

## 融通通宸债券型证券投资基金更新招募说明书摘要 (2018年第1号)

### 重要提示

融通通宸债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2016年8月9日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予融通通宸债券型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2016]1768号文）准予募集注册。基金合同生效日为2016年12月21日。

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。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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%，但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或超过50%的除外。

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在

获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。

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资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。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。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2017年12月21日，有关财务数据截止日为2017年9月30日，净值表现截止日为2017年6月30日（本报告中财务数据未经审计）。

## 一、基金合同生效日期

2016年12月21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

住所：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。

督察长涂卫东先生，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，曾在证监会法律部和基金监管部工作，曾是证监会公职律师。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

黄浩荣先生，厦门大学管理学硕士，4年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2014年6月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部固定收益研究员，现任融通易支付货币、融通汇财宝货币（由原融通七天理财债券转型而来）、融通通源短融债券、融通增利债券、融通通安债券、融通通福债券（LOF）（由原融通通福分级债券转型而来）、融通通和债券、融通通祺债券、融通通宸债券、融通通玺债券、融通通穗债券、融通通弘债券、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2016年12月21日起至2017年7月28日，由王涛先生担任本基金的基金经理。

自2017年7月29日起至今，由黄浩荣先生担任本基金的基金经理。

### 5、投资决策委员会成员

公司固定收益投资决策委员会成员：固定收益投资总监、基金经理张一格先生，固定收益部总监、基金经理王超先生，交易部总经理谭奕舟先生，风险管理部总经理马洪元先生。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### （一）基金托管人基本情况

名称：招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）

设立日期：1987年4月8日

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

注册资本：252.20亿元

法定代表人：李建红

行长：田惠宇

资产托管业务批准文号：证监基金字[2002]83号

电话：0755—83199084

传真：0755—83195201

资产托管部信息披露负责人：张燕

#### （二）发展概况

招商银行成立于1987年4月8日，是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行，总行设在深圳。自成立以来，招商银行先后进行了三次增资扩股，并于2002年3月成功地发行了15亿A股，4月9日在上交所挂牌（股票代码：600036），是国内第一家采用国际会计标准上市的公司。2006年9月又成功发行了22亿H股，9月22日在香港联交所挂牌交易（股票代码：3968），10月5日行使H股超额配售，共发行了24.2亿H股。截至2017年9月30日，本集团总资产61,692.39亿元人民币，高级法下资本充足率15.01%，权重法下资本充足率12.26%。

2002年8月，招商银行成立基金托管部；2005年8月，经报中国证监会同意，更名为资产托管部，下设业务管理室、产品管理室、业务营运室、稽核监察室、基金外包业务室5个职能处室，现有员工76人。2002年11月，经中国人民银行和中国证监会批准获得证券投资基金托管业务资格，成为国内第一家获得该项业务资格上市银行；2003年4月，正式办理基金托管业务。招商银行作为托管业务资质最全的商业银行，拥有证券投资基金托管、受托投资管理托管、合格境外机构投资者托管（QFII）、合格境内机构投资者托管（QDII）、全国社会保障基金托管、保险资金托管、企业年金基金托管等业务资格。

招商银行确立“因势而变、先您所想”的托管理念和“财富所托、信守承诺”的托管核心价值，独创“6S托管银行”品牌体系，以“保护您的业务、保护您的财富”为历史使命，不断创新托管系统、服务和产品：在业内率先推出“网上托管银行系统”、托管业务综合系

统和“6心”托管服务标准，首家发布私募基金绩效分析报告，开办国内首个托管银行网站，成功托管国内第一只券商集合资产管理计划、第一只FOF、第一只信托资金计划、第一只股权私募基金、第一家实现货币市场基金赎回资金T+1到账、第一只境外银行QDII基金、第一只红利ETF基金、第一只“1+N”基金专户理财、第一家大小非解禁资产、第一单TOT保管，实现从单一托管服务商向全面投资者服务机构的转变，得到了同业认可。

招商银行资产托管业务持续稳健发展，社会影响力不断提升，四度蝉联获《财资》“中国最佳托管专业银行”。2016年6月招商银行荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，成为国内唯一获奖项国内托管银行；“托管通”获得国内《银行家》2016中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；7月荣膺2016年中国资产管理【金贝奖】“最佳资产托管银行”；2017年6月再度荣膺《财资》“中国最佳托管银行奖”，“全功能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017中国金融创新“十佳金融产品创新奖”；8月荣膺国际财经权威媒体《亚洲银行家》“中国年度托管银行奖”，进一步扩大我行托管业务在国际资管和托管业界的影响力。

### （三）主要人员情况

李建红先生，招商银行董事长、非执行董事，2014年7月起担任招商银行董事、董事长。英国东伦敦大学工商管理硕士、吉林大学经济管理专业硕士，高级经济师。招商局集团有限公司董事长，兼任招商局国际有限公司董事会主席、招商局能源运输股份有限公司董事长、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司董事长、招商局华建公路投资有限公司董事长和招商局资本投资有限责任公司董事长。曾任中国远洋运输（集团）总公司总裁助理、总经济师、副总裁，招商局集团有限公司董事、总裁。

田惠宇先生，招商银行行长、执行董事，2013年5月起担任招商银行行长、招商银行执行董事。美国哥伦比亚大学公共管理硕士学位，高级经济师。曾于2003年7月至2013年5月历任上海银行副行长、中国建设银行上海市分行副行长、深圳市分行行长、中国建设银行零售业务总监兼北京市分行行长。

王良先生，招商银行副行长，货币银行学硕士，高级经济师。1991年至1995年，在中国科技国际信托投资公司工作；1995年6月至2001年10月，历任招商银行北京分行展览路支行、东三环支行行长助理、副行长、行长、北京分行风险控制部总经理；2001年10月至2006年3月，历任北京分行行长助理、副行长；2006年3月至2008年6月，任北京分行党委书记、副行长（主持工作）；2008年6月至2012年6月，任北京分行行长、党委书记；2012年6月至2013年11月，任招商银行总行行长助理兼北京分行行长、党委书记；2013年11月至2014年12月，任招商银行总行行长助理；2015年1月起担任招商银行副行长；2016年11月起兼任招商银行

董事会秘书。

姜然女士，招商银行资产托管部总经理，大学本科毕业，具有基金托管人高级管理人员任职资格。先后供职于中国农业银行黑龙江省分行，华商银行，中国农业银行深圳市分行，从事信贷管理、托管工作。2002年9月加盟招商银行至今，历任招商银行总行资产托管部经理、高级经理、总经理助理等职。是国内首家推出的网上托管银行的主要设计、开发者之一，具有20余年银行信贷及托管专业从业经验。在托管产品创新、服务流程优化、市场营销及客户关系管理等领域具有深入的研究和丰富的实务经验。

#### （四）基金托管业务经营情况

截至2017年9月30日，招商银行股份有限公司累计托管316只开放式基金。

### 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

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北京分公司

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上海分公司

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）269478562

## 2、其他销售机构

### （1）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：北京市西城区新街口外大街 28 号 C 座 505 室

法定代表人：林义相

电话：010-66045777

传真：010-66045518

联系人：谭磊

客服热线：010-66045678

公司网站：[www.txsec.com](http://www.txsec.com)

### （2）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/>

### （3）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：梁云波

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

（4）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：李娟

客服热线：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

（5）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：上海市徐汇区龙田路195号3C座楼

法定代表人：其实

电话：021-54509998

传真：021-64385308

联系人：高莉莉

客服热线：4001818188

公司网站：1234567.com.cn

（6）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

（7）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](http://www.5ifund.com)

(8) 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

电话：021-50583533

传真：021-50583633

联系人：曹怡晨

客服热线：400-921-7755

公司网站：<http://a.leadfund.com.cn/>

(9) 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](http://www.qianjing.com)

(10) 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路海岸大厦东座1115室，1116室及1307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.ifastps.com.cn

（11）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区深南大道6019号金润大厦23A

法定代表人：高锋

电话：0755-83655588

传真：0755-83655518

联系人：廖苑兰

客服热线：4008048688

公司网站：www.keynesasset.com

（12）大泰金石基金销售有限公司

办公地址：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

法定代表人：袁顾明

联系人：何庭宇

电话：021-20324153

网址：<http://www.dtfunds.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）出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

经办律师：安冬、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：安冬

#### （四）审计基金财产的会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：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

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：俞伟敏

经办注册会计师：陈玲、俞伟敏

## 五、基金的名称

融通通宸债券型证券投资基金。

## 六、基金的类型

契约型开放式。

## 七、基金的投资目标

本基金在严格控制风险的前提下，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。

## 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固定收益类品种，包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、可分离交易可转债的纯债部分、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等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的相关规定）。

本基金不投资于股票、权证等权益类资产，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。

基金的投资组合比例为：

本基金对债券的投资比例不低于基金资产的80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例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

本基金的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略以及资产支持证券投资策略等部分。

### 1、资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。

### 2、利率策略

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对引起利率变化的相关因素进行跟踪和分析，进而对债券组合的久期和持仓结构制定相应的调整方案，以降低利率变动对组合带来的影响。本基金管理人的固定收益团队将定期对利率期限结构进行预判，并制定相应的久期目标，当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，以达到利用市场利率的波动和债券组合久期的调整提高债券组合收益率目的。

### 3、信用策略

本基金将根据不同信用等级债券与同期限国债之间收益率利差的历史数据比较，并结合不同信用等级间债券在不同市场时期利差变化及收益率曲线变化，调整债券类属品种的投资比例，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

本基金还将积极、有效地利用本基金管理人比较完善的信用债券评级体系，研究和跟踪发行主体所属行业周期、业务状况、公司治理结构、财务状况等因素，综合评估发行主体信用风险，确定信用产品的信用风险利差，有效管理组合的整体信用风险。

### 4、类属配置与个券选择策略

本基金根据券种特点及市场特征，将市场划分为企业债、银行间国债、银行间金融债、央行票据、交易所国债等子市场。综合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，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。

本基金从债券票息率、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，从中选择具有较高票息率且暂时被市场低估或估值合理的投资品种。

#### 5、资产支持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

### 十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合指数收益率

中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本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，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前2个工作日在指定媒介上予以公告。

### 十一、风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低风险/收益的产品。

### 十二、基金投资组合报告

本基金托管人招商银行股份有限公司根据基金合同规定，于2018年1月17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9月30日。

#### 8.1 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	500,412,502.97	97.51
	其中：债券	500,412,502.97	97.51
	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	5,000,000.00	0.97
	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	1,779,301.79	0.35
8	其他资产	5,986,337.50	1.17
9	合计	513,178,142.26	100.00

### 8.2 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	30,000,000.00	5.85
	其中：政策性金融债	30,000,000.00	5.85
4	企业债券	50,038,502.97	9.76
5	企业短期融资券	350,987,000.00	68.43
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	69,387,000.00	13.53
9	其他	-	-
10	合计	500,412,502.97	97.57

### 8.3 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	011769017	17 同方 SCP002	500,000	50,185,000.00	9.78
2	011760076	17 国药控股 SCP001	500,000	50,160,000.00	9.78
3	041769004	17 国家核电 CP001	500,000	50,150,000.00	9.78
4	011759071	17 九州通 SCP004	500,000	50,035,000.00	9.76
5	111710384	17 兴业银行 CD384	500,000	49,465,000.00	9.64

#### 8.4 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。

#### 8.5 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.7.1 本期股指期货投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 8.7.2 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。

##### 8.7.3 本期股指期货投资评价

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.8.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 8.8.2 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。

##### 8.8.3 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。

## 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.9.2 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,986,337.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,986,337.50

### 8.9.3 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。

## 十三、 基金的业绩

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。

基金合同生效日为2016年12月21日，基金业绩截止日为2017年6月30日。基金合同生效以来本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表如下：

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
2016年12月21日（基金合同生效日）至2016年12	0.0900%	0.0099%	0.9955%	0.0903%	-0.9055%	-0.0804%

月 31 日						
2017 年上半 年	1.60%	0.02%	-2.11%	0.08%	3.71%	-0.06%

#### 十四、 基金的费用与税收

##### （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、基金的证券交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 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 0.30% 的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，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。

3、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于本基金成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

（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各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 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》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《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 2017 年 8 月 5 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“一、重要提示”部分明确了更新招募说明书内容的截止日期、有关财务数据的截止日期；

2、在“三、基金管理人”部分，根据最新资料进行了更新；

3、在“四、基金托管人”部分，根据最新资料更新了相关信息；

4、在“五、相关服务机构”部分，更新了销售机构的相关信息；

5、在“八、基金份额的申购、赎回与转换”部分，根据最新资料更新了相关信息；

6、在“九、基金的投资”部分，更新了“（九）基金投资组合报告”的内容，更新数据

为本基金 2017 年 1 季度报告中的投资组合数据；

7、在“十、基金的业绩”部分，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；

8、在“二十一、对基金份额持有人的服务”部分，根据最新资料更新了相关信息。

9、在“二十二、其他应披露的事项”部分，对本报告期内的基金公告进行了列表说明。

融通基金管理有限公司

2018 年 2 月 3 日