财通景利纯债债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2020年6月13日公告）

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:徽商银行股份有限公司

重要提示

本基金经2019年1月14日中国证券监督管理委员会证监许可【2019】74号文准予注册募集。本基金基金合同于2019年07月19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。本基金为债券型基金,预期风险与预期收益高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金,属于中低风险、中低收益的基金产品。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。

基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》实施之日起一年后开始执行。

本基金本次更新招募说明书系为2020年度定期更新。

本招募说明书所载内容截止日为2020年5月8日,有关财务数据截止日为2020年3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:夏理芬
组织形式:有限责任公司
注册资本:人民币贰亿元
联系人:何亚玲
联系电话:021-2053 7888
股权结构:

股东	出资额（万元人民币）	出资比例（%）
财通证券股份有限公司	8,000	40
杭州市实业投资集团有限公司	6,000	30
浙江瀚叶股份有限公司	6,000	30
合计	20,000	100

(二)主要人员情况

1、董事会成员:

夏理芬先生,董事长,工商管理硕士。历任浙江省国际信托投资公司义乌证券交易营业部经理、西湖证券营业部总经理,金通证券股份有限公司总裁办公室主任、运营管理部总经理,中信金通证券有限责任公司运营管理部总经理、总经理助理、合规总监,中信证券(浙江)公司合规总监、执行总经理兼江西分公司总经理,中信证券股份有限公司江西分公司总经理,财通证券股份有限公司首席风险官、总经理助理兼首席风险官。现任财通证券股份有限公司党委委员、副总经理兼首席风险官,财通基金管理有限公司党委书记、董事长,财通证券(香港)有限公司董事,财通证券资产管理有限公司董事。浙江证券业协会合规风控专业委员会主任委员、中国证券业协会风险管理委员会委员。

王家俊先生,董事,总经理,工商管理硕士(EMBA)。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、党委副书记、董事,上海财通资产管理有限公司董事长。

陈可先生,董事,注册会计师、税务师。历任杭州市下城区国有投资控股有限公司财务部经理、董事;杭州市实业投资集团有限公司财务部部长助理、副部长,财务管理部(财务总监管理办公室)部长(主任),现任杭州市实业投资集团有限公司风险管理部(法律事务部)部长兼任杭华油墨股份有限公司董事、财通基金管理有限公司董事。

唐静波女士,工商管理硕士(EMBA)。历任诺亚(中国)财富管理中心市场总监,上海中和至成投资咨询有限公司董事长、总经理,青岛易邦生物工程有限公司董事,上海瀚叶财富管理顾问有限公司副总裁;现任浙江瀚叶股份有限公司董事、副总裁,西藏观复投资有限公司执行董事兼总经理,德清瀚叶科创文化园产业管理有限公司监事、上海雍贯投资管理有限公司董事、财通基金管理有限公司董事。

王开国先生,独立董事,经济学博士,高级经济师。历任国家国有资产管理局科研所应用室副主任、政策法规司政策研究处处长、科研所副所长;海通证券有限公司副总经理,党组书记、总经理,党组书记、董事长兼总经理,党委书记、董事长兼总经理,党委书记、董事长。现任上海中平国瑀资产管理有限公司董事长,兼任财通基金管理有限公司独立董事,上海大众公用事业(集团)股份有限公司独立董事、上海农村商业银行股份有限公司独立董事、安信信托投资股份有限公司独立董事、中梁控股集团有限公司独立董事。

朱洪超先生,独立董事,法学硕士。现任上海市联合律师事务所高级合伙人,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。财通基金管理有限公司独立董事,海通证券股份有限公司独立董事、易居(中国)企业控股有限公司独立董事、万达信息股份有限公司独立董事、钜派投资有限公司独立董事。

朱颖女士,独立董事,会计专业硕士,高级会计师。中国注册会计师协会资深会员、专家库专家,财政部会计领军人才。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兼职教授及硕士生导师,财通基金管理有限公司独立董事。

2、职工监事:

殷平先生,职工监事,产品战略部总监,产业经济学硕士。历任中国建设银行上海市分行个人金融部六级产品经理、上投摩根基金管理有限公司产品研发部总监。现任财通基金管理有限公司产品战略部总监。

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、经理;建行上海分行财富管理与私人银行部产品经理、总经理助理;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、上海财通资产管理有限公司董事。

刘为臻先生,首席信息官兼运营总监,复旦大学工商管理硕士、南昌大学计算数学及其应用软件本科。历任国泰君安证券股份有限公司信息技术总部系统开发与维护员,国联安基金信息技术部副总监,德邦基金运作保障部总经理。2018年10月加入财通基金管理有限公司,现任公司首席信息官兼运营总监,分管信息技术部和基金清算部。

4、督察长:

武祎先生,伦敦政治经济学院会计与金融专业硕士研究生学历。历任云南省财政厅预算处副主任科员,中国证监会期货监管部市场监管处副主任科员,中国证监会基金监管部监管四处主任科员,中国证监会私募基金监管部综合处主任科员,南华基金管理有限公司筹备组副组长,南华基金管理有限公司督察长。现任财通基金管理有限公司督察长、上海财通资产管理有限公司董事。

5、基金经理:

林洪钧先生,复旦大学工商管理硕士、复旦大学力学与工程科学本科。曾就职于国泰君安证券公司(上海分公司)机构客户部、华安基金管理有限公司债券交易员,Financial Engineering Source Inc.金融研究员,先后担任交银施罗德基金管理有限公司固定收益部债券研究员、专户投资部投资经理、固定收益部助理总经理/基金经理,光大保德信基金管理有限公司固定收益部固定收益投资总监,兴证证券资产管理有限公司固定收益投资三部固收总监。2018年8月加入财通基金管理有限公司固定收益部,现任公司固定收益投资总监兼固定收益部总监。

杨烨超先生,复旦大学本科、硕士。2010年7月加入光大保德信基金管理有限公司,历任市场部产品助理、产品经理(负责产品设计研究等)、固定收益部研究员、基金经理。2018年7月加入财通基金管理有限公司,曾任固定收益部投资经理,现任固定收益部基金经理。

6、投资决策委员会成员:

王家俊先生,总经理;
张毅先生,总经理助理兼权益投资总监;
林洪钧先生,固定收益投资总监兼固定收益部总监;
金梓才先生,基金投资部总监;
金立先生,研究部副总监(主持工作)。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

1、基本情况

名称:徽商银行股份有限公司
住所:安徽合肥安庆路79号天徽大厦A座
办公地址:安徽合肥安庆路79号天徽大厦A座
邮政编码:230001
法定代表人:吴学民
成立日期:1997年4月4日
批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银复【1997】70号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监许可【2014】63号
注册资本:1,215,480.1211亿元人民币
存续期间:持续经营
联系电话:0551-62667542
联系人:王大禹

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内、外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同行业拆借;从事银行卡业务;买卖、代理买卖外汇;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保管箱服务;办理委托存贷款业务;经中国银行业监督管理机构批准的其他业务。经中国人民银行批准,经营结汇、售汇业务。客服电话:96588

2、基金托管部门及主要人员情况

我行自2014年初取得基金托管资格。基金托管部下设市场营销团队、托管运作团队、稽核监督团队、运行保障团队。通过部门单设、团队分工、岗位职责体现前、中、后三位一体全过程的监督制衡,确保基金托管业务运营的完整与独立。

我行基金托管部拥有一支高素质人才队伍,具有5年以上金融从业经历的人员占100%。人员100%具有本科及以上学历,其中硕士占80%以上。人员知识构成中,涉及证券、基金、银行、会计、计算机、法律、国际金融等专业,能够为托管业务提供全方位的知识支持,从事清算,核算,投资监督,信息披露等核心业务人员均拥有证券投资基金从业资格。通过系统的业务培训和从业道德操守教育,我行资产托管业务人员能够适应银行理财资产以及其他各类证券化资金托管业务发展和市场的需要。

3、证券投资基金托管情况

截至2019年12月31日,徽商银行已托管25只证券投资基金,其中境内基金25只,目前托管运作中共23只,公募基金托管余额270亿元。

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:夏理芬
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
财通基金微管家(微信号:ctfund88)

2、代销机构

(1)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:孙永祥
联系人:江恩前
联系电话:021-38784580-8920
客服电话:95351
公司网址:www.xcsc.com

(2)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
联系人:秦雨晴
电话:021-20315197
客服电话:95538
公司网址:www.zts.com.cn

(二)注册登记机构

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:夏理芬
电话:021-2053 7888
联系人:薛程

(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
公司电话:(021)2228 8888
公司传真:(021)2228 0000
签章会计师:蒋燕华、骆文慧
业务联系人:蒋燕华

四、基金名称

财通景利纯债债券型证券投资基金

五、基金的类型

债券型证券投资基金

六、基金的投资目标

在严格控制风险的前提下,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的稳健回报。

七、投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、政府支持机构债券、政府支持债券、可分离交易可转债的纯债部分、资产支持证券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、同业存单、银行存款、货币市场工具、债券回购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)。本基金不投资于股票、权证等资产,也不投资于可转换债券(可分离交易可转债的纯债部分除外)、可交换债券。

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。

本基金投资于债券的比例不低于基金资产的80%;本基金持有的现金或到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、投资策略

本基金通过对宏观经济增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响。本基金注重组合的流动性,在分析和判断国内外宏观经济形势、市场利率走势、信用利差状况和债券市场供求关系等因素的基础上,自上而下确定大类债券资产配置和信用债券类属配置,动态调整组合久期和信用债券的结构,依然坚持自下而上精选个券的策略,在获取持有期收益的基础上,优化组合的流动性。

1、久期调整策略

本基金根据中长期的宏观经济走势和经济周期波动趋势,判断债券市场未来的走势,并形成对未来市场利率变动方向的预期,动态调整组合的久期。当预期收益率曲线下移时,适当提高组合久期,以分享债券市场上涨的收益;当预期收益率曲线上移时,适当降低组合久期,以规避债券市场下跌的风险。

2、收益率曲线配置策略

本基金除了考虑系统性的利率风险对收益率曲线平移的影响之外,还将考虑债券市场微观因素对收益率曲线的影响,如历史期限结构、回购及市场拆借利率等,形成一定阶段内的收益率曲线形状变动趋势的预测,据此调整债券投资组合。当预期收益率曲线变陡时,本基金将采用子弹型策略;当预期收益率曲线变平时,将采用哑铃型策略。

3、信用债券投资策略

在投资市场选择层面,本基金将在控制市场风险与流动性风险的前提下,根据交易所市场和银行间市场信用债券到期收益率相对变化、流动性情况和市场规模等,相机调整不同市场的信用债券所占的投资比例。

在品种选择层面,本基金将基于各品种信用债券类金融工具信用利差水平的变化特征、宏观经济预测分析和信用债券供求关系分析等,综合考虑流动性、绝对收益率等因素,采取定量分析和定性分析结合的方法,在各种不同信用级别的信用债券之间进行优化配置。

4、精选个券

本基金将利用公司内部信用评级分析系统,针对发债主体和具体债券项目的信用情况进行深入研究并及时跟踪。主要内容包括:公司管理水平和公司财务状况、债券发行人所处行业的市场地位及竞争情况,并结合债券担保条款、抵押品估值、选择权条款及债券其他要素,对债券发行人信用风险和债券的信用级别进行细致调研,并做出综合评价,着重挑选信用评级被低估以及公司未来发展良好,信用评级有可能被上调的券种。

5、息差策略

在综合考虑债券品种的票息收入和回购利率后,在控制组合整体风险的基础上,当回购利率低于债券收益率时,买入收益率高于回购利率的债券,通过正回购操作来博取超额收益。

6、资产支持证券投资策略

本基金将深入分析资产支持证券的市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等基本面因素,估计资产违约风险和提前偿付风险,并根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程,辅助采用数量化定价模型,评估其内在价值。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:中债综合(全价)指数收益率

中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布,该指数样本具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),是中国目前最权威、应用也最广的指数。中债综合指数反映了债券全市场的整体价格和投资回报情况,适合作为本基金的业绩比较基准。

随着法律法规和市场环境发生变化,如果上述业绩比较基准不适用本基金,或者本基金业绩比较基准中所使用的指数暂停或终止发布或变更名称,或者推出更权威的能够代表本基金风险收益特征的指数,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,与基金托管人协商一致,履行适当程序后对业绩比较基准进行相应调整,并报中国证监会备案并及时公告,无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

本基金是债券型基金,其预期风险与收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金和混合型基金,属于证券投资基金中的中低风险、中低收益品种。

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。

基金托管人中国徽商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2020年4月12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2020年3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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	63,043,400.00	96.69
	其中:债券	63,043,400.00	96.69
	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	729,729.69	1.12
8	其他资产	1,431,079.96	2.19
9	合计	65,204,209.65	100.00

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	10,319,000.00	20.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	52,724,400.00	102.57
	其中:政策性金融债	52,724,400.00	102.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	63,043,400.00	122.65

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	150314	15进出14	200,000	20,994,000.00	40.84
2	010107	21国债(7)	100,000	10,319,000.00	20.08
3	108604	国开1805	100,000	10,215,000.00	19.87
4	190208	19国开08	60,000	6,200,400.00	12.06
5	190215	19国开15	50,000	5,164,000.00	10.05

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

本基金不投资股指期货。

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	16,249.92
2	应收证券清算款	199,753.84
3	应收股利	-
4	应收利息	1,215,076.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,431,079.96

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

十一、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

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2019-07-19至2019-12-31	0.94%	0.03%	0.85%	0.04%	0.09%	-0.01%
2020-01-01至2020-03-31	1.96%	0.11%	1.85%	0.10%	0.11%	0.01%
自基金合同生效起至今(2019-07-19至2020-03-31)	2.92%	0.07%	2.72%	0.07%	0.20%	0.00%

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

注:(1)本基金合同生效日为2019年7月19日,基金合同生效起至披露时点不满一年;

(2)本基金的建仓期为合同生效日起6个月;截止建仓期末和报告期末,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、诉讼费和仲裁费;
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、基金的开户费用、账户维护费用;
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0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H＝E×0.3%÷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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起3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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H＝E×0.1%÷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,由基金管理人与基金托管人核对一致后,基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等,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)增加了本基金基金合同生效时间;
(2)更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据截止日。
2、"三、基金管理人"部分
(1)更新了主要人员情况。
3、"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。
4、"六、基金的募集"部分
(1)更新了基金的募集。
5、"七、基金合同的生效"部分
(1)更新了基金合同的生效。
6、"八、基金份额的申购与赎回"部分
(1)增加了本基金开始办理日常申购、赎回、转换、定投业务时间。
7、"九、基金的投资"部分
(1)增加了基金投资组合报告。
8、"十、基金的业绩"部分
(1)增加了基金的业绩。
9、"十五、基金的会计与审计"部分
(1)更新了基金的年度审计。
10、"十六、基金的信息披露"部分
(1)更新了基金的信息披露。
11、"二十、基金托管协议的内容摘要"部分
(1)更新了基金托管人注册资本;
(2)更新了基金募集期间及募集资金的验资方面的要求。
12、"二十一、对基金份额持有人的服务"部分
(1)更新了对基金份额持有人的服务。
13、"二十二、其他应披露事项"部分
(1)更新了其他应披露事项。

财通基金管理有限公司
二〇二〇年六月十三日

(上接C33版)

法人代表:高涛
联系人:胡正境
电话:0755-88320851
客服电话:95532
公司网址:www.ciccwm.com

(104)上海有鱼基金销售有限公司
注册地址:上海自由贸易试验区浦东大道2123号3层3E-2655室
办公地址:上海市徐汇区桂平路391号A座五层
法人代表:林琼
联系人:徐海峥
电话:021-64389188
传真:021-64389188-102
客服电话:021-60907378
公司网址:www.youyufund.com

(105)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
办公地址: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
法人代表:吕春卫
联系人:丁倩云
电话:01086499427
客服电话:4006206868
公司网址:www.lczq.com

(106)深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙商务大厦8楼A-1(811-812)
办公地址:辽宁省大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1
法定代表人:苗宏升
联系人:葛俏俏
座机:0411-66889809
传真:0411-66889827
客服电话:4007-903-688
公司网址:www.fundying.com

(107)沈阳麟龙投资顾问有限公司
注册地址:辽宁省沈阳市浑南区白塔二南街18-2号B座601
办公地址:上海市青云路158号城建大厦5楼
法定代表人:朱荣晖
联系人:钱金菊
电话:021-5109-1679
传真:021-51091674
客服电话:024-62836088
公司网址:www.linlongtougu.com

(108)济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
电话:010-65309516
传真:010-65330699
客服电话:400-673-7010
公司网址:www.jianfortune.com

(109)弘业期货股份有限公司
注册地址:南京市中华路50号
办公地址:南京市中华路50号弘业大厦
法定代表人:周剑秋
联系人: 张苏怡
电话:025-52278981
传真:025-52278733
客服电话:400-8281288
公司网址:www.ftol.com.cn

(110)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
联系人:杨一新
电话:021-50206002
传真:021-50206001
客户电话:021-50206003
网址:msftec.com

(111)方正证券股份有限公司
注册地址:长沙市天心区湘江中路二段36号华远华中心4、5号楼3701-3717
办公地址:湖南省长沙市天心区湘江中路二段36号
法定代表人:施华
联系人:周静
联系电话:010-56437030
传真:010-56437032
客服电话:95571
网址:www.foundersc.com

(112)东吴证券股份有限公司
注册地址:江苏省苏州市工业园区星阳街5号
办公地址:江苏省苏州市工业园区星阳街5号
法定代表人:范力
联系人:陆晓
电话:0512-62938521
客服电话:95330
公司网址:www.dwjq.com.cn

(113)长江期货股份有限公司
注册地址:武汉市武昌区中北路9号长城汇T2号写字楼第27、28层
办公地址:武汉市武昌区中北路9号长城汇T2号写字楼第27层
法定代表人:谭显荣
联系人:梅晨
传真:86-27-85860102
客服电话:027-85861133
公司网址:www.cjfco.com.cn

(114)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、14层
办公地址: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:010-60833754
客服电话:400-9908-826
公司网址:www.citicsf.com

(115)方德保险代理有限公司
注册地址:北京市东城区东直门外大街46号12层02室
办公地址:北京市东城区东直门外大街46号12层02室
法定代表人:林柏均
客服电话:010-64068617
公司网站:www.fundsure.cn

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。

(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:蒋燕华、骆文慧
业务联系人:蒋燕华

四、基金名称

财通多策略福鑫定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

五、基金的类型

混合型证券投资基金

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(包括国债、央行票据、金融债券、地方政府债券、政府支持债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、中小企业私募债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、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:封闭期内,本基金投资于股票资产的比例为0~100%;开放期内,投资于股票资产的比例则为0~95%。开放期内,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,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%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但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。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,本基金的投资比例会做相应调整。

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)非公开发行股票的融资方式。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。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产支持证券。

7、中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比,中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易,整体流动性相对较差,而且受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响,整体的信用风险相对较高。因此,对于中小企业私募债券的投资应采取更为谨慎的投资策略。投资该类债券的核心要点是对个券信用资质进行详尽的分析,并综合考虑发行人的企业性质、所处行业、资产负债状况、盈利能力、现金流、经营稳定性等关键因素,确定最终的投资决策。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准:沪深300指数收益率×55%+上证国债指数收益率 ×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,或者指数编制机构调整或停止上述指数的发布,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2020年4月21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2020年3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	225,845,391.99	85.27
	其中:股票	225,845,391.99	85.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	38,920,484.22	14.70
8	其他资产	78,210.90	0.03
9	合计	264,844,087.11	100.00

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

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	225,808,691.70	85.54
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	19,147.31	0.01
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	17,552.98	0.01
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	225,845,391.99	85.55

2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通机制投资的港股。

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

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	300502	新易盛	399,895	23,333,873.25	8.84
2	300433	蓝思科技	1,430,800	20,832,448.00	7.89
3	002475	立讯精密	540,000	20,606,400.00	7.81
4	300394	天孚通信	510,926	19,926,114.00	7.55
5	600183	生益科技	729,961	19,322,067.67	7.32
6	603160	汇顶科技	64,900	16,924,622.00	6.41
7	603005	晶方科技	181,400	16,336,884.00	6.19
8	002241	歌尔股份	939,964	15,424,809.24	5.84
9	002463	沪电股份	642,000	15,202,560.00	5.76
10	002384	东山精密	735,000	15,148,350.00	5.74

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68,622.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,588.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	78,210.90

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2017年10月23日-2017年12月31日	1.44%	0.22%	1.61%	0.51%	-0.17%	-0.29%
2018年1月1日-2018年12月31日	-15.93%	1.48%	-12.22%	0.74%	-3.71%	0.74%
2019年1月1日-2019年12月31日	71.94%	2.05%	21.32%	0.69%	50.62%	1.36%
2020年1月1日-2020年3月31日	4.16%	3.25%	-4.40%	1.06%	8.56%	2.19%
自基金合同生效起至今(2017年10月23日-2020年3月31日)	52.73%	1.90%	3.32%	0.74%	49.41%	1.16%

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

财通多策略福鑫定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金

注:(1)本基金合同生效日为2017年10月23日;

(2)本基金建仓期为基金合同生效起6个月,截至报告期末和基金建仓期末,基金的资产配置符合基金契约的相关要求;

(3)本基金自2017年9月8日起根据中国证券投资基金业协会《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》(中基协发〔2017〕6号)确定的估值方法对持有的流通受限股票进行调整。

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×1.5%÷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×0.25%÷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)增加了投资于科创板股票及中小企业私募债券的风险提示;
(2)更新了本招募说明书所载内容截止日及有关财务数据截止日。
2、"三、基金管理人"部分
(1)更新了主要人员情况。
3、"四、基金托管人"部分
(1)更新了主要人员情况;
(2)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。
5、"十、基金的投资"部分
(1)更新了基金投资组合报告。
6、"十一、基金的业绩"部分
(1)更新了基金的业绩。
7、"十六、基金的会计与审计"部分
(1)更新了基金的年度审计。
8、"十七、基金的信息披露"部分
(1)更新了基金的信息披露。
9、"十八、风险揭示"部分
(1)更新了本基金特有风险。
10、"二十一、基金托管协议的内容摘要"部分
(1)更新了募集资金的验证方面的要求。
11、"二十二、对基金份额持有人的服务"部分
(1)更新了对基金份额持有人的服务。
12、"二十三、其他应披露事项"部分
(1)更新了其他应披露事项。

财通基金管理有限公司
二〇二〇年六月十三日