

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2号）

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	260,570,220.00	51.22
	其中:政策性金融债	260,570,220.00	51.22
4	企业债券	65,964,763.50	12.97
5	企业短期融资券	40,328,000.00	7.93
6	中期票据	50,449,700.00	9.92
7	可转债(可交换债)	--	--
8	商业存单	--	--
9	其他	--	--
10	合计	417,312,683.50	82.02

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	170402	17农发02	1,100,000	108,592,000.00	21.34
2	101569028	15泛海MTN001	500,000	49,440,000.00	9.72
3	1290431	12六盘水开投债	1,000,000	40,870,000.00	8.03
4	041769004	17国农集电CF001	400,000	40,328,000.00	7.93
5	160215	16国开15	400,000	39,004,000.00	7.67

12.4 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。

12.5 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。

12.6 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。

12.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

12.8 投资组合报告附注

12.8.1 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。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,078.43
2	应收证券清算款	--
3	应收股利	--
4	应收利息	7,527,433.17
5	应收申购款	--
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	7,529,511.60

12.8.3 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12月31日。基金合同生效以来本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较如下:

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月31日	0.09%	0.01%	1.19%	0.09%	-1.10%	-0.08%
2017年度	3.39%	0.02%	-3.38%	0.06%	6.77%	-0.04%

十四、基金的费用与税收

(一)基金费用的种类

- 基金管理人的管理费；
- 基金托管人的托管费；
- 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所、律师费和诉讼费；
- 基金份额持有人大会费用；
- 基金的证券交易费用；
- 基金的银行汇划费用；
- 基金的相关帐户的开户及维护费用；
- 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。管理费率的计算方法如

下：
H=E×0.30%÷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,则顺延至下一个工作日。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×0.10%÷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,则支付日期顺延。

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管理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:

- 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;
 - 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;
 - 基金合同生效前的相关费用;
 - 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2018年2月3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:

- 在“第一部分、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,并根据最新资料进行了更新;
- 在“第二部分、基金管理人”部分,根据最新资料进行了更新;
- 在“第四部分、基金托管人”部分,根据最新资料进行了更新;
- 在“第五部分、相关服务机构”部分,更新了销售机构的相关信息;
- 在“第九部分、基金份额的申购、赎回与转换”部分,更新了“(七)申购、赎回与转换的数量限制”,“(八)申购、赎回与转换的价格、费用及其用途”,“(九)拒绝或暂停申购的情形”的内容。
- 在“第九部分、基金的投资”部分,更新了“(八)基金投资组合报告”的内容,更新数据为本基金2018年1季度报告中的投资组合数据;
- 在“第十部分、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,已按基金托管人复核;
- 在“第二十一部分、对基金份额持有人的服务”部分,根据最新资料进行了更新。
- 在“第二十二部分、其他应披露的事项”部分,对本基金自上次招募说明书更新截止日以来的相关公告进行了列示。

客服热线:4008936885

公司网站:www.qianjiang.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(入驻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道航天科技广场A座17楼1704室
法定代表人:TEO WEE HOWE
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2A
法定代表人:高峰
电话:0755-83665588
传真:0755-83665518
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:袁颖明
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:0755-268948075
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

本基金将投资于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(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或者到期日在一年以内的政府债券投资占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、券种的结构特性以及信用水平,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。

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财务经营状况、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等级,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、绝对和相对价值定价、信用分析、公司研究等角度精选具有投资价值品种。本基金力求通过绝对和相对定价模型对市场上市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
本基金通过对比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,并在中国证监会备案,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个工作日在中国证监会网站上公告。

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7月12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2018年3月31日(财务数据未经审计)。

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	417,312,683.50	81.97
	其中:债券	417,312,683.50	81.97
	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	79,450,229.73	15.61
	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	4,785,152.49	0.94
8	其他投资	7,529,511.60	1.48
9	合计	609,077,627.32	100.00

12.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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年中国金融创新“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”,“全能能网上托管银行2.0”荣获《银行家》2017年中国金融创新“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”,2018年1月获得中央国债登记结算有限责任公司“2017年度优秀资产托管机构”奖项,同月招商银行“托管大数据平台风险管理系统”荣获2016-2017年度银监会系统“金点子”方案一等奖,以及中央金融工委、全国金融青联第五届“双提升”金点子方案二等奖;3月招商银行荣获公募基金20年“最佳基金托管银行”奖。

(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长、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。

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2018年3月31日,招商银行股份有限公司累计托管364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:518063
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:北京市西城区太平桥大街84号丰汇时代大厦东翼5层502-507房间
邮政编码:100140
联系人:魏陆薇
电话:(010)66190089

(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:518063
联系人:李荣涛
联系电话:(0755)26947504

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:林文相
电话:010-66045777
传真:010-66045618
联系人:谭磊
客服热线:010-66045678
公司网站:www.txsec.com

(2)南京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内大街28号富卓大厦16层
法定代表人:杨懿
电话:010-83363101
传真:0592-3122701
客户服务热线:400-918-0808
公司网站:www.xds.com.cn

(4)诺亚正行(上海)基金销售有限公司
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366号c栋
法定代表人:李静波
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
法定代表人:其实
电话:021-54509988
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:021-68696916
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:0571-86890423
联系人:吴昊
客服热线:4008-773-772
公司网站: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:上海浦东东新路1991弄6号10号楼12楼
法定代表人:李兴春
电话:021-50683533
传真:021-50683633
联系人:曹怡晨
客服热线:400-921-7755
公司网站:http://aleadfund.com.cn/

(9)北京景晟基金销售有限公司
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

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。

投资有风险,投资人购买本基金前应认真阅读本基金的基金合同、招募说明书。本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,并经中国证监会注册。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。

本招募说明书所载内容截止日为2018年6月21日,有关财务数据截止日为2018年3月31日,净值表现截止日为2017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9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:赖文亮

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