

# 融通丰利四分法证券投资基金 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

二〇一八年九月

## 重要提示

融通丰利四分法证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会证监基金字证监许可[2012]1360号文核准募集。本基金基金合同生效日为2013年2月5日。

投资有风险，投资者申购本基金时应认真阅读本基金更新招募说明书正文。

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更新招募说明书编写，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2018年8月5日，有关财务数据和基金业绩表现数据截止日为2018年6月30日（本招募说明书中的财务数据未经审计）。

### 一、基金合同生效日

2013年2月5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

胡允畧先生，加拿大麦基尔大学经济及金融管理学士，美国特许金融分析师（CFA），12年证券投资从业经历，具有基金从业资格及香港证监会颁发的1,4,9号牌的从业资格。历任日亚证券有限公司（香港）证券研究部副总裁，三井住友资产管理有限公司（香港）大中

华区投资研究部投资分析员，摩根大通银行（日本东京总行）债券坐盘交易部分析员，富达基金有限公司（香港及东京分行）财务部财务分析员。2011年6月加入融通基金管理有限公司，现任融通丰利四分法（QDII-FOF）基金的基金经理。

（2）历任基金经理情况

自2013年2月5日起至2014年4月11日，由胡允畧先生担任本基金的基金经理。

自2014年4月12日起至2015年4月28日，由胡允畧先生和刘冬先生共同担任本基金的基金经理。

自2015年4月29日起至2016年9月8日，由胡允畧先生担任本基金的基金经理。

自2016年9月9日起至2018年1月19日，由胡允畧先生和王浩宇先生共同担任本基金的基金经理。

自2018年1月20日起至今，由胡允畧先生担任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司境外公募基金投资决策委员会成员：常务副总经理颜锡廉先生、基金经理成涛先生、基金经理何博女士、基金经理胡允畧先生、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、基金托管人及境外托管人概况

（一）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：010-66105798

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，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。

#### （二）境外托管人

##### 1、基本情况

名称：布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.）

地址：140 Broadway New York, NY 10005

法定代表人：William B. Tyree (Managing Partner)

组织形式：合伙制

存续期间：持续经营

成立于1818年的布朗兄弟哈里曼银行（“BBH”）是全球领先的托管银行之一。BBH自1928年起已经开始在美国提供托管服务。1963年，BBH开始为客户提供全球托管服务，是首批开展全球托管业务的美国银行之一。BBH的业务集中于三个主要领域：投资者服务（即全球托管）、投资管理和私人银行。目前全球员工约5千人，在全球18个国家和地区设有分支机构。

##### 2、托管业务及主要人员情况

布朗兄弟哈里曼银行的全球托管业务隶属于布朗兄弟哈里曼银行的投资者服务部。在全球范围内，该部门由布朗兄弟哈里曼银行合伙人Sean Pairceir先生领导。在亚洲，该部门由

布朗兄弟哈里曼银行合伙人Taylor Bodman先生领导。

作为一家全球化公司，BBH拥有服务全球跨境投资的专长，其全球托管网络覆盖近一百个市场。截止2017年12月底，BBH的全球托管服务所涉托管资产规模超过4万亿美元，主要集中于金融机构和基金管理机构。亚洲是BBH业务增长最快的地区之一。我们投身于亚洲市场，迄今已逾25年，亚洲服务管理资产近6千亿美元。

投资者服务部是公司最大的业务，拥有近4400名员工。我们致力为客户提供稳定优质的服务，并根据客户具体需求提供定制化的全面解决方案，真正做到“以客户为中心”。

由于坚持长期提供优质稳定的客户服务，BBH多年来在行业评比中屡获殊荣，包括：

1.  : 《全球托管人》

2016年行业领导者大奖

#1 - 共同基金管理托管服务-

2015年共同基金行政管理调查

被评为“全球杰出表现者”

2015年行业领导者大奖

#1 - 共同基金管理客户服务 - 北美

2014年代理银行调查

#1 - 美国代理银行资产服务

2013年全球托管银行调查

机构投资者：12项类别中有9项位列#1，2项位列 #2

基金管理者：8项类别中有2项位列#1，5项位列 #2

2.  : 《全球投资人》

2016全球托管银行调查

#1 - 共同基金/ UCITS -美洲地区(原始分数)

#2 -使用多个托管人的客户 - - 欧洲、中东和非洲地区(加权)

2015年全球托管银行调查

#1 - 使用多个托管人的客户 - 亚太地区(加权 )

#2 - 共同基金管理者 (全球和仅美洲地区)

2014年全球托管银行调查

#1 - 资产管理规模超过30亿美元的客户 - 全球

#1 - 资产管理规模超过30亿美元的客户 - 欧洲、中东和非洲

#1 - 美洲共同基金管理者

3. : 《ETF Express》

2016年ETF Express大奖

最佳欧洲ETF基金管理者

2014年ETF Express大奖

最佳北美ETF基金管理者

4. : 《R&M 调查》

2014年Custody.net 全球托管银行调查

#1 美洲

### 3、境外托管人的职责

- (1) 安全保管受托财产；
- (2) 计算境外受托资产的资产净值；
- (3) 按照相关合同的约定，及时办理受托资产的清算、交割事宜；
- (4) 按照相关合同的约定和所适用国家、地区法律法规的规定，开设受托资产的资金账户以及证券账户；
- (5) 按照相关合同的约定，提供与受托资产业务活动有关的会计记录、交易信息；
- (6) 保存受托资产托管业务活动的记录、账册以及其他相关资料；
- (7) 其他由基金托管人委托其履行的职责。

## 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：魏艳薇

电话：（010）66190989

(3) 融通基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 501 号上海中心大厦 34 层 3405 号

邮政编码：200120

联系人：刘佳佳

联系电话：（021）38424889

(4) 融通基金管理有限公司网上直销

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

邮政编码：518053

联系人：殷洁

联系电话：（0755）26947856

2、代销机构

(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：易会满

联系人：刘秀宇

客户服务电话：95588

传真：（010）66107914

(2) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：周慕冰

联系人：高阳

客户服务电话：95599

(3) 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：彭纯

客服电话：95559

（4）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

（5）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

（6）渤海银行股份有限公司

办公地址：天津市河西区马场道 201-205 号

法定代表人：李伏安

联系人：王宏

电话：022-58316666

客服电话：4008888811

（7）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

（8）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。

（9）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

（10）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

（11）深圳诺亚正行（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

（12）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

（13）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

法定代表人：王莉

电话：0755-82721122-8625

联系人：李延鹏

客服电话：400-920-0022、021-20835588

（14）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

办公地址：上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人：张跃伟

联系人：敖玲

电话：021-58788678-8201

传真：021-58787698

客服电话：400-089-1289

（15）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](http://cifcofund.com)

（16）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

（17）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室

法人代表：罗细安

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

联系人：孙晋峰

（18）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

法定代表人：卓紘晶

联系人：王妮萍

电话：0755-33376853

客服电话：4006-877-899

（19）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号楼2楼

法定代表人：凌顺平

联系人：胡璇

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772

（20）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：北京市阜成门大街2号万通新世界广场A座2208

法定代表人：吴雪秀

联系人：段京璐

电话：010-88312599

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-1566

（21）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B座46楼06-10单元

办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、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：景琪

电话：021-20289890

传真：021-20280110

客户服务电话：400-021-8850

（22）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

办公地址：北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层

法定代表人：王兵

联系人：赵森

电话：010-59539864

传真：010-59539806

客户服务电话：95162

（23）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](http://www.xds.com.cn)

（24）上海汇付金融服务有限公司

注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19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

公司网站：www.fund.bundtrade.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）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

（27）深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

办公地址：深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人：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

（28）上海陆金所资产管理有限公司（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：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

（29）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

（30）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](http://www.ehowbuy.com)

（31）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/>

（32）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](http://www.fundzone.cn)

（33）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](http://www.qianjing.com)

（34）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](http://www.zzwealth.cn)

（35）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

(36) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

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

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

法定代表人：TAN YIK KUAN

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](http://www.ifastps.com.cn)

(37) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司（仅代销前端）

注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15

办公地址：北京市亦庄经济技术开发区科创十一街18号京东集团总部A做17层

法定代表人：陈超

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

联系人：徐伯宇

客服热线：95518

公司网站：[jr.jd.com](http://jr.jd.com)

(38) 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](http://www.tonghuafund.com)

(39) 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/](http://www.hongdianfund.com/)

（40）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](http://www.urainf.com)

（41）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.ananj.cn>

（42）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](http://www.66liantai.com)

（43）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/>

（44）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](http://www.amcfortune.com)

（45）蚂蚁（杭州）基金销售有限公司（仅代销前端）

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](http://www.fund123.cn)

（46）中证金牛（北京）投资咨询有限公司（仅代销前端）

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

（47）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/>

（48）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：400-8557333

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

（49）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）60833889

客服电话：4008895548

（50）海通证券股份有限公司

注册地址：上海广东路 689 号

法定代表人：周杰

联系人：涂洋

电话：（021）23219275

客服电话：4008888001

（51）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

法定代表人：李梅

联系人：李玉婷

电话：（021）33389888

客服电话：95523 或 4008895523

（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

法定代表人：姜晓林

联系人：孙秋月

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

（53）长城证券股份有限公司

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 层

法定代表人：丁益

联系人：李嘉禾

电话：（0755）83516289

客服电话：4006666888

（54）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

（55）恒泰证券股份有限公司

注册地址：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

（56）国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

法定代表人：徐丽峰

联系人：周欣玲

电话：（0791）86281305

客服电话：4008222111

（57）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

法定代表人：尤习贵

联系人：奚博宇

电话：（027）65799999

客服热线：400-8888-999、95579

（58）信达证券股份有限公司

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

电话：（010）63080994

客服电话：4008008899

（59）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：李晓哲

电话：（021）22169130

客服电话：95525

（60）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：杨宇翔

联系人：周一涵

电话：021-38637436

客服电话：95511 转 8

（61）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：95318，4008096518

（62）第一创业证券股份有限公司

联系地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路 12 号中民时代广场 B 座 25、26 层

法定代表人：刘学民

联系人：李晓伟

电话：（0755）25831754

客服电话：4008881888

（63）太平洋证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市青年路 389 号志远大厦 18 层

法人代表：李长伟

联系人：王婧

电话：010-88321613

客服热线：0871-68898130

（64）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：（021）33388229

客服热线：95523 或 4008895523

（65）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

（66）招商证券股份有限公司

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦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

（67）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

（68）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：4008888108

（69）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

（70）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

客服电话：4008888888

（71）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

客服电话：95538

（72）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：吴坚

联系人：周青

电话：023-63786141 客服电话：4008096096

（73）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

（74）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

(二)基金注册登记机构

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

办公地址: 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

成立日期: 2001 年 5 月 22 日

法定代表人: 高峰

电话: (0755) 26948075

联系人: 杜嘉

(三) 律师事务所

名称: 广东嘉得信律师事务所

住所: 深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

办公地址: 深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场 A 座 201

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: 075533382888 (总机) 075533033020 (直线) 15302728596

传真: 075533033086

(四) 会计师事务所

名称: 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所: 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

办公地址: 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人: 李丹

联系电话: (021) 23238888

传真: (021) 23238800

联系人: 俞伟敏

经办注册会计师: 薛竞、俞伟敏

**五、基金的名称**

融通丰利四分法证券投资基金

## 六、基金的类型

契约型开放式

## 七、基金的投资目标

通过全球化的资产配置和组合管理，有效地分散投资风险；在降低组合波动性的同时，实现基金资产的长期增值；通过投资较高分红回报的资产力求实现稳定的分红。

## 八、基金的投资方向

本基金主要投资于全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括银行存款、可转让存单、银行承兑汇票、银行票据、商业票据、回购协议、短期政府债券等货币市场工具；政府债券、公司债券、可转换债券、住房按揭支持证券、资产支持证券等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证（可简称“REITs”）；在已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构登记注册的公募基金；与固定收益、股权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；远期合约、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；以及中国证监会许可的其他金融工具。

本基金主要投资于以下四大类资产：包括美国高息债券及基金、美国能源类高分红上市公司及基金、亚太高息股票及基金、亚太房地产投资信托凭证（REITs）及基金。

本基金的投资组合比例为：

投资组合类别	投资比例	目标投资比例
美国高息债券及基金	10-40%	30%
美国能源类高分红上市公司及基金	10-40%	20%
亚太高息股票及基金	10-40%	25%
亚太房地产投资信托凭证（REITs）及基金	5-30%	20%
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	5%	5%

本基金为基金中基金，本基金投资基金的比例不低于本基金资产净值的60%。

如果法律法规或中国证监会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，可以将其纳入本基金的投资范围。

## 九、基金的投资策略

本基金具体投资策略包括资产配置策略、亚太高息股票投资策略、美国高息债券投资策略、美国能源类高分红上市公司投资策略、亚太房地产投资信托凭证（REITs）投资策略、指数型基金投资策略、金融衍生品投资策略等部分。

### 1、资产配置策略

战略资产配置层面，本基金长期大类资产配置遵循各类资产目标投资比例。

战术资产配置层面，基金管理人将根据对未来市场资产收益与风险的判断，在各类资产（亚太高息股票、美国高息债券、美国能源类高分红上市公司、亚太 REITs、现金等）目标投资比例的基础上，对各类资产配置进行调整，以优化资产结构，提高资产配置效率。基金管理人对未来市场资产收益与风险的判断主要依赖于以下分析：宏观因素、政策变化、市场估值、市场情绪等。

（1）宏观因素：分析经济整体运行中的各类宏观因素，对资产配置进行前瞻性和框架性把握，主要包括经济增长、投资与消费、对外贸易、利率与汇率、财政与货币、价格体系、流动性等诸多角度；

（2）政策变化：分析各种政策对未来各类资产价格走势可能产生的影响，主要包括经济产业政策、货币政策、财政政策等；

（3）市场估值：分析市场整体估值水平的变化，以及不同结构资产的估值变化，从横向和纵向两个角度判断资产的风险水平；

（4）市场情绪：从对市场投资者的投资情绪分析来解释资产配置，主要指标包括资金流向、成交与换手、公募基金股票比例变化、相对风险水平等。

### 2、亚太高息股票投资策略

亚太高息股票是指在亚太地区证券市场进行交易或至少 50% 的主营业务收入来自于亚太地区而在亚太以外交易所上市、持续进行分红、股息率较高、基本面良好的股票。

本基金亚太高息股票投资主要采用类指数化投资方式（包括完全复制及抽样复制方法及适当采用增强策略等），主要投资于业绩比较基准中该类资产对应的指数之成份股及其备选成份股。在该指数成份股权重基础上，根据宏观市场环境、上市公司的商业经营环境、股息率、现金流、分红派息一致性及估值研究适当调整投资股票名单及其权重。

同时本基金也可以通过投资亚太高息股票指数基金等获取亚太高息股票市场收益。

### 3、美国高息债券投资策略

高息债券，又名非投资级债券，是指标准普尔信用评级 BBB 以下企业所发行的债券。美国的三大评级公司——标普、穆迪、惠誉使用不同的字母来评定发债公司的信用等级，反映

了发债公司偿还债务的能力，违约的可能性，还有违约后本金的补偿率。BBB 级以下的债券一般被认为具有投机成份，风险比较高，支付能力不稳定。这类债券需要提供比政府债券和资本雄厚的大公司企业债更高的利息来吸引投资者。

美国高息债券是指在美国证券市场进行交易或债券发行人至少 50%的主营业务收入来自于美国而在美国以外证券市场交易的高息债券。

高息债券的发行人主要包括：

- (1) 没有达到投资级别要求的经营历史、资本规模的新成立公司，这些公司也有可能成为投资评级的大型公司；
- (2) 历史上投资评级很高，但由于一些内外因而导致投资级别降至 BBB 级以下；
- (3) 杠杆收购产生的一类主要靠发行高息债来收购的公司；
- (4) 不能通过内部融资或银行贷款满足融资需求的资本密集型公司；
- (5) 高负债公司和外国政府或外国公司。

本基金主要通过投资高息债券基金等获取高息债券市场收益。

同时，本基金美国高息债券投资也可采用类指数化投资方式（包括完全复制及抽样复制方法及适当采用增强策略等）。

指数化投资方式主要在业绩比较基准中该类资产对应的指数之成份债券及其权重基础上，参照指数久期，根据对利率趋势的判断以及收益率曲线的变动趋势适当调整组合久期，采用抽样的方法进行投资，并根据市场环境、债券息率、收益率曲线偏离度、绝对和相对价值分析、信用分析、公司研究等适当调整投资债券名单及其权重。

本基金高息债券投资部分强调对高息债券信用风险的分析，关键信用风险分析因素包括：

- (1) 所有行业共同面临的系统性宏观经济风险；
- (2) 发行人所属行业面临的特定风险；
- (3) 发行人性质及管理水平；
- (4) 发行人的行业地位及业务的稳定情况；
- (5) 发行人运营能力及具体财务状况。

#### 4、美国能源类高分红上市公司投资策略

美国能源类高分红上市公司处于能源产业链的中游，主要投资在特种行业，如石油、天然气、油田，特别是油线管道、油品运输和储存。相比普通能源类上市公司，此类上市公司不易明显受商品市场和价格波动的影响，并且具有持续性稳定的现金流收入用于分红。

本基金主要通过投资美国能源类高分红上市公司基金分享美国能源类高分红上市公司资产的长期收益。

本基金也可直接投资美国能源类高分红上市公司，投资主要采用类指数化投资方式（包括完全复制及抽样复制方法及适当采用增强策略等）。在业绩比较基准中该类资产对应的指数之成份股及其权重基础上，根据市场环境、基本面、派息率及估值研究适当调整投资股票名单及其权重。

#### 5、亚太房地产投资信托凭证（REITs）投资策略

亚太房地产投资信托凭证（REITs）是指在亚太地区证券市场进行交易或至少 50% 的主营业务收入来自于亚太地区而在亚太以外交易所上市的房地产投资信托凭证（REITs）。

本基金亚太房地产投资信托凭证投资主要采用类指数化投资方式（包括完全复制及抽样复制方法及适当采用增强策略等）。在业绩比较基准中该类资产对应的指数之成份 REITs 及其权重基础上，根据市场环境、基本面、派息率及估值研究适当调整投资 REITs 名单及其权重。

通过房地产细分行业分析以及个券分析相结合的策略优化投资组合。房地产细分行业选择是指根据对办公楼、区域性商厦、公寓住宅、度假村等地产细分行业发展趋势的预期和判断，对各细分行业的资产配置比例进行适当主动调整；个券选择是指通过房地产信托凭证所对应的基础资产的实地考察和财务分析，选择具有稳定现金流收益及长期增值潜力的个券进入组合或提高配置比例。

#### 6、指数型基金投资策略

本基金投资于指数基金的主要目标是简单、有效的实现本基金对美国高息债券、美国能源类高分红上市公司、亚太高息股票、亚太 REITs 等大类资产的配置，该类基金的选择指标主要包括：

基金管理公司：公司经营情况、公司管理该类基金的经验、管理历史以及规模等；

发行人：发行人经营情况、发行人信用风险、发行人管理该类产品的经验、管理历史及规模等；

做市商评价指标：包括做市商的基本情况、报价连续性和买卖价差，历史成交量等；

基金管理团队评价指标：投资理念、投资风格、历史业绩和稳定性等；

指数型基金评价指标：指数型基金所跟踪指数和市场的代表性；指数型基金的长期表现和跟踪效率；指数型基金的波动性和风险调整后收益及业绩归因分析等；指数型基金的年内日均成交量及流动性；指数型基金的费率等。

（1）投资标的筛选：形成指数型基金的备选投资标的池

定性分析，主要针对基金管理人、基金管理团队、发行人和做市商；

定量指标，主要针对基金投资组合。

（2）投资标的优选：形成指数型基金核心投资标的池

1) 投资标的优选

本基金分析研究人员将结合备选投资标的池中对于每只备选投资标的定性和定量分析的指标进行分析判断，并结合当前市场实际情况进行微调，最后根据计算结果对备选投资标的进行评估打分。

2) 确定核心投资标的池

根据评估打分和优选结果确定本基金投资的指数型基金核心投资标的池。

3) 构建投资组合

本基金组合将在核心投资标的池的基础之上构建投资组合。

7、金融衍生品投资策略

本基金将以投资组合避险或有效管理为目标，在基金风险承受能力许可的范围内，本着谨慎原则，适度参与衍生品投资。衍生品投资的主要策略包括：利用汇率衍生品，降低基金汇率风险；利用指数衍生品，降低基金的市场整体风险等。

本基金主要投资于在经中国证监会认可的交易所上市交易的金融衍生品，当这些交易所没有本基金需要的衍生产品时，在严格风险控制的前提下，本基金将采用场外交易市场（OTC）买卖衍生产品。

## 十、基金的业绩比较基准

巴克莱美国高收益流通总收益指数(Barclays Capital US Corporate High-Yield Very Liquid Total Return Index)×30%+ Alerian MLP 价格指数(Alerian MLP Price Index)×20%+ MSCI 亚太(除日本)高息股票净价指数(MSCI AC ASIA ex Japan High Dividend Yield Net Index)×25%+ MSCI 亚太REIT净收益指数(MSCI AC Asia Equity REITS Net Total Return Index)×20%+人民币活期存款收益率(税后)×5%。

巴克莱美国高收益流通总收益指数是由巴克莱资本公司编制，于1994年首次推出的美国高息债券指数。目前该指数在国际上被广泛采用为美国高息债券的业绩基准，具有较高的知名度和市场影响力。Alerian MLP 价格指数由Alerian公司于1995年编制发布，指数成分涵盖了最主要的美国能源类高分红上市公司，能够很好的反映美国能源类高分红上市公司的投资表现。MSCI 亚太(除日本)高息股票净价指数由MSCI公司于1998年编制发布。该指数市



场代表性较好、具备较好公信力，是国际上最常用和跟踪资产量最大的亚太高息股票指数之一。MSCI 亚太 REIT 净收益指数由 MSCI 公司于 2013 年编制发布。该指数市场代表性较好、具备较好公信力，覆盖了亚太市场上最主要的房地产信托凭证。

本基金选择的巴克莱美国高收益流通总收益指数、Alerian MLP 价格指数、MSCI 亚太（除日本）高息股票净价指数和 MSCI 亚太 REIT 净收益指数覆盖了国际市场上最主要的四类高收益资产类别。本基金业绩比较基准选取的指数及其权重与本基金的投资范围和资产配置具有较好的一致性。

如果指数编制单位变更或停止指数的编制及发布、或指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致该业绩比较基准不宜继续使用，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的业绩比较基准。

### 十一、基金的风险收益特征

本基金为基金中基金，属于中等风险中等预期收益的基金品种，其预期收益和风险高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

### 十二、基金的投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据基金合同规定，于 2018 年 8 月 29 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 2018 年 6 月 30 日（本招募说明书中的财务数据未经审计）。

#### 1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,438,928.57	19.92
	其中：普通股	3,438,928.57	19.92
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	11,029,465.64	63.88
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售	-	-

	金融资产		
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,756,777.33	15.97
8	其他资产	40,748.00	0.24
9	合计	17,265,919.54	100.00

2、报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
中国香港	3,033,827.90	18.08
美国	405,100.67	2.41
合计	3,438,928.57	20.49

3、报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	1,083,063.12	6.45
日常消费品	290,700.88	1.73
信息技术	2,065,164.57	12.31
合计	3,438,928.57	20.49

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	港交所	中国香港	5,000	1,660,063.90	9.89
2	Hang Seng Bank Ltd	恒生银行	11 HK	港交所	中国香港	4,100	678,206.50	4.04
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	BABA US	美国交易所	美国	330	405,100.67	2.41
4	AIA Group Ltd	友邦保险	1299 HK	港交所	中国香港	7,000	404,856.62	2.41
5	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒	168 HK	港交所	中国香港	8,000	290,700.88	1.73

注：本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

5、报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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。

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金融衍生品投资明细  
本基金本报告期末未持有金融衍生品。

9、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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	ISHARES 0-5 YR HY CORP BOND	ETF 基金	开放式	BlackRock Fund Advisors	1,264,710.16	7.54
2	JPMORGAN ALERIAN MLP INDEX	ETF 基金	开放式	JP Morgan Chase & Co	1,125,563.06	6.71
3	NEXT FUNDS REIT NOMURA ETF	ETF 基金	开放式	Nomura Asset Management Co	991,217.22	5.91
4	SPDR S&P/ASX 200 LISTED PROP	ETF 基金	开放式	State Street Global Advisors, Australia Services Ltd	919,194.44	5.48
5	SPDR BBG BARC ST HIGH YIELD	ETF 基金	开放式	State Street Bank and Trust Company	848,664.97	5.06
6	FIRST TRUST NORTH AMERICAN E	ETF 基金	开放式	First Trust Portfolios LP	814,278.50	4.85
7	PROSHARES ULTRA QQQ	ETF 基金	开放式	ProShares Trust	743,692.61	4.43
8	DIREXION DAILY FTSE CHINA BE	ETF 基金	开放式	DIREXION DAILY CHINA BULL 3X	677,367.81	4.04
9	POWERSHARES SENIOR LOAN	ETF 基金	开放式	Invesco PowerShares Capital Mgmt Ltd	606,080.56	3.61
10	DRXN D CSI CH A-SHR BEAR 1X	ETF 基金	开放式	Direxion Shares ETF Trust	560,845.78	3.34

10、投资组合报告附注

10.1 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。

10.2 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。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	39,514.54
4	应收利息	30.77
5	应收申购款	1,202.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,748.00

#### 10.4 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。

#### 10.5 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。

本基金合同生效日为2013年2月5日，基金业绩截止日为2018年6月30日。

自基金合同生效以来，本基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较如下：

阶段	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
2013年度	-2.90%	0.37%	-2.95%	0.47%	0.05%	-0.10%
2014年度	1.96%	0.48%	3.70%	0.39%	-1.74%	0.09%
2015年度	-16.87%	1.01%	-10.37%	0.77%	-6.50%	0.24%
2016年度	0.36%	0.48%	17.19%	0.70%	-16.83%	-0.22%
2017年度	7.75%	0.57%	1.70%	0.34%	6.05%	0.23%
2018年半年度	-8.09%	1.08%	-0.01%	0.49%	-8.08%	0.59%

注：同期业绩比较基准以人民币计价。

### 十四、费用概览

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金的管理费；
- 2、基金的托管费；
- 3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金的证券交易费用及在境外市场的交易、清算、登记等实际发生的费用（out-of-

pocket fees)；

5、基金份额持有人大会费用；

6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费，税务顾问费等根据有关法律、法规、《基金合同》或相应协议的规定，由基金管理人按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用；

7、基金依照有关法律、法规应当缴纳的，购买或处置证券有关的任何税收、征费、关税、印花税、交易及其他税收及预扣提税（以及与前述各项有关的任何利息及费用）（简称“税收”）；

8、代表基金投票或其他与基金投资活动有关的费用；

9、基金的银行汇划费用；

10、与基金有关的诉讼、追索费用；

11、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

## （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

### 1、基金的管理费

基金的管理费包含基金管理人的管理费和境外投资顾问的投资顾问费两部分，其中境外投资顾问的投资顾问费在境外投资顾问与基金管理人签订的《顾问协议》中进行约定。

本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.8% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.8\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，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、基金的托管费

本基金托管费自基金合同生效日起，按如下方法进行计提。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.35% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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3-11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或摊入当期费用，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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率和基金托管费率，须召开基金份额持有人大会审议，除非基金合同、相关法律法规或监管机构另有规定；调低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2个工作日在指定报刊和网站等媒介上公告，并在公告日分别报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

## 十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》以及《融通丰利四分法证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人于2018年3月19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”部分明确了更新招募说明书所载内容和有关财务数据的截止日期；
- 2、在“第一部分 绪言”部分，补充了招募说明书的编制依据；
- 3、在“第二部分释义”部分，根据《流动性风险管理规定》补充了相关释义；

4、在“第四部分 基金的投资”，根据《流动性风险管理规定》第18条规定更新了投资范围；根据《流动性风险管理规定》第15-18条规定更新了投资限制；更新了“十四、基金的投资组合报告”的内容，更新数据为本基金2018年第2季度报告中的投资组合数据；

5、在“第五部分 基金管理人”，根据最新的资料进行了更新；

6、在“第六部分 境外投资顾问”，根据最新的资料进行了更新；

7、在“第九部分 基金份额的申购与赎回”部分，根据《流动性风险管理规定》的第19条、第21条、第23条、第24条等规定补充更新了“申购和赎回的数量限制”、“申购和赎回的价格、费用及其用途”、“拒绝或暂停申购的情形”、“暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形”及“巨额赎回的情形及处理方式”等相关的内容及条款；

8、在“第十一部分 基金的业绩”，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；

9、在“第十三部分 基金资产的估值”部分，根据《流动性风险管理规定》第24条规定补充更新了暂停估值的情形；

10、在“第十八部分 基金托管人”，对基金境内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；

11、在“第十九部分 境外托管人”，根据最新的资料进行了更新；

12、在“第二十部分 相关服务机构”部分，更新了直销机构、代销机构及会计师事务所的相关信息；

13、在“第二十四部分 其他应披露事项”，对自上次招募说明书截止日以来与本基金相关的基金公告进行了列表说明。

14、在“第十六部分 基金的信息披露”部分，根据《流动性风险管理规定》第26-27条规定补充更新了公开披露的基金信息和临时报告等相关内容；

15、在“第二十一部分 基金合同的内容摘要”部分，根据最新的基金合同修订了相关内容；

16、在“第二十二部分 基金托管协议的内容摘要”部分，根据最新的基金托管协议修订了相关托管协议内容。

17、更新了“第二十四部分 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。

二〇一八年九月十九日