融通增利债券型证券投资基金更新招募说明书摘要

(2017年第1号)

重要提示

融通增利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2016年1月5日证监许可[2016]14号文准予募集注册。本基金的基金合同于2016年4月1日正式生效。

投资有风险,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。

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更新招募说明书编写,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2017年3月31日,有关财务数据截止日为2017年3月31日,净值表现截止日为2016年12月31日(本报告中财务数据未经审计)。

一、基金合同生效日期

2016年4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

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

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。2017年3月起至今,代行公司总经理职责。

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。

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。2017年3月起至今,代行公司总经理职责。

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

王涛先生,南开大学经济学硕士,13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,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、融通月月添利定期开放债券、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,固定收益部副总监、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跳元先生。

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:中信银行股份有限公司(简称“中信银行”)

住所:北京市东城区朝阳门北大街9号

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号

法定代表人:李庆萍

成立时间:1987年4月7日

组织形式:股份有限公司

注册资本:489.35亿元人民币存续期间;持续经营

批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基金字[2004]125号

联系人:中信银行资产托管部

电话:4006800000

传真:010-85230024客服电话:95558

网址:bank.ecitic.com

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;代理开放式基金业务;办理黄金业务;黄金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务;保险兼业代理业务(有效期至2017年09月08日)。(依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。)

中信银行(601998.SH、0998.HK)成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一。是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大,于2005年8月,正式更名“中信银行”。2006年12月,以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。同年,成功引进战略投资者,与欧洲领先的西班牙对外银行(BBVA)建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司(简称:中信国金)70.32%股权。经过近三十年的发展,中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一,是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告,表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

(二)主要人员情况

孙德顺先生,中信银行执行董事、行长。孙先生自2016年7月20日起任中信银行行长。孙先生同时担任中信银行(国际)董事长。此前,孙先生于2014年5月至2016年7月任中信银行常务副行长;2014年3月起任中信银行执行董事;2011年12月至2014年5月任中信银行副行长,2011年10月起任中信银行党委副书记;2010年1月至2011年10月任交通银行北京管理部副总裁兼交通银行北京市分行党委书记、行长;2005年12月至2009年12月任交通银行北京市分行党委书记、行长;1984年5月至2005年11月在中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、数据中心(北京)等单位工作,期间,1995年12月至2005年11月任中国工商银行北京分行行长助理、副行长,1999年1月至2004年4月曾兼任中国工商银行数据中心(北京)总经理;1981年4月至1984年5月就职于中国人民银行。孙先生拥有三十多年的中国银行业从业经验。孙先生毕业于东北财经大学,获经济学硕士学位。

张强先生,中信银行副行长,分管托管业务。张先生自2010年3月起任中信银行副行长。此前,张先生于2006年4月至2010年3月任中信银行行长助理、党委委员,期间,2006年4月至2007年3月曾兼任总行公司银行部总经理。张先生2000年1月至2006年4月任中信银行总行营业部副总经理、常务副总经理和总经理;1990年9月至2000年1月先后在中信银行信贷部、济南分行和青岛分行工作,曾任总行信贷部副总经理、总经理、分行副行长和行长。自1990年9月至今,张先生一直为中信银行服务,在中信银行业拥有近三十年从业经历。张先生为高级经济师,先后于中南财经大学(现中南财经政法大学)、辽宁大学获得经济学学士学位、金融学硕士学位。

杨洪先生,现任中信银行资产托管部总经理,硕士研究生学历,高级经济师,教授级注册咨询师。先后毕业于四川大学和北京大学工商管理学院。曾供职于中国人民银行四川省分行、中国工商银行四川省分行。1997年加入中信银行,相继任中信银行成都分行信贷部总经理、支行行长、总行零售银行部总经理助理兼市场营销部总经理、贵宾理财部总经理、中信银行贵阳分行党委书记、行长、总行行政管理部总经理。

(三)基金托管业务经营情况

2004年8月18日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则,切实履行托管人职责。

截至2016年末,中信银行已托管119只公开募集证券投资基金,以及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总规模达到6.57万亿元人民币。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

基金管理人通过在深圳、北京和上海设立的销售服务小组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、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

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:魏艳薇

联系电话:(010)6619 0989

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:中国(上海)自由贸易试验区银城中路501号上海中心大厦3405单元

邮编:200120

联系人:刘佳佳

联系电话:(021)38424885

传真:(021)38424884

(4)融通基金管理有限公司网上直销

网址:www.rtfund.com.

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:殷浩

联系电话:(0755)26947856

传真:(0755)26948079

2、代销机构

(1)渤海银行股份有限公司

办公地址:天津市河东区海河东路218号

法定代表人:李伏安

联系人:王宏

电话:022-58316666

客服电话:95541

网址:www.cbhb.com.cn

(2)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.

(3)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:杨赟

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/

(4)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

法定代表人:王莉

地址:北京市朝阳区建外大街22号返利大厦10层

手机:13911828608

电话:8610-85650628

传真:8610-65884788

E-mail:liuy@staff.hexun.com

(5)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

(6)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

(7)深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼

法定代表人:薛峰????????

电话:021-50583533

传真:021-50583633

联系人:曹怡晨

客服热线:400-067-6266

公司网站:http://a.leadfund.com.cn/

(15)一路财富(北京)信息科技有限公司

注册地址:北京市西城区阜成门大街2?2号1幢A2008室

办公地址:北京市西城区阜成门大街2?2号万通新世界广场?A?座?2208

法定代表人:吴雪雯

联系人:刘栋栋

电话:010-88312877

传真:010-88312099

客户服务电话:400-001-1566

网址:www.yilucaifu.com

(16)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

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

(17)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楼

办公地址:上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7楼

法定代表人:金佶

电话:021-33323999

传真:021-33323837

联系人:陈云卉

客服热线:400-821-3999

公司网站:tty.chinapnr.com

(18)深圳富济财富管理有限公司

注册地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

办公地址:深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期418室

法定代表人:刘鹏宇

电话:0755-83999907-815

传真:0755-83999926

联系人:马力佳

客服热线:0755-83999907

公司网站:www.jinqianwo.cn

(19)上海陆金所资产管理有限公司

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

(20)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

(21)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

2、其他销售机构

(1)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销售本基金,并及时公告。

(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)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)会计师事务所

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

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

融通增利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

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。

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。

本基金的投资组合比例为:本基金投资债券资产的比例不低于基金资产的80%,现金或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%。

本基金不直接投资股票、权证等权益类资产,但可持有因可转换债券转股所形成的股票、因可交换债券换股所形成的股票、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。因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起10个交易日内卖出。

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的投资策略等部分。

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、有效的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。

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。

6、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比,中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让,普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究,结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量,选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为:①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息,分析企业的长期运作风险;②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价,评估发行人财务风险;③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息,估算私募债券发行人的违约率及违约损失率;④考察债券发行人的增信措施,如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等;⑤综合上述分析结果,确定信用利差的合理水平,利用市场的相对失衡,选择具有投资价值的品种进行投资。

十、业绩比较基准

1、本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数

2、选择比较基准的理由:中债综合全价(总值)指数由中央国债登记结算有限责任公司编制,该指数旨在综合反映债券全市场整体价格和投资回报情况。该指数涵盖了银行间市场和交易所市场,成份券种包括除资产支持债券和部分在交易所发行上市的债券以外的其他所有债券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的业绩比较基准。

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,或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,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,且无需召开基金份额持有人大会。

十一、风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

十二、基金投资组合报告

本基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月26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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,336,065,116.50	96.77
	其中:债券	1,336,065,116.50	96.77
	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	18,576,236.42	1.35
8	其他资产	26,051,977.89	1.89
9	合计	1,380,693,330.81	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	63,470,592.80	6.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,100,000.00	2.03
	其中:政策性金融债	20,100,000.00	2.03
4	企业债券	158,608,203.70	15.98
5	企业短期融资券	50,043,000.00	5.04
6	中期票据	199,094,320.00	20.06
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	538,802,000.00	54.30
9	其他	305,947,000.00	30.83
10	合计	1,336,065,116.50	134.65

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	140161	16辽宁09	1,000,000	98,900,000.00	9.97
2	140082	16宁夏09	600,000	59,010,000.00	5.95
3	019539	16国债11	580,120	57,977,192.80	5.84
4	1282513	12滨海建MTN1	500,000	50,380,000.00	5.08
5	111695064	16温州银行CD086	500,000	48,245,000.00	4.86

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股指期货交易情况说明

7.1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。

7.2本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.1本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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。

8.3本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

9、投资组合报告附注

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。

9.2其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,144.23
2	应收证券清算款	633,725.92
3	应收股利	-
4	应收利息	25,415,107.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,051,977.89

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。

本基金合同生效日为2016年4月1日,基金业绩截止日为2016年12月31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
自基金合同生效至2016年12月31日	1.46%	0.07%	-1.95%	0.10%	3.41%	-0.03%

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

在通常情况下,本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.3%的年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.3%÷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。由基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月前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

在通常情况下,本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷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。由基金管理人与基金托管人核对一致后,由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托管人,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。

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2016年11月10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“重要提示”部分,明确了更新招募说明书内容的截止日期、有关财务数据和基金业绩的截止日期。

2、在“三、基金管理人”部分,根据最新资料更新了基金管理人概况、主要人员情况;

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,更新了相关信息;

6、在“九、基金的投资”部分,对本基金2017年第1季度报告中的投资组合数据进行了列示;

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、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、其他应披露事项”部分,对本报告期内的公告信息进行了列示。

融通基金管理有限公司

2017年4月27日

融通中证军工指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《融通中证军工指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)关于不定期份额折算的相关规定,当融通中证军工指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之融通军工B份额的基金份额参考净值低至0.250元或以下时,本基金融通军工份额(场内简称:融通军工,基础份额,基金代码:161628)、融通军工A份额(场内简称:军工股A,基金代码:150335)、融通军工B份额(场内简称:军工股B,基金代码:150336)将进行不定期份额折算。

由于近期A股市场波动较大,截至2017年5月12日,军工股B的基金份额参考净值接近基金合同约定的不定期份额折算阈值,因此本基金管理人敬请投资者密切关注军工股B近期的基金份额参考净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、由于军工股A、军工股B折算前可能存在折溢价交易情形,不定期份额折算后,军工股A、军工股B的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意高溢价所带来的风险。

二、军工股B表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后其杠杆将恢复至初始杠杆水平。

三、由于触发折算阈值当日,军工股B的基金份额参考净值可能已低于阈值,而折算基准日在触发阈值日后才能确定,因此折算基准日军工股B的基金份额参考净值可能与折算阈值0.250元有一定差异。

四、军工股A表现为低风险、收益相对稳定的特征,但在不定期份额折算后军工股A份额持有人的风险收益特征将发生较大变化,由持有单一的较低风险收益特征军工股A变为同时持有较低风险收益特征军工股A与较高风险收益特征融通军工份额的情况,因此军工股A份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加。

本基金管理人的其他重要提示:

一、根据深圳证券交易所的相关业务规则,场内份额数将取整计算(最小单位为1份),舍去部分计入基金资产,持有极小数量融通军工份额、军工股A、军工股B的份额持有人存在折算后份额因为不足1份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

二、为保证折算期间本基金的平稳运作,基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停军工股A与军工股B的上市交易和融通军工份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告,敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情,请参阅本基金的基金合同及《融通中证军工指数分级证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)或者拨打本公司客服电话:400-883-8088(免长途话费)。

三、本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责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。

本基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,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承担。投资有风险,选择须谨慎。敬请投资者于投资前认真阅读本基金的基金合同和招募说明书等相关法律文件。

特此公告。

融通基金管理有限公司

2017年5月15日

融通基金管理有限公司关于旗下融通通泽混合型证券投资基金开展直销中心赎回费率(含转换转出费率)优惠活动的公告

为更好的满足投资者的理财需求,融通基金管理有限公司(以下简称“本公司”)决定自2017年5月15日起开展融通通泽灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)在本公司直销中心的赎回费率(含转换转出费率)优惠活动。现将有关事宜公告如下:

一、适用基金:

融通通泽灵活配置混合型证券投资基金,基金代码:前端(000278)/后端(001024)。

二、适用渠道:

本优惠活动在融通基金管理有限公司直销中心(指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、北京小组、上海小组,不含网上直销交易系统)(下称“直销中心”)开通。该优惠活动暂不在上述基金的其他销售渠道开通。

三、优惠时间:

自2017年5月15日起至2017年6月30日。

四、费率优惠情况:

优惠活动期间,投资者几通过本公司直销中心赎回或转换转出本基金的,享有如下优惠费率。

1. 赎回费率(含转换转出赎回费率):

持有时长	原费率	原赎回费归入基金资产比例	优惠费率	调整后赎回费归入基金资产比例
T<7天	1.50%	100%	1.500%	100%
7天≤T<30天	0.75%	100%	0.75%	100%
30天≤T<90天	0.50%	75%	0.375%	100%
90天≤T<180天	0.50%	50%	0.250%	100%
180天≤T<1年	0.50%	25%	0.125%	100%
T≥1年	0.00%	0%	0.000%	100%

按照本优惠活动规则,本基金的赎回费用(含转换转出赎回费用)由赎回基金(含转换转出)的基金份额持有人承担,赎回费(含转换转出赎回费)全额归入基金资产,此次费率优惠不会对基金份额持有人利益造成实质性的不利影响。

2. 本基金转换转出至本公司旗下其他基金的申(认)购费用补差,享有0折优惠。

五、重要提示:

1、本公告的最终解释权归融通基金管理有限公司所有。

2、投资者可以通过以下途径咨询有关情况:

融通基金管理有限公司:

公