财通基金管理有限公司

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基金份额上市交易公告书

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
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:上海证券交易所
上市时间:2017年12月1日
公告日期:2017年11月28日

一、重要声明与提示

《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基金份额上市交易公告书》(以下简称“本公告书”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号(上市交易公告书的内容与格式)》和《上海证券交易所证券投资基金上市交易规则》的规定编制,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(以下简称“本基金”)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、误导性陈述或者重大遗漏,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。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司保证本公告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和上海证券交易所对本基金上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。

凡本公告书未涉及的有关内容,请投资者详细查阅2017年8月24日登载于《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》、上海证券交易所网站和财通基金管理有限公司网站(www.ctfund.com)的《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招募说明书》(以下简称“招募说明书”)。

本基金上市交易后,基金交易价格受供求关系影响,与基金净值之间可能存在折溢价,敬请投资者关注。

二、基金概览

1、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
2、基金类型:混合型发起式
3、基金运作方式:上市契约型、定期开放。本基金以定期开放方式运作,即本基金在一定期间内封闭运作,不接受基金的申购、赎回;在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期,受理本基金的申购、赎回等申请。
4、基金存续期限:不定期
5、基金份额的申购与赎回:本基金首个封闭期为自基金合同生效日起(包括基金合同生效日)至第一个开放期的首日(不含该日)之间的期间,之后的封闭期为每相邻两个开放期之间的期间。在封闭期内,本基金不开放申购、赎回业务,但投资人可在本基金上市交易后通过上海证券交易所转让基金份额。

本基金每个开放期时长为5至20个工作日,具体时间由基金管理人在每一开放期前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介予以公告。每个开放期的结束之日为上一个封闭期开始之日的18个月对日。即本基任一个封闭期加上其后一个开放期构成的周期总时长原则上为18个月。开放期内,投资人可进行基金份额的申购、赎回,也可在本基金上市交易后通过证券交易所转让基金份额。

6、跨系统转托管:基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转托管。
7、基金份额简称:财通福鑫定开混合发起
8、本次上市交易的基金份额场内简称:财通福鑫
9、基金份额交易代码:501046
10、基金份额总额:截至2017年11月24日,基金份额总额为433,999,617.27份
11、本次上市交易份额:59,900,003.00份
12、基金份额净值:截至2017年11月24日,基金份额净值为0.9956元。
13、上市交易的证券交易所:上海证券交易所
14、上市交易日期:2017年12月1日
15、基金管理人:财通基金管理有限公司
16、基金托管人:中国工商银行股份有限公司
17、基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

三、基金的募集与上市交易

(一)上市前基金募集情况

1、本基金募集申请的注册机构和注册文号:2017年5月16日中国证监会证监许可〔2017〕727号
2、基金运作方式:上市契约型、定期开放。本基金以定期开放方式运作,即本基金在一定期间内封闭运作,不接受基金的申购、赎回;在封闭期结束和下一封闭期开始之间设置开放期,受理本基金的申购、赎回等申请。
3、基金合同期限:不定期
4、本基金发售日期:2017年8月30日至2017年10月16日
5、份额发售方式:场外和场内两种方式公开发售
6、发售价格:基金份额初始面值为人民币1元
7、发售机构:
(1)场外发售机构
直销机构:财通基金管理有限公司直销柜台、财通基金网上直销系统。
(2)场内发售机构:中国工商银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、深圳南海微众银行股份有限公司、东莞银行股份有限公司
(2)证券公司销售渠道:财通证券股份有限公司、爱建证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、恒泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、开源证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、德邦证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、华福证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、申万宏源证券有限公司、国都证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、东北证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、中山证券有限责任公司、九州证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、世纪证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、中银国际证券有限责任公司、第一创业证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、国泰君安股份有限公司、东方证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、申万宏源西部证券有限公司、中信证券(山东)有限责任公司、湘财证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、江海证券有限公司、民生证券股份有限公司、东兴证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司

3)其他销售渠道:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、上海好买基金销售有限公司、蚂蚁(杭州)基金销售有限公司、浙江同花顺基金销售有限公司、深圳众禄金融控股股份有限公司、上海长量基金销售投资顾问有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、浙江金观诚财富管理有限公司、一路财富(北京)信息科技有限公司、北京虹点基金销售有限公司、上海联泰资产管理有限公司、上海陆金所资产管理有限公司、泰诚财富基金销售(大连)有限公司、上海凯石财富基金销售有限公司、珠海盈米财富管理有限公司、大泰金石投资管理有限公司、北京恒天明泽基金销售有限公司、嘉实财富管理有限公司、上海利得基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、中证金牛(北京)投资咨询有限公司、奕丰金融服务(深圳)有限公司、厦门市鑫鼎盛控股有限公司、北京创金启富投资管理有限公司、北京广源达信投资管理有限公司、北京鼎鼎耀华投资咨询有限公司、北京晟视天下投资管理有限公司、上海大智慧财富管理有限公司、北京新浪仓石基金销售有限公司、武汉市伯嘉基金销售有限公司、宜信普泽投资顾问(北京)有限公司、杭州科地瑞富基金销售有限公司、上海基煜基金销售有限公司、北京蛋卷基金销售有限公司、深圳市金斧子基金销售有限公司、乾道金融信息服务(北京)有限公司、北京肯特瑞财富投资管理有限公司、北京汇成基金销售有限公司、凤凰金信(银川)基金销售有限公司、上海利民基金销售有限公司、深圳市新兰德证券投资咨询有限公司、上海云湾投资管理有限公司、北京电盈基金销售有限公司、天津万家财富资产管理有限公司

(2)场内发售机构

本基金的场内发售机构为上海证券交易所内具有基金销售业务资格的会员单位。本基金募集结束前获得基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位可新增为本基金的场内发售机构。具体名单可在上海证券交易所网站查询,本基金管理人不就此事项进行公告。

8、验资机构名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
9、募集资金总额及入账情况

本次募集的净认购金额为433,734,940.68元人民币,认购款项在本基金验资确认日之前产生的银行利息共计264,676.59元人民币。本次募集所有资金已于2017年10月19日全额划入本基金托管专户。

本次募集有效认购户数为3,502户,按照每份基金份额面值1.00元人民币计算,本次募集资金及其产生的利息结转的基金份额共计433,999,617.27份,已全部计入各基金份额持有人的基金账户。

10、基金备案情况

本基金已于2017年10月19日验资完毕,并向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2017年10月23日获书面确认,本基金(基金合同)自该日起正式生效。

11、基金合同生效日:2017年10月23日
12、基金合同生效日的基金份额总额:433,999,617.27份

(二)基金份额上市交易的主要内容

1、本基金基金份额上市交易的核准机构和核准文号:上海证券交易所自律监管决定书[2017]433号
2、上市交易日期:2017年12月1日
3、上市交易的证券交易所:上海证券交易所。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基金简称:财通福鑫定开混合发起
5、场内简称:财通福鑫
6、交易代码:501046
7、本次上市交易份额:59,900,003.00份
8、基金资产净值的披露:本基金的基金合同生效后,在基金份额开始上市交易前,基金管理人将至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值,在基金份额上市交易后,基金管理人应当通过基金管理人网站、上市的证券交易所、基金销售网点以及其他媒介,在每个交易日的次日披露基金份额净值、基金份额累计净值;基金管理人应当公告半年度和年度最后一个市场交易日基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当在前款规定的市场交易日的次日,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒介上。
9、未上市交易份额的流通规定:未上市交易的份额托管在场外,基金份额持有人将其跨系统转托管至上海证券交易所场内后即可上市流通。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

(一)基金份额持有情况

截至2017年11月24日,财通福鑫的基金份额持有人总户数为3,502户,共持有基金份额433,999,617.27份,平均每户持有的基金份额数为123,929.07份。其中场内财通福鑫基金份额持有人户数为1,246户,平均每户持有的场内基金份额为48,073.84份;财通福鑫场外基金份额持有人户数为2,256户,平均每户持有的场外基金份额为165,824.30份;

截至2017年11月24日,场内机构投资者持有的本次上市交易的基金份额为0份,占本次上市交易场内基金份额比例为0%;场内个人投资者持有的本次上市交易的基金份额为59,900,003.00份,占本次上市交易场内基金份额比例为100%。

(二)场内基金份额前十名持有人情况(截至2017年11月24日)

序号	持有人名称	持有基金份额(份)	占场内基金份额的比例(%)
1	艾庆祝	1,984,756.00	3.3134%
2	户俊	1,587,805.00	2.6508%
3	吴剑文	1,291,086.00	2.1554%
4	寿稹	1,200,450.00	2.0041%
5	李碧兰	992,963.00	1.6577%
6	李华芳	992,468.00	1.6569%
7	王凯平	992,378.00	1.6567%
8	江似火	992,378.00	1.6567%
9	伍伟	992,153.00	1.6563%
10	陈卫东	992,153.00	1.6563%

(三)基金管理人的从业人员持有本基金的情况(截至2017年11月24日)

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	9,316,907.44	2.15%

(四)基金管理人的从业人员持有本基金份额总量区间情况(截至2017年2月13日)

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金	100万份以上
本基金基金经理持有本基金	0

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人

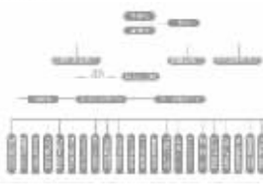
1、基金管理人概况
名称:财通基金管理有限公司
法定代表人:刘未
总经理:王家俊
注册资本:贰亿元人民币
注册地址:上海市虹口区吴淞路619号505室
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监许可【2011】840号
统一社会信用代码:91310000577433812A
经营范围:基金募集;基金销售;资产管理和中国证监会许可的其它业务
2、股东及其出资比例

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

3、内部组织结构及职能:

1)内部组织机构

本基金管理人内部共设有风险管理部、监察稽核部、财务管理部、人力资源部、行政支持部、基金清算部、信息技术部、集中交易部、专户理财部、渠道理财部、机构理财部、市场策划部、客户服务部、上海中心、投行部、产品战略部、固定收益部、新三板投资部、量化投资部、专户投资部、基金投资部、研究部等职能部门,并在北京、广州设立有分公司,并设立了子公司上海财通资产管理有限公司。公司的组织架构图如下:



2)部门职能

风险管理部:对公司进行全面的风险管理,主要包括投资组合风险(研究风险、市场风险、流动性风险、信用风险、交易风险等)、业务风险(产品风险、销售风险、客户维护风险、市场推广风险、新业务风险等)、操作风险,以及财务风险和人力资源风险等,对公司运作和基金管理活动进行重点风险的监督、控制和管理;对各部门实施日常的常规风险检查;对公司的重大决策提供风险管理建议等;负责组织定期召开风险控制会议,对各类风险进行充分的揭示,并将其控制在合理的范围之者予以杜绝,以提升公司基金业绩的平稳性,并确保公司基金规模的平稳增长及后台的平稳运行,最终能让公司获取最大化的经风险调整后的收益。

监察稽核部:负责建立公司合规管理和风险控制体系;负责审核合同、处理法律事务;负责内部稽核审计;负责反洗钱工作;负责信息披露工作,负责开展员工的合规培训等工作,不断提高员工合规意识,防范风险,保障公司长远、稳健、高效发展。

财务管理部:建立健全公司的财务管理和会计核算工作并监督实施,规范公司的财务行为,按时进行公司会计账务处理,编制财务报表,定期进行财务分析,负责管理和核算公司的各项资产,按时交纳各种税款;负责公司的全面预算管理,监督、控制各部门财务预算的执行情况;负责公司自有资金流动性投资管理等。

人力资源部:负责公司人力资源的规划、开发与管理,负责拟定公司人力资源开发管理基本政策和人才队伍发展规划;协助公司领导进行企业文化建设;制订和实施公司组织架构及部门设置、调整的方案;组织人员招聘,进行岗位配置;制订薪酬福利体系草案并提出调整建议,及时计发员工薪酬;制订公司的考核管理体系并组织考核实施;组织、安排员工的内外部学习与培训;负责管理公司人力资源基本信息和人事档案;管理员工关系及其他日常人事事务性工作。

行政支持部:负责公司行政后勤、外部接待、安全保卫、采购,以及办公环境日常管理;负责公司内、外部发文的起草、接收、流转,协调相关部门执行领导的工作指示;负责组织安排公司的重大会议活动,传达并跟进会议决议;起草公司工作计划、报告、总结、通知等各类公文;制定行政管理方面的制度流程;负责公司公章、档案、重要证照的保管、借阅和使用;负责办公车辆使用管理等工作。

基金清算部:负责公司所管理基金的基金会计工作,包括基金清算、记账、估值、划款、与托管行对账、报表编制、对内对外数据提供;负责公司所管理的基金的资金结算工作,包括申登账户的开立及管理、资金结算银行账户的开立及管理、申购赎回相关资金的划拨及记账、数据提供;负责公司所管理的基金的注册登记工作,数据的接收及发送、数据的确认、对内对外数据提供;负责公司所管理的基金的直销中心工作;实施会计监督职能,对基金会计、资金结算、注册登记工作的合法性、合规性进行监督;负责基金清算相关数据、账簿的安全保管;负责信息披露工作中财务部分的编制与审核。

信息技术部:负责根据公司业务发展战略规划参与制定信息技术系统战略规划及信息技术部工作计划,并组织实施;负责信息技术系统软件及硬件设备的选型、购置、使用、维护,报废等方面的管理,确保各信息技术系统设备运转正常;负责交易业务数据及其他重要数据的备份管理并指导其他部门对重要数据进行备份;完成信息技术系统数据库的维护和支持,并为信息技术系统用户提供培训和技术支持;保障全公司信息技术系统的安全运行,为公司各部门提供技术支持,协助相关部门进行信息技术系统管理和维护;负责IT机房的维护和管理,定期对IT机房的各项设施进行检查,并记录检查日志,且做好各项安放措施;准确、完整地记录信息技术系统的运行日志,详细记载发生异常时的现象、时间、处理方式及处理结果等内容并妥善保存有关原始资料,发生技术故障按规定进行报告。

集中交易部:执行基金经理或投资经理的投资交易指令,实现投资组合投资目标;按照法律、法规和公司相关业务规定,对投资组合投资行为进行监控;及时就市场情况向基金经理或投资经理进行反馈,并提出相应建议,尽可能降低交易成本;负责交易的记录、汇总、核对和报告等;开展对市场及重要投资品种运行趋势的判断分析;开展对不同投资品种交易方法和交易技术的研究;组织、协调券商的选择与评估工作;负责公司租用券商席位的管理;维护交易合作关系,扩大交易对手范围,协调公司内部和外部与交易相关的业务关系。

专户理财部:负责公司专户业务的开拓及维护;负责根据市场环境及公司董事会目标制定专户理财工作的销售目标、销售计划并最终达成销售目标等;负责建立部门各项规章制度、工作流程及考核办法等;负责专户客户资料档案建立、维护、保存及管理工作。

渠道理财部:对公司托管银行及销售主渠道选择提出合理化建议;全面负责代销渠道总部的维护、服务及上线等工作;根据市场环境及公司董事会目标制定渠道销售目标、计划等;全面负责公司渠道销售工作:制定各基金IPO、持续销售等专项活动的销售目标、营销方案、销售策略等,并最终达成销售目标;负责协调管理各理财区渠道业务:分解销售任务、制定销售策略、分配销售资源、监督销售过程、考核销售结果等;负责指定部门各项规章制度,行为规范、考核项目及考核制度等。

机构理财部:负责保险公司、财务公司、上市公司、个人高端客户、QFII、券商自营、券商资管、社保基金、企业年金客户类等客户的开拓及维护;根据市场环境及公司董事会目标制定机构理财工作的销售目标、销售计划并最终达成销售目标等;负责建立部门各项规章制度、工作流程及考核办法等;负责直销客户资料档案建立、维护、保存及管理工作。

市场策划部:负责公司品牌建设及管理,负责公司公共关系的开拓及维护,负责媒体关系的建立及维护;负责发布对外信息;负责公关活动的策划及举办;负责公司各类营销材料的设计及制作;负责市场调研;负责自行或委托第三方开展调研问卷及活动等;负责公司宣传材料、媒体发稿、培训课件的统一撰写;根据公司营销发展战略和产品营销计划,有效实施公司形象和基金产品的网上宣传和推介活动;负责维护好网站的基金客户及潜在客户,不断开拓新的创新服务模式,提升网站客户的忠诚度,提高网上直销交易量/占比。

客户服务部:制定客户服务及电子商务工作规则,包括工作纪律、操作流程、人员考核等;拟定客户服务及电子商务发展战略及工作计划,得到批准后组织实施;制定客户服务原则和标准并执行,包括制定投诉处理办法、客户分级标准、服务标准等,塑造和维护公司的信誉及整体利益,提高客户满意度,减少客户流失;负责公司直销柜台工作,接待个人高端直销客户,协助机构直销客户下单。

上海中心:全面负责华东区域渠道销售工作,根据公司渠道销售目标,制定区域内渠道营销方案,完成区域内渠道销售任务;协助分管领导维护华东区域渠道总部,形成定期拜访、沟通制度;全面负责上海区各项规章制度、管理办法的制定并监督实施;全面负责上海区渠道人员的招聘、培训、考核及日常管理工作;协助公司各部门在华东区域开展公司各项工作。

投行部:负责搭建整合投行业务资源平台,负责对金融市场各类创新性投行业务进行研究,组织相关培训;负责研究与投资银行、商业银行相关的金融监管方面政策法规的动向;组织对相关重大事项、事件进行调研分析;负责各类行业信息的搜集,开拓与上市公司在投融资方面的业务合作机会,研究制订投融项目的投资方案,对投融项目的投资预期回报与风险进行分析和判断,提供投资操作建议;负责定增业务中有关投行事务的沟通,协调定增报价;负责制订与投行业务相关的各项制度与流程。

产品战略部:产品战略部是公司的产品战略研究与执行的部门,主要负责产品战略研究,负责公募产品、专户产品的设计及审报,负责新业务资格申请等工作。

固定收益部:负责拟订固定收益证券的研究、投资管理、风险评估、绩效考核等相关管理制度;负责公司旗下所有公募产品和专户产品的固定收益证券的投资与管理,组织固定收益基金经理或投资经理拟定各固定收益产品的投资计划,报投资决策委员会批准组织实施;负责组织宏观策略分析师、固定收益分析师系统研究宏观经济、货币政策、财政政策以及信用产品、利率产品及其衍生产品等,为固定收益投资提供研究支持,同时向投资研究平台提交宏观经济运行报告。

新三板投资部:负责拟订新三板市场的研究、投资管理、风险评估、绩效考核等相关管理制度;负责公司旗下所有公募产品和专户产品的新三板证券的投资与管理,组织新三板基金经理或投资经理拟定各新三板产品的投资计划,报投资决策委员会批准组织实施;负责组织新三板各领域分析师,系统研究新三板证券及所处行业等,为新三板投资提供研究支持;负责与新三板证券投资相关的外部机构的交流与合作。

量化投资部:负责公司公募基金和专户产品的量化投资、指数化投资的投资管理工作;负责公司的金融工程平台,投资风险分析、投资业绩分析、数据需求、量化策略开发和量化投资研究平台的构建和维护;参与投研体系的研究工作;参与量化策略开发和研究,通过与各部门的协作,参与公司的产品设计、宣传、推介、营销、客户服务等工作。

专户投资部:负责公司专户投资业务的具体组织和执行,通过建立严格的内部管理制度、投资管理系统和风险控制系统,来实现风险的防范和控制,在符合法律、法规和制度的前提下,为客户资产增值最大化服务。

基金投资部:负责公司公募产品投资;在严格遵守国家的有关法规和公司的有关管理制度前提下,建立集中决策、独立运作、集中交易、统一管理、授权操作的运作模式,在投资决策委员会的领导下,努力实现基金公司设定的投资目标,追求实现目标的稳定性、持续性和可靠性。

研究部:负责通过对基本面(包括宏观经济、行业部门、上市公司等)的深入研究、结合对市场面(包括股票市场、债券市场、汇率市场、商品市场等)的综合研究,为投资决策委员会、基金经理、投资经理提供研究报告和投资建议,实现各产品的投资目标。

北京分公司:全面负责北方区域渠道销售工作,根据公司渠道销售目标,制定区域内渠道营销方案,完成区域内渠道销售任务;协助分管领导维护北京渠道总部,形成定期拜访、沟通制度;协助公司领导完成公司产品的报批工作及日常与证监会、托管行等单位的联系及维护工作;全面负责北京区各项规章制度、管理办法的制定并监督实施;全面负责北京区渠道人员的招聘、培训、考核及日常管理工作;协助公司各部门在北京区域开展公司各项工作。

广州分公司:全面负责广东区域渠道销售工作,根据公司渠道销售目标,制定区域内渠道营销方案,完成区域内渠道销售任务;协助分管领导维护广东区域渠道总部,形成定期拜访、沟通制度;全面负责广东区各项规章制度、管理办法的制定并监督实施;全面负责广东区渠道人员的招聘、培训、考核及日常管理工作;协助公司各部门在广东区域开展公司各项工作。

4、人员情况

截至2017年11月24日,公司共有员工185人,公司董事长刘未先生、基金经理金梓才先生、姚思劼先生于2017年3月6日收到中国证券监督管理委员会上海监管局下发的采取监管谈话措施的决定,除上述情况外,其他人员在本公司最近三年内均没有受到所在单位或有关管理部门的处罚。

5、信息披露负责人:黄惠
电话:021-2053 7888
6、基金管理业务情况

截至2017年11月24日,财通基金管理有限公司旗下共管理14只基金产品,管理的基金资产净值为18,802,156,061.49元。

7、本基金基金经理

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,现任基金投资部基金经理。

(二)基金托管人

1、基金托管人概况
名称:中国工商银行股份有限公司
法定代表人:易会满
注册资本:人民币35,640,625.71万元
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
信息披露负责人:郭明
电话:010-66105799
2、主要人员情况

截至2017年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工218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。

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2017年6月,中国工商银行共托管证券投资基金745只。自2003年以来,本行连续十四年获得香港《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54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)基金验资机构

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:吴港平
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、蔡玉芝
业务联系人:蒋燕华

六、基金合同摘要

详见本公告书附件。

七、基金财务状况

(一)基金费用期间费用

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不得从基金财产中列支。

(二)基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

(三)基金资产负债表

本基金截至2017年11月24日资产负债表如下:

单位:人民币元

资产	资产期末余额
资产:	
银行存款	235,717,875.79
结算备付金	882,352.94
存出保证金	–
交易性金融资产	30,842,728.00
其中:股票投资	30,842,728.00
基金投资	–
债券投资	–
资产支持证券投资	–
贵金属投资	–
衍生金融资产	–
买入返售金融资产	164,300,000.00
应收证券清算款	127,206.02
应收利息	807,975.97
应收股利	–
应收申购款	–
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	432,678,138.72
负债与所有者权益	负债期末余额
负债:	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	–
应付赎回款	–
应付管理人报酬	428,314.21
应付托管费	71,385.69
应付销售服务费	–
应付交易费用	26,723.22
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	66,000.00
负债合计	592,423.12
所有者权益:	
实收基金	433,999,617.27
未分配利润	–1,913,901.67
所有者权益合计	432,085,715.60
负债和所有者权益总计	432,678,138.72

八、基金投资组合

截至2017年11月24日,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的投资组合如下:

(一)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	30,842,728.00	7.13%
	其中:股票	30,842,728.00	7.13%
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	164,300,000.00	37.97%
	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	236,600,228.73	54.68%
8	其他资产	935,181.99	0.22%
9	合计	432,678,138.72	100.00%

(二)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	–	–
B	采矿业	–	–
C	制造业	23,046,745.50	5.33%
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	–	–
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	7,795,982.50	1.80%
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	–	–
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	30,842,728.00	7.14%

(三)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	300558	贝达药业	200,000.00	11,748,000.00	2.72%
2	603328	依顿电子	872,490.00	11,298,745.50	2.61%
3	002174	游族网络	375,710.00	7,795,982.50	1.80%

(四)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。

(五)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。

(六)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。

(七)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。

(八)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。

(九)报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
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。

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。

(十)报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
1、本期国债期货投资政策
本基金暂不投资国债期货。
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。
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。

(十一)投资组合报告附注
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。

根据上市公司公告,本基金投资的前十名证券中游族网络(证券代码:002174)于2016年12月12日收到福建证监局下发的《关于对游族网络股份有限公司采取责令改正措施的决定》(〔2016〕28号),并已整改完毕。

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。
3、其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	127,206.02
3	应收股利	–
4	应收利息	807,975.97
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	935,181.99

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。
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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300558	贝达药业	11,748,000.00	2.72%	大宗交易限售
2	603328	依顿电子	11,298,745.50	2.61%	大宗交易限售
3	002174	游族网络	7,795,982.50	1.80%	大宗交易限售

注:上述流通受限股票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)确定的估值方法进行估值。
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。

九、重大事件揭示

本基金自向证监会提交上市交易公告书公告前未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、证券交易所的监督管理。

(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起投资决策的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就本基金上市交易后履行托管人职责做出如下承诺:

(一)严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

(二)根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正,并在限期内,随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。

(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件

(一)备查文件目录

1、中国证监会准予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募集注册的文件。
2、《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基金合同》。
3、《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托管协议》。
4、法律意见书。
5、基金管理人业务资格批件、营业执照。
6、