融通通源短融债券型证券投资基金招募说明书摘要

(2016年第1号)

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

二〇一六年六月

重要提示

融通通源短融债券型证券投资基金(以下简称"本基金")由融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型而成,融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1294号)和《关于融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2013]984号)注册。《融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2013年12月31日正式生效。

融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金2014年10月17日,2014年10月20日及2014年10月21日的份额累计净值分别为1.101元,1.100元及1.100元。即融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金累计份额净值已于2014年10月21日触发"连续3个工作日不低于1.10元"的封闭期提前到期条件,基金管理人按照基金合同的约定,提前结束融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金的封闭运作并进入过渡期,过渡期结束后的下一日(2014年10月30日)起,融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型为"融通通源短融债券型证券投资基金"。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。中国证监会对本基金募集的准予注册,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。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,应全面了解本基金的产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。

投资人购买本基金时应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。投资者购买本基金份额的行为视为同意基金合同的约定。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为2016年4月30日,有关财务数据截止日为2016年3月31日,本招募说明书中的财务数据未经审计

一、基金合同生效日

融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基合同生效日:2013年12月31日。

融通通源短融债券型证券投资基金合同生效日:2014年10月30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

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)26948070

联系人:刘宏

目前公司股东及出资比例为: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(美国)首席执行官,巴克莱集团,财富管理(美国)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。

董事孟朝霞女士,经济学硕士,现任融通基金管理有限公司总经理。历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理、富国基金管理有限公司副总经理。2015年2月至今,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,简历同上。

总经理孟朝霞女士,经济学硕士,历任新华人寿保险股份有限公司企业年金管理中心总经理、泰康养老保险股份有限公司副总经理,富国基金管理有限公司副总经理。2014年9月至今,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策划总监,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3月至今,任公司督察长。

4.基金经理

(1)现任基金经理情况

王超先生,厦门大学金融工程硕士,华中科技大学经济学、数学双学士,8年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司固定收益部总监助理。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易盘投资与理财投资管理经理、2012年8月加入融通基金管理有限公司,2013年12月27日起至今任"融通标普中国可转债指数型证券投资基金"、"融通债券投资基金"基金经理、2014年11月7日起至今任"融通通源短融债券型证券投资基金"基金经理、2015年3月14日起至今任"融通四季添利债券证券投资基金(LOF)"、"融通岁岁添利定期开放债券证券投资基金"基金经理、2015年6月23日起至今任"融通通瑞债券型证券投资基金"基金经理。

王海先生,南开大学经济学硕士,12年证券投资从业经历,具有基金从业资格。历任中国工商银行深圳市分行外汇及衍生品交易员、招商银行总行金融市场部交易员、东莞证券固定收益类产品投资经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司,2015年1月6日起至今任"融通易支付货币市场证券投资基金"、"融通汇财宝货币市场基金"基金经理,2015年1月21日起至今任"融通通源短融债券型证券投资基金"基金经理,2016年4月1日起至今任"融通增利债券型证券投资基金"基金经理。

(2)历任基金经理情况

自2013年12月31日起至2014年1月3日,由周珺先生担任本基金的基金经理。

自2014年1月4日起至2014年11月5日,由周珺先生和丁经纬先生共同担任本基金的基金经理。

自2014年11月7日起至2015年1月20日,由王超先生担任本基金的基金经理。

自2015年1月21日起至今,由王超先生、王海先生共同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:固定收益投资总监孙海忠先生,固定收益部总经理、基金经理张一格先生,固定收益部总监助理、基金经理王超先生,基金交易部副总经理谭奕丹先生,风险管理部副总经理马洪元先生。

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:中国农业银行股份有限公司(简称中国农业银行)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:刘士余

成立日期:2009年1月15日

批准设立机关和批准设立文号:中国银监会银监复[2009]13号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[1998]23号

注册资本:32,479,411.7万元人民币

存续期间:持续经营

联系电话:010-66060069

传真:010-68121816

联系人:林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京。经国务院批准,中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年1月15日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务领域最广、服务对象最多、业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉。每年位居《财富》世界500强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"伴你成长"服务品牌,依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,2004年被英国《全球托管人》评为中国"最佳托管银行"。2007年中国农业银行通过了美国SAS70内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届"·金牌理财"TOP10颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,2004年9月更名为托管业务部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处,拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

2.主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工140余名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3.基金托管业务经营情况

截止2016年3月31日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共334只。

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:陈思辰

联系电话:(0755)26948034

传真:(0755)26935139

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室

邮编:100033

联系人:魏聪薇

联系电话:(010)66190989

传真:(010)88091635

(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:杨熙

联系电话:(021)38424950

传真:(021)38424884

(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:殷洁

联系电话:(0755)26947856

传真:(0755)26948079

2.代销机构

(1)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

法定代表人:杨德红

联系人:冯敏祺

传真:(021)38676161

客服电话:4008888666

(2)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:许梦园

电话:(010)85130236

客服电话:400-888-8108

(3)国信证券股份有限公司

注册地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人:何如

联系人:周杨

电话:(0755)82134993

客服电话:95536

(4)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:侯艳红

电话:(010)60838995

客服电话:4008895548

(5)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

(6)申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人:李梅

联系人:曹晔

电话:(021)33388215

客服电话:4008895523

(7)长江证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市江汉区新华路特8号

法定代表人:杨泽柱

联系人:戴博宇

电话:(021)68751860

客服电话:95579或4008-888-999

(8)华泰证券股份有限公司

注册地址:江苏省南京市江东中路228号

法定代表人:吴万善

联系人:庞晓芸

电话:(0755)82492193

客户服务电话:95597

(9)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

法定代表人:侯巍

联系人:邓颖睿

联系电话:(0351)8686796

客服电话:95573

(10)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

法定代表人:杨宜林

联系人:赵艳青

电话:(0532)85023924

客服电话:95548

(11)东吴证券股份有限公司

注册地址:苏州市工业园区星阳街5号

法定代表人:范力

联系人:方晓丹

电话:(0512)65581136

客服电话:4008601555

(12)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

法定代表人:张志刚

联系人:鹿馨方

电话:(010)63080994

客服电话:4008008899

(13)长城证券股份有限公司

注册地址:深圳福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17楼

法定代表人:黄耀华

联系人:刘阳

电话:(0755)83516289

客服电话:4006666888

(14)新时代证券股份有限公司

注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人:田德军

联系人:田芳芳

电话:(010)83561146

客服热线:400-6989-888

(15)平安证券有限责任公司

注册地址: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:周一涵

电话:(021)38637436?

客服电话:95511转8

(16)恒泰证券股份有限公司

注册地址:内蒙古呼和浩特市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:魏巍

电话:(0471)4974437

客服电话:(0471)4961259

(17)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:马跃进

法定代表人:薛小菲

联系:0791-86283080

客服电话:4008222111

(18)中万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人:李季

联系人:李巍

电话:010-88085858

客户服务电话:400-800-0562

(19)第一创业证券股份有限公司

注册地址: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:毛诗莉

电话:(0755)25831754

客服电话:4008881888、95358

(20)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:黄柳君

电话:(0755)82943511

客服电话:4008888111、95565

(21)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3楼

法定代表人:薛峰

联系人:刘晨

电话:(021)22169081

客服电话:95525、400-8888-788

(22)中国国际金融股份有限公司

注册地址:北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人:丁学东

电话:010-85679888-6035

联系人:秦朗

客服电话:4009101166

(23)国金证券股份有限公司

注册地址:成都市东城根上街95号

法定代表人:冉singe

电话:028-86690057

联系人:刘婧漪

客服电话:4006-600109

(24)中信期货有限公司

注册地址: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

电话:0755-82791065

联系人:吴丹

客服热线:4009908826

(25)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

法定代表人:李玮

电话:021-20315255

联系人:许曼华

客服电话:95538

(26)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

法定代表人:余维佳

电话:023-63786141

联系人:张熙

客服电话:4008096096

(27)北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址:北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座28层

法定代表人:蒋煜

联系人:尚瑾

电话:010-58170925

客服电话:4008188866

(28)中国工商银行股份有限公司

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:娄建清

电话:(010)66107900

(29)上海银行股份有限公司

注册地址:上海市中山东路585号

法定代表人:范一飞

联系电话:(021)63371293

业务联系人:汤征程

(30)中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:赵欢

客户服务电话:95599

(31)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

(32)深圳众禄基金销售有限公司

注册地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼I、J单元

法定代表人:薛峰

联系人:童彩平

电话:(0755)33227950

(33)上海天天基金销售有限公司

注册地址:上海市浦东新区娥山路613号6幢551室

办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座9楼

法定代表人:其实

联系人:练兰兰

电话:(021)54509988

(34)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:蒋蕾

电话:(021)58870011

(35)杭州数米基金销售有限公司

注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

联系人:周嬿旻

电话:(0571)28829790 (021)60897869

客服电话:4000-766-123

(36)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

法定代表人:张跃伟

联系人:吕朦

电话:(021)58788678

(37)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

客服电话:400-888-6661

(38)中期资产管理有限公司

注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路16号1幢11层

法人代表:朱剑林

电话:400-8888-160

联系人:朱剑林

客服电话:95162、4008888160

(39)深圳腾元基金销售有限公司

注册地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)单元

办公地址:深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心主楼4F(07)单元

法定代表人:曾革

联系人:王臧萍

电话:0755-33376853

客服电话:4006-877-899

(40)宁波银行股份有限公司

办公地址:宁波市鄞州区宁南南路700号24层

法定代表人:陆华裕

客户服务电话:95574

联系人:邱甄

电话:0574-87050397

(41)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

联系人:文雯

电话:010-83363101

(42)厦门市鑫鼎盛控股有限公司

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:李智磊

联系电话:0592-3122679

传真:0592-3122701

客服热线:0592-3122716

公司网站:www.xds.com.cn

(43)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

注册地址:上海市金山区廊下镇漕廊公路7650号205室

法定代表人:汪静波

联系人:方成

电话:021-38602377

传真:021-38509777

(44)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

法定代表人:凌顺平

电话:0571-88911818

传真:0571-88911818-8001

客服电话:95525

(45)北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012

法定代表人:赵荣春

客服电话:400-893-6885

(46)上海汇付金融服务有限公司

注册地址:上海市黄浦区中山南路100号19层

办公地址:上海市黄浦区中山南路100号金外滩国际广场19层

法定代表人:冯修敏

电话:021-33323999

传真:021-33323830

联系人:陈云卉

客服热线:400-820-2819

公司网站:www.fund.bundtrade.com

(47)深圳富济财富管理有限公司

办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室

法定代表人:齐小贺

电话:0755-83999907

联系人:马力佳

(48)上海陆金所资产管理有限公司(仅代销前端)

办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼

法定代表人:郭坚

联系人:宁博宇

电话:021-20665952

客户服务电话:4008219031

(49)珠海盈米财富管理有限公司(仅代销前端)

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

传真:020-89629011

联系人:黄敏嫦

电话:020-89629099

客服热线:020-89629066

(二)基金注册登记机构

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)律师事务所

名称:广东嘉得信律师事务所

注册地址:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201

办公地址:深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201

法定代表人:倪齐双

联系人:崔卫群

经办律师:倪齐双 崔卫群

电话:075533033096(直线) 13480989076

传真:075533033086

(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)

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

融通通源短融债券型证券投资基金

六、历史沿革

本基金由融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型而成,融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金经中国证监会《关于核准融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》(证监许可[2013]1294号)和《关于融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金募集时间安排的确认函》(基金部函[2013]984号)核准募集。《融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2013年12月31日正式生效。

融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金2014年10月17日、2014年10月20日及2014年10月21日的份额累计净值分别为1.101元,1.100元及1.100元。即融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金累计份额净值已于2014年10月21日触发"连续3个工作日不低于1.10元"的封闭期提前到期条件,基金管理人按照基金合同的约定,提前结束融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金的封闭运作并进入过渡期,过渡期结束后的下一日(2014年10月30日)起,融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型为"融通通源短融债券型证券投资基金"。

根据融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同的约定,转型后基金合同、托管协议和招募说明书分别变更为《融通通源短融债券型证券投资基金基金合同》、《融通通源短融债券型证券投资基金托管协议》和《融通通源短融债券型证券投资基金招募说明书》,调整的内容包括但不限于转型后的基金名称、投资目标、投资范围、投资限制、投资策略以及基金费率等。自过渡期结束后的下一日(2014年10月30日)起,《融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效,《融通通源短融债券型证券投资基金基金合同》生效,融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型为融通通源短融债券型证券投资基金。

七、基金的类型

债券型证券投资基金

八、投资目标

通过基金管理人对以短期融资券和超级短期融资券为主的债券的深入研究和对市场环境的判断,选择具有投资价值的债券,严格控制风险,力争实现超过业绩比较基准的投资回报。

九、投资范围

融通通源短融债券型证券投资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短期融资券、超级短期融资券、国家债券、金融债券、次级债券、中央银行票据、企业债券、公司债券、中期票据、可分离交易可转债的纯债、资产支持证券、回购和银行存款等金融工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他债券资产。

本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购和新股增发。同时本基金不参与可转换债券以及可分离交易可转债投资(纯债部分除外)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,其中投资于短期融资券和超级短期融资券、剩余期限在1年之内的中期票据、公司债、企业债的比例不低于投资于非现金基金资产的80%,该债券基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例不低于5%。上述所指短融包括短期融资券和超级短期融资券、剩余期限在1年之内的中期票据、公司债、企业债。

十、投资策略

1.资产配置策略

本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和类属资产配置。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例;在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。

(1)整体资产配置策略

通过对国内外宏观经济状况、市场利率走势、市场资金供求情况,以及证券市场走势、信用风险情况、风险预算和有关法律法规等因素的综合分析,在整体资产之间进行动态配置,确定资产的最优配置比例和相应的风险水平。

(2)类属资产配置策略

在整体资产配置策略的指导下,根据资产的风险来源、收益来水平、利息税务处理以及市场流动性等因素,将市场细分为普通债券(含国债、金融债、央行票据、企业债、短期融资券等)、资产证券化产品等子市场,采取积极投资策略,定期对投资组合类属资产进行最优化配置和调整,确定类属资产的最优权数。

(3)明细资产配置策略

在明细资产配置上,首先根据明细资产的剩余期限、资产信用等级、流动性指标决定是否纳入组合;其次,根据个别债券的收益率(到期收益率、票面利率、利息支付方式、利息税务处理)与剩余期限的配比,对照基金的收益要求决定是否纳入组合;最后,根据个别债券的流动性指标(发行总量、流通量、上市时间),决定投资总量。

2.普通债券投资策略

本基金在普通债券的投资中主要基于对国家财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的动态跟踪,采用久期控制下的主动性投资策略,主要包括:久期控制、期限结构配置、信用风险控制、跨市场套利和相对价值判断等管理手段,对债券市场、债券收益率曲线以及各种债券价格的变化进行预测,相机而动、积极调整。

(1)久期控制是根据对宏观经济发展状况、金融市场运行特点等因素的分析确定组合的整体久期,有效的控制整体资产风险;

(2)期限结构配置是在确定组合久期后,针对收益率曲线形态特征确定合理的组合期限结构,包括采用集中策略、两端策略和梯形策略等,在长期、中期和短期债券间进行动态调整,从长、中、短期债券的相对价格变化中获利;

(3)信用风险控制是通过对宏观经济形势、基准利率走势、资金面状况、行业以及个券信用状况的研判,积极主动发掘收益充分覆盖风险、甚至在覆盖之余还存在超额收益的投资品种;同时通过行业及个券信用等级限定、久期控制等方式有效控制投资信用风险;

(4)跨市场套利根据不同债券市场间的运行规律和风险特性,构建和调整债券组合,提高投资收益,实现跨市场套利;

(5)相对价值判断是根据对同类债券的相对价值判断,选择合适的交易时机,增持相对低估、价格将上升的债券,减持相对高估、价格将下降的债券。

3.资产证券化产品投资策略

证券化是将缺乏流动性但能够产生稳定现金流的资产,通过一定的结构化安排,对资产中的风险与收益进行分离组合,进而转换成可以出售、流通,并带有固定收入的证券的过程。

资产证券化产品的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响,本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上,对资产证券化产品的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析,采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略,投资于资产证券化产品。

十一、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:一年期定期存款利率(税后)

其中,人民币一年期定期存款利率是指中国人民银行规定的一年期金融机构人民币存款基准利率。未来,如果商业银行可以自由调整存款利率,管理人将与托管人协商确定基准利率。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时,并且更接近本基金的风格时,经基金托管人同意,本基金管理人在履行适当程序之后,可选用新的比较基准,并将及时公告。

十二、风险收益特征

本基金为较低风险、较低收益的债券型基金产品,其风险收益水平高于货币市场基金,但低于混合型基金和股票型基金。

十三、基金投资组合报告

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2016年5月10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2016年3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	998,289,772.60	97.42
	其中:债券	998,289,772.60	97.42
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	10,000,135.00	0.98
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,238,298.57	0.71
7	其他资产	9,243,135.49	0.90
8	合计	1,024,771,341.66	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	149,400,507.20	20.09
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	116,802,265.40	15.70
5	企业短期融资券	711,487,000.00	95.66
6	中期票据	20,600,000.00	2.77
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	998,289,772.60	134.23

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	019513	15国债13	600,000	60,192,000.00	8.09
2	041560117	15内蒙电投CP001	500,000	50,245,000.00	6.76
3	011699031	16微公用SCP001	500,000	50,045,000.00	6.73
4	011699043	16南电SCP001	500,000	50,015,000.00	6.72
5	011699227	16五矿股SCP001	500,000	49,960,000.00	6.72

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。

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。

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。

7.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.2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。

7.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.投资组合报告附注

8.1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。

8.2其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	40,666.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,151,268.63
5	应收申购款	51,200.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,243,135.49

9.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。

十四、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:

融通通源短融债A

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
2014-10-30至2014-12-31	-0.40%	0.10%	0.49%	0.01%	-0.89%	0.09%
2015-01-01至2015-12-31	5.22%	0.04%	2.12%	0.01%	3.10%	0.04%

融通通源短融债B

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
2015-11-16至2015-12-31	0.58%	0.05%	0.18%	0.00%	0.40%	0.05%

注:自2015年11月16日,本基金实施基金份额分类。融通通源短融债B的数据统计期间为2015年11月16日至2015年12月31日