

融通四季添利债券型证券投资基金 （LOF）更新招募说明书摘要 （2020 年第 1 号）

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

日 期：二〇二〇年二月

重要提示

融通四季添利债券型证券投资基金经中国证监会 2011 年 10 月 21 日证监许可[2011]1683 号文核准募集，基金合同于 2012 年 3 月 1 日正式生效，依照融通四季添利债券型证券投资基金基金合同约定，基金合同生效后两年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易；基金合同生效满两年后，于 2014 年 3 月 3 日转换运作方式为上市开放式基金，基金名称变更为融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）。（以下简称“本基金”）

2018 年 3 月 14 日经中国证监会《关于准予融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）变更注册的批复》（证监许可[2018]465 号）准予变更注册，本基金于 2018 年 3 月 29 日至 2018 年 5 月 1 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2018 年 5 月 2 日决议通过《关于修改〈融通四季添利债券型证券投资基金基金合同〉的议案》，修改后的基金合同自 2018 年 5 月 3 日起生效。

投资有风险，投资者申购基金时应认真阅读更新招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本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。基金投资者依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过 50%的除外。

本招募说明书所载内容截止日为 2020 年 2 月 10 日，有关财务数据截止日为 2019 年 12 月 31 日，净值表现截止日为 2019 年 6 月 30 日（本招募说明书中的财务资料未经审计）。

一、基金合同生效日

2012 年 3 月 1 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 Yuji Ooyagi（大柳雄二）先生，本科学历，现任日兴资产管理有限公司执行副总裁。历任日兴证券投资组合经理，日兴资产管理有限公司商务拓展部负责人、投资信托销售本部负责人、资深常务总监、日本零售事业本部负责人等职务。2020年2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

余志勇先生，武汉大学金融学硕士，20年证券投资从业经历，具有基金从业资格。1992年7月至1997年9月就职于湖北省农业厅任研究员，2000年7月至2004年7月就职于闽

发证券公司任研究员，2004年7月至2007年4月就职于招商证券股份有限公司任研究员。2007年4月加入融通基金管理有限公司，历任研究部行业研究员、行业研究组组长、研究部总监、融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理（2012年8月10日至2014年12月24日）、融通通泽灵活配置混合基金基金经理（2015年2月25日至2017年11月17日）、融通增裕债券型证券投资基金基金经理（2016年5月13日至2018年7月24日）、融通增丰债券型证券投资基金基金经理（2016年8月2日至2018年2月28日）、融通通景灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016年8月19日至2017年12月12日）、融通通尚灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016年10月19日至2018年4月11日）、融通新优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016年11月2日至2017年8月17日）、融通通润债券型证券投资基金基金经理（2017年3月13日至2018年12月26日）、融通通颐定期开放债券型证券投资基金基金经理（2017年3月16日至2018年9月28日）、融通新动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2017年8月3日至2018年7月4日）、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理（2015年3月17日至2019年7月15日），现任组合投资部总监、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2015年6月15日起至今）、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2015年11月17日起至今）、融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理（2016年10月28日起至今）、融通通慧混合型证券投资基金基金经理（2019年5月16日起至今）、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2019年6月11日起至今）、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理（2019年7月16日起至今）、融通蓝筹成长证券投资基金基金经理（2020年2月5日起至今）。

王超先生，厦门大学金融工程硕士，12年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2007年7月至2012年8月就职于平安银行金融市场产品部从事债券投资研究工作。2012年8月加入融通基金管理有限公司，历任投资经理、融通汇财宝货币市场基金基金经理（2014年1月2日至2015年6月23日）、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理（2014年11月7日至2016年11月17日）、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理（2015年6月23日至2016年11月17日）、融通增裕债券型证券投资基金基金经理（2016年5月13日至2018年7月24日）、融通增丰债券型证券投资基金基金经理（2016年8月2日至2018年2月28日）、融通现金宝货币市场基金基金经理（2016年11月10日至2018年11月7日）、融通稳利债券型证券投资基金基金经理（2016年11月18日至2018年10月16日）、融通可转债债券型证券投资基金基金经理（2016年12月9日至2018年5月18日）、融通通泰

保本混合型证券投资基金基金经理（2016年5月13日至2019年7月15日）、融通通宸债券型证券投资基金基金经理（2018年11月21日起至2019年12月28日）、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理（2016年5月5日起至2019年12月30日），现任固定收益部总监、融通债券投资基金基金经理（2013年12月27日起至今）、融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）基金经理（2015年3月14日起至今）、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金经理（2015年3月14日起至今）、融通增益债券型证券投资基金基金经理（2016年5月11日起至今）、融通汇财宝货币市场基金基金经理（2018年7月5日起至今）、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理（2018年7月12日起至今）、融通通优债券型证券投资基金基金经理（2018年12月26日起至今）、融通超短债债券型证券投资基金基金经理（2019年3月19日起至今）、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理（2019年7月16日起至今）。

（2）历任基金经理情况

自2012年3月1日起至2012年8月30日，由乔羽夫先生和蔡奕奕女士共同担任本基金的基金经理。

自2012年8月31日起至2015年3月13日，由蔡奕奕女士担任本基金的基金经理。

自2015年3月14日起至2016年10月27日，由王超先生担任本基金的基金经理。

自2016年10月28日起至今，由王超先生和余志勇先生共同担任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司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、基金经理蒋秀蕾先生，研究部总经理、基金经理彭炜先生，组合投资部总监、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、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

1、基金托管人的基本情况

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： 陈四清

注册资本： 人民币 35,640,625.7089 万元

联系电话： 010-66105799

联系人： 郭明

2、主要人员情况

截至 2019 年 9 月，中国工商银行资产托管部共有员工 208 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 2019 年 9 月，中国工商银行共托管证券投资基金 1006 只。自 2003 年以来，本行连续十六年获得香港《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 68 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 、15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：柴玟

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

2、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）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：田国立

客服电话：95533

联系人：王琳

电话：（010）66275654

（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：刘连舸

客户服务电话：95566

（4）交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：任德奇

客服电话：95559

联系人：张作伟

电话：（021）58781234

（5）民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人：洪崎

客服电话：95568

联系人：董云巍

（6）招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：李建红

联系人：邓炯鹏

电话：（0755）83198888

客服电话：95555

（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

联系人：汤征程

联系电话：（021）68475888

（8）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街甲17号

法定代表人：张东宁

联系人：王曦

电话：（010）66223584

客户服务电话：95526

（9）平安银行股份有限公司

注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人：谢永林

联系人：张莉

电话：021-38637673

客户服务电话：95511-3

（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：郑杨

客服热线：95528

公司网站 www.spdb.com.cn

（12）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室

办公地址：浙江省杭州市翠柏路7号杭州电子商务产业园2号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

联系电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客服电话：0571-88920897 4008-773-772

（13）嘉实财富管理有限公司

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53层5312-15单

元

办公地址：北京市朝阳区建国路91号金地中心A座6层

法定代表人：赵学军

电话：010-65215588

传真：010-85712195

联系人：李雯

客服热线：400-021-8850

公司网站：www.harvestwm.cn

（14）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层

办公地址：上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19层

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830

联系人：陈云卉

客服热线：400-820-2819

（15）天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

联系人：林爽

联系电话：（010）66045608

客服电话：（010）66045678

传真：010-66045521

（16）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

（17）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

（18）上海陆金所基金销售有限公司（仅销售前端）

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

（19）珠海盈米基金销售有限公司（仅销售前端）

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

（20）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

法定代表人：张跃伟

联系人：吕慧

电话：（021）58788678

（21）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

（22）诺亚正行基金销售有限公司

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

（23）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

联系人：潘世友

电话：021-54509977

传真：021-64385308

客服电话：95021 / 4001818188

网址：www.1234567.com.cn

（24）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

（25）上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室

办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼

法定代表人：李兴春

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：曹怡晨

客服热线：400-921-7755

公司网站：<http://a.leadfund.com.cn/>

（26）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.fundzone.cn

（27）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

（28）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

（29）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

（30）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路海岸大厦东座1115室，1116室及1307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

（31）北京肯特瑞基金销售有限公司（仅销售前端）

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

（32）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/

（33）上海基煜基金销售有限公司

办公地址：上海市昆明路518号北美广场A1002-A1003室

法定代表人：王翔

客服电话：021-65370077

网址：www.jiyufund.com.cn

（34）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/>

（35）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

（36）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

（37）万家财富基金销售（天津）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/>

（38）上海华夏财富投资管理有限公司

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

（39）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

（40）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/>

（41）方德保险代理有限公司（原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

（42）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：李娟

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（43）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

（44）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

（45）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

（46）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

（47）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：0411-39027817

传真：0411-39027835

联系人：辛志辉

客服热线：4000899100

公司网站：www.yibaijin.com

（48）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

（49）上海大智慧基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南428号1号楼1102单元

办公地址：中国上海市浦东新区杨高南路428号1号楼1102单元

法定代表人：申健

传真：021-20219923

联系人：张蜓

电话：18017373527

客服热线：021-20292031

公司网站：www.wg.com.cn

（50）[北京百度百盈基金销售有限公司](http://www.baidu.com)

[注册地址：北京市海淀区上地十街10号1幢1层101](http://www.baidu.com)

[办公地址：北京市海淀区西北旺东路10号院西区4号楼](http://www.baidu.com)

[法定代表人：张旭阳](http://www.baidu.com)

[电话：010—59403028](tel:010-59403028)

[传真：010—59403027](tel:010-59403027)

[联系人：杨琳](#)

[客服热线：95055](tel:95055)

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

（51）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：占文驰

电话：（0791）86283372

客服电话：4008222111

（52）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路689号

法定代表人：周杰

联系人：涂洋

电话：（021）23219275

客服电话：4008888001或95553

（53）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：周健男

联系人：李晓哲

电话：（021）22169130

客服电话：95525

（54）长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市江汉区新华路特8号

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

电话：（021）68752206

客服电话：95579或4008-888-999

（55）中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

电话：（010）85130236

客服电话：400-8888-108或95587

（56）民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：余政

联系人：韩秀萍

电话：（010）85252656

客户服务电话：4006198888

（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：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

（58）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：（0551）96518、400-80-96518

（59）新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法人代表：叶顺德

联系人：田芳芳

电话：（010）83561146

客服电话：400-698-9898

（60）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

（61）国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

联系人：杨鹏军

电话：（0551）2207114

客服电话：95578，4008888777

（62）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）38676767

客服电话：4008888666

（63）申万宏源证券有限公司

通讯地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：杨玉成

联系人：余敏

电话：（021）33388215

客服电话：95523或4008895523

（64）东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

电话：（0512）62938521

客服电话：40086015555

（65）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：霍达

联系人：黄蝉君

电话：（0755）83285134

客服电话：4008888111、95565

（66）平安证券股份有限公司

办公地址：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：95511-8

（67）第一创业证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民

联系人：李晓伟

电话：（010）63197785

客服电话：4008881888

（68）华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人：陈牧原

联系人：邓鹏怡

电话：（0931）8490208

客服电话：96668

（69）信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63080994

客服电话：4008008899

（70）华福证券有限责任公司

注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：0591-87383600

客服电话：96326

（71）万联证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号18、19楼全层

法定代表人：罗钦城

联系人：罗创斌

电话：(020)38286651

客服电话：400-8888-133

（72）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：张佑君

联系人：马静懿

电话：（010）60838995

客服电话：4008895548

（73）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：王春峰

联系人：王星

电话：022-28451709

客服电话：4006515988

（74）世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人：姜昧军

联系人：袁媛

电话：0755-83199599-8166

客服电话：（0755）83199509

（75）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路90号

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：（0755）82492193

客服电话：95597

（76）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：徐朝晖

联系人：刘莹

电话：（029）87406649

客服电话：95582

（77）国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路13号

法定代表人：何春梅

联系人：牛孟宇

电话：（0755）83707413

客服电话：95563

（78）东北证券股份有限公司

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：4006000686

（79）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：（020）87558888-8333

客服电话：95575

（80）恒泰证券股份有限公司

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街111号

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：0471-4974437

客服电话：4001966188

（81）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：马焮

电话：010-88321613

客服热线：0871-68898130

（82）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

（83）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

（84）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

（85）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

（86）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：廖庆轩

联系人：周青

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

（87）北京晟视天下基金销售有限公司

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：许爽

客服电话：4008188866

（88）国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16—26 层

法定代表人：何如

联系人：李颖

电话：（0755）82130833

客服电话：95536

（89）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：陈耀庭

联系人：王一彦

电话：021-20333910

客服电话：400-888-858

（90）联储证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区福田街道岗厦社区深南大道南侧金地中心大厦9楼

法定代表人：吕春卫

联系人：龚愫雪

电话：0755-36991933

客服电话：400-620-6868

（91）广州证券股份有限公司

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：胡伏云

联系人：宋丽雪

电话：020-88836999

客服电话：95396

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：周明

办公地址：北京市西城区太平桥大街17号

联系电话：（010）59378839

传真：（010）59378907

联系人：朱立元

（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：陆奇

（四）审计基金财产的会计师事务所

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

联系电话：（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

融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）

六、基金的类型

契约型。基金合同生效后两年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易，基金合同生效满两年后，转为上市开放式基金（LOF），名称为融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）。

本基金已于2014年3月3日（封闭期届满之日）按照有关法律法规的规定和本基金合同的约定转为上市开放式基金（LOF）。

七、基金的投资目标

在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

八、基金的投资方向

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（包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、中期票据、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、可交换债券、地方政府债券、次级债券等）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、同业存单、权证、资产支持证券、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场股票申购或增发股票，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可

分离债券而产生的权证等。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于债券资产占基金资产的比例不低于 80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过 20%；每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

九、基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内，采取稳健的一级资产配置。通过对宏观经济运行状况的研究，积极的调整和优化可转债、信用债等固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，获得基金资产的稳定增值；并根据对股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测，适度参与一级市场首发新股和增发新股的申购，提高基金总体收益率。

2、固定收益类资产组合投资策略

本基金在债券组合构建过程中，具体的投资策略主要包括：利率策略、信用策略、可转债投资策略、资产支持证券等投资策略。

（1）利率策略

利率策略指考察市场利率的动态变化及预期变化，对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析。通过对宏观经济运行情况和对财政政策、货币政策的深入研究，形成对利率变化方向的预期，主动调整债券投资组合的久期。预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。

（2）信用策略

根据不同信用等级债券与同期限国债之间收益率利差的历史数据比较，并结合不同信用等级间债券在不同市场时期利差变化及收益率曲线变化，调整债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

本基金还将积极、有效的利用本基金管理公司比较完善的行业研究平台和信用债券评级体系，研究和跟踪发行主体所属行业发展周期、业务状况、公司治理结构、财务状况等因素，综合评估发行主体信用风险，确定信用产品的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。

（3）可转换债券的投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队及外部研究机构的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估，最终选择合适的投资品种。

（4）资产支持证券等的投资策略

资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产。

3、股票申购策略

本基金将积极参与股票申购。本基金将积极利用本基金管理公司比较完善的行业研究平台和股票估值体系，分析首次发行股票及增发股票的上市公司基本面因素，再结合股票市场整体定价水平以及股票中签率等因素，判断股票上市交易的合理价格。充分发挥作为机构投资者在股票询价发行过程中的对股票定价所起的积极作用，积极参与股票询价及路演活动，有效识别并防范风险。同时参考一级市场资金利率成本，制定灵活的股票申购策略。

本基金对于通过参与股票认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定上市后继续持有或者卖出。

4、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

十、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中债综合指数收益率。

如果今后证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案。基金管

理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒介上予以公告。

十一、风险收益特征

本基金属于债券基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据基金合同规定，于2020年2月26日复核了本报告的内容，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12月31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	2,550,000.00	0.22
	其中：股票	2,550,000.00	0.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,096,046,987.41	94.81
	其中：债券	1,096,046,987.41	94.81
	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	28,000,000.00	2.42
	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	9,461,108.24	0.82
8	其他资产	19,965,375.05	1.73
9	合计	1,156,023,470.70	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,550,000.00	0.28
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,550,000.00	0.28

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	000903	云内动力	1,000,000	2,550,000.00	0.28

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	107,522,327.60	11.67
	其中：政策性金融债	67,246,327.60	7.30
4	企业债券	448,842,942.52	48.73
5	企业短期融资券	60,370,000.00	6.55
6	中期票据	437,144,000.00	47.46
7	可转债（可交换债）	42,167,717.29	4.58
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,096,046,987.41	119.01

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	101801325	18 瓷矿 MTN014	500,000	51,450,000.00	5.59
2	101754077	17 河钢集 MTN010	500,000	50,800,000.00	5.52
3	091900026	19 中国华融债 01(品种一)	400,000	40,276,000.00	4.37
4	108801	进出 1901	330,000	33,009,900.00	3.58
5	101801263	18 鞍钢 MTN001	300,000	30,621,000.00	3.32

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

10.3 本期国债期货投资评价

无。

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	22,974.19
2	应收证券清算款	34,191.77
3	应收股利	-
4	应收利息	19,893,842.80
5	应收申购款	14,366.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	19,965,375.05
---	----	---------------

10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	110053	苏银转债	14,086,800.00	1.53
2	113021	中信转债	5,657,000.00	0.61
3	113011	光大转债	3,739,800.00	0.41
4	113009	广汽转债	1,741,200.00	0.19
5	110046	圆通转债	1,289,300.00	0.14
6	128059	视源转债	1,123,110.00	0.12
7	113022	浙商转债	596,100.00	0.06
8	113515	高能转债	584,950.00	0.06
9	113536	三星转债	438,880.00	0.05
10	128016	雨虹转债	259,140.00	0.03
11	123020	富祥转债	254,800.00	0.03
12	123019	中来转债	117,010.00	0.01

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

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2012年3月1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的比较如下表所示：

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3月1日(基金合同生效日)至2012年12月31日	5.96%	0.07%	0.27%	0.06%	5.69%	0.01%
2013年度	0.92%	0.09%	-3.75%	0.08%	4.67%	0.01%
2014年度	13.72%	0.16%	6.54%	0.11%	7.18%	0.05%
2015年度	8.47%	0.15%	4.18%	0.08%	4.29%	0.07%
2016年度	4.44%	0.10%	-1.63%	0.09%	6.07%	0.01%
2017年度	1.06%	0.07%	-3.38%	0.06%	4.44%	0.01%
2018年度	8.88%	0.13%	4.79%	0.07%	4.09%	0.06%
2019半年度	1.40%	0.08%	0.24%	0.06%	1.16%	0.02%

十四、基金费用概览

（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、基金的上市费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 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0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述（一）基金费用的种类中第3—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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 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。

（五）与基金销售有关的费用

1、申购费

投资者通过场内或场外申购本基金份额时需交纳申购费。本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

	申购金额（M）	申购费率
场内/场外 申购费	M < 100 万	0.80%
	100 万 ≤ M < 500 万	0.50%
	M ≥ 500 万	单笔 1000 元

2、赎回费

投资者在场内或场外赎回本基金份额时需交纳赎回费。

本基金的场外赎回费率随赎回基金份额持有期限的增加而递减，同时区分普通客户赎回和通过直销柜台赎回的养老金客户。

上述养老金客户包括基本养老保险与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等，包括：

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

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型，基金管理人届时将发布临时公告将其纳入养老金客户范围，在招募说明书更新时对其进行更新，并按规定向中国证监会备案。

普通客户指除通过直销柜台赎回的养老金客户以外的其他客户。

普通客户场外赎回的具体费率如下：

持有期限（N）	赎回费率
$N < 7$ 日	1.50%
$7 \text{ 日} \leq N < 1$ 年	0.50%
$1 \text{ 年} \leq N < 2$ 年	0.25%
$N \geq 2$ 年	0

注：上表中，1 年以 365 天计算。

普通客户场内赎回的具体费率如下：

持有期限（N）	赎回费率
$N < 7$ 日	1.50%
$N \geq 7$ 日	0.5%

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。

对于普通客户而言，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人，收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期不少于 7 日基金份额持有人，将不低于赎回费总金额的 25% 计入基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

对于养老金客户而言，对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人，收取的赎回费全额计入基金财产。对持续持有期不少于 7 日的基金份额持有人设置特定赎回费率，特定赎回费率为原赎回费率的 25%，收取的特定赎回费全额计入基金财产。

赎回份额持有时间的计算，以该份额在登记机构的登记日开始计算。

3、转换费率

基金转换费用包括转换费和补差费：

1) 转换费率：按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用；

2) 补差费率

转换出基金	转换金额分段	转换入基金
-------	--------	-------

		融通巨潮 100 指数 (LOF)	融通领先成长混合 (LOF)	融通军工分级	证券分级	融通人工智能指数 (LOF)
融通四季添利债券 (LOF)	M<100 万	0.70%	0.70%	0.40%	0.40%	0.40%
	100 万≤M<200 万	0.70%	0.50%	0.10%	0.10%	0.10%
	200 万≤M<500 万	0.10%	0	0	0	0
	M≥500 万	0	0	0	0	0

转换出基金	转换金额分段	转换入基金
		融通四季添利债券 (LOF)
融通巨潮 100 指数 (LOF)	M<100 万	0
	100 万≤M<1000 万	0
	1000 万≤M<2000 万	0
	M≥2000 万	0
融通领先成长混合 (LOF)	M<100 万	0
	100 万≤M<200 万	0
	200 万≤M<500 万	0
	M≥500 万	0
融通军工分级	M<100 万	0
	100 万≤M<200 万	0
	200 万≤M<500 万	0.10%
	M≥500 万	0
证券分级	M<100 万	0
	100 万≤M<200 万	0
	200 万≤M<500 万	0.10%
	M≥500 万	0
融通人工智能指数 (LOF)	M<100 万	0
	100 万≤M<200 万	0

	200万 \leq M<500万	0.10%
	M \geq 500万	0

目前参与本基金的转换业务的上述开放式基金的费率详见各相关基金最新招募说明书或公告的约定。

基金管理人可以根据《基金合同》的相关约定调整费率或收费方式，基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施日前2个工作日在指定媒介上公告。

当发生大额申购或赎回情形时，基金管理人可以采用摆动定价机制，以确保基金估值的公平性。具体处理原则与操作规范遵循相关法律法规以及监管部门、自律规则的规定。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行相关手续后基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

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，对本基金最近一期刊登的更新招募说明书进行了更新，主要更新内容如下：

一、在“第三部分 基金管理人”部分，根据最新资料进行了更新；

二、在“第四部分 基金托管人”部分，对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况按照最新资料进行了更新；

三、在“第五部分 相关服务机构”部分，更新了直销机构和代销机构的相关信息；

四、在“第九部分 基金份额的申购、赎回与转换”部分，更新了申购、赎回的相关信息；

五、在“第十部分 基金的投资”部分，更新了“基金投资组合报告”的内容，更新数据为本基金2019年第4季度报告中的投资组合数据；

六、在“第十一部分 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；

七、在“第十三部分 基金资产的估值”部分，更新了相关信息；

八、在“第十八部分 风险揭示”部分，更新了相关信息；

- 九、在“第二十部分 基金合同的内容摘要”部分，更新了相关信息；
- 十、在“第二十一部分 基金托管协议的内容摘要”部分，更新了相关信息；
- 十一、在“第二十二部分 对基金份额持有人的服务”部分，更新了相关信息；
- 十二、在“第二十三部分 其他应披露事项”部分，对本基金自上次招募说明书更新截止日以来的相关公告进行了列示。

融通基金管理有限公司

2020年2月28日