融通丰利四分法证券投资基金更新招募说明书摘要

（2015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

二〇一五年九月

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。本基金基金合同于2013年2月5日正式生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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，投资者申购本基金时应认真阅读本招募说明书。

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。

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，因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2015年8月4日，有关财务数据截止日为2015年6月30日（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

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：0755-26948070

联系人：刘宏

目前公司股东及出资比例为：新时代证券有限责任公司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。

独立董事杜键女士，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，现任新时代证券有限责任公司名誉董事长。历任中国人民银行办公厅副主任、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顾问有限公司

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：刘汝军

联络人：卢珊

电话：（010）83561072

客服电话：400698989

17、恒泰证券有限责任公司

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：魏巍

电话：（0471）4974437

客服电话：（0471）4961259

18、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：曾小普

联系人：陈明

电话：（0791）86281305

客服电话：4008222111

19、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：王利

电话：0755-82721122-8625

联系人：李炫鹏

客服电话：400-920-0022、021-20835588

20、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

21、中期时代基金销售(北京)有限公司

注册地址：北京市朝阳区建国门外光华路16 号1 幢11 层

法人代表：路瑶

电话：400-8888-160

传真：010-59539866

联系人：朱剑林

客服电话：95162、4008888160

22、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

23、长江证券股份有限公司

联系地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：杨泽柱

联系人：李良

电话：（027）65799999

客服热线：400-8888-999、95579

24、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：鹿馨力

电话：（010）63080994

客服电话：4008008899

25、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

法定代表人：薛峰

联系人：丁梅

电话：（021）22169130

客服电话：95525

26、平安证券有限责任公司

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：吴辰

电话：（0755）22621866

客服电话：95511转9

27、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：96518

28、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：毛诗莉

电话：（0755）25831754

客服电话：4008881888

29、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 号建成大厦1208 室

法人代表：罗增安

电话：010-67000988

传真：010-67000988-6000

联系人：孙晋峰

30、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 皇岗商务中心主楼4F（07）单元

法定代表人：卓喆晶

联系人：王斌萍

电话：0755-33376853

客服电话：4006-877-899

31、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：王翔秋

电话：010-62020088

客服电话：400-888-6661

32、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：胡陨

电话：0571-88911818

传真：0571-86800423

客户服务电话：4008-773-772

33、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：010-88312959

传真：010-88312099

客户服务电话：400-001-156634、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

35、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

36、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：谢兰

电话：010-88321613

客服热线：0871-68898130

37、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：许建平

电话：010-88088888

传真：010-88085195

联系人：李巍

客户服务电话：400-800-0562

38、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

电话：010-85679888-60357

联系人：秦朗

客服电话：4009101166

39、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：宫少林

联系人：黄婵君

电话：（0755）82960167

客服电话：95565

40、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

电话：028-86650057

联系人：刘浩隆

客服电话：4006-600109

41、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：4008888108

42、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

电话：0755-82791065

传真：员川

客服热线：4009908826

43、厦门市鑫鼎盛控股有限公司

办公地址：厦门市思明区莲江道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

44、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

45、上海利得基金销售有限公司

公司地址：上海市浦东新区东方路989号中达大厦2楼

联系电话：021-50583533

传真：86-021-50583633

客服热线：4000676266

公司网站：www.leadfund.com.cn

二、基金注册登记机构

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

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

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：尹小胜

经办律师：闵齐双　刘少华　尹小胜　崔卫群

电话：0755333382888（总机）　075533303020（直线）15302728596

传真：0755333033086

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）

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址：上海市湖滨路202 号普华永道中心11 楼（邮编：200021）

法人代表：杨绍信

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：汪建、刘莉

经办注册会计师：汪建、王灵

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：包括关国高息债券及基金、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%
现金或者剩期日在一年以内的政府债券	5%	5%

本基金为基金中基金(FOF)，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据：

（1）宏观因素：分析经济整体运行状况、宏观因素、政策变化、市场估值、市场情绪等。

（2）政策因素：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），主要投资于金融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级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。这类债券需要投机比较政治债券和资本趋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，这些公司由于能成为投资级评级的大型公司；

（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、地对和相对价值分析、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策略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，主要投资在转种行业，如石油、天然气、油田、特别是油纯管道、油品运输和储存。相比普通能源类上市公司，此类上市公司不易受宏观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。

通过房地产部分行业分析以及个券分析相结合的策略优化投资组合。房地产部分行业选择是指根据对办公楼、区域性商厦、公寓住宅、度假村等地产部分行业发展趋势的预期和判断，对各部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回归分析等；指数型基金的年内日均或交量及流动性；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

本基金业绩比较基准为：

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）高息股票价格指数（MSCI AC Asia Pacific ex Japan High Dividend Yield Price Index）×25%+ MSCI亚太REIT价格指数（MSCI AC Asia Pacific IMI REIT Price 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）高息股票价格指数由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最最大的亚太高息股票指数之一。MSCI亚太REIT价格指数由MSCI公司于2007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）高息股票价格指数和MSCI亚太REIT价格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、或指数出其他指数替代、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本基金合同规定，于2015年8月20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2016年6月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,979,759.27	22.43
	其中：普通股	7,979,759.27	22.43
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	21,117,267.34	59.35
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	3,584,092.21	10.07
8	其他资产	2,902,421.14	8.16
9	合计	35,583,539.96	100.00

2、期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位:人民币元

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
香港	7,979,759.27	22.99
合计	7,979,759.27	22.99

3、期末按行业分类的权益投资组合

金额单位:人民币元

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	5,488,213.01	15.81
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	1,792,364.63	5.16
电信服务	699,181.63	2.01
公用事业	-	-
合计	7,979,759.27	22.99

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权益投资明细

金额单位:人民币元

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	CHINA LIFE INSURANCE CO-H	中国人寿	2628 HK	港交所	中国香港	35,000	931,545.56	2.68
2	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	700 HK	港交所	中国香港	6,000	731,987.80	2.11
3	ALIBABA HEALTH INFORMATION T	阿里健康	241 HK	港交所	中国香港	110,000	699,181.63	2.01
4	NEW CHINA LIFE INSURANCE C-H	新华保险	1336 HK	港交所	中国香港	19,000	693,740.22	2.00
5	VALUE PARTNERS GROUP LTD	惠理集团	806 HK	港交所	中国香港	70,000	675,681.05	1.95
6	KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR	金蝶国际	268 HK	港交所	中国香港	170,000	619,374.29	1.78
7	PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP C-H	中国人民保险集团	1339 HK	港交所	中国香港	140,000	547,610.78	1.58
8	LEGEND HOLDINGS CORP-H	联想控股股份有限公司	3396 HK	港交所	中国香港	12,900	441,002.54	1.27
9	BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	中银香港	2388 HK	港交所	中国香港	17,000	433,025.75	1.25
10	AGRICULTURAL BANK OF CHINA-H	农业银行	1288 HK	港交所	中国香港	130,000	427,505.48	1.23

注:本基金所用证券代码均采用当地市场代码。

5、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末持有债券。

6、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末持有债券。

7、按在报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末持有资产支持证券。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末持有金融衍生品。

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	HANG SENG H-SHARE INDEX ETF	ETF	开放式	Hang Seng Investment Management Ltd	4,056,688.70	11.69
2	SPDR BARCLAYS SHORT-TERM HIG	ETF	开放式	State Street Bank and Trust Company	3,764,650.95	10.85
3	JPMORGAN ALERIAN MLP INDEX	ETN	开放式	JP Morgan Chase&Co	2,493,615.17	7.19
4	DIREXION DAILY FTSE CHINA BU	ETF	开放式	DirexionShares	2,332,313.95	6.72
5	X-LINKS CUSHING MLP INFRASTR	ETN	开放式	Credit Suisse	1,887,194.96	5.44
6	CHINAAMC CSI 300 IDX ETF-HKD	ETF	开放式	China Asset Management(Hong Kong)	1,465,158.52	4.22
7	ISHARES FTSE A50 CHINA INDEX	ETF	开放式	BlackRock Asset Management North Asi	1,229,206.41	3.54
8	SPDR S&P/ASX 200 LISTED PROP	ETF	开放式	State Street Global Advisors	1,059,311.97	3.05
9	NEXT FUNDS REIT NOMURA ETF	ETF	开放式	Nomura Asset Mnagement Co.	988,797.28	2.85
10	DEUTSCHE X-TRACKERS HARVEST	ETF	开放式	Deutsche Bank	843,860.21	2.43

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	2,789,810.82
3	应收股利	109,857.23
4	应收利息	406.72
5	应收申购款	2,346.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,902,421.14

10.4 本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 本报告期末前十名股票中在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资部分前十名股票中不存在流通受限情况。

十三、基金的业绩

基金管理人承诺按照勤勉尽职守、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。

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2月5日至2013年12月31日	-2.90%	0.37%	-2.95%	0.47%	0.05%	-0.10%
2014年1月1日至2014年12月31日	1.96%	0.48%	3.70%	0.39%	-1.74%	0.09%
2015年1月1日至2015年6月30日	-3.74%	1.03%	-2.41%	0.46%	-1.33%	0.57%

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、基金的证券交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、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1.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×1.8%÷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0.35%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.35%÷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—8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）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、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率，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21日在至少一种指定媒体上公告。

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》、《销售管理办法》、《运作管理办法》、《信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求、对本基金管理人于2014年3月21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“第四部分 基金的投资”，更新了“基金投资组合报告”的内容，更新数据为本基金2015年第2季度报告中的投资组合数据；

2、在“第五部分 基金管理人”，根据最新管理人资料进行了更新；

3、在“第六部分 境外投资顾问”，对境外投资顾问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；

4、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；

5、在“第十八部分 基金托管人”，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；

6、在“第十九部分 境外托管人”，对基金境外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；

7、在“第二十部分 相关服务机构”，按最新资料更新了销售机构和基金注册登记机构资料；

8、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。

融通基金管理有限公司
二〇一五年九月十八日

证券简称：铜陵有色　证券代码：000630　公告编号：2015－068

铜陵有色金属集团股份有限公司关于召开2015年第五次临时股东大会的提示性公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容的真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

铜陵有色金属集团股份有限公司（以下简称“公司”）七届十八次董事会审议通过了《公司关于召开2015年第五次临时股东大会的议案》，并于2015年9月8日在《中国证券报》、《证券时报》及巨潮资讯网上刊登了《公司关于召开2015年第五次临时股东大会的通知》。由于本次临时股东大会将通过深圳证券交易所交易系统向社会公众股股东提供网络形式的投票平台，根据中国证监会《关于加强社会公众股股东权益保护的若干规定》和深圳证券交易所《信息披露业务备忘录第7号——股东大会》及《上市公司股东大会规则（2014 年修订）》的相关规定，现发布关于公司召开2015年第五次临时股东大会的提示性公告，有关事项通知如下：

（一）召开会议的基本情况

1、召集人：铜陵有色金属集团股份有限公司董事会。

2、本次会议的召开时间：

现场会议召开时间为：2015年9月23日下午14：30。

网络投票时间为：通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为：2015年9月23日上午9：30—11：30，下午13：00—15：00；通过深圳证券交易所互联网投票系统投票的具体时间为：2015年9月22日15：00至2015年9月23日15：00期间的任意时间。

3、现场会议召开地点：安徽省铜陵市长江西路有色大院西楼公司办公楼三楼大会议室

4、股权登记日：2015年9月17日

5、会议方式：本次临时股东大会采取现场投票和网络投票相结合的方式。公司将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统（http://www.cninfo.com.cn）向流通股股东提供网络形式的投票平台，股东可以在网络投票时间内通过上述系统行使表决权。

6、参加会议的方式：同一表决权只能选择现场、网络或其他表决方式中的一种。同一表决权出现重复表决的以