融通四季添利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2013年第1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

日　　期：二〇一三年四月

重要提示

融通四季添利债券型证券投资基金经中国证监会2011年10月21日证监许可［2011］1683号文核准募集。本基金基金合同于2012年3月1日正式生效。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书；

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。

除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2013年3月1日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年12月31日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日期

2012年3月1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

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：田德军

电话：（0755）26948070

联系人：殷敬东

注册资本：12500万元人民币。

目前的股权结构为：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

董事长田德军先生，经济学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任中信证券股份有限公司投资银行业务主管；上海远东证券有限公司董事长兼总经理；新时代证券有限责任公司总经理。2010年3月至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，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，执业律师。现任南开大学金融学教授（博士生导师）、金融发展研究院副院长（主持工作）。曾经就读伦敦大学伦敦商学院，执教于密歇根大学WDI研究所、北京大学光华管理学院、长江商学院。2011年1月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，教授，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。

董事奚星华先生，经济学硕士。现任融通基金管理有限公司总经理。历任长财证券经纪有限责任公司总裁；恒泰长财证券有限责任公司法定代表人。2012年1月至今，任公司董事。

董事Frederick Reidenbach（弗莱德）先生，毕业于美国宾夕法尼亚州斯克兰顿大学，注册会计师。现任日兴资产管理有限公司执行副总裁兼首席财务官和首席营运官。历任日本富达投资首席行政官；富达投资（Fidelity Investment）旗下子公司KVH电信的首席执行长和首席营运官；日本Aon Risk Service的首席财务官和首席营运官。2010年3月至今，任公司董事。

董事Blair Pickerell（裴布雷）先生，工商管理硕士。现任日兴资产管理香港有限公司亚洲区总裁及全球首席营销总监。历任摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理。2012年1月至今，任公司董事。

董事徐卫东先生，法学硕士。现任融通基金管理有限公司督察长。历任国务院法制办公室（原国务院法制局）财金司一处主任科员；中国证监会基金监管部监管一处处级干部；中国证监会公司监管部副处级干部。2009年4月至今，任中共融通基金管理有限公司支部委员会副书记。2010年3月至今，任公司董事。

2、现任监事情况

监事李先生，经济学硕士。现任融通基金管理有限公司监察稽核部总监。历任北京大学经济管理系讲师；广东省南方金融服务总公司基金部副总经理；广东华侨信托投资公司规划发展部总经理；广州鼎盛投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估公司董事长；天一证券有限责任公司广州营业部总经理及华南业务总部总经理。2004年任融通基金管理有限公司监察稽核部总监。2011年3月至今，任公司监事。

3、公司高级管理人员情况

总经理奚星华先生，经济学硕士。历任黑龙江省证券公司宏观行业研究员；北京时代博讯高科技有限公司投资业务副总经理；长财证券经纪有限责任公司总裁；恒泰长财证券有限责任公司执行董事、法定代表人。2011年1月至今，任公司总经理。

常务副总经理颜锡廉（Allen Yan）先生，工商管理硕士。历任美国富达投资公司财务分析员；日本富达投资公司财务经理；日兴资产管理有限公司财务会计与分析部部长。2011年1月至今，任公司常务副总经理。

副总经理秦玮先生，工学硕士。历任中国工商银行深圳分行格兰信息咨询公司总经理助理；鹏华基金管理有限公司行政部总监；融通基金管理有限公司登记清算部总监、总经理助理等职务。2009年至今，任公司副总经理。

督察长徐卫东先生，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，曾在中国证监会法律部和基金监管部工作，曾是中国证监会公职律师。2011年至今任公司督察长。

4、基金经理

（1）现任基金经理情况

蔡奕奕女士：6年证券从业经验。管理科学硕士，具有证券从业资格。2006年3月至2006年11月，就职于万家基金管理有限公司，担任交易员职务，从事股票债券交易工作；2006年12月至2008年8月，就职于银河基金管理有限公司，担任交易员职务，从事债券交易工作；2008年9月至今，就职于融通基金管理有限公司，历任交易员、行业研究员职务。现任融通易支付货币基金基金经理。

（2）历任基金经理情况

自2012年3月1日至2012年8月31日，由乔羽先生先生和蔡奕奕女士共同担任本基金基金经理。

自2012年9月1日，由蔡奕奕女士担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司投资决策委员会由总经理奚星华先生，常务副总经理颜锡廉（Allen Yan）先生，总经理助理陈晓生先生，基金管理部总监吴巍先生，研究策划部总监邹曦先生，基金交易部总监王冰心先生，基金经理郭恒先生组成。

6、上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545.827元

联系电话：（010）66105799

联系人：赵会军

2、主要人员情况

截至2012年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工157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、安心账户资金、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、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2012年12月，中国工商银行共托管证券投资基金282只，其中封闭式5只，开放式277只。自2003年以来，本行连续九年获得香港《亚洲货币》、美国《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35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。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、场外发售机构

（1）直销机构

基金管理人通过在深圳设立的理财中心、在北京和上海设立的分公司以及网上直销为投资者办理开放式基金开户、认购、申购、赎回、基金转换等业务；

1）融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务深圳小组

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：关澜

联系电话：（0755）26948004

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机构理财部机构销售及服务北京小组

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

邮编：100140

联系人：宋雅萍

联系电话：（010）66190975

3）融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务上海小组

地址：上海市世纪大道8号国金中心汇丰银行大楼6楼601—602

邮编：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

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：曾刚

联系电话：（0755）26948077

（2）代销机构

本基金代销机构：中国工商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、民生银行、招商银行、上海银行、平安银行、北京银行、中信建投证券、信达证券、华龙证券、天相投资、新时代证券、东北证券、民生证券、西部证券、银河证券、国泰君安证券、申银万国证券、国盛证券、华安证券、华泰证券、长江证券、国元证券、海通证券、光大证券、东吴证券、第一创业证券、世纪证券、平安证券、万联证券、渤海证券、国海证券、华福证券、广发证券、中信证券、中信万通证券、招商证券、中信证券（浙江）、恒泰长财证券、恒泰证券。

1）　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

办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：（010）66107900

联系人：陶坤伟

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

2）　中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：王洪章

客服电话：95533

联系人：王琳

电话：（010）66275654

网址：www.ccb.com

3）　中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

4）　交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

联系人：陈铭铭

电话：（021）58781234

网址：www.95559.com.cn

5）　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：董文标

客服电话：95568

联系人：董云巍

网址：www.cmbc.com.cn

6）　招商银行股份有限公司

办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

联系人：邓炳鹏

电话：(0755)83198888

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

7）　上海银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路168号

办公地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：范一飞

开放式基金咨询电话：(021)962888

联系人：张萍

联系电话：(021)68475888

网址：www.bankofshanghai.com

8）　北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址：北京市西城区金融大街甲17号

法定代表人：闫冰竹

联系人：王曦

电话：（010）66223584

客户服务电话：95526

网址：www.bankofbeijing.com.cn

9）　平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路5047号深发展大厦

办公地址：深圳市深南东路5047号深发展大厦

法定代表人：肖遂宁

联系人：芮嵩

电话：（0755）25879756

客户服务电话：95511-3

网址：www.bank.pingan.com

10）　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

11）　海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：李明山

联系人：李笑鸣

电话：（021）23219275

客服电话：4008888001

12）　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：徐浩明

联系人：刘晨

电话：（021）22169081

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

13）　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

法定代表人：胡运钊

联系人：李良

电话：（027）65799999

客服电话：95579或4008-888-999

14）　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：权唐

电话：（010）85130577

客服电话：400-8888-108

15）　民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-18层

法定代表人：余政

联系人：赵明

电话：（010）85252656

客户服务电话：4006198888

16）　中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

法定代表人：杨宝林

联系人：吴忠超

电话：（0532）85022326

客服电话：（0532）96577

17）　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：钱宾

电话：（0551）65161821

客服电话：（0551）96518、400-80-96518

18）　新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法人代表：刘汝军

联系人：孙恺

客服电话：400-698-9898

19）　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号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

联系人：宋明

电话：（010）66568450

客服电话：4008-888-8888

20）　国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

联系人：杨麟军

电话：（0551）2207114

客服电话：95578，4008888777

21）　国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：万建华

联系人：吴倩

客服电话：4008888666

22）　申银万国证券股份有限公司

通讯地址：上海市常熟路171号

法定代表人：储晓明

联系人：曹晖

电话：（021）33388215

客服电话：95523或4008895523

23）　东吴证券股份有限公司

注册地址：苏州工业园区翠园路181号商旅大厦17-21层

法定代表人：吴永敏

联系人：王晓晓

电话：（0512）62938715

客服电话：（0512）33396288

24）　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

法定代表人：宫少林

联系人：邱晓华

电话：（0755）83285134

客服电话：4008888111、95565

25）　平安证券有限责任公司

办公地址：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：郑舒丽

电话：（0755）22626391

客服电话：95511-8

26）　第一创业证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25F

法定代表人：刘学民

联系人：翟丽娜

电话：（010）63197785

客服电话：4008881888

27）　华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼

法定代表人：李晓安

联系人：刘宏波

电话：（0931）8490208

客服电话：96668

28）　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

天相投顾网址：http://www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

29）　信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

联系人：唐静

联系电话：（010）88656476

客服电话：4008008899

30）　华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

法定代表人：黄金琳

联系人：张腾

电话：（0591）87383623

客服电话：（0591）96326

31）　万联证券有限责任公司

注册地址：广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

法定代表人：张建军

联系人：罗创斌

电话：(020)38286651

客服电话：400-8888-133

32）　中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号

法定代表人：王东明

联系人：腾艳

电话：（010）60838832

客服电话：4008895548

33）　渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

联系人：胡天彤

电话：022-28451709

客服电话：4006515988

34）　世纪证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人：卢长才

联系人：袁媛

电话：（0755）83199511

客服电话：（0755）83199599

35）　华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

联系人：施晓艳

电话：（0755）82492193

客服电话：95597

36）　西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16—17层

法定代表人：刘建武

联系人：刘莹

电话：（029）87406649

客服电话：95582

37）　国海证券股份有限公司

注册地址：广西壮族自治区桂林市辅星路13号

法定代表人：张雅锋

联系人：武斌

电话：（0755）83707413

客服电话：95563

38）　东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：（0431）85096517

客服电话：4006000686

39）广发证券股份有限公司

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

电话：（020）87555888-8333

客服电话：95575

40）中信证券（浙江）有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

联系人：周妍

电话：（0571）86078823

客服电话：96598

41）恒泰证券股份有限责任公司

办公地址：吉林省长春市长江路经济开发区人民大街280号科技城2层A-33段

法定代表人：赵晓武

联系人：王楠

电话：（0431）86702865

客服电话：（0431）82951765

42）恒泰证券股份有限公司

办公地址：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：王旭华

电话：（0471）4972343

客服电话：（0471）4961259

（3）基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

2、场内发售机构

（1）具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位（具体名单可在深交所网站查询）。

（2）本基金募集期结束前获得基金代销资格同时具备深交所会员单位资格的证券公司也可代理场内的基金份额发售。具体名单可在深交所网站查询。

（3）尚未取得基金代销资格、但属于深交所会员的其他机构，可在本基金上市交易后，代理投资者通过深交所交易系统参与本基金的上市交易。

（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：北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人：金颖

办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层

联系电话：（010）58598839

联系人：朱立元

（三）律师事务所

名称：广东嘉得信律师事务所

注册地址：深圳市红岭中路国信证券大厦12楼

办公地址：深圳市红岭中路国信证券大厦12楼

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：（0755）33382888（总机）（0755）33033020（直线）15302728596

（四）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

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：杨经信

电话：（021）23238888

联系人：薛竞、刘莉

经办注册会计师：薛竞、王灵

五、基金的名称

融通四季添利债券型证券投资基金

六、基金的类型

契约型，本基金合同生效后两年内封闭运作，在深圳证券交易所上市交易，基金合同生效满两年后，转为上市开放式基金（LOF），名称为融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)。

七、基金的投资目标

在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值。

八、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括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）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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（但需符合中国证监会的相关规定）。

本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、短期融资券、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具。

本基金不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，但可以参与一级市场新股申购或增发新股，并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等。

如法律法规或监管机构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，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于固定收益类金融工具的资产占基金资产的比例不低于80%，其中投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例合计不低于80%；投资于权益类金融工具的资产占基金资产的比例不超过20%；在封闭期结束后，本基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

本基金所指信用债券是指企业债券、公司债券、短期融资券、地方政府债券、商业银行金融债券、商业银行次级债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券等除国债和中央银行票据之外的、非国家信用的固定收益类金融工具。

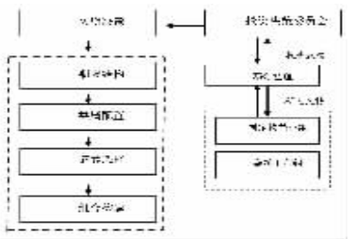
九、基金的投资策略

1、大类资产配置策略

本基金将在基金合同约定的投资范围内，采取稳健的一级资产配置。通过对宏观经济运行状况的研究，积极的调整和优化可转债、信用债等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，获得基金资产的稳定增值；并根据对股票市场的趋势研判及新股申购收益率预测，适度参与一级市场首发新股和增发新股的申购，提高基金总体收益率。

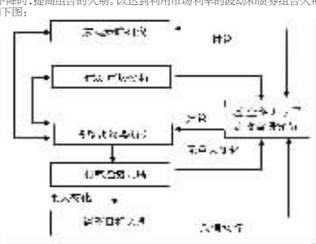
2、固定收益类资产组合投资策略

本基金在债券组合构建过程中，具体的投资策略主要包括：利率策略、信用策略、可转债投资策略、资产支持证券等投资策略。决策体系如下图所示：



（1）利率策略

利率策略指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。通过对宏观经济运行状况和对财政政策、货币政策的深入研究，形成对利率变化方向的预期，主动调整债券投资组合的久期。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。基金目标久期决策流程如下图：



（2）信用策略

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、有效的利用本基金管理公司比较完善的行业研究平台和信用债券评级体系，研究和跟踪发行主体所属行业发展周期、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。

（3）可转换债券的投资策略

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析。本基金还会充分借鉴基金管理人股票分析团队及外部研究机构的研究成果，对可转债的基础股票的基本面进行分析，形成对基础股票的价值评估，最终选择合适的投资品种。

（4）资产支持证券投资策略

资产支持类证券的定价受市场利率、流动性、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率及其它附加条款等多种因素的影响。本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产。

3、新股申购策略

本基金将积极参与新股申购。本基金将积极利用本基金管理公司比较完善的行业研究平台和股票估值体系，分析首次发行股票及增发新股的上市公司基本面因素，再结合股票市场整体定价水平以及新股中签率等因素，判断新股上市交易的合理价格，充分发挥作为机构投资者在新股询价发行过程中的对新股定价所起的积极作用，积极参与新股询价及路演活动，有效识别并防范风险。同时参考一级市场资金利率成本，制定灵活的新股申购策略。

本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定上市后继续持有或者卖出。

十、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为中债综合指数。

如果今后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。基金管理人应在调整前2个工作日在至少一种指定媒体上予以公告。

十一、风险收益特征

本基金属于债券基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

十二、基金投资组合报告

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2013年3月25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。

本投资组合报告所载数据截至2012年12月31日，报告期为2012年10月1日至2012年12月31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

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	固定收益投资	1,588,549,900.00	94.54
	其中：债券	1,588,549,900.00	94.54
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	47,617,446.35	2.83
6	其他资产	44,080,096.17	2.62
7	合计	1,680,247,442.52	100.00

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	578,303,900.00	44.21
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	1,010,246,000.00	77.22
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,588,549,900.00	121.43

3、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

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	1182398	11陕交通MTN1	900,000	92,268,000.00	7.05
2	122103	11航机01	700,000	71,120,000.00	5.44
3	1082131	10TCLMTN2	700,000	68,873,000.00	5.26
4	122135	12宝泰隆	600,000	62,700,000.00	4.79
5	1282069	12中科集MTN1	600,000	61,242,000.00	4.68

4、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。

5、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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

6、投资组合报告附注

6.1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。

6.2其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,615,466.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	214,629.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,080,096.17

6.3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。

本基金合同生效日2012年3月1日，基金业绩截止日为2012年6月30日。

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
2012年3月1日(基金合同生效日)至2012年12月31日	5.96%	0.07%	0.27%	0.06%	5.69%	0.01%

十四、基金费用概览

（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、基金的上市费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

6、基金份额持有人大会费用；

7、基金的证券交易费用；

8、基金的银行汇划费用；

9、基金账户开户费用和银行账户维护费；

10、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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（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0.60%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷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2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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.20%÷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2个工作日内从基金财产中一次性支付。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—10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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

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2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

（五）与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金转为上市开放式基金（LOF）后，投资者通过场内或场外申购本基金份额时需交纳申购费。具体费率如下：

场内/场外申购费	申购金额（M）	申购费率
	M<100万	0.80%
	100万≤M<500万	0.50%
	M≥500万	单笔1000元

2、赎回费

本基金转为上市开放式基金（LOF）后，投资者在场内或场外赎回本基金份额时需交纳赎回费。具体费率如下：

场外赎回费	持有时间（T）	赎回费率
	T<1年	0.50%
	1年≤T<2年	0.25%
	T≥2年	0
场内赎回费	固定值0.50%	

注：上表中，1年以365天计算。

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，赎回费总金额的25%归基金财产所有，其余部分用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

基金管理人可以在法律法规和基金合同规定范围内调整申购费率和赎回费率。费率如发生变更，基金管理人应在调整实施日前2个工作日在至少一家指定媒体及基金管理人网站上刊登公告。

基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

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2012年10月15日刊登的本基金招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

一、在“三、基金管理人”部分：“（二）主要人员情况”中更新了董事信息和投资决策委员会成员信息。

二、在“四、基金托管人”部分，更新了“（一）基金托管人概况”的“主要人员情况”与“基金托管业务经营情况”和“（二）基金托管人的内部控制制度”的相关信息。

三、在“五、相关服务机构”部分，“（一）基金份额发售机构”部分更新了部分直销机构和代销机构相关联系信息；新增恒泰证券股份有限公司为本基金的代销机构。

四、在“十、基金的投资”部分；更新了“（十二）基金投资组合报告”的内容，数据为本基金2012年4季度报告中的投资组合数据。

五、新增“十一　基金的业绩”部分；列示了自基金合同生效日以来至2012年12月31日止的投资业绩数据。

六、在“二十四、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
2013年4月12日

证券代码：002205　　证券简称：国统股份　　编号：2013－022

新疆国统管道股份有限公司中标提示性公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整，没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2013年4月10日晚间，保定市南水北调工程建设委员会办公室在河北省南水北调网发布中标候选人公示公告（网址http://www.hebnsbd.gov.cn/syscolumn/tzgg/gggs/index.html），确定我公司为“河北省南水北调配套工程保沧干渠工程保定段PCCP管道制造第五标段”第一中标候选人。中标金额为人民币贰亿零捌佰肆拾陆万贰仟叁佰柒拾贰元整（208,462,372元）。公示期间为4月10日－12日。

一、业主方及项目基本情况

1、项目业主方：保定市南水北调工程建设委员会办公室，隶属河北省南水北调办公室。

2、项目名称：河北省南水北调配套工程保沧干渠工程保定段PCCP管道制造第五标段

3、项目基本情况：

标段长度为30.964km，包含南干线（起点桩号SG0+000，终点蠡县肃宁界桩号SG9+164），为DN2000PCCP单管布置；北干线(起点桩号NG0+000，终点桩号NG21+800)，为DN2000PCCP双管布置。标段主要工作内容为对应于该桩号范围内的DN2000PCCP管材和PCCP管配件的结构设计、阴极保护设备埋设、承插口防腐、检测、制造、运输等。

4、2012年度，公司未与业主方发生类似业务。

5、公司与业主方不存在任何关联关系。

二、中标对公司的影响

1、本次中标金额占公司2012年度经审计的营业总收入的44.13%。该工程总工期计划为16个月，2013年5月起供货。年均合同执行金额104,231,186元，占公司2012年度经审计的营业总收入的22.