融通四季添利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2014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：二〇一四年四月

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。

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，本基金已于2014年3月3日转为上市开放式基金（LOF）。

除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2014年3月1日，有关财务数据截止日为2013年12月31日。

一、基金合同生效日

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：敖敬东
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。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。

董事涂卫东先生，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；中国证监会公职律师。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

监事李华先生，经济学硕士，现任公司监察稽核部总监。曾任北京大学经济管理系讲师，1993 年起历任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、广州鼎源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。2011 年至今任公司监事。

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企划与分析部部长。2011年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：8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的基金经理、融通岁岁添利定期开放债券基金的基金经理。

（2）历任基金经理情况

自2012年3月1日至2012年8月31日，由乔羽夫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2013年12月末，中国工商银行资产托管部共有员工176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、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2013年12月，中国工商银行共托管证券投资基金358只。自2003 年以来，本行连续十年获得香港《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41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
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：关澜
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
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：宋雅萍
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：居雯莉
联系电话：（021）38424888转4984
传真：（021）38424884

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：刘晶
联系电话：（0755）26948105

（2）代销机构

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：陶仲伟
客户服务电话：95588

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

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：田国立
客户服务电话：95566

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：牛锡明
客服电话：95559
联系人：张作伟
电话：（021）58781234

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

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：邓炯鹏
电话：(0755)83198888
客服电话：95555

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：汤征程
联系电话：(021)68475888

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

9）平安银行股份有限公司
注册办公所：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号
法定代表人：肖遂宁
联系人：张莉
电话：021-38637673
客户服务电话：95511-3

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：周欣玲
电话：（0791）86281305
客服电话：4008222111

11）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：李笑鸣
电话：（021）23219275
客服电话：4008888001或95553

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：袁长清（代行）
联系人：丁梅
电话：（021）22169130
客服电话：95525

13）长江证券股份有限公司
注册地址：武汉市江汉区新华路特8号
法定代表人：胡运钊
联系人：孙昊
电话：（021）68752206
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：张颢
电话：（010）85156398
客服电话：400-8888-108或95587

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：山东省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：95548

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：钱欢
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
电话：（010）83561149
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2-6层
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：杨鹏军
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
电话：（021）38676767
客服电话：4008888666

22）申银万国证券股份有限公司
通讯地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人：储晓明
联系人：曹晔
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：苏州工业园区星阳街5号
法定代表人：范力
联系人：方晓丹
电话：（0512）65581136
客服电话：40086015555

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：黄蝉君
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25、26层
法定代表人：刘学民
联系人：温丽娜
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：邓鹏怡
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
传真：010-66045521

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：张志刚
联系人：鹿馨方
联系电话：010-63080994
客服电话：4008008899

30）华福证券有限责任公司
注册地址：福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
法定代表人：黄金琳
联系人：张宗锐
电话：0591-87383600
客服电话：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18、19楼全层
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：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
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
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：胡三鲁
电话：0755-83199599-8166
客服电话：（0755）83199509

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
法定代表人：吴万善
联系人：庞晓芸
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：李珊
电话：（0571）85776114
客服电话：95548

41）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：魏巍
电话：0471-4974437
客服电话：（0471）4961259

42）北京展恒基金销售有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
法定代表人：闫振杰
联系人：王婉秋
电话：010-62020088
传真：010-62020355
客服电话：400-888-6661

（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：北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人：周明
办公地址：北京市西城区太平桥大街17号
联系电话：（010）59378856
联系人：崔巍

（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（特殊普通合伙）
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：杨绍信
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)。

本基金已于2014年3月3日（封闭期届满之日）按照有关法律法规的规定和本基金合同的约定转为上市开放式基金（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（但须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。

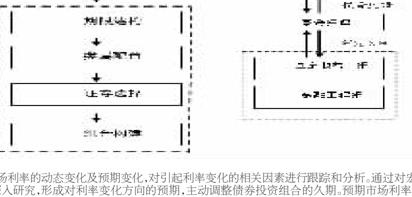
九、基金的投资策略

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。

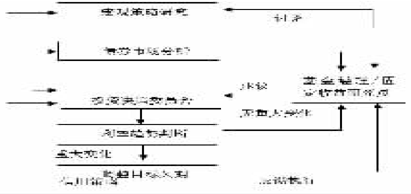
2、固定收益类资产组合投资策略

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情况和对财政政策、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）资产支持证券等的投资策略

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2014年3月20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2013年12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	固定收益投资	1,350,384,046.76	67.77
	其中：债券	1,350,384,046.76	67.77
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	150,000,545.00	7.53
	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	116,762,203.03	5.86
6	其他资产	375,449,313.15	18.84
7	合计	1,992,596,107.94	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	619,189,046.76	49.25
5	企业短期融资券	19,962,000.00	1.59
6	中期票据	711,233,000.00	56.57
7	可转债	–	–
8	其他	–	–
9	合计	1,350,384,046.76	107.41

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	101360018	13乌城投MTN1	800,000	78,384,000.00	6.23
2	1082131	10TCLMTN2	700,000	67,445,000.00	5.36
3	1282011	12津水集MTN1	500,000	50,355,000.00	4.01
4	124387	13湛基投	500,000	49,977,216.44	3.98
5	101373002	13华信资产MTN001	500,000	47,985,000.00	3.82

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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、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

本基金本报告期末投资国债期货。

（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。

（3）本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7、投资组合报告附注

7.1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。

7.2其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	41,801.47
2	应收证券清算款	339,999,817.70
3	应收股利	–
4	应收利息	35,407,693.98
5	应收申购款	–
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	375,449,313.15

7.3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2013年12月31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%
2013年度	0.92%	0.09%	-3.75%	0.08%	4.67%	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、证券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：

$H = E \times 0.60\% \div 当年天数$

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0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div 当年天数$

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—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。本基金的申购费按申购金额采用比例费率，投资人在一天之内如果有多笔申购，适用费率按单笔分别计算。具体费率如下：

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

（2）赎回费率

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：

	持有时间（T）	赎回费率
场外赎回费	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2013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“一、释义”部分，对《基金法》、《销售办法》、《运作办法》、基金资产总值和基金资产净值的释义进行了更新。

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。

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2013年4季度报告中的投资组合数据。

五、在“十一 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。

六、在“第二十三节 对基金份额持有人的服务”部分，对“定制服务”和“在线服务”进行了更新；

七、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
2014年4月15日

证券代码：600418　证券简称：江淮汽车　公告编号：2014-018

安徽江淮汽车股份有限公司重大资产重组停牌公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

公司4月13日接到控股股东安徽江淮汽车集团有限公司（以下简称"江汽集团"）的通知，于4月14日申请因重要事项未公告停牌一天。

根据江汽集团的通知，江汽集团拟通过重大资产重组方式实现整体上市，该事项将对公司构成重大资产重组。鉴于相关事项尚存在不确定性，为保证公平信息披露，维护投资者利益，避免公司股价异常波动，经公司申请，公司股票自2014年4月15日起停牌，停牌不超过30天。

本公司承诺将按照《上市公司重大资产重组管理办法》及其他有关规定，组织审计机构、评估机构、法律顾问和独立财务顾问等相关中介机构开展审计、评估、法律及财务顾问等各项工作。停牌期间公司将根据重大资产重组的进展情况，及时履行信息披露义务，每五个交易日发布一次有关事项的进展公告。待相关工作完成后召开董事会审议重大资产重组预案，及时公告并复牌。

如公司未能在上述期限内披露重大资产重组预案或报告书，公司将根据重组推进情况确定是否向上海证券交易所申请延期复牌。

特此公告。

安徽江淮汽车股份有限公司董事会
2014年4月15日

证券代码：002212　证券简称：南洋股份　公告编号：2014-014

广东南洋电缆集团股份有限公司第三届董事会第三十次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏承担责任。

广东南洋电缆集团股份有限公司(下称"公司")第三届董事会第三十次会议于2014年4月12日上午9:30在公司三楼会议室以现场表决的形式召开，会议通知于2014年4月9日以传真、电子邮件等通讯方式向全体董事发出。应到董事9名，实到董事9名，实际表决的董事9名。郑钟南董事长主持会议。会议的召集和召开符合《中华人民共和国公司法》和《公司章程》的有关规定。会议审议通过了以下议案：

一、以9票同意，0票反对，0票弃权，审议并通过关于修订《期货套期保值业务操作管理制度》的议案

为规范公司的套期保值业务，发挥套期保值业务在公司原材料采购中规避价格风险的功能，根据商品交易所有关期货交易规则、深圳证券交易所《中小企业板信息披露业务备忘录第25号》及《公司章程》的规定，修订本管理制度。

修订后的《期货套期保值业务操作管理制度》于2014年4月15日刊登在巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）。

二、以9票同意，0票反对，0票弃权，审议并通过关于修订《投资者关系管理制度》的议案

为了加强和规范公司与投资者和潜在投资者（以下统称"投资者"）之间的信息沟通，促进投资者对公司的了解和认同，进一步完善公司法人治理结构，实现公司价值最大化和股东利益最大化，根据《关于切实做好上市公司投资者投诉处理工作的通知》（广东证监[2014]28号）的要求及《中华人民共和国公司法》、《中华人民共和国证券法》、深圳证券交易所《股票上市规则》、《公司章程》等有关法律法规的规定，结合本公司实际，修订本制度。

修订后的《投资者关系管理制度》于2014年4月15日刊登在巨潮资讯网（www.cninfo.com.cn）。

特此公告！

广东南洋电缆集团股份有限公司
董事会
二〇一四年四月十五日

证券代码：002603　证券简称：以岭药业　公告编号：2014-031

石家庄以岭药业股份有限公司关于2014年第一次临时股东大会决议公告的更正公告

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

石家庄以岭药业股份有限公司（以下简称"公司"）于2014年4月14日披露了《2014年第一次临时股东大会决议公告》（公告编号：2014-029）。由于工作失误，误将该公告中一项议案名称披露错误。现更正如下：

原披露内容为："1、审议通过了《关于变更公司经营范围的议案》。"

现更正为："1、审议通过了《关于增加公司经营范围的议案》。"

由此给投资者造成不便，公司特致以深深的歉意。

特此公告。

石家庄以岭药业股份有限公司
董事会
2014年4月14日

证券代码：600346　证券简称：大橡塑　编号：临2014-018

大连橡胶塑料机械股份有限公司筹划重大事项停牌公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、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。

大连橡胶塑料机械股份有限公司（以下简称"公司"）正在筹划重大事项。鉴于该事项尚存在不确定性，为保证公平信息披露，保护广大投资者利益，避免公司股价异常波动，根据上海证券交易所《股票上市规则》及相关规定，经公司申请，公司股票自2014年4月14日上午开始起停牌。

公司承诺：将尽快确定是否筹划上述重大事项，并于股票停牌之日起的5个工作日内（含停牌当日）公告并复牌。

特此公告。

大连橡胶塑料机械股份有限公司
董 事 会
2014年4月14日

证券代码：002306　证券简称：湘鄂情　公告编号：2014-56

北京湘鄂情集团股份有限公司2014年第一季度业绩预告修正公告

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。

特别提示：

合肥天焱公司业务没有明显的季节性或周期性，合肥天焱公司今后业绩取决于市场环境情况、经营团队努力程度等多种因素影响，存在一定的不确定性，请广大投资者注意投资风险。

一、预计的本期业绩情况

1、业绩预告期间：2014年1月1日至2014年3月31日

2、前次业绩预告情况：

北京湘鄂情集团股份有限公司（简称“公司”）于2013年3月3日在指定信息披露媒体刊登的《2014年第一季度业绩预告修正公告》(以下简称“前次预告”)中预计：2014年1月至3月归属于上市公司股东的净利润变动区间为盈利6000万元人民币至7000万元人民币。

3、修正后的预计业绩

□亏损　√扭亏为盈　□同向上升　□同向下降　□其他

项　目	本报告期	上年同期
归属于上市公司股东的净利润	盈利：3000万元至4000万元	亏损：6840.09万元

二、业绩预告修正预审计情况

本次业绩预告修正未经会计师事务所预审计。

三、业绩修正原因说明

根据2014年第一季度经营完成情况，与前次预告存在业绩差距的主要原因是：第一，合肥天焱部分订单未能达到2014年一季度销售收入的确认条件。公司原先根据合肥天焱的业务情况预计2014年一季度盈利5000-7000万元，根据现有的交货进度及财务核算数据，合肥天焱盈利调减至4000万元左右。

第二，公司原先计划的出售部分房产将产生1300万元盈利，因交易进度原因，未能在2014年一季度完成出售。

第三，酒楼业务亏损较前次预告有所增加。酒楼业务客源的稳定性难以准确掌握的因素，前次预告的亏损数由原先的4000万增加至4500万左右。

四、其他相关说明

1、本次公司2014年第一季度业绩修正是公司初步测算的结果，具体财务数据以公司未来披露的2014年第一季度报告为准；

2、公司董事会对本次业绩预告修正给投资者带来的不便致以诚挚的歉意，敬请投资者注意投资风险。

特此公告

北京湘鄂情集团股份有限公司
董事会
二〇一四年四月十三日

证券代码：002270　证券简称：法因数控　公告编号：[2014]010号

山东法因数控机械股份有限公司关于持股5%以上股东减持股份的公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

山东法因数控机械股份有限公司（以下简称“公司”）于2014年4月11日收到公司持股5%以上股东管彤先生减持公司股份的通知。2013年12月11日至2014年4月11日期间，管彤先生减持其所持有的本公司股份6,133,400股，占公司总股本的3.2426%。减持后，管彤先生持有公司股份9,326,322股，占公司总股本的4.9306%，其中流通股1,596,461股，限售股7,729,861股。具体情况如下：

一、股东减持情况

1、股东减持股份情况

股东名称	减持方式	减持期间	减持均价（元）	减持股数（万股）	减持比例（%）
管　彤	大宗交易	2013年12月11日	5.950	490.00	2.5905
	集中竞价	2014年2月14日——2014年2月24日	9.647	65.59	0.3468
		2014年3月31日	8.073	4.38	0.0231
		2014年4月1日——2014年4月11日	8.268	53.37	0.2822
合　计		——	——	613.34	3.2426

2、股东本次减持前后持股情况

股东名称	股份性质	本次减持前持有股份		本次减持后持有股份	
		股数(万股)	占总股本比例(%)	股数(万股)	占总股本比例(%)
管彤	合计持有股份	1545.9722	8.1732	932.6322	4.9306
	其中：无限售条件股份	772.9861	4.0866	159.6461	0.8440
	有限售条件股份	772.9861	4.0866	772.9861	4.0866

二、其他相关说明

1、本次减持未违反《上市公司解除限售存量股份转让指导意见》、《上市公司收购管理办法》、《深圳证券交易所中小企业板上市公司规范运作指引》等有关法律、法规、规章、业务规则的规定；

2、本次权益变动后，管彤先生合计持有公司4.9306%的股份，不再是公司持股5%以上的股东。

3、本次权益变动情况详见2014年4月15日巨潮资讯网《简式权益变动报告书》。

三、备查文件

《简式权益变动报告书》

特此公告。

山东法因数控机械股份有限公司
董事会
二〇一四年四月十四日