普全债指数收益率”变更为“中债综合全价（总值）指数收益率”。

融通深证 100 指数基金业绩比较基准为：深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

融通蓝筹成长混合基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%。

自 2015 年 10 月 1 日起“融通蓝筹成长证券投资基金”的业绩比较基准由原来的“沪深 300 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”变更为“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

融通债券基金：属于相对低风险的基金品种。

融通深证 100 指数基金：风险和预期收益率接近市场平均水平。

融通蓝筹成长混合基金：力求获得超过市场平均水平的收益，承担相应的风险。

十二、基金的投资组合报告

本系列基金管理人的董事会及董事保证本投资组合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。

本系列基金托管人中国工商银行根据本系列基金合同规定，于 2018 年 11 月 2 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。

本投资组合报告所载数据截至 2018 年 9 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

（一）融通债券基金投资组合报告

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	165,782,645.90	94.47
	其中：债券	165,782,645.90	94.47
	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	6,834,752.19	3.89
8	其他资产	2,869,807.14	1.64
9	合计	175,487,205.23	100.00

2、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	32,663,677.00	25.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	52,964,840.00	40.99
	其中：政策性金融债	52,964,840.00	40.99
4	企业债券	37,752,128.90	29.22
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	12,194,000.00	9.44
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	30,208,000.00	23.38
10	合计	165,782,645.90	128.29

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	180210	18国开10	400,000	39,492,000.00	30.56
2	019536	16国债08	185,100	16,523,877.00	12.79
3	019547	16国债19	130,000	11,109,800.00	8.60
4	180406	18农发06	100,000	10,229,000.00	7.92
5	101800662	18京能源 MTN001	100,000	10,171,000.00	7.87

4、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。

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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1 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。

7.2 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。

7.3 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。

8、投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,569.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,139,789.16
5	应收申购款	720,448.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,869,807.14

8.3 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。

（二）融通深证 100 指数基金投资组合报告

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	4,859,232,767.14	94.72
	其中：股票	4,859,232,767.14	94.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	180,030,000.00	3.51
	其中：债券	180,030,000.00	3.51
	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	85,586,073.89	1.67

8	其他资产	5,296,926.54	0.10
9	合计	5,130,145,767.57	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末指数投资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	169,226,693.52	3.31
B	采掘业	17,381,271.25	0.34
C	制造业	3,127,621,199.06	61.08
D	电力、热力、燃气及水 生产和供应业	-	-
E	建筑业	46,016,927.20	0.90
F	批发和零售业	124,768,259.92	2.44
G	交通运输、仓储和邮政 业	17,631,164.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息 技术服务业	278,074,806.72	5.43
J	金融业	494,705,913.04	9.66
K	房地产业	331,364,616.05	6.47
L	租赁和商务服务业	107,904,629.95	2.11
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施 管理业	41,464,266.50	0.81
O	居民服务、修理和其他 服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	77,310,719.13	1.51
R	文化、体育和娱乐业	25,762,300.80	0.50
S	综合	-	-
	合计	4,859,232,767.14	94.90

2.2 报告期末积极投资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积极投资部分的股票。

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

3.1 报告期末指数投资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	000651	格力电器	7,859,910	315,968,382.00	6.17
2	000333	美的集团	7,503,409	315,668,416.63	6.17
3	000858	五粮液	3,027,266	205,702,724.70	4.02
4	002415	海康威视	5,754,350	165,380,019.00	3.23
5	000002	万科A	6,652,955	161,666,806.50	3.16
6	000001	平安银行	13,781,678	152,287,541.90	2.97
7	300498	温氏股份	6,223,981	144,520,838.82	2.82
8	000725	京东方A	41,431,003	130,507,659.45	2.55
9	002304	洋河股份	925,445	118,456,960.00	2.31
10	002027	分众传媒	12,679,745	107,904,629.95	2.11

3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票。

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	180,030,000.00	3.52
	其中：政策性金融债	180,030,000.00	3.52
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	180,030,000.00	3.52

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	160208	16国开08	900,000	89,910,000.00	1.76
2	180407	18农发07	500,000	50,220,000.00	0.98

3	160420	16 农发 20	400,000	39,900,000.00	0.78
---	--------	----------	---------	---------------	------

- 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
本基金本报告期末未持有股指期货。
- 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。
- 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	121,830.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,363,710.89
5	应收申购款	2,811,385.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,296,926.54

- 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 报告期末股票中存在流通受限情况的说明
- 11.5.1 报告期末指数投资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	000333	美的集团	315,668,416.63	6.17	重大事项停牌

11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资部分的股票。

（三）融通蓝筹成长混合基金投资组合报告

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	496,967,378.61	66.18
	其中：股票	496,967,378.61	66.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	151,172,077.60	20.13
	其中：债券	151,172,077.60	20.13
	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	88,537,388.98	11.79
8	其他资产	14,309,532.90	1.91
9	合计	750,986,378.09	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	7,232,750.00	1.00
B	采矿业	43,108,789.60	5.94
C	制造业	266,189,341.31	36.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,542,000.00	0.21
E	建筑业	3,543,425.00	0.49
F	批发和零售业	32,734,678.90	4.51
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,657,500.00	0.64
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,195,290.04	4.30
J	金融业	71,208,179.40	9.82
K	房地产业	16,033,975.00	2.21

L	租赁和商务服务业	15,730,849.36	2.17
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	3,790,600.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	496,967,378.61	68.52

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	601288	农业银行	4,750,000	18,477,500.00	2.55
2	603605	珀莱雅	390,079	16,824,107.27	2.32
3	601336	新华保险	330,000	16,658,400.00	2.30
4	601939	建设银行	2,249,935	16,289,529.40	2.25
5	600276	恒瑞医药	252,649	16,043,211.50	2.21
6	600048	保利地产	1,317,500	16,033,975.00	2.21
7	601888	中国国旅	231,268	15,730,849.36	2.17
8	601318	中国平安	224,000	15,344,000.00	2.12
9	601933	永辉超市	1,876,000	15,289,400.00	2.11
10	600028	中国石化	2,139,430	15,232,741.60	2.10

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	28,792,700.00	3.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	122,379,377.60	16.87
	其中：政策性金融债	122,379,377.60	16.87
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	151,172,077.60	20.84

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	018005	国开 1701	508,240	51,128,944.00	7.05
2	180201	18 国开 01	300,000	30,132,000.00	4.15
3	170211	17 国开 11	300,000	30,021,000.00	4.14
4	020244	18 贴债 27	170,000	16,780,700.00	2.31
5	019592	18 国债 10	120,000	12,012,000.00	1.66

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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。

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	906,708.63
2	应收证券清算款	9,780,647.70
3	应收股利	-
4	应收利息	3,575,660.97

5	应收申购款	46,515.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,309,532.90

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，投资者在做投资决策前应仔细阅读本系列基金的招募说明书。

本系列基金合同生效日为2003年9月30日。**基金业绩截止日为2018年6月30日**。基金合同生效以来最近10个会计年度的投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示：

融通债券基金 A/B 类						
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
2008 年度	9.22%	0.16%	9.52%	0.21%	-0.30%	-0.05%
2009 年度	1.75%	0.13%	1.86%	0.06%	-0.11%	0.07%
2010 年度	2.26%	0.15%	2.00%	0.07%	0.26%	0.08%
2011 年度	-4.10%	0.18%	3.79%	0.06%	-7.89%	0.12%
2012 年度	8.36%	0.10%	4.03%	0.04%	4.33%	0.06%
2013 年度	1.33%	0.11%	1.78%	0.05%	-0.45%	0.06%
2014 年度	11.36%	0.18%	9.41%	0.16%	1.95%	0.02%
2015 年度	11.47%	0.11%	5.54%	0.07%	5.93%	0.04%
2016 年度	0.33%	0.12%	-1.63%	0.09%	1.96%	0.03%
2017 年度	0.91%	0.07%	-3.38%	0.06%	4.29%	0.01%
2018 年上 半年度	6.12%	0.17%	2.16%	0.08%	3.96%	0.09%
融通债券基金 C 类						
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 年度	7.40%	0.09%	3.53%	0.04%	3.87%	0.05%
2013 年度	0.85%	0.11%	1.78%	0.05%	-0.93%	0.06%
2014 年度	10.85%	0.18%	9.41%	0.16%	1.44%	0.02%
2015 年度	10.98%	0.11%	5.54%	0.07%	5.44%	0.04%
2016 年度	0.00%	0.12%	-1.63%	0.09%	1.63%	0.03%
2017 年度	0.58%	0.07%	-3.38%	0.06%	3.96%	0.01%
2018 年上 半年度	5.96%	0.18%	2.16%	0.08%	3.80%	0.10%
融通深证 100 指数基金 A/B 类						

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
2008年度	-60.61%	2.87%	-61.08%	2.89%	0.47%	-0.02%
2009年度	103.78%	2.02%	107.59%	2.04%	-3.81%	-0.02%
2010年度	-3.66%	1.64%	-2.94%	1.64%	-0.72%	0.00%
2011年度	-29.66%	1.34%	-28.92%	1.34%	-0.74%	0.00%
2012年度	2.14%	1.38%	3.32%	1.38%	-1.18%	0.00%
2013年度	-4.19%	1.36%	-3.12%	1.35%	-1.07%	0.01%
2014年度	32.60%	1.16%	32.84%	1.15%	-0.24%	0.01%
2015年度	20.79%	2.70%	22.37%	2.46%	-1.58%	0.24%
2016年度	-15.07%	1.77%	-14.24%	1.57%	-0.83%	0.20%
2017年度	23.76%	0.87%	26.94%	0.86%	-3.18%	0.01%
2018年上 半年度	-13.73%	1.33%	-13.37%	1.34%	-0.36%	-0.01%

融通深证100指数基金C类

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
2017年度	10.03%	0.94%	12.33%	0.93%	-2.30%	0.01%
2018年上半 年度	-13.84%	1.33%	-13.37%	1.34%	-0.47%	-0.01%

融通蓝筹成长混合基金

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
2008年度	-49.60%	1.82%	-50.30%	2.29%	0.70%	-0.47%
2009年度	50.59%	1.50%	74.03%	1.49%	-23.44%	0.01%
2010年度	-6.01%	1.07%	-8.57%	1.19%	2.56%	-0.12%
2011年度	-19.03%	0.82%	-18.35%	0.98%	-0.68%	-0.16%
2012年度	2.87%	0.90%	7.06%	0.96%	-4.19%	-0.06%
2013年度	7.00%	1.08%	-4.97%	1.05%	11.97%	0.03%
2014年度	35.67%	1.14%	40.22%	0.92%	-4.55%	0.22%
2015年度	32.90%	2.04%	7.08%	1.87%	25.82%	0.17%
2016年度	-16.66%	1.41%	-8.55%	1.05%	-8.11%	0.36%
2017年度	9.30%	0.72%	15.04%	0.48%	-5.74%	0.24%
2018年上 半年度	-7.00%	0.98%	-9.21%	0.86%	2.21%	0.12%

十四、费用概览

(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、销售服务费；

- 4、证券交易费用；
- 5、基金信息披露费用；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、会计师费和律师费；
- 8、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

A、融通债券基金

1、基金管理人的管理费

基金管理人的管理费按前一日的基金资产净值的 0.6% 年费率计提。具体计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首日起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

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 2.0% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 2.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管人的托管费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首日起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、销售服务费

融通债券投资基金 A/B 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.35%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务，基金管理人将在基金年度报告中对该项费用的列支情况作专项说明。

在通常情况下，销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由基金管理人分别支付给各基金销售机构。

4、上述 1 中（4）到（8）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。

B、融通深证 100 指数基金

1、基金管理人的管理费

基金管理人的管理费按前一日的基金资产净值的 1.0% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理人的管理费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首日起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

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 2.0% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 2.0\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管人的托管费每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首日起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、C 类基金份额的销售服务费

本基金 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日 C 类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日 C 类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出,由基金管理人分别支付给各基金销售机构。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

4、上述 1 中（4）到（8）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。

C、融通蓝筹成长混合基金

1、基金管理人的管理费

基金管理人的管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计算,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

基金管理人的管理费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首日起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

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的 2.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管人的托管费每日计提,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取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3、上述 1 中（4）到（8）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。

（三）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。

（四）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以磋商酌情降低基金管理费率或基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。基金管理人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报刊公告。

（五）销售服务费的调整

基金管理人可视情况调整销售服务费,基金管理人必须最迟于新的费率实施日 2 日前在指定媒介上刊登公告。

（六）基金的税收

基金运作过程中涉及的各项纳税主体,依照中国、香港及投资人所在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,对本系列基金管理人于 2018 年 5 月 11 日刊登的本系列基金更新招募说明书进行了更新,主要更新内容如下：

一、在“三、基金管理人”中“（一）基金管理人概况”和“（二）主要人员情况”部分,更新了“1、现任董事情况”、“2、现任监事情况”、“3、公司高级管理人员情况”、“4、本系列基金基金经理”及“5、投资决策委员会成员”的信息；

二、在“四、基金托管人”部分,更新了“（一）基金托管人基本情况”和“（二）基金托管人的内部控制制度”及“（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序”的信息。

- 三、在“五、相关服务机构”部分，更新了直销机构、代销机构的相关信息；
- 四、在“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分，主要对“（六）申购、赎回与转换的数额限制”做了说明修改。
- 五、在“九、基金的投资”部分，更新了“五 基金投资组合报告”的内容，更新数据为本系列基金2018年第3季度报告中的投资组合数据；
- 六、在“十、基金的业绩”部分，更新了投资业绩数据；
- 七、在“二十一、对基金份额持有人的服务”部分，更新了相关信息；
- 八、在“二十二、其他应披露事项”部分，对本系列基金自上次更新招募说明书披露所载内容截止日至2018年9月30日期间的公告信息进行了列表说明。

融通基金管理有限公司
二〇一八年十一月十日