

财通多策略升级混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

基金管理人：财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

重要提示

本基金经 2015 年 12 月 29 日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]3121 号文准予注册募集。本基金基金合同于 2016 年 3 月 9 日正式生效。

基金管理人保证本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申请的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资者认购或申购本基金时应认真阅读本招募说明书，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资者自身的风险承受能力，并对于认购（或申购）基金的意愿、时机、数量等投资行为做出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险，包括市场风险、管理风险、估值风险、流动性风险、本基金的特定风险和其他风险等。本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高预期收益的基金产品。基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。

基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

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，但不保证本基金一定盈利，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。

本招募说明书所载内容截止日为 2017 年 3 月 9 日，有关财务数据截止日为 2016 年 12 月 31 日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

本基金管理人为财通基金管理有限公司，基本信息如下：

名称：财通基金管理有限公司

住所：上海市虹口区吴淞路 619 号 505 室

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 41 楼

设立日期：2011 年 6 月 21 日

法定代表人：刘未

组织形式：有限责任公司

注册资本：人民币贰亿元

联系人：王家俊

联系电话：021-2053 7888

股权结构：



（二）主要人员情况

1、董事会成员：

刘未先生，董事长，浙江大学经济学硕士。历任财通证券经纪有限责任公司营业部总经理，财通证券经纪有限责任公司经纪业务管理部总经理，原财通证券有限责任公司（现财通证券股份有限公司）基金筹建部负责人，财通基金管理有限公司副总经理、常务副总经理、总经理。现任财通证券股份有限公司总经理助理、财通基金管理有限公司董事长、上海财通资产管理有限公司董事长。

王家俊先生，总经理，中山大学高级工商管理硕士。历任东方证券遵义路营业部市场部经理，汇添富基金南方大区经理及券商渠道负责人、南方分公司总经理、全国渠道销售总监兼华东分公司总经理、财通基金管理有限公司副总经理、常务副总经理。现任财通基金管理有限公司总经理、上海财通资产管理有限公司董事。

骆旭升先生，董事，技术经济及管理硕士研究生，高级工程师。历任杭州武林实业总公司副总经理，杭州轻工控股（集团）有限公司科技处副处长，杭州市工业资产经营投资集团有限公司投资部部长，副总经理，现任杭州市实业投资集团有限公司副董事长、总经理。

吴梦根先生，董事，EMBA，高级经济师。历任湖州市经济体制改革委员会副主任，升华集团控股有限公司副总经理、总经理，浙江升华拜克生物股份有限公司董事长、副董事长，现任升华集团控股有限公司董事、总裁。

朱颖女士，独立董事，高级会计师，复旦大学会计专业硕士学历。中国注册会计师协会专家库专家，上海市徐汇区金融办上市专家顾问，财政部会计领军人才，上海立信会计学院兼职教授、硕士生导师等。现任立信会计师事务所高级合伙人、上海立信会计金融学院教授及硕士生导师、易居（中国）企业集团股份有限公司独立董事。

姚先国先生，独立董事，经济学硕士。历任浙江大学对外经济贸易学院、经济学院教授、常务副院长，浙江大学公共管理学院教授、院长，浙江大学社会科学学部主任。现任浙江大学公共政策研究院院长、博士生导师、浙江大学求是特聘教授、浙江大学文科资深教授，浙江亚太药业股份有限公司、浙江卧龙电气集团股份有限公司、浙江浙能电力股份有限公司、浙江核新同花顺网络信息股份有限公司、温州银行股份有限公司、南华期货股份有限公司独立董事。

朱洪超先生，独立董事，法律硕士。现任上海市联合律师事务所主任，上海仲裁委员会仲裁员、国际经济贸易仲裁委员会仲裁员、上海国际仲裁中心仲裁员、易居(中国)控股有限公司、中化国际（控股）股份有限公司、上海第一医药股份有限公司、万达信息股份有限公司、上海广电电气股份有限公司等独立董事。

2、职工监事：

杨铁军先生，职工监事，监察稽核部总监、法学硕士。执业律师，历任金元比联基金管理有限公司监察稽核部副总监、财通基金管理有限公司监察稽核部副总监，现任财通基金管理有限公司监察稽核部总监。

3、经营管理层人员：

王家俊先生，总经理（简历同上）；

汪海先生，副总经理，上海大学双学士，新加坡管理大学财富管理硕士。历任建行上海市徐汇支行计划财务部科员、经理助理、个人金融部客户经理；建行上海分行财富管理与私人银行部产品经理、个人金融部产品经理、副总经理、财通基金管理有限公司总经理助理，现任财通基金管理有限公司副总经理。

4. 督察长

黄惠女士，工商管理硕士、EMBA。历任张家界旅游股份有限公司董事会秘书，方正证券有限责任公司北京代表处主任，中国证券投资者保护基金有限公司高级经理。现任财通基金管理有限公司督察长、工会委员会主席、上海财通资产管理有限公司董事。

5、基金经理

姚思劼先生，复旦大学理学学士、管理学硕士。2011年7月加入财通基金管理有限公司，历任财通基金管理有限公司助理研究员、研究员，研究行业覆盖汽车、

机械、公用事业等，重点关注高端装备制造等战略新兴产业，现任财通多策略精选混合型证券投资基金基金经理、财通多策略升级混合型证券投资基金、财通多策略福享混合型证券投资基金、财通多策略福瑞定期开放混合型发起式证券投资基金、财通福盛定增定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

6、投资决策委员会成员：

王家俊先生，总经理；

金梓才，基金投资部副总监；

陆玲玲女士，研究部副总监；

张亦博先生，固定收益部基金经理。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基本情况

本基金托管人为中国工商银行股份有限公司，基本信息如下：

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

设立日期：1984 年 1 月 1 日

批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146 号）

组织形式：股份有限公司

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

法定代表人：易会满

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

联系人：郭明

电话：010-66105799

（二）主要人员情况

截至 2016 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 190 人，平均年龄 30 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、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 2016 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 587 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《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 51 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。

三、相关服务机构

(一) 销售机构

1、直销机构

名称：财通基金管理有限公司

住所：上海市虹口区吴淞路 619 号 505 室

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 41 楼

法定代表人：刘未

电话：021-2053 7888

传真：021-2053 7999

联系人：何亚玲

客户服务电话：4008 209 888

公司网址：www.ctfund.com

2、代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市复兴门内大街 55 号

法定代表人：易会满

联系人：刘秀宇

传真：010-66107914

客服电话：95588

公司网址：www.icbc.com.cn

(2) 中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

办公地址：北京市西城区太平桥大街 25 号中国光大中心

法定代表人：唐双宁

联系人：朱红

客服电话：95595

公司网址：www.cebbank.com

(3) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 2 号

法定代表人：洪崎

联系人：王继伟

客服电话：95568

公司网址：www.cmbc.com.cn

(4) 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：牛锡明

联系人：张作伟

客服电话：95559

公司网站：www.bankcomm.com

(5) 上海银行股份有限公司

注册地址：上海市银城中路 168 号

办公地址：上海市银城中路 168 号

法定代表人：范一飞

联系人：汤征程

电话：021-68475888

客服电话：021-962888

公司网址：www.bankofshanghai.com

(6) 宁波银行股份有限公司

注册地址：中国浙江宁波市宁南南路 700 号

办公地址：中国浙江宁波市宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

联系人：胡技勋

客服电话：95574

公司网站：www.nccb.com.cn

(7) 广发银行股份有限公司

注册地址：广州市越秀区东风东路 713 号

办公地址：广州市越秀区东风东路 713 号

法定代表人：董建岳

联系人：陈泾渭

客服电话：400-830-8003

公司网站：www.cgbchina.com.cn

(8) 浙江民泰商业银行股份有限公司

注册地址：浙江省温岭市三星大道 168 号

办公地址：浙江省温岭市三星大道 168 号

法定代表人：江建法

联系人：刘兴龙

电话：0571-88821178

客服电话：400-8896-521

公司网址：www.mintaibank.com

(9) 平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号

法定代表人：孙健一

电话：0755-8208 8888

传真：0755-8201 1018

公司网址：<http://bank.pingan.com/>

(10) 财通证券股份有限公司

注册地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：徐轶青

电话：0571-87822359

传真：0571-87818329

客服电话：96336（浙江），40086-96336（全国）

公司网址：www.ctsec.com

(11) 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

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：唐静

联系电话：010-63081000

传真：010-63080978

客服电话：400-800-8899

公司网址：www.cindasc.com

(12) 华融证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街8号华融大厦A座3层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门北大街18号中国人寿保险大厦1至18层

法定代表人：祝献忠

联系人：李慧灵

电话：010-85556100

传真：010-85556088

客服电话：400-898-9999

网址：www.hrsec.com.cn

(13) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：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：赵大建

传真：0351-8686667

客服电话：95573

公司网站：<http://www.i618.com.cn/>

(14) 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号国际企业大厦C座

办公地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈共炎

联系人：邓颜

电话：010-66568292

传真：010-66568532

客服电话：400-8888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

(15)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 45 层

办公地址:上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人:李梅

联系人:黄莹

电话:021-33388211

传真:021-33388224

客服电话:95523 或 4008895523

公司网址:www.swhysc.com

(16)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

办公地址: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:021-22169089

传真:(8621) 62151789

客服电话:95525、400-8888-788

公司网址:www.ebscn.com

(17)兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路 268 号

办公地址:上海浦东新区长柳路 36 号丁香国际东楼 21 楼

法定代表人:兰荣

联系人:夏中苏

电话:0591-38281963, 0591-38507538

客服电话:400-8888-123

公司网址:www.xyzq.com.cn

(18)湘财证券股份有限公司

注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号新南城商务中心 A 栋 11 楼

法定代表人:林俊波

联系人:李欣

电话:021-68634510-888193

传真：021-68865680

客服电话：400-888-1551

公司网址：<http://www.xcsc.com/>

(19) 华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-9 楼

办公地址：福建省福州市五四路 157 号新天地大厦 7-9 楼

法定代表人：黄金琳

联系人：郭相兴

电话：021-20655175

传真：021-20655196

公司网址：<http://www.gfhfzq.com.cn/>

(20) 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

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

联系电话：021-38676161

客服电话：400-8888-666 / 95521

网址：www.gtja.com

(21) 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

办公地址：北京市朝阳区亮马桥 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑军

联系人：侯艳红

电话：010-60838995

客服电话：95548

公司网址：www.cs.ecitic.com

(22) 国信证券股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层至 26 层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16 层至 26 层

法定代表人：何如

联系人：李颖

电话：0755-82130833-701266

传真：0755-82133066

客服电话：95536

公司网址：www.guosen.com.cn

(23)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

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：宫少林

联系人：林生迎

电话：0755-82960223

传真：0755-82943636

客服电话：400-8888-111，95565

公司网址：www.newone.com.cn

(24)上海证券有限责任公司

住所：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：龚德雄

客户服务电话：4008918918、021-962518

网址：www.962518.com/www.shzq.com

(25)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

办公地址：深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

电话：0755-82825551

传真：0755-82558355

客服电话：400-8001-001

公司网址：www.essence.com.cn

(26)东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18-19 楼

办公地址：上海浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

电话：021-20333910

传真：021-50588876

客服电话：95531

公司网址：www.longone.com.cn

(27) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 23 楼

办公地址：上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人：郭林

联系人：陈敏

电话：021-32229888

客服电话：021-63340678

公司网址：www.ajzq.com

(28) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 号

法定代表人：丁益

联系人：郑舒丽

电话：0755-83516089

传真：0755-83515567

客服电话：400-6666-888

公司网址：www.cgws.com

(29) 国海证券股份有限公司

注册地址：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 楼

法定代表人：张雅锋

联系人：牛孟宇

电话：0755-83709350

传真：0755-83704850

客服电话：95563

公司网址：www.ghzq.com.cn

(30) 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

办公地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第

20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户服务热线：0532-96577

网址：www.zxwt.com.cn

(31)中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号院盘古大观 A 座 40F-43F

办公地址：北京市朝阳区北四环中路 27 号盘古大观 A 座 40F-43F

法定代表人：何亚刚

联系人：尚蓓

电话：010-59355497

传真：010-56437032

客服电话：4008895618

网址：www.e5618.com

(32) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心 3/4 楼

办公地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心 3/4 楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话：0752-2119700

传真：0752-2119660

客服电话：0752-95564

网址：www.lxzq.com.cn

(33)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

电话：021-23219290

传真：021-23219000

客服电话：95553

公司网址：www.htsec.com

(34)德邦证券股份有限公司

注册地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

办公地址：上海市福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人：姚文平

传真：021-68767880

客服电话：021-68761616

公司网站：www.tebon.com.cn

(35)长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：奚博宇

电话：021-68751860

传真：027-85481900

客服电话：95579

公司网址：www.95579.com

(36)平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

法定代表人：詹露阳

联系人：石静武

电话：021-38631117

传真：021-58991896

客服电话：95511 转 8

公司网址：<http://stock.pingan.com>

(37)国金证券股份有限公司

注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

传真：028-86690126

客服电话：95310

公司网址：<http://www.gjqz.com.cn/>

(38)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

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：余维佳

联系人：张煜

电话：023-63786141

传真：023-63786212

客服电话：95355

公司网址：www.swsc.com.cn

(39) 中国中投证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18-21 层及第四层 01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 4、18-21 层

法定代表人：高涛

客服电话：95532、4006008008

公司网址：<http://www.china-invs.cn/>

(40) 华鑫证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01(b) 单元

办公地址：上海市宛平南路 8 号

法定代表人：俞洋

客服电话：4001099918

公司网址：www.cfsc.com.cn

(41) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：杨树财

客服电话：95360

公司网址：<http://www.nesc.cn/>

(42) 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

办公地址：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

客服电话：95318

公司网址：<http://www.hazq.com/>

(43)恒泰证券股份有限公司

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

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

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：0471-4972675

客服电话：400-196-6188

公司网址：<http://www.cnht.com.cn/>

(44)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

办公地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

客服电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(45)广州证券股份有限公司

注册地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：邱三发

客服电话：95396

公司网址：www.gzs.com.cn

(46)华龙证券股份有限公司

注册地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心

办公地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心

法定代表人：李晓安

客服电话：95368

公司网址：www.hlzq.com

(47)大同证券有限责任公司

注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址：太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层

法定代表人：董祥

客服电话：4007121212

公司网址：www.dtsbc.com.cn

(48)中银国际证券有限责任公司（上海）

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

法定代表人：钱卫

客服电话：400-620-8888/021-61195566

公司网址：www.bocichina.com/

(49)东莞证券有限责任公司

注册地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

办公地址：莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：张运勇

客服电话：95328

公司网址：<http://www.dgzq.com.cn/>

(50)中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

联系人：许梦园

电话：010-85156398

传真：010-65182261

客服电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

(51)华泰证券股份有限公司

住所：南京市江东中路 228 号

办公地址：南京市江东中路 228 号

法定代表人：周易（代为履行）

联系人：庞晓芸

电话：0755-82492193

客服电话：95597/ 025-83389999

公司网址：<http://www.htsc.com.cn/>

(52)方正证券股份有限公司

注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人:何其聪

客服电话:95571

公司网址: www.foundersc.com

(53)杭州数米基金销售有限公司

注册地址: 杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址: 浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人: 陈柏青

联系人: 周旻旻

电话: 0571-28829790, 021-60897869

传真: 0571-26698533

客服电话: 4000-766-123

公司网址: www.fund123.cn/

(54)上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址: 上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人: 杨文斌

联系人: 张茹

电话: 021-58870011

传真: 021-68596916

客服电话: 400-700-9665

公司网址: www.ehowbuy.com

(55)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

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 楼

法定代表人: 凌顺平

联系人: 杨翼

联系电话: 0571-88911818-8653

传真: 0571-86800423

客服电话: 0571-88920897

公司网站: www.ijijin.cn

(56)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I/J 单元

办公地址: 深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I/J 单元

法定代表人：薛峰

传真：0755-82080798

客服电话：4006-788-887

公司网址：www.zlfund.cn/www.jjmmw.com

(57)和讯信息科技有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层

办公地址：上海市浦东新区东方路18号保利广场E座18楼

法定代表人：王莉

联系人：周轶

电话：021-20835789

传真：021-20835879

客服电话：400-920-0022

公司网站：<http://www.licaike.com/>

(58)诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

法定代表人：汪静波

联系人：张裕

电话：021-80359127

客服电话：400-821-5399

诺亚网址：www.noah-fund.com

(59)上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

办公地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层

法定代表人：其实

联系人：许云婷

电话：021-54509998

传真：021-64385308

客服电话：400-1818-188

天天基金网址：www.1234567.com.cn

(60)上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

法定代表人：张跃伟

联系人：唐诗洋

电话：021-20691926

传真：021-2069-1861

公司网址：www.erichfund.com

(61) 北京钱景财富投资管理有限公司

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

传真：010-57569671

客服电话：400-893-6885

公司网址：www.qianjing.com

(62) 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

办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层

法定代表人：闫振杰

联系人：翟飞飞

电话：13520236631

客服电话：400-888-6661

公司网址：www.myfund.com

(63) 浙江金观诚财富管理有限公司

注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室

法定代表人：陈峥

客服电话：400-068-0058

公司官网：www.jincheng-fund.com

(64) 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

传真：010-58325282

联系人：文雯

电话：010-83363101

客服电话：400-166-1188

公司网址：<http://www.jrj.com.cn/>

(65) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702 室
办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208
法定代表人：吴雪秀
传真：(010)88312877
联系人：段京璐
电话：(010)88312877
客服电话：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com

(66) 北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208
办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208
法定代表人：罗细安
传真：010-67000988-6000
联系人：李皓
电话：010-67000988
客服电话：400-001-8811
公司网址：www.zcvc.com.cn

(67) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 16 层 1603
法定代表人：董浩
传真：010-56580660
联系人：于婷婷
电话：010-56409010
客服电话：400-068-1176
公司网址：www.jimufund.com

(68) 上海联泰资产管理有限公司

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 号楼 3 层
法定代表人：燕斌
传真：021-52975270
联系人：凌秋艳
电话：021-52822063

客服电话：4000-466-788

公司网址：www.66zichan.com

(69) 上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

电话：021-33323999

传真：021-33323830

客服电话：400-820-2819

公司网址：<https://tty.chinapnr.com/>

(70) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

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

传真：021-22066653

客服电话：400-821-9031

公司网址：www.lufunds.com

(71) 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 46 层 4609-10 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

联系人：于永健

电话：010-85097570

传真：010-85097308

客服电话：400-021-8850

网址：www.harvestwm.cn

(72) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

联系人：张晔

电话：010-56810307

传真：010-56810630

客服电话：4008-980-618

网址：www.chtfund.com

(73)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

联系人：李晓明

电话：021-63333319

传真：021-63332523

客服电话：400 178 000

(74)泰诚财富基金销售（大连）有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号

法定代表人：林卓

联系人：薛长平

电话：0411-88891212

传真：0411-88891212-122

客服电话：4006411999

网址：<http://www.taichengcaifu.com>

(75)珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：吴煜浩

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客服电话：020-89629066

网址：www.yingmi.cn

(76)大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 层

法定代表人：袁顾明

联系人：朱真卿

电话：021-22267943

传真：021-22268089

客服电话：4009282266

网址：www.dtfunds.com

(77) 中信期货有限公司

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
13 层 1301-1305 室/14 层

办公地址：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
13 层 1301-1305 室/14 层

法定代表人：张皓

传真：0755-83217421

客服电话：400-990-8826

公司网站：<http://www.citicsf.com/>

(78) 中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27/28 层

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27/28 层

法定代表人：丁学东

存续期间：持续经营

电话：010-65051166

传真：010-65051156

公司网址：www.cicc.com.cn

(79) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

联系人：徐鹏

电话：86-021-50583533

传真：86-021-50583633

网址：<http://a.leadfund.com.cn/>

客户服务中心电话：400-067-6266

(80) 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

联系人：赵源

电话：010-59336542

传真：010-59336500

客服电话：4008909998

公司网址：www.jnlc.com

(81) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

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

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室、1116 室及 1307 室

联系人：叶健

电话：0755-89460507

传真：0755-21674453

客服电话：400-684-0500

公司网址：www.ifastps.com.cn

(82) 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 号第一广场西座 1501-1504

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号第一广场西座 1501-1504

联系人：陈承智

电话：0592-3122673

传真：0592-3122701

客服电话：400-918-0808

公司网址：www.xds.com.cn

(83) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

联系人：马力佳

电话：0755-83999907-815

传真：0755-83999926

客服电话：0755-83999907

公司网址：www.jinqianwo.cn

(84)北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址：北京市朝阳区朝外大街万通中心 D 座 28 层

联系人：杨惠宁

电话：15981106039

传真：010-58170800

客服电话：400-818-8866

公司网址：<http://www.shengshiview.com/>

(85)上海大智慧财富管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、
1103 单元

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 428 号 1 号楼 1102、
1103 单元

联系人：裘爱萍

电话：021-20219988-39069

传真：021-20219923

客服电话：021-20219931

网址：<https://8.gw.com.cn/>

(86)北京君德汇富投资咨询有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 18 号 15 层办公楼一座 1502 室

办公地址：北京市东城区建国门内大街 18 号恒基中心办公楼一座 2202 室

联系人：周雯

电话：13810043063

传真：010-65174782

客服电话：400-829-1218

公司网址：<https://www.kst treasure.com/>

(87)武汉市伯嘉基金销售有限公司

注册地址：武汉市江汉区中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）七栋 23 层 1 号
4 号

办公地址：武汉市江汉区中央商务区泛海国际 SOHO 城（一期）七栋 23 层 1 号
4 号

联系人：陆锋

电话：027-87006003-8026

传真：027-87006010

客服电话：400-027-9899

公司网址：www.buyfunds.cn

(88) 宜信普泽投资顾问（北京）有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国路 88 号 9 号楼 15 层 1809

办公地址：北京市朝阳区建国路 88 号 SOHO 现代城 C 座 18 层 1809

联系人：宋欣晔

电话：010-52855713

传真：010-85894285

客服电话：400-6099200

公司网址：www.yixinfund.com

(89) 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（上海泰和经济发展区）

办公地址：上海市杨浦区昆明路 518 号 A1002 室

法定代表人：王翔

联系人：蓝杰

电话：021-65370077

传真：021-55085991

客户服务电话：4008-205-369

网址：www.jiyufund.com.cn

(90) 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：北京市朝阳区望京 SOHO, T2, B 座 2507

联系人：翟相彬

电话：010-61840688

传真：010-61840699

客服电话：4000-618-518

公司网址：danjuanapp.com

(91) 开源证券股份有限公司

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代销人：李刚

客服电话： 4008608866

公司网址： <http://www.kysec.cn/>

(92) 北京懒猫金融信息服务有限公司

注册地址： 北京市石景山区石景山路 31 号院盛景国际广场 3 号楼 1119

办公地址： 北京市朝阳区四惠东通惠河畔产业园区 1111 号

联系人： 朱翔宇

电话： 15921710500

传真： 010-87723200

客服电话： 4001-500-882

网址： www.lanmao.com

手机 APP： 懒猫金服

(93) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址： 北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401-15

法定代表人： 陈超

电话： 4000988511/ 4000888816

传真： 010-89188000

客服电话： 400 098 8511

公司官网： <http://fund.jd.com/>

(94) 乾道金融信息服务（北京）有限公司

注册地址： 北京市海淀区东北旺村南 1 号楼 7 层 7117 室

办公地址： 北京市西城区德外大街合生财富广场 1302 室

联系人： 高雪超

电话： 010-62062880

传真： 010-82057741

客服电话： 4000-888-080

公司网址： www.qiandaojr.com

(95) 凤凰金信（银川）投资管理有限公司

注册地址： 宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路 142 号
14 层 1402

办公地址： 北京市朝阳区紫月路 18 号院 朝来高科技产业园 18 号楼

联系人： 张旭

传真： 010-58160173

客服电话： 400-810-5919

公司网址: www.fengfd.com

(96)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大街 11 号 A 座 1108 室

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 A 座 1108 室

联系人: 马怡

电话: 010-56282140

传真: 010-62680827

客服电话: 400-619-9059

公司网址: www.hcjijin.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求, 选择其它符合要求的机构代理销售本基金, 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

电话: 021-5887 2935

联系人: 郑奕莉

(三) 出具法律意见书的律师事务所

名称: 上海源泰律师事务所

住所: 上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人: 廖海

电话: 021-5115 0298

传真: 021-5115 0398

联系人: 刘佳

经办律师: 刘佳、范佳斐

(四) 审计基金财产的会计师事务所

名称: 安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)

执行事务合伙人: 毛鞍宁

住所: 北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼(东三办公楼)
16 层

办公地址: 上海市世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

邮政编码: 200120

公司电话: (021) 22288888

公司传真：（021）22280000

签章会计师：郭杭翔、蒋燕华

业务联系人：郭杭翔

四、基金名称

财通多策略升级混合型证券投资基金

五、基金的类型

混合型

六、基金的投资目标

本基金将灵活运用多种投资策略，充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会，力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。

七、投资范围

本基金的投资范围为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）、权证、债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指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：股票资产比例为基金资产的30%~95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产的0%~70%；在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

八、投资策略

1、资产配置策略

本基金综合分析国内外政治经济环境、经济基本面状况、宏观政策变化、金融市场形势等多方面因素，通过对货币市场、债券市场和股票市场的整体估值状况比较分析，对各主要投资品种市场的未来发展趋势进行研判，根据判断结果进行资产配置及组合的构建，确定基金在股票、债券、货币市场工具等资产类别上的投资比例，并随着各类资产风险收益特征的相对变化，适时动态调整各资产类别的投资比例，在控制投资组合整体风险基础上力争提高收益。

本基金进行综合分析的各项指标和因素主要包括：基本面分析方面主要包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、

发电量等宏观经济统计数据；政策面分析方面主要包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等各项货币政策，财政支出总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策；金融市场分析方面主要包括市场投资者参与度、市场资金供求变化、市场估值水平等。

2、股票投资策略

本基金在价值投资理念的基础上，建立成长策略、主题策略、定向增发策略以及动量策略等多策略体系，并根据市场环境的变化进行针对性运用。具体投资过程中，本基金通过自下而上的成长股策略，对上市公司进行基本面研究，精选股票；通过自上而下的主题策略，研究行业轮动与市场热点，精选行业；通过动量策略进行股票操作层面的动态调整，捕捉市场动量效应驱动的投资机会；通过定向增发策略把握上市公司定向增发事件关联的投资机会，选择基本面和安全边际双优的定增企业。通过以上多种策略的综合应用，本基金建立基金投资组合，并根据宏观经济状况、公司基本面变化等因素进行动态调整。

（1）成长策略

本基金对成长型公司的投资以新兴产业、处于周期性景气上升阶段的拐点行业以及持续增长的传统产业为重点，并精选其中行业代表性高、潜在成长性好、估值具有吸引力的个股进行投资。对于新兴产业，在对产业结构演变趋势进行深入研究和分析的基础上，准确把握新兴产业的发展方向，重点投资体现行业发展方向、拥有核心技术、创新意识领先并已经形成明确盈利模式的公司；对于拐点产业，依据对行业景气变化趋势的研究，结合投资增长率等辅助判断指标，提前发现景气度进入上升周期的行业，重点投资拐点行业中景气敏感度高的公司；对于传统产业，主要关注产业增长的持续性、企业的竞争优势、发展战略以及潜在发展空间，重点投资具有清晰商业模式、增长具有可持续性和不可复制性的公司。

（2）主题策略

本基金通过对经济发展过程中的制度性、结构性或周期性趋势的研究和分析，深入挖掘潜在的投资主题，并选择那些受惠于投资主题的公司进行投资。首先，从经济体制变革、产业结构调整、技术发展创新等多个角度出发，分析经济结构、产业结构或企业商业运作模式变化的根本性趋势以及导致上述根本性变化的关键性驱动因素，从而前瞻性地发掘经济发展过程中的投资主题；其次，通过对投资主题的全面分析和评估，明确投资主题所对应的主题行业或主题板块，从而确定受惠于相关主题的公司，依据企业对投资主题的敏感程度、反应速度以及获益水平等指标，精选个股；再次，通过紧密跟踪经济发展趋势及其内在驱动因素的变化，不断地挖掘和研究新的投资主题，并对主题投资方向做出适时调整，从而准

确把握新旧投资主题的转换时机，充分分享不同投资主题兴起所带来的投资机遇。

（3）定向增发策略

定向增发是指上市公司向特定投资者（包括大股东、机构投资者、自然人等）非公开发行股票的方式。本基金将对进行非公开发行的上市公司进行基本面分析，结合市场未来走势进行判断，从战略角度评估参与定向增发的预期中签情况、预期损益和风险水平，积极参与风险较低的定向增发项目。在定向增发股票锁定期结束后，本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。

（4）动量策略

动量策略是指市场在一定时期内可呈现“强者恒强”的特征，通过买入过去一段时期的强势股可以获得超越市场平均水平的收益。本基金将综合分析各股票的市场价格动量特征，分析指标包括各股票的阶段累计收益率、换手率、市场交易活跃度、波动率，选择动量特征明显和价格趋势强劲的个股纳入投资组合，作为本基金的辅助投资策略。

3、固定收益类资产投资策略

固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

（1）利率预期与久期控制策略

本基金密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在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。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略，如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

（2）个券选择策略

个券选择层面，对各信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后，进行个券选择。财务分析方面，以企业财务报表为依据，对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分；非财务分析方面（包括管理能力、市场地位和发展前景等指标）则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。

（3）时机策略

i. 价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性，建立债券的估值模型，

对当日无交易的债券计算理论价值，买进价格低于价值的债券；相反，卖出价格高于价值的债券。

ii. 骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

iii. 息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

iv. 利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析，对利差水平的未来走势做出判断，从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下进行权证投资。权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，结合权证的溢价率、隐含波动率、到期日等指标，选择权证的买入和卖出时机，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

5、股指期货的投资策略

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准： $\text{沪深 300 指数收益率} \times 55\% + \text{上证国债指数收益率} \times 45\%$
本基金选择该业绩基准，是基于以下因素：

- (1) 沪深 300 指数和上证国债指数编制方法合理、透明；
- (2) 沪深 300 指数和上证国债指数编制和发布有一定的历史，有较高的知名度和市场影响力；
- (3) 具有市场覆盖率，不易被操纵；
- (4) 本基金的股票、债券和现金比例，选用该业绩比较基准能够真实反映本基金的风险收益特征。

沪深 300 指数由中证指数有限公司编制和计算。中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的精确性。关于指数值和成分股名单的所有知识产权归属中证指数有限公司。

上证国债指数由上海证券交易所委托中证指数有限公司管理。上证指数的所有权归属上海证券交易所。

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的业绩基准的股票指数时，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，而无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金是混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金产品和货币市场基金、低于股票型基金产品，属于中高风险、中高收益的基金产品。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 1 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计，本投资组合报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日。

1 报告期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

■

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

■

2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通机制投资的港股。

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

■

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

■

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



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合约。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

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

本基金暂不投资国债期货。

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合约。

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合约。

11 投资组合报告附注

11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形。

11.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

11.3 其他资产构成

单位：人民币元



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

金额单位：人民币元



11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

本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。

(一) 基金净值表现

1、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



注：(1)上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

(2)本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

(二) 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通多策略升级混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 3 月 9 日-2016 年 12 月 31 日)



注：(1)本基金合同生效日为 2016 年 3 月 9 日，基金合同生效起至披露时点不满一年；

(2)根据《基金合同》规定：股票资产比例为基金资产的 30%~95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产的 0%~70%；在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金建仓期是 2016 年 3 月 9 日至 2016 年 9 月 9 日，截至报告期末及建仓

期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

十三、基金费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的上市初费和月费；
- 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1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

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

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、公休日等，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的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、“重要提示”部分

（1）更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日期信息。

2、“三、基金管理人”部分

- （1）更新了基金管理人概况。
- （2）更新了主要人员情况。

3、“四、基金托管人”部分

- （1）更新了基金托管人基本情况；
- （2）更新了主要人员情况。
- （3）更新了基金托管业务经营情况。

4、“五、相关服务机构”部分

- （1）更新了直销机构方面信息。
- （2）更新了代销机构方面信息。

8、“九、基金的投资”部分

- （1）更新了基金投资组合报告，报告所载数据截至 2016 年 12 月 31 日。

9、“十、基金的业绩”部分

10、“二十二、其他应披露事项”部分

（1）更新了 2016 年 9 月 12 日至 2016 年 12 月 31 日期间涉及本基金的相关公告。

财通基金管理有限公司

二〇一七年四月十九日