# 融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017年第2号)

**重要提示**

融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2015年6月2日证监许可[2015]1089号文准予注册募集。本基金基金合同于2015年6月15日正式生效。

投资有风险,投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、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更新招募说明书编写,并经中国证监会准予注册募集。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。

本招募说明书所载内容截止日为2017年6月14日,有关财务数据截止日为2017年3月31日,净值表现截止日为2016年12月31日(财务数据未经审计)。

**一、基金合同生效日期**

2015年6月15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

注册地址: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。

董事马金声先生,高级经济师,现任新时代证券股份有限公司名誉董事长。历任中国人民银行沙公厅副主任、主任,金银管理司司长,中国农业发展银行副行长,国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长,华林证券有限责任公司党委书记。2007年1月至今,任公司董事。

董事黄庆华先生,工科学士,现任上海宜利实业有限公司总裁助理兼投资管理部总经理。历任上海宜利实业有限公司投资管理部经理助理、新时代证券股份有限公司经纪事业部综合管理处主管。2015年2月至今,任公司董事。

董事David Semaya(薛迈雅)先生,教育学硕士,现任日兴资产管理有限公司执行董事长,三井住友信托银行有限公司顾问。历任日本美林副总,纽约美林总监,美林投资管理有限公司首席运营官、代表董事和副总、代表董事和主席,巴克莱全球投资者日本信托银行有限公司总裁及首席执行官,巴克莱全球投资者(英国)首席执行官,巴克莱集团、财富管理(英国)董事及总经理。2015年6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。

副总经理刘晓玲女士,金融学学士。历任博时基金管理有限公司零售业务部渠道总监,富国基金管理有限公司零售业务部负责人,泰康资产管理有限责任公司公募事业部市场总监。2015年9月起至今,任公司副总经理。

督察长徐卫东先生,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

张一格先生,中国人民银行研究生部经济学硕士、南开大学法学学士,美国特许金融分析师(CFA)。10年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司固定收益部总经理。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券等基金的基金经理。2015年6月加入融通基金管理有限公司,现任融通易支付货币、融通通盈保本、融通增裕债券、融通增祥债券、融通增丰债券、融通通瑞债券、融通通优债券、融通月月添利定期开放债券、融通通景灵活配置混合、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通通怡债券基金的基金经理。

余志勇先生,武汉大学金融学硕士、工商管理学学士,16年证券投资从业经历,具有证券从业资格,现任融通基金管理有限公司研究部副总监。历任湖北省农业厅研究员、闽发证券公司研究员、招商证券股份有限公司研究发展中心研究员。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、行业组长,现任融通通泽灵活配置混合、融通通泰保本、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通增裕债券、融通增丰债券、融通通景灵活配置混合、融通通尚灵活配置混合、融通通润债券、融通通颐定期开放债券基金的基金经理。

(2)历任基金经理情况

自2015年6月15日起至2016年9月21日,由余志勇先生担任本基金的基金经理。

自2016年9月22日起至今,由余志勇先生和张一格先生共同担任本基金的基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司公募基金投资决策委员会成员:投资总监商小虎先生,权益投资负责人、基金经理邹曦先生,研究部副总监、基金经理余志勇先生,研究部总监助理、基金经理付伟琦先生,基金经理张延闽先生。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

**三、基金托管人**

(一)基金托管人基本情况

名称:渤海银行股份有限公司(简称“渤海银行”)

住所:天津市河东区海河东路218号

办公地址:天津市河东区海河东路218号

法定代表人:李伏安

成立时间:2005年12月30日

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币捌拾亿元整

存续期间:持续经营

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监许可[2010]893 号

联系人:阮劲松

联系电话:010-66270109

渤海银行是1996年至今国务院批准新设立的唯一一家全国性股份制商业银行,是第一家在发起设立阶段就引进境外战略投资者的中资商业银行,是第一家总部设在天津的全国性股份制商业银行。

渤海银行由天津泰达投资控股有限公司、渤打银行(香港)有限公司、中国远洋运输(集团)总公司、国家开发投资公司、宝钢集团有限公司、天津信托有限责任公司和天津商汇投资控股)有限公司等7家股东发起设立。2005年12月30日成立,2006年2月正式对外营业。

渤海银行在发展规划中确定了成为“最佳体验现代财资管家”的长远发展愿景,明确了以客户为中心,通过特色化、综合化、数字化、国际化四大抓手,建立人才、科技、财务、风险和机制五大保障,持续推动转型的战略定位,树立了“客户为先、开放创新、协作有为、人本关爱”的企业核心价值观。自成立以来,在制度、管理、商业模式和科技平台创新上进行了不懈地探索,实现了资本、风险和效益的协同发展,保持了包括规模、利润等成长性指标和风险控制指标的同业领先水平。

2016年,渤海银行资产总额达到8561.20亿元,较年初增长12.02%;实现营业收入218.65亿元,同比增长18.32%;实现净利润64.73亿元,同比增长13.80%。截至2017年3月末,渤海银行已在全国设立了24家一级分行、22家二级分行、122家支行、85家社区小微支行,并在香港设立了代表处。下辖分支机构网点总数达到254家,网点布局覆盖了环渤海、长三角、珠三角及中西部地区的重点城市。

2016年,在英国《银行家》杂志公布的“全球银行1000强”排名中,渤海银行综合排名逐年大幅提升,从2009年的603位,提升至202位;亚洲银行综合竞争力排名第50位。在《金融时报》主办的“中国金融机构金牌榜·金龙奖”评选中,荣获“年度十佳互联网金融创新机构”奖,以及在《中国经营报》、《21世纪经济报道》、《每日经济新闻》等组织的一系列评选活动中,先后获得“卓越竞争力个人贷款业务银行”、“卓越金融市场业务银行”、“卓越资金存托管银行”等多项殊荣。

2、主要人员情况

付钢先生,渤海银行行长。曾任辽宁省锦州市财贸办财金处处长,辽宁省锦州经济技术开发区管委会党委委员、副主任,交通银行锦州分行副行长,交通银行营口分行党委书记、行长,交通银行福州分行党委书记、行长,交通银行天津市分行党委书记、行长。2015年2月起任渤海银行股份有限公司党委副书记、行长。

王锦虹先生,渤海银行副行长,分管托管业务。曾任深圳发展银行天津分行行长助理、副行长;历任本行国有和大型企业部总经理,天津分行行长兼滨海新区分行书记、行长,总行行长助理兼天津分行、滨海新区分行党委书记、行长。2014年2月起任渤海银行副行长。

赵亚萍女士,渤海银行托管业务部总经理,30余年金融从业经历,具有丰富的托管业务管理经验,曾任中国农业银行信托投资公司信贷员、部门副经理、部门经理,中国农业银行基金托管部资金清算处处长、核算处兼市场处处长,天弘基金管理有限公司副总经理,2007年起任渤海银行托管业务部总经理。

渤海银行总行设托管业务部,下设市场营销、产品及业务推动、托管运作、稽核监督、需求与运维、基金业务外包服务六个团队,配备有人员60余人。部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格,高管人员和团队负责人均具备研究生以上学历。

3、基金托管业务经营情况

渤海银行于2010年6月29日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务,2011年5月3日获得中国保监会核准开办保险资金托管业务。渤海银行始终秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,严格履行资产托管人职责,为投资者和金融资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,并依据不同客户的需求,提供个性化的托管服务和增值服务,获得了合作伙伴一致好评。

目前,渤海银行托管业务已涵盖信托计划保管、商业银行理财产品托管、证券投资基金托管、基金管理公司特定客户资产管理托管、证券公司客户资产管理托管、私募投资基金托管、保险资金托管、客户资金托管、互联网金融托管等业务品种。

**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机构理财部机构销售及服务深圳小组

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机构理财部机构销售及服务北京小组

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座1241-1243单元

邮政编码:100140

联系人:魏艳薇

电话:(010)66190989

(3)融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务上海小组

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)国泰君安证券股份有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号

法定代表人:杨德红

联系人:钟伟镇

电话:(021)62580818

客服热线:400-8888-666

(2)中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座

法定代表人:王东明

联系人:周雪晴

电话:(010)60838995

客服热线:400-8895-548

(3)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:田德军

联系人:田芳芳

电话:(010)83561146

客服热线:400-6989-898

(4)华安证券股份有限公司

注册地址:合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人:李工

联系人:樊忠亚

电话:(0551)65161821

客服电话:95318、4008096518

(5)第一创业证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法定代表人:刘学民

联系人:李若辰

电话:(0755)25831754

客服热线:4008881888

(6)中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法人代表:杨宝林

联系人:孙秋月

电话:(0532)85023924

客服电话:95548

(7)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:马燉

电话:010-88321613

客服电话:0871-68898130

(8)申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人:李梅

联系人:李玉婷

电话:(021)33389888

(9)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:李季

联系人:李巍

电话:010-88085858

(10)上海证券有限责任公司

注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人:黄德雄

联系人:邵珍珍

电话:021-53686262

客户服务电话:4008-918-918

(11)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:许曼华

电话:021-20315255

客户服务电话:95538

(12)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

电话:(010)63080994

客户服务电话:400-800-8899

(13)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:胡运钊

联系人:奚博宇

电话:(021)68751860

客服电话:95579或4008-888-999

(14)东北证券股份有限公司

注册地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:杨树财

联系人:安岩岩

电话:(0431)85096517

客户服务电话:4006000686

(15)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:马秋雄

联系人:周欣玲

电话:(0791)86283080

客服电话:4008222211

(16)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)85130336

客服电话:400-888-8108

(17)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:陈有安

电话:(010)66568450

联系人:辛国政

客服热线:400-8888-888

(18)光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号3楼

法定代表人:薛峰

联系人:李晓转

电话:(021)22169081

客服热线:400-8888-788、10108998、95525

(19)西南证券股份有限公司

注册地址:重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人:余维佳

电话:023-63786141

联系人:周青

客服电话:4008096096

(20)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

(21)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:尚瑾

客服电话:4008188866

(22)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

联系人:汤征程

开放式基金咨询电话:021-962888

网址:www.bankofshanghai.com

(23)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

(24)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:邱颖

电话:0574-87050397

(25)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。

(26)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

(27)上海天天基金销售有限公司

注册地址:上海市浦东新区蛱山路613号6楼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

(28)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:吕慧

电话:(021)58788678

(29)北京展恒基金销售有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号

法定代表人:闫振杰

联系人:王婉秋

电话:010-62020088

客服电话:400-888-6661

(30)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

(31)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:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702室

法定代表人:吴雪秀

传真:010-88312885

联系人:宗昊

客服电话:400-0011-566

公司网站:www.fund.bundtrade.com

(32)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

(33)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

公司网站:www.lufunds.com

(34)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

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/

(35)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

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:张裕

客服热线:400-821-5399

公司网站:www.noah-fund.com

(36)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

(37)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

法定代表人:凌顺平

电话:0571-88911818

传真:0571-86800423

联系人:吴强

客服热线:4008-773-772

公司网站:www.5ifund.com

(38)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

电话:021-50583533

传真:021-50583633

联系人:曹怡晨

客服热线:400-067-6266

公司网站:http://a.leadfund.com.cn/

(39)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

(40)珠海益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

电话:020-89629099

传真:020-89629011

联系人:黄敏晴

客服热线:020-89629066

公司网站:www.yingmi.cn

(41)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道航天科技广场A座17楼1704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.dfustps.com.cn

(42)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:柴云波

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

(43)北京汇成基金销售有限公司

地址:北京市海淀区中关村e世界A座1108室

法人代表人:王伟刚

联系人:丁向坤

北京汇成客户服务电话:400-619-9059 ;

网址:www.fundzone.cn

(44)上海中正达广投资管理有限公司

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

(45)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

(46)天津国美基金销售有限公司

注册地址:天津经济技术开发区第一大街79号MSDC1-28层2801

办公地址:北京市朝阳区菅云路26号鹏润大厦B座9层

法定代表人:丁东华

电话:010-59287984

传真:010-59287825

联系人:郭宝宪?

客服热线:400-111-0889

网址:www.gomefund.com

(47)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/

(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)律师事务所

名称:广东嘉得信律师事务所

注册地址: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:鲍泽飞

经办律师:闵齐双 鲍泽飞

电话:075533382888(总机) 075533033096(直线) 13480989076

传真:075533033086

(四)会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所有限公司(特殊普通合伙)

注册地址: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(邮编:200021)

邮编:200120

法人代表:杨绍信

联系人:俞伟敏

电话:021-23238888

传真:021-23238800

经办注册会计师:陈玲、俞伟敏

**五、基金的名称**

融通通鑫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**

在严格控制风险的前提下,投资于优质上市公司,并结合积极的大类资产配置,谋求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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、股指期货、权证等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)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)。

基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的0%-95%,其余资产投资于债券、货币市场工具、资产支持证券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;基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;在扣除股指期货部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的比例合计不低于基金资产净值的5%。

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。

**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。

2、股票投资策略

本基金结合定量和定性分析,通过对上市公司基本面状况分析,财务分析和股票估值分析的三层分析来逐级优选股票,在确定优质备选行业的基础上,发掘技术领先、竞争壁垒明显、具有长期可持续增长模式并且估值水平相对合理的优质上市公司进行组合式投资。

(1)上市公司基本面状况分析

具体分析而言,行业地位方面,选择在产业链上有稳固地位,行业壁垒高的上市公司;技术研发方面,通过对公司产品和研发团队的判断,选择有竞争优势,符合具备创新技术的公司;公司治理结构方面,选择管理层优秀,公司治理结构规范,有清晰的竞争战略,人员激励到位的公司。

(2)上市公司财务状况分析

本基金的财务分析偏重于公司的成长性分析。本基金通过对财务报告提供的信息,系统性的分析企业的经营情况,重点关注上市公司的盈利能力、经营效率、业务成长能力、持续经营能力、资金杠杆水平以及现金流管理水平,对公司做出综合分析和评价,预测公司未来的盈利能力,挑选出有优良财务状况的上市公司投资。

(3)上市公司股票估值分析

本基金将采用多种指标对股票进行估值分析。包括盈利性指标(市盈率、市销率等)、增长性指标(销售收入增长率、净利润增长率等)以及其他指标对公司股票进行多方面的评估。本基金同时将公司市值与行业竞争对手、未来市场成长空间进行多维度对比。基于以上的综合评估,确定本基金的重点备选投资对象,从中选择最具有投资吸引力的股票构建投资组合。

3、债券投资策略

在债券投资上,我们贯彻“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。在对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)中小企业私募债投资策略

中小企业私募债券是在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券。由于其非公开性及条款可协商性,普遍具有较高收益。本基金将深入研究发行人资信及公司运营情况,合理合规合格地进行中小企业私募债券投资。本基金在投资过程中密切监控债券信用等级或发行人信用等级变化情况,尽力规避风险,并获取超额收益。

(5)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。

4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具,其投资原则为优化基金资产的风险收益特征。本基金将在权证理论定价模型的基础上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

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)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)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,属于中等预期收益和预期风险水平的投资品种。

**十二、基金投资组合报告**

本基金托管人渤海银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年7月6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2017年3月31日。本报告中所列财务数据未经审计。

1.1 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 | 124,765,648.27 | 9.71 |
| | 其中:股票 | 124,765,648.27 | 9.71 |
| 2 | 基金投资 | – | – |
| 3 | 固定收益投资 | 1,140,055,458.90 | 88.70 |
| | 其中:债券 | 1,140,055,458.90 | 88.70 |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 4 | 贵金属投资 | – | – |
| 5 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 6 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 6,191,890.88 | 0.48 |
| 8 | 其他资产 | 14,282,325.70 | 1.11 |
| 9 | 合计 | 1,285,295,323.75 | 100.00 |

1.2 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 | 6,572,000.00 | 0.51 |
| B | 采矿业 | – | – |
| C | 制造业 | 68,402,516.34 | 5.33 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 9,172,253.30 | 0.71 |
| F | 批发和零售业 | 130,984.00 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 10,474,967.56 | 0.82 |
| H | 住宿和餐饮业 | – | – |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,979,996.91 | 0.31 |
| J | 金融业 | – | – |
| K | 房地产业 | – | – |
| L | 租赁和商务服务业 | 4,366,000.00 | 0.34 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 9,176,930.16 | 0.71 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 12,490,000.00 | 0.97 |
| 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 | 124,765,648.27 | 9.72 |

1.3 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 | 600201 | 生物股份 | 299,950 | 10,162,306.00 | 0.79 |
| 2 | 600803 | 新奥股份 | 699,953 | 10,114,320.85 | 0.79 |
| 3 | 603609 | 禾丰牧业 | 802,950 | 9,667,518.00 | 0.75 |
| 4 | 300284 | 苏交科 | 500,000 | 9,160,000.00 | 0.71 |
| 5 | 600496 | 精工钢构 | 1,999,960 | 8,959,820.80 | 0.70 |
| 6 | 000069 | 华侨城A | 1,000,000 | 7,300,000.00 | 0.57 |
| 7 | 300498 | 温氏股份 | 200,000 | 6,572,000.00 | 0.51 |
| 8 | 002570 | 贝因美 | 500,000 | 6,485,000.00 | 0.51 |
| 9 | 601919 | 中远海控 | 1,000,000 | 5,910,000.00 | 0.46 |
| 10 | 002008 | 大族激光 | 219,945 | 5,777,955.15 | 0.45 |

1.4 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 | 97,965,000.00 | 7.63 |
| | 其中:政策性金融债 | 97,965,000.00 | 7.63 |
| 4 | 企业债券 | 122,308,458.90 | 9.53 |
| 5 | 企业短期融资券 | 623,533,500.00 | 48.58 |
| 6 | 中期票据 | 161,425,500.00 | 12.58 |
| 