

融通逆向策略灵活配置混合型 证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019 年第 3 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：二〇一九年十二月

融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2019年第3号)

重要提示

本基金经2017年7月5日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2017]1128号文）准予募集注册。本基金基金合同于2018年2月11日正式生效。

投资有风险，投资人认购（或申购）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，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与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

投资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。

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。

本基金如投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票，本基金并非必然投资于科创板股票。

本招募说明书有关基金管理人的主要人员情况截止日为2019年11月30日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2019年6月30日（本招募说明书中财务数据未经审计），其余所载内容截止日为2019年8月11日。

一、基金合同生效日期

2018年2月11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、15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，兼任投资银行业务内核负责人及场外市场部行政负责人。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合规管理部总经理、法律事务部总经理、公司内核负责人、场外市场部负责人、投行业务条线负责人。2018年2月至今，任公司董事。

董事律磊先生，法学硕士，现任明天控股有限公司人力资源部总经理。历任原国务院法制办公室秘书行政司副主任科员、主任科员、副处长、调研员等。2019年8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资深常务投资顾问，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，日兴资产管理有限公司全球投资主管兼首席投

资官，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，日兴资产管理有限公司联合全球投资主管兼首席投资官。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，清华大学 EMBA。历任新时代证券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月至今，任公司董事长。

总经理张帆先生，工商管理硕士，清华大学 EMBA。历任新时代证券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。曾在原国务院法制办公室财金司、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

刘安坤先生，武汉大学金融学硕士，6年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2013年7月至2015年6月就职于长江证券股份有限公司任分析师。2015年6月加入融通基金管理有限公司，历任金融行业研究员、策略研究员、专户投资经理，现任融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2019年5月17日起至今）。

（2）历任基金经理情况

自2018年2月11日起至2019年5月16日，由张延闽先生担任本基金的基金经理。

自2019年5月17日起至2019年11月29日，由张延闽先生和刘安坤先生共同担任本

基金的基金经理。

自 2019 年 11 月 30 日起至今，由刘安坤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，组合投资部总监、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

（一）基金托管人基本情况

名称：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（100032）

法定代表人：陈四清

电话：010-66105799

传真：010-66105798

联系人：郭明

成立时间：1984 年 1 月 1 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3 号

（二）主要人员情况

截至 2018 年 12 月，中国工商银行资产托管部共有员工 202 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。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、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 12 月，中国工商银行共托管证券投资基金 923 只。自 2003 年以来，本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 64 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）融通基金管理有限公司

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：柴功

电话：（010）66190982

（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、15 层

邮政编码：518053

联系人：韦荣涛

联系电话：（0755）26947504

（二）其他销售机构

（1）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：陈四清

联系人：郭明

电话：（010）66107909

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

（2）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 188 号

办公地址：上海市银城中路 188 号

法定代表人：任德奇（代）

联系人：张宏革

电话：021—58781234

传真：021—58408483

客户服务电话：95559

（3）招商银行股份有限公司（仅销售前端）

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

（4）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

公司网站： bank.ecitic.com

（5）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

客服热线：95528

公司网站 www.spdb.com.cn

（6）兴业银行股份有限公司

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

（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

开放式基金咨询电话：021-962888

开放式基金业务传真：021-68476497

联系人：汤征程

联系电话：021-68475521

网址：www.bankofshanghai.com

（8）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

（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

网址：www.cbhb.com.cn

（10）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

（11）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

（12）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号同花顺大楼

法定代表人：凌顺平

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

联系人：董一锋

客服热线：4008-773-772

公司网站：www.5ifund.com

（13）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：黄祎

电话：021-5071 2782

传真：021-5071 0161

联系人：徐亚丹

客服热线：400-799-1888

网址：www.fundsure.cn

（14）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704

办公地址：北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座7层

法定代表人：洪弘

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/>

（15）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

（16）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：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦7层

法定代表人：沈丹义

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客服热线：400-101-9301

网址：www.tonghuafund.com。

（17）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.zhongzhengfund.com

（18）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

（19）北京虹点基金销售有限公司（北京乐融多源投资咨询有限公司）

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号群房2层22单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号群房2层22单元

法定代表人：郑毓栋

电话：400-618-0707

传真：010-65951887

联系人：牛亚楠

客服热线：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com/

（20）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：上海市虹口区东大名路1098号浦江国际金融广场18层

法定代表人：李兴春

电话：021-60195121

传真：021-61101630

联系人：郭丹妮

客服热线：95733

公司网站：<http://www.leadfund.com.cn/>

（21）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/>

（22）上海长量基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址：上海市浦东新区东方路1267号11层

法定代表人：张跃伟

联系人：王敏

电话：021-2069-1831

传真：021-2069-1861

客服热线：4008202899

网址：www.erichfund.com

（23）深圳富济基金销售有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元

办公地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大厦3203A单元

法定代表人：刘鹏宇

电话：0755-83999907-8814

传真：0755-83999926

联系人：刘勇

客服热线：0755-83999907

公司网站：www.fujifund.cn

（24）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗街道梨园路物资控股置地大厦8楼801

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：龚江江

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

网址：www.zlfund.cn

（25）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号厦门第一广场西座1501-1504室

办公地址：厦门市思明区鹭江道2号厦门第一广场西座1501-1504室

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

（26）上海汇付基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元

办公地址：上海市徐汇区宜山路 700 号普天软件园 C5 幢

法定代表人：金佶

电话：021-34013996

传真：021-33323837

联系人：陈云卉

客服热线：021-34013999

公司网站：www.hotjijin.com

（27）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：深圳市福田区福华路 355 号岗厦皇庭中心 8 楼 DE

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

（28）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：上海市徐汇区宛平南路 88 号金座大楼（东方财富大厦）

法定代表人：其实

电话：021-54509998

传真：021-64385308

联系人：潘世友

电话：021-54509977

传真：021-64385308

客服电话：95 客服电话：95021 / 4001818188

公司网站：1234567.com.cn

（29）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司

注册地址：浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路 969 号 3 幢 5 层 599 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：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

（30）北京钱景基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路18号1号楼11层B-1108

办公地址：北京市海淀区中关村东路18号1号楼11层B-1108

法定代表人：赵荣春

电话：010-59422766

传真：010-57569671

联系人：姚付景

客服热线：4008936885

公司网站：www.qianjing.com

（31）北京肯特瑞基金销售有限公司

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座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

（32）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：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：侯芳芳

客服热线：400-159-9288

公司网站：<https://danjuanapp.com/>

（33）方德保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号楼7层711

法定代表人：林柏均

电话：010-68091380

传真：010-68091380

联系人：胡明哲

客服热线：010-64068617

公司网站：www.fundsure.cn

（34）上海挖财基金销售有限公司

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：孙琦

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（35）珠海盈米基金销售有限公司

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

（36）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层

法定代表人：樊怀东

电话：0411-39027810

传真：0411-39027835

联系人：于秀

客服热线：4000899100

公司网站：www.yibaijin.com

(37) 江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区砖墙集镇78号

办公地址：南京市玄武区天时国贸大厦11层E座

法定代表人：吴言林

联系人：李跃

电话：025-56663409

客服热线：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

(38) 民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室

办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼

法定代表人：贲惠琴

电话：021-50206003

传真：021-50206001

联系人：杨一新

客服热线：021-50206003

公司网站：www.msftec.com

(39) 南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道1-5号

法定代表人：王锋

电话：025-66996699

传真：025-66996699

联系人：张云飞

客服热线：025-66996699

公司网站：www.snjijin.com

（40）北京汇成基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村e世界A座1108室

办公地址：北京市海淀区中关村e世界A座1108室

法定代表人：王伟刚

电话：010-56251471

传真：010-62680827

联系人：王骁骁

客服热线：010-56251471

公司网站：www.hcjijin.com

（41）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室

办公地址：上海市浦东新区银城中路488号太平金融大厦1503室

法定代表人：王翔

电话：021-65370077

传真：021-55085991

联系人：许付漪

客服热线：400-820-5369

公司网站：www.jiyufund.com.cn

（42）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

电话：021-63333389

传真：021-63333390

联系人：冯强

客服热线：4006-433-389

网址：www.vstonewealth.com

（43）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室

办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼

法定代表人：陈继武

电话：021-63333389

传真：021-63333390

联系人：冯强

客服热线：4006-433-389

网址：www.vstonewealth.com

（44）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、14层

办公地址：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、14层

法定代表人：张皓

邮编：518048

客户服务电话：400-990-8826

网址：<http://www.citicsf.com>

（45）阳光人寿保险股份有限公司（仅销售前收）

注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

客服热线：95510

公司网站：<http://fund.sinosig.com/>

（46）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：朱琴

电话：021-20315161

客户服务电话：95538

（47）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

（48）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：余敏

电话：（021）33389888

客服电话：95523 或 4008895523

（49）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：李琦

联系人：余敏

电话：010-88085858

客服电话：400-800-0562

（50）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：王连志

联系人：刘志斌

联系电话：（0755）82558323

客服电话：4008001001

（51）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：张佑君

联系人：马静懿

电话：（010）60838995

客服电话：0755-23835888

（52）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：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

（53）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：010-60833754

客服电话：4009908826

（54）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

（55）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

（56）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

电话：（010）85130236

客服电话：400-8888-108

（57）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3楼

法定代表人：周健男

联系人：李芳芳

电话：（021）22169081

客服热线：400-8888-788、10108998、95525

（58）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：何之江

联系人：周一涵

电话：（021）38637436

客服电话：95511 转 8

（59）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳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：95565

（60）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）38676161

客服电话：4008888666

（61）第一创业证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民

联系人：王叔胤

电话：（0755）25831754

客服电话：4008881888

（62）华西证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市高新区天府二街198号

法定代表人：杨炯洋

联系人：谢国梅

电话：010-52723273

客服电话：4008888818

（63）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：章宏韬

联系人：樊忠亚

电话：（0551）65161821

客服电话：95318，4008096518

（64）中银国际证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：宁敏

联系人：王炜哲

电话：（021）20328309

客服电话：4006208888

（65）长江证券股份有限公司

联系地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

电话：（021）68751860

客服热线：400-8888-999、95579

（66）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

（67）方正证券股份有限公司

办公地址：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：施华

联系人：丁敏

电话：（0731）85832463

客服电话：95571

（68）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：姜志军

联系人：丁敏

电话：（0731）85832463

客服电话：400-889-5618；

（69）东海证券股份有限公司

注册地址：常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333910

客服电话：400-888-858

（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、15 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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号星展银行大厦507单元01

室

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：薛竞、俞伟敏

五、基金的名称

融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金。

六、基金的类型

契约型开放式。

七、基金的投资目标

本基金将采用逆向投资策略，重点投资于价值低估及阶段性错误定价的个股品种，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

八、基金的投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（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、短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货与权证、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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0% - 95%，权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%，任何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（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不低于基金资产净值的 5%。

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

九、基金的投资策略

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

本基金以逆向策略为核心的股票精选，将采用定性分析和定量分析相结合、审慎稳健的逆向投资策略，精选价值被低估但具备长期竞争力和发展活力的股票进行中长期投资，同时回避由于受市场热点追捧而高估的股票，构建本基金的股票库。

（1）定性分析

在定性分析方面，本基金将重点关注存在逆向投资机会的股票。主要包括：

1) 市场阶段性关注程度较低的股票。

由于宏观政策、行业更替、证券市场风格转换等因素影响，部分上市公司的股票可能在

一段时期内交易不活跃，估值低于历史平均水平。本基金将通过一定时期内媒体关注度、股票成交量、换手率、价格波动、机构持股比例、卖方报告跟踪频率等指标对股票关注程度进行衡量，筛选出市场阶段性关注程度较低的股票。

2) 由于突发事件造成市场过度反应的股票

突发事件主要包括自然灾害、行业事件导致的风险、公司遭遇重大危机、管理层发生重大变更等。这些突发事件往往对公司的生产、运营产生重大影响并造成市场的过度反应，其估值也会相应的出现大幅度波动，因此存在中长期投资机会。本基金将分析和评估受突发事件影响的上市公司，选择长期不受影响，价值能够回归的公司进行投资。

3) 传统行业中阶段性周期底部的股票

由于宏观经济自身的周期波动，部分传统行业在周期向下时会被市场过度抛弃。然而在中国不是所有的传统行业都等同于夕阳行业，相反其中一些行业竞争格局稳定，盈利模式清晰，并且拥有关系国计民生的战略地位，当经济复苏时行业龙头能够很快展示出盈利弹性。本基金将通过自上而下判断周期拐点，自下而上评估企业价值的方法选择安全边际高的公司左侧持有。

4) 对未来成长性判断存在巨大分歧的公司

在新兴行业的发展过程中，常常出现“独角兽”公司，这类企业会极大改变人们生活和推动行业的发展，并且其自身的增长速度呈现非线性。然而在成长初期此类公司并不一定能够得到投资人的足够重视，市场对公司未来成长速度以及可持续性存在着巨大的分歧。本基金将从国际比较、技术领先性、企业家精神等多方面挖掘此类潜在的行业龙头。

(2) 定量分析

本基金将主要运用估值分析方法进行个股的定量分析。综合运用市盈率(P/E)、市净率(P/B)、市销率(P/S)、(P/E)/G、EV/EBITDA 以及现金流折现模型(DCF)等估值指标，精选价值被低估的上市公司，实现基金资产的持续稳健增值。

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上所有债券品种进行投资价值评估，从中选择暂时被市场低估或估值合理的投资品种。

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

4、资产支持证券投资策略

基金管理人本着风险可控和优化组合风险收益的原则，投资于资产支持证券，以期获得稳定的收益。坚持价值投资理念，综合考虑信用等级、债券期限结构、分散化投资、行业分布等因素，制定相应的资产支持证券投资计划。根据信用风险、利率风险和流动性风险变化，把握市场交易机会，积极调整投资策略。

5、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。

十、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×50%

选择该业绩比较基准的理由主要如下：

1、沪深 300 指数对股票市场具有较强的代表性，适合作为本基金股票部分的业绩比较基准。

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。

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合用于本基金业绩比较基准时，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、风险收益特征

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。

七、基金管理人代表基金行使股东权利和债权人权利的处理原则及方法

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；
- 3、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利，保护基金份额持有人的利益；
- 4、有利于基金资产的安全与增值；
- 5、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2019年8月26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2019年6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	152,559,180.69	90.95
	其中：股票	152,559,180.69	90.95
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	372,856.80	0.22
	其中：债券	372,856.80	0.22
	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	14,656,054.59	8.74
8	其他资产	153,835.26	0.09
9	合计	167,741,927.34	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	26,775,692.60	16.22
B	采矿业	109,308.05	0.07
C	制造业	59,052,710.85	35.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	25,286,431.00	15.32
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,145,245.76	11.60
J	金融业	12,391,131.59	7.51
K	房地产业	9,775,554.24	5.92
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	152,559,180.69	92.41

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	600887	伊利股份	489,100	16,340,831.00	9.90
2	601933	永辉超市	1,457,100	14,876,991.00	9.01
3	300059	东方财富	1,035,920	14,036,716.00	8.50
4	300498	温氏股份	383,060	13,736,531.60	8.32
5	601336	新华保险	224,555	12,357,261.65	7.48
6	603960	克来机电	441,625	12,051,946.25	7.30
7	603883	老百姓	178,000	10,409,440.00	6.31
8	000031	大悦城	1,522,672	9,775,554.24	5.92
9	600742	一汽富维	819,680	8,745,985.60	5.30
10	002714	牧原股份	141,900	8,342,301.00	5.05

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	372,856.80	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	372,856.80	0.23

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	113531	百姓转债	3,370	372,856.80	0.23

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	146,383.01
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,761.22
5	应收申购款	2,691.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	153,835.26

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2018年2月11日，基金业绩截止日为2019年6月30日。基金合同生效以来本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表如下：

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
2018年2月11日（基金合同生效日）至2018年12月31日	-19.37%	1.25%	-9.04%	0.67%	-10.33%	0.58%
2019年上半年	19.61%	1.70%	13.28%	0.77%	6.33%	0.93%

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、仲裁费和诉讼费；
- 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、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1.50%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第3—9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各纳税主体，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》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于2019年9月25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，更新了招募说明书中有关基金管理人的主要人员情况截止日。其他所载内容截止日；

2、在“三、基金管理人”部分，根据最新资料对基金管理人的主要人员情况进行了更新。

融通基金管理有限公司

2019年11月30日