财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)更新招募说明书摘要

（2018年第2号）

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

重要提示

本基金经2015年12月29日中国证券监督管理委员会证监许可[2015]3121号文准予注册募集。本基金基金合同于2016年3月9日正式生效。本基金自2017年9月9日起转为上市开放式基金（LOF）。本基金名称变更为"财通多策略升级混合型证券投资基金（LOF）"

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、中高预期收益的基金产品。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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，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2018年9月9日，有关财务数据截止日为2018年6月30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：刘未
组织形式：有限责任公司
注册资本：人民币贰亿元
联系人：王家俊
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：

刘未先生，董事长，浙江大学经济学硕士。历任财通证券经纪有限责任公司营业部总经理，财通证券经纪有限责任公司经纪业务管理部总经理，原财通证券有限责任公司（现财通证券股份有限公司）基金筹建部负责人，财通基金管理有限公司副总经理、常务副总经理、总经理、上海财通资产管理有限公司董事长。现任财通证券股份有限公司总经理助理、财通基金管理有限公司董事长、浙江财通创新投资有限公司董事长。

王家俊先生，董事，总经理，上海交通大学高级金融学EMBA、中山大学高级工商管理硕士。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、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，现任杭州实业投资集团有限公司财务管理部（财务总监管理办公室）部长（主任），兼任杭华油墨股份有限公司董事、杭实股权投资基金（杭州）有限公司董事。

孙文秋先生，董事，经济学硕士，历任上海财经大学教师，上海东方明珠股份有限公司计划财务部经理、证券事务部经理，上海东方明珠投资有限公司总经理，上海东方明珠股份有限公司副总会计师、总会计师，上海东方明珠（集团）股份有限公司董事、副总裁，上海东方明珠新媒体股份有限公司副总裁、董事会秘书。现任浙江瀚叶股份有限公司副董事长、总经理，兼任上海新农饲料股份有限公司独立董事、上海晶丰明源半导体股份有限公司独立董事、上海唯赛勃环保科技股份有限公司独立董事、霍尔果斯拜克影视有限公司董事长、浙江瀚叶投资管理有限公司执行董事及青岛易邦生物工程有限公司董事。

姚先国先生，独立董事，教授，博士生导师。历任浙江大学经济学院常务副院长，浙江大学公共管理学院院长，浙江大学社会科学学部主任。现任浙江省公共政策研究院院长，浙江大学公共政策研究院院长。同时担任中程科技有限公司、浙江大学创新技术研究院有限公司、浙江叁农投资管理有限公司、浙江省基础建设投资集团股份有限公司董事；浙江浙能电力股份有限公司、浙江核新同花顺网络信息股份有限公司、温州银行股份有限公司、南华期货股份有限公司、浙江君亭酒店管理股份有限公司、浙江众和科技股份有限公司独立董事。

朱洪超先生，独立董事，法律硕士。现任上海市联合律师事务所主任，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，易居(中国)控股有限公司、上海第一医药股份有限公司、万达信息股份有限公司独立董事。

朱颖女士，独立董事，高级会计师，复旦大学会计专业硕士学历。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、易居（中国）企业集团股份有限公司独立董事。

2、职工监事：

股平先生，职工监事，产品战略总监、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、个人金融部副总经理；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。

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

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。

谈洁颖女士，毕业于中国人民大学工商企业管理专业。曾就职于北京大学从事教育管理工作，历任长信基金管理有限责任公司专户投资经理、基金经理、投资副总监、总监，公司投资决策委员会委员，国内股票基金投资决策委员会主席。2017年4月加入财通基金管理有限公司，现任总经理助理兼权益投资总监。

6、投资决策委员会成员：
王家俊先生，总经理；
谈洁颖女士，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，基金投资部副总监；
陆玲玲女士，研究部副总监。

7、上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

本基金托管人为中国工商银行股份有限公司，基本信息如下：
名称：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
设立日期：1984年1月1日
批准设立机关和批准设立文号：国务院《关于中国人民银行专门行使中央银行职能的决定》（国发[1983]146号）
组织形式：股份有限公司
注册资本：人民币35,640,625.71万元
法定代表人：易会满
基金托管业务批准文号：中国证监会和中国人民银行证监基字【1998】3号
联系人：郭明
电话：010-66105799

（二）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。

（三）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。

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：刘未
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

2、代销机构
(1)中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市复兴门内大街55号
办公地址：北京市复兴门内大街55号
法定代表人：易会满
传真：010-66107914
客服电话：95588
公司网址：www.icbc.com.cn
(2)中国光大银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
办公地址：北京市西城区太平桥大街25号中国光大中心
法定代表人：李晓鹏
客服电话：95595
公司网址：www.cebbank.com
(3)中国民生银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人：洪崎
联系人：王继伟
客服电话：95568
公司网址：www.cmbc.com.cn
(4)交通银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路188号
办公地址：上海市银城中路188号
法定代表人：彭纯
联系人：曹榕
电话：021-58781234
传真：021-58408842
客服电话：95559
公司网站：www.bankcomm.com
(5)上海银行股份有限公司
注册地址：上海市银城中路168号
办公地址：上海市银城中路168号
法定代表人：金煜
联系人：汤征程
电话：021-68475888
客服电话：021-962888
公司网址：www.bankofshanghai.com
(6)宁波银行股份有限公司
注册地址：中国浙江宁波市宁南南路700号
办公地址：中国浙江宁波市宁南南路700号
法定代表人：陆华裕
联系人：胡技勋
电话：0574-89068340
客服电话：95574
公司网站：www.nbcb.com.cn
(7)广发银行股份有限公司
注册地址：广州市越秀区东风东路713号
办公地址：广州市越秀区东风东路713号
法定代表人：杨明生
联系人：陈泾渭
客服电话：400-830-8003
公司网站：www.cgbchina.com.cn
(8) 浙江民泰商业银行股份有限公司
注册地址：浙江省温岭市三星大道168号
办公地址：浙江省温岭市三星大道168号
法定代表人：江建法
联系人：刘兴龙
电话：0571-88821178
客服电话：400-8896-521
公司网址：www.mintaibank.com
(9) 平安银行股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人：谢永林
电话：0755-8208 8888
传真：0755-8201 1018
公司网址：http://bank.pingan.com/
(10) 财通证券股份有限公司
注册地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
办公地址：杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心
法定代表人：陆建强
联系人：陶志华
电话：86-571-87789160
传真：0571－87818329
客服电话：95336
公司网址：www.ctsec.com
(11)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
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：唐静
电话：010-83252182
传真：010-63080978
客服电话：95321
公司网址：www.cindasc.com
(12)华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街8号
办公地址：北京市西城区金融大街8号，朝阳区朝阳门北大街18号
法定代表人：祝献忠
联系人：李慧灵
电话：010-85556100
传真：010-85556088
客服电话：95390
网址：www.hrsec.com.cn
(13)山西证券股份有限公司
注册地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
办公地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼
法定代表人：侯巍
联系人：邓颖赟
电话：0351-8686656
传真：0351-8686667
客服电话：95573、400-666-1618
公司网站：http://www.i618.com.cn/
(14)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
办公地址：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：010-83574507
传真：010-66568990
客服电话：400-8888-888或95551
公司网址：www.chinastock.com.cn
(15)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
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号45层
法定代表人：李梅
联系人：黄莹
电话：021-33388211
传真：021-33388224
客服电话：95523或4008895523
公司网址：www.swhysc.com
(16)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
办公地址：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：周健男
联系人：李芳芳
电话：021-22169089
传真：（8621）62151789
客服电话：95525
公司网址：www.ebscn.com
(17)兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
办公地址：上海浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼21层
法定代表人：杨华辉
联系人：夏中苏
电话：0591-38507538
客服电话：95562
公司网址：www.xyzq.com.cn
(18)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：李欣
电话：021-68634510-888193
传真：021-68865680
客服电话：95351
公司网址：http://www.xcsc.com/
(19)华福证券有限责任公司
注册地址：福建省福州市五四路157号新天地大厦7-9楼
办公地址：福建省福州市五四路157号新天地大厦7-9楼
法定代表人：黄金琳
联系人：郭相兴
电话：021-20655175
传真：021-20655196
客服电话：95547
公司网址：http://www.gfhfzq.com.cn/
(20) 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
办公地址：上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人：杨德红
联系人：钟伟镇
联系电话：021-38032284
客服电话：400-8888-666 / 95521
网址：www.gtja.com
(21)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
办公地址：广东省深圳市福田区中心三路8号中信证券大厦
法定代表人：张佑君
联系人：刘玉静
电话：010-60837208
客服电话：95548
公司网址：www.cs.ecitic.com
(22)国信证券股份有限公司
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层至26层
法定代表人：何如
联系人：李颖
电话：0755-82130833-701266
传真：0755-22940910
客服电话：95536/0755-25822002
公司网址：www.guosen.com.cn
(23)招商证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人：霍达
联系人：吴昊
电话：0755-82960904
传真：0755-82943636
客服电话：95565
公司网址：www.newone.com.cn
(24)上海证券有限责任公司
住所：上海市黄浦区四川中路213号7楼
办公地址：上海市黄浦区四川中路213号7楼
法定代表人：李俊杰
联系人：凌里
联系电话：021-63608830
客户服务电话：4008918918
网址：www.shzq.com
(25)安信证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人：王连志
联系人：陈剑虹
电话：0755-82825551
传真：0755-82558355
客服电话：95517
公司网址：www.essence.com.cn
(26)东海证券股份有限公司
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：赵俊
联系人：王一彦
电话：021-20333910
传真：021-50588876
客服电话：95531
公司网址：www.longone.com.cn
(27)爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市世纪大道1600号32楼
办公地址：上海市世纪大道1600号32楼
法定代表人：祝健
联系人：王冠昌
电话：021-32229888-25512
客服电话：40001-962-502
公司网址：www.ajzq.com
(28)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号
办公地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17号
法定代表人：丁益
联系人：金夏
电话：010-60838995
客服电话：400-6666-888
公司网址：www.cgws.com
(29)国海证券股份有限公司
注册地址：广西桂林市辅星路13号
办公地址：广西壮族自治区南宁市滨湖路46号
法定代表人：何春梅
联系人：王成
电话：021-50182571
客服电话：95563
公司网址：www.ghzq.com.cn
(30)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
办公地址：青岛市市南区东海西路28号龙翔广场东楼2层
法定代表人：姜晓林
联系人：吴忠超
电话：0532-85022326
传真：0532-85022605
客服电话：95548
网址：www.zxwt.com.cn
(31)中国民族证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院盘古大观A座40F-43F
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F
法定代表人：姜志军
联系人：程博怡
电话：010-56437060
传真：010－56437032
客服电话：4008895618、95571
网址：www.e5618.com
(32) 联讯证券股份有限公司
注册地址：广州省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心3/4楼
办公地址：广州省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心3/4楼
法定代表人：徐刚
联系人：彭莲
电话：0752-2119700
传真：0752-2119660
客服电话：95564
网址：www.lxzq.com.cn
(33)海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：周杰
联系人：李笑鸣
电话：021-23219275
客服电话：95553、4008888001、02195553
公司网址：www.htsec.com
(34)德邦证券股份有限公司
注册地址：上海市曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市福山路500号城建国际中心26楼
法定代表人：武晓春
联系人：朱磊
电话：021-68761616-8076
客服电话：400-8888-128
公司网站：www.tebon.com.cn
(35)长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人：尤习贵
联系人：奚博宇
联系电话：010-60838995
客服电话：95579/4008888999
公司网址：https://www.95579.com/
(36)平安证券股份有限公司
注册地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
办公地址：深圳市福田中心区金田路4036号荣超大厦16-20层
法定代表人：何之江
联系人：石静武
电话：021-38631117
传真：021-58991896
客服电话：95511转8
公司网址：http://stock.pingan.com
(37)国金证券股份有限公司
注册地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号
办公地址：四川省成都市青羊区东城根上街95号
法定代表人：冉云
联系人：刘婧漪
电话：028-86690057
客服电话：95310
公司网址：http://www.gjzq.com.cn/
(38) 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
办公地址：重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人：廖庆轩
联系人：张煜
电话：023-63786141
传真：023-63786212
客服电话：95355
公司网址：www.swsc.com.cn
(39)中国中投证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋4层、18-21层
办公地址：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第4、18-21层
法定代表人：高涛
联系人：张鹏
电话：0755-82026539
客服电话：95532、4006008008
公司网址：http://www.china-invs.cn/
(40) 华鑫证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元
办公地址：上海市宛平南路8号
法定代表人：俞洋
联系人：王逍
电话：021-54967203
传真：021-54967293
客服电话：95323
公司网址：www.cfsc.com.cn
(41)东北证券股份有限公司
注册地址：长春市自由大路1138号
办公地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：李福春
联系人：傅静雅
电话：0431-82006251
客服电话：95360
公司网址：http://www.nesc.cn/
(42)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
办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路198号
法定代表人：章宏韬
联系人：左黄奇
电话：0551-65161565
客服电话：95318
公司网址：http://www.hazq.com/
(43)恒泰证券股份有限公司
注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼
办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座D座光大银行办公楼14-18楼
法定代表人：庞介民
联系人：熊丽
电话：0471-4972675
客服电话：400-196-6188
公司网址：http://www.cnht.com.cn/
(44)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：许曼华
电话：021-20315290
客服电话：95538
公司网址：www.zts.com.cn
(45)广州证券股份有限公司
注册地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址：广州市珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人：胡伏云
客服电话：95396
公司网址：www.gzs.com.cn
(46)华龙证券股份有限公司
注册地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心
办公地址：兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心
法定代表人：李晓安
联系人：范坤
客服电话：95368、400-6898888
公司网址：http://www.hlzqgs.com
(47)大同证券有限责任公司
注册地址：大同市城区迎宾街15号桐城中央21层
办公地址：太原市长治路111号山西世贸中心A座12、13层
法定代表人：董祥
联系人：刘亮
电话：0351-7219929
客服电话：4007121212
公司网址：www.dtsbc.com.cn
(48) 中银国际证券股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F
办公地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F
法定代表人：宁敏
联系人：王炜哲
联系电话：021-20328309
客服电话：400-620-8888/021-61195566
公司网址：www.bocichina.com/
(49)东莞证券股份有限公司
注册地址：莞城区可园南路1号金源中心30楼
办公地址：莞城区可园南路1号金源中心30楼
法定代表人：陈照星
客服电话：95328
公司网址：http://www.dgzq.com.cn/
(50)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
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
联系人：许梦园
电话：010-85156398
传真：010-65182261
客服电话：95587或4008-888-108
公司网址：www.csc108.com
(51)华泰证券股份有限公司
住所：南京市江东中路228号
办公地址：南京市江东中路228号
法定代表人：周易
联系人：马艺卿
电话：0755-82492193
客服电话：95597/ 025-83389999
公司网址：http://www.htsc.com.cn/
(52) 方正证券股份有限公司
注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：施华
联系人：齐冬尼
电话：010-59355807
客服电话：95571
公司网址：www.foundersc.com
(53)蚂蚁（杭州）基金销售有限公司
注册地址：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/
(54)上海好买基金销售有限公司
注册地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址：上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903～906室
法定代表人：杨文斌
联系人：王诗玙
电话：021-20613999
传真：021-20613999
客服电话：400-700-9665
公司网址：www.ehowbuy.com
(55)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：浙江省杭州市余杭区同顺街18号同花顺大楼
法定代表人：凌顺平
联系人：董一锋
联系电话：0571-88911818-8653
传真：0571-88911818-8001
客服电话：4008-773-772
公司网站：www.ijijin.cn
(56)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801
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
传真：0755-33227951
客服电话：4006-788-887
公司网址：www.zlfund.cn/www.jjmmw.com
(57)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1002室
办公地址：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
联系人：刘洋
电话：010-85650628
传真：010-65884788
客服电话：400-920-0022
公司网站：http://licaike.hexun.com/
(58)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
联系人：余翼飞
电话：021-80358749
传真：021-38509777
客服电话：400-821-5399
诺亚网址：www.noah-fund.com
(59)上海天天基金销售有限公司
注册地址：上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址：上海市徐汇区宛平南路88号东方财富大厦
法定代表人：其实
联系人：王超
电话：021-54509977
传真：021-64385308
客服电话：400-1818-188
网址：www.1234567.com.cn
(60)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：上海市浦东新区东方路1267号11层
法定代表人：张跃伟
联系人：吴艳秋
电话：021-2069-1831
客服电话：4008202899
传真：021-2069-1861
公司网址：www.erichfund.com
(61) 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
联系人：李超
电话：010-56200948
传真：010-57569671
客服电话：400-893-6885
公司网址：www.qianjing.com
(62) 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6层
法定代表人：闫振杰
联系人：李晓芳
联系电话：010-59601366转7167
客服电话：400-818-8000
公司网址：www.myfund.com
(63) 浙江金观诚基金销售有限公司
注册地址：杭州市拱墅区登云路45号（锦昌大厦）1幢10楼1001室
办公地址：杭州市拱墅区登云路55号（锦昌大厦）1楼金观诚大厅
法定代表人：蒋雪琦
联系人：来舒岚
客服电话：400-068-0058
公司官网：www.jincheng-fund.com
(64) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704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：马勇
联系人：文雯
联系电话：010-83363101
客服电话：400-166-1188
传真：010-83363072
公司网址：www.new-rand.cn
(65) 一路财富（北京）信息科技股份有限公司
注册地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座2208
法定代表人：吴雪秀
联系人：徐越
电话：(010)88312877
传真：(010)88312877
客服电话：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com
(66) 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
办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
法定代表人：罗细安
联系人：闫丽敏
电话：010-67000988
传真：010-67000988-6000
客服电话：400-001-8811
公司网址：www.zcvc.com.cn
(67) 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号裙楼2层222单元
办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲二号盈科中心东门二层
法定代表人：郑毓栋
联系人：姜颖
电话：010- 85643600
客服电话：400-618-0707
公司网址：www.hongdianfund.com
(68)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号楼3层
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.66zichan.com
(69) 上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址：上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
法定代表人：冯修敏
电话：021-33323999
传真：021-33323830
客服电话：400-820-2819
公司网址：https://tty.chinapnr.com/
(70)上海陆金所基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号西群楼14楼
法定代表人：王之光
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客服电话：400-821-9031
公司网址：www.lufunds.com
(71)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号上海国金中心办公楼二期46层4609-10单元
办公地址：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：于永健
电话：010-85097570
传真：010-85097308
客服电话：400-021-8850
网址：www.harvestwm.cn
(72)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址：北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人：周斌
联系人：陈霞
电话：15249236571
传真：010-53509643
客服电话：4008-980-618
网址：www.chtfund.com
(73)上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：蔡小威
电话：021-63333389
传真：021-63333390
客服电话：400 178 000
公司网址：www.vstonewealth.com
(74)泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：徐江
电话：0411-88891212
传真：0411-88891212-122-119
客服电话：4000411001
网址：http://www.taichengcaifu.com
(75)珠海盈米财富管理有限公司
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
联系人：吴煜浩
电话：020-89629099
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
网址：www.yingmi.cn
(76)大泰金石基金销售有限公司
注册地址：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
办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼
法定代表人：袁顾明
联系人：赵明
电话：021-20324069
传真：021-20234199
客服电话：4009282266
网址：www.dtfunds.com
(77) 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室/14层
办公地址：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室/14层
法定代表人：张皓
传真：0755-83217421
客服电话：400-990-8826
公司网站：http://www.citicsf.com/
(78) 中国国际金融股份有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27/28层
办公地址：北京市朝阳区建国门外大街1号国贸大厦2座27/28层
法定代表人：丁学东
存续期间：持续经营
电话：010-65051166
传真：010-65051156
公司网址：www.cicc.com.cn
(79)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
联系人：陈孜明
电话：86-021-50583533
传真：86-021-50583633
客服电话：400-921-7755
网址：http://www.leadfund.com.cn/
(80)中证金牛（北京）投资咨询有限公司
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
联系人：徐英
电话：010-59336539
传真：010-59336500
客服电话：4008909998
公司网址：www.jnlc.com
(81)奕丰基金销售有限公司
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
法人代表：TEO WEE HOWE
联系人：叶健
电话：0755-89460507
传真：0755-21674453
客服电话：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn
(82)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号第一广场西座1501-1504
办公地址：厦门市思明区鹭江道2号第一广场西座1501-1504
法人代表：陈洪生
联系人：梁云波
电话：0592-3122757
客服电话：400-918-0808
公司网址：www.xds.com.cn
(83)深圳富济基金销售有限公司
注册地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
办公地址：深圳市福田区福田街道金田路中洲大厦35层01B、02、03、04单位
法定代表人：刘鹏宇
联系人：刘勇
电话：0755-83999907-815-8814
传真：0755-83999926
客服电话：0755-83999907
公司网址：www.fujiwealth.cn
(84)北京晟视天下投资管理有限公司
注册地址：北京市怀柔区九渡河镇黄坎村735号03室
办公地址：北京市朝阳区朝外大街万通中心D座28层
联系人：宋志强
电话：010-58170932
联系人：张伟艳
电话：010-58170910
传真：010-58170840
客服电话：010-58170761
公司网址：http://www.shengshiview.com/
(85) 上海大智慧基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102单元
法定代表人：申健
联系人：宋楠
客服电话：021-20292031
网址：https://www.wg.com.cn/
(86)北京君德汇富基金销售有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街18号4层办公楼二座414室
办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心4办公楼二座414室
法定代表人：李振
联系人：周雯
电话：13810043063
传真：010-65174782
客服电话：400-829-1218
公司网址：https://www.kstreasure.com/
(87)武汉市伯嘉基金销售有限公司
注册地址：武汉市江汉区中央商务区泛海国际SOHO城（一期）七栋23层1号4号
办公地址：武汉市江汉区中央商务区泛海国际SOHO城（一期）七栋23层1号4号
法人代表：陶捷
联系人：陆锋
电话：027-83863742
传真：027-83862682
客服电话：400-027-9899
公司网址：www.buyfunds.cn
(88)宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座18层1809
法人代表：戎兵
联系人：魏晨
电话：010-52858244
传真：010-85800047
客服电话：400-6099200
公司网址：www.yixinfund.com
(89)上海基煜基金销售有限公司
注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址：上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人：王翔
联系人：蓝杰
电话：021-65370077
传真：021-55085991
客户服务电话：4008-205-369
网址：www.jiyufund.com.cn
(90)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：北京市朝阳区望京SOHO，T2，B座2507
法人代表：钟斐斐
联系人：翟相彬
电话：010-61840688
传真：010-61840699
客服电话：4000-618-518
公司网址：danjuanapp.com
(91)开源证券股份有限公司
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代销人：李刚
客服电话：4008608866
公司网址：http://www.kysec.cn/
(92) 北京肯特瑞基金销售管理有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
法定代表人：江卉
电话：4000988511/ 4000888816
传真：010-89188000
客服电话：400 098 8511
公司官网：http://fund.jd.com/
(93) 乾道盈泰基金销售（北京）有限公司
注册地址：北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
办公地址：北京市西城区德胜门外大街13号院1号楼1302
法人代表：王兴吉
联系人：宋子琪
电话：18500501595
传真：010-82057741
客服电话：4000-888-080
公司网址：www.qiandaojr.com
(94)凤凰金信（银川）基金销售有限公司
注册地址：宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址：北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法人代表：程刚
联系人：张旭
电话：010-58160168
传真：010-58160173
客服电话：400-810-5919
公司网址：www.fengfd.com
(95)北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号A座1108室
法人代表：王伟刚
联系人：王骁骁
电话：010-56251471
传真：010-62680827
客服电话：400-619-9059
公司网址：www.hcjijin.com
(96)海银基金销售有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区银城中路8号402室
办公地址：上海市浦东新区银城中路8号4楼
法人代表：刘惠
联系人：毛林
电话：021-80133597
传真：021-80133413
客服电话：400-808-1016
公司网址：www.fundhaiyin.com
(97)上海云湾投资管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层，200127
办公地址：中国上海浦东新区新金桥路27号1号楼
法人代表：桂水发
联系人：范泽杰
电话：021-20530186
传真：021-20539999
客服电话：400-820-1515
网址：http://www.zhengtongfunds.com/
(98) 北京电盈基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区呼家楼（京广中心）1号楼36层3603室
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦F座12B
法人代表：曲馨月
联系人：周静华
传真：010-56176117
客服电话：400-100-3391
公司网址：www.bjdyfund.com
(99) 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
法人代表：李修辞
联系人：王芳芳
电话：010-59013842
传真：010-59013828
客服电话：010-59013842
公司网址：http://www.wanjiawealth.com/
(100) 世纪证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
办公地址：深圳市福田区深南大道招商银行大厦40-42层
联系人：王雯
电话：0755-83199599
客服电话：4008323000
公司网址：http://www.csco.com.cn
(101)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：400-7676-298
公司网址：www.youyufund.com
(102)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：沙常明
联系人：丁倩云
电话：01086499427
客服电话：4006206868
公司网址：www.lczq.com
(103)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
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

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，并及时公告。

（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
注册地址：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、蔡玉芝
业务联系人：蒋燕华

四、基金名称

财通多策略升级混合型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

混合型

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、中期票据、短期融资券、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：股票资产比例为基金资产的30%～95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产的0%～70%；在封闭期内，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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；转换为上市开放式基金（LOF）后，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。

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、反应速度以及获益大小等指标，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。

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2018年7月18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2018年6月30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	1,481,430,231.62	88.37
	其中：股票	1,481,430,231.62	88.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,911,902.02	0.23
	其中：债券	3,911,902.02	0.23
	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	122,347,194.75	7.30
8	其他资产	68,689,004.23	4.10
9	合计	1,676,378,332.62	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)	占基金资产净值的比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	867,961,606.96	51.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,482,603.15	0.15
E	建筑业	11,392,072.00	0.68
F	批发和零售业	63,145,984.00	3.78
G	交通运输、仓储和邮政业	17,779,775.96	1.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,265,777.18	6.60
J	金融业	301,260,241.00	18.02
K	房地产业	52,653,980.00	3.15
L	租赁和商务服务业	31,423,122.25	1.88
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,082,044.75	0.30
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	17,983,024.37	1.08
S	综合	-	-
	合计	1,481,430,231.62	88.62

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	601318	中国平安	2,271,200	133,046,896.00	7.96
2	000858	五 粮 液	1,559,872	118,550,272.00	7.09
3	600426	华鲁恒升	4,837,481	85,091,290.79	5.09
4	601233	桐昆股份	4,215,761	72,595,404.42	4.34
5	600030	中信证券	4,371,200	72,430,784.00	4.33
6	600038	中直股份	1,744,960	69,780,950.40	4.17
7	601688	华泰证券	4,422,600	66,206,322.00	3.96
8	002092	中泰化学	6,915,700	65,516,608.00	3.92
9	300296	利亚德	5,264,085	64,695,604.65	3.87
10	000830	鲁西化工	3,768,258	64,361,846.64	3.85

注：本基金报告期末持有中泰化学（002092）上市流通及流通受限部分，上表中按同一股票合并计算。

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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）	3,911,902.02	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,911,902.02	0.23

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	123006	东财转债	32,526	3,911,902.02	0.23

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 2017年9月，中泰化学（002092）收到国家发展和改革委员会下发的《行政处罚决定书》（发改办价监处罚[2017]11号）；2018年5月4日，利亚德（300296）收到深交所下发的《关于对利亚德光电股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的决定》。上述信息详见上市公司发布的相关公告。报告期内，除上述情况外，本基金投资的其他前八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。

本基金投资中泰化学（002092）、利亚德（300296）的投资决策程序为：
1、投资决策委员会确定每个产品的基本投资逻辑；
2、投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
3、基金经理拟订所管理产品的投资计划与方案；
4、金融工程小组对基金经理/投资经理的投资计划进行风险评价，并向投资决策委员会提交评估报告；
5、投资决策委员会对基金经理/投资经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；
6、根据决策纪要，基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施；
7、中央交易室按有关交易规则执行基金经理/投资经理下达的交易指令，并将有关信息进行反馈；
8、基金经理/投资经理定期检讨投资组合的运作成效；
9、金融工程小组定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理/投资经理出具绩效与风险评估报告。

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	973,597.43
2	应收证券清算款	67,669,173.49
3	应收股利	-
4	应收利息	28,390.44
5	应收申购款	17,842.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,689,004.23

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	123006	东财转债	3,911,902.02	0.23

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002092	中泰化学	35,826,372.00	2.14	非公开发行解禁后限售
2	300296	利亚德	64,695,604.65	3.87	非公开发行解禁后限售

注：根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》要求（下称《规定》），持有上市公司非公开发行股份的股东，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，减持数量不得超过其持有该次非公开发行股份数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。上述通过非公开发行方式获得的股份已过限售期的，但根据《规定》要求需于一定时间内继续处于限售状态。

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

1 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

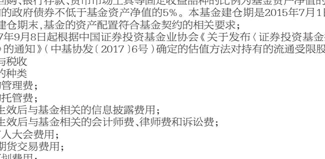
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2017年9月9日-2017年12月31日	-3.18%	0.72%	3.04%	0.40%	-6.22%	0.32%
2018年1月1日-2018年6月30日	-6.99%	1.41%	-5.94%	0.64%	-1.05%	0.77%
2017年9月9日-2018年6月30日	-9.95%	1.19%	-3.08%	0.56%	-6.87%	0.63%

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）自基金合同转型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

财通多策略升级混合型证券投资基金(LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2017年9月9日-2018年6月30日）



注：(1)本基金合同生效日为2016年3月9日，转型日期为2017年9月9日，基金转型至披露时点不满一年；

(2)根据《基金合同》规定：本基金投资于股票资产占基金净值：30%-95%；债券、中期票据、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具等固定收益品种的比例为基金资产净值的0%～70%；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%。本基金建仓期是2015年7月1日至2016年1月1日，截至报告期末及建仓期末，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）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、"二、释义"部分
（1）更新了流动性风险管理规定；
（2）更新了流动性受限资产。
3、"三、基金管理人"部分
（1）更新了主要人员情况。
4、"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；
（3）更新了基金托管人的内部控制制度。
5、"五、相关服务机构"部分
（1）更新了代销机构方面信息。
6、"九、基金份额的申购与赎回"部分
（1）更新了申购和赎回的数量限制；
（2）更新了申购费用和赎回费用；
（3）更新了拒绝或暂停申购的情形；
（4）更新了暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形；
（5）更新了巨额赎回的情形及处理方式。
7、"十、基金的投资"部分
（1）更新了投资范围；
（2）更新了投资限制；
（3）更新了基金投资组合报告，报告所载数据截至2018年6月30日。
8、"十一、基金的业绩"部分
（1）更新了基金的业绩。
9、"十三、基金资产估值"部分
（1）更新了暂停估值的情形。
10、"十七、基金的信息披露"部分
（1）更新了公开披露的基金信息。
11、"二十一、基金托管协议的内容摘要"部分
（1）更新了基金托管人对基金管理人的业务监督和核查。
12、"二十三、其他应披露事项"部分
（1）更新了2018年1月1日至2018年8月7日期间涉及本基金的相关公告。

财通基金管理有限公司
二〇一八年十月二十日