

融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金更新招募说明书摘要

02019年第1号)

重要提示

本基金经2018年6月26日中国证监会（以下简称“中国证监会”）下发的《关于准予融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》（证监许可[2018]1026号文）准予募集注册。本基金的基金合同于2018年7月10日正式生效。

投资有风险，投资者购买本基金前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，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利义务关系，基金投资人自依基金合同取得基金份额后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，并授权《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。

本基金允许单一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额达到或者超过基金份额总额的50%。本基金不向个人投资者销售。

本招募说明书所载内容截止日为2019年1月10日，有关财务数据截止日为2018年12月31日，净值数据截止日为2018年12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

2018年7月10日

二、基金管理人

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08月22日

法定代表人：李伟

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

电话：(0755) 29947517

联系人：魏尧亮

注册资本：12500万元人民币

股权结构：融通证券股份有限公司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。

独立董事李斌女士，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。历任中国第一二一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。

独立董事李利刚先生，金融学博士，执业律师，现任南开大学金融发展研究院教授。历任密歇根大学雅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。

独立董事施文涛先生，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、中国证券法研究会和中国保险法研究会副会长。2012年1月至今，任公司独立董事。

董事王利先生，工学学士，现任新时代证券股份有限公司风险控制管理部内核负责人、场外市场部负责人。历任中信证券时代分公司财务部主任，上海远东证券有限公司总经理助理兼风控部负责人，融通基金管理有限公司副总经理兼合规管理部、法律事务部总经理。2018年9月至今，任公司董事。

董事杨景宏先生，中国语言文学博士，现任中天控股有限公司董事长兼业务管理中心副总裁。历任安徽合肥市第八中学中文语文教师，中国语言进出口(集团)总公司党委组织部部长、新华社安徽集团分公司党工部副部长、党委书记、董事、集团党委副书记、集团党委书记（副经理）。2018年3月至今，任公司董事。

董事王兴岗先生，工商管理学硕士，现任日兴资产管理有限公司副总裁，全球投资主管兼首席投资官（国际），兼任ARK Investment Management GP LLC董事兼联席代表。历任M&T Bank分析师，FGIC（GE Capital通用资本的子公司）交易员，General Reinsurance基金经理，CGA Investment Management 高级基金经理，Structured Credit Partners LLC 联合创始人兼首席投资官，Wachovia Corporation 董事总经理兼全球结构信贷产品主管，董事总经理兼全球市场和投资银行业务亚洲主管，宏利资产管理（Manulife Asset Management）香港亚洲固定收益产品主管，日兴资产管理有限公司首席投资官（国际），日兴资产管理有限公司全球投资主管兼首席投资官（国际）。2018年3月至今，任公司董事。

董事Allen 王（颜锦康）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。历任渣打投资公司（美国波士顿）分析师，富达投资公司（日本东京总部），日兴资产管理有限公司部长。2015年6月至今，任公司董事。

董事张帆先生，工商管理硕士，清华大学EMBA。历任新时代证券经纪业务管理部总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月起至今，任公司董事。

2. 现任监事情况

监事会主席李学军先生，计算机科学与技术硕士，现任公司监察稽核部总经理。历任海信投资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。

总经理张帆先生，工商管理硕士，清华大学EMBA。历任新时代证券经纪业务管理部总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月起至今，任公司总经理。

常务副总经理Allen 王（颜锦康）先生，工商管理硕士。历任渣打投资公司（美国波士顿）分析师，富达投资公司（日本东京总部），日兴资产管理有限公司部长。2011年3月至今，任公司副总经理。

督察长涂卫东先生，法学硕士。历任中国证券法制办督察(原中国证券法制局)财会司公务员，曾任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

朱浩然先生，中央财经大学经济学硕士、经济学学士。6年证券从业经历，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基金经理。历任华夏基金管理公司机构债券投资部研究员、交易管理部交易员、机构债券投资基金基金经理、上海海际华证券资产管理合伙企业投资经理。2017年2月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部基金经理。现任融通增辉债券FOF、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增辉债券型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理。

(2) 历任基金经理情况

自2018年7月19日起至今，由朱浩然先生担任本基金的基金经理。

5. 投资决策委员会成员

公司固定收益公募基金投资决策委员会成员：固定收益投资总监、基金经理张一格先生、固定收益部总监、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洪元先生。

6. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管

名称：中国光大银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区太平桥大街25号，甲25号中国光大中心

成立日期：1992年6月18日

批准设立机关及批准设立文号：国务院、国函[1992]7号

组织形式：股份有限公司

注册资本：466.79005亿元人民币

法定代表人：李勇

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【2002】75号

投资与托管业务部总经理：张博

电话：(010) 63639343

传真：(010) 63639312

网址：www.osbchina.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；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；提供信用证服务及担保；代收代付款项及代理保险业务；提供保管箱服务；经中国银行业监督管理委员会批准的其他业务。

(二) 投资与托管业务部员工及主要人员情况

法定代表人李勇先生，曾任中国工商银行河南省分行党组成员、副行长，中国工商银行总行营业部总经理，中国工商银行四川省分行党委书记、行长，中国工商银行资产管理委员会、副总裁，中国工商银行党委常委、行长助理兼北京分行行长，中国工商银行党委常委、副行长，中国工商银行股份有限公司党委常委、副行长，执行董事兼现任任中国工商银行监事长；招商银行集团副董事长、总经理，党委副书记。曾任工行银团国际控股有限公司董事长、工银金融租赁有限公司董事长、工银国际基金管理有限公司董事长、招商银行

股份有限公司副董事长、招商局能源运输股份有限公司董事长、招商局港口控股有限公司董事会主席、招商局华建公路投资有限公司董事长、招商局资本投资有限责任公司董事长、招商局联合发展投资有限公司董事长、招商局投资发展有限公司董事长等职务。现任中国光大集团董事长兼党委书记、董事长，兼任中国光大银行股份有限公司党委书记、董事长，中国光大集团有限公司董事长，中国旅游协会副会长、中国旅游金融学会副会长、中国农村金融学会副会长。武汉大学金融学博士研究生，经济学博士，高级经济师。

行长葛海蛟先生，曾任中国光大银行辽宁省分行国际业务部总经理助理、副总经理、总经理。现任中国光大银行辽宁省分行党委书记、行长，中国农业银行大连市分行党委书记、副行长，中国农业银行黑龙江省分行总经理，中国农业银行国际业务部副总经理(部门总经理级)，中国农业银行黑龙江省分行党委副书记、党委书记，行长兼任悉尼分行海外高管，黑龙江省十二届人大常委会主任。兼任中国光大实业(集团)有限责任公司董事长，光大证券股份有限公司董事，中国光大集团股份公司光大实业(集团)有限公司董事长兼党委书记，光大证券股份有限公司董事、副总裁兼首席财务官，光大证券股份有限公司党委书记、行长，光大集团股份公司党委书记、副董事长，中国光大银行总行副行长、西安分行行长，乌鲁木齐分行筹备组组长、分行行长，青岛分行行长，光大消费金融公司筹备组长。兼任中国光大银行电子银行部副总经理(总经理级)，负责普惠贷款团队业务。现任中国光大银行投资与托管业务部总经理。

(三) 证券投资基金托管情况

截至2018年12月31日，中国光大银行股份有限公司托管华夏睿晋六个月定期开放混合型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、汇安多策略灵活配置混合型证券投资基金等共128只证券投资基金，托管基金资产规模3091.02亿元。同时，开展了证券公司产品管理计划、专户理财、企业年金基金、ODI、银行理财、保险债权投资计划等资产的托管及信托公司资金信托计划、产业投资基金、股权基金等产品的托管业务。

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：518053

联系人：陈思辰

电话：(0755) 26949034

客户服务中心电话：400-883-8088（免长途话费），(0755) 26949088

(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64号丰汇时代大厦东翼5层502-507房间

邮政编码：100032

联系人：魏尧亮

电话：(010) 61679099

(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号上海中大厦34层3405室

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

法定代表人：高峰

联系人：李海芳

联系电话：(0755) 26947504

2、其他销售机构

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08月22日

法定代表人：高峰

电话：(0755) 26949075

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11楼

负责人：李功

经办律师：安冬、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

(四) 审计基金资产的会计师事务所

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：俞钧

经办注册会计师：陈玲、俞钧敏

五、基金合同生效前

六、基金合同的类型

七、基金的投资目标

本基金在严格控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

八、基金的投资范围

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、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、可转债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、中小企业私募债）、货币市场工具（含同业存单）、可交换债券等固定收益资产及法律法规许可的法律法规规定可投资于的其他金融工具。

如参与股指期货交易，应符合法律法规规定和期货交易所风险控制要求，且交易策略应符合基金合同约定的股指期货交易策略。

如参与国债期货交易，应符合法律法规规定和期货交易所风险控制要求，且交易策略应符合基金合同约定的国债期货交易策略。

如参与股指期货交易，应符合法律法规规定和期货交易所风险控制要求，且交易策略应符合基金合同约定的股指期货交易策略。

的。

(2) 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利率变化及收益曲线变化，调整债券类属品种的资产配置，获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。

本基金将积极、有效地利用本基金管理人相对完善的信用债券评级体系、研究和跟踪发行主体所属行业信用周期、业务状况、公司治理情况、财务状况等因素，综合评价发行主体信用风险，确定信用产品的信用风险溢价，有效管理组合的整体信用风险。

(3) 类属配置与个券选择策略

本基金根据配置特点及市场环境，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、税收优惠等因素，对几个市场之间的相对风险、收益（等价税后收益）进行综合评价后确定各市场债券资产的配置。

本基金在债券类属配置上采取绝对和相对相结合、信用分析、信用分析、信用分析等角度精选投资品种的债券品种。本基金力求通过对绝对和相对定价模型对市场所有债券品种进行投资价值评估，从中选择具有较高票息且暂时被市场低估或估值合理的投资品种。

3. 股票投资策略

本基金将在严格控制投资风险的前提下适度参与股票资产投资，增强基金资产收益。本基金将充分发挥研究团队主动选股优势，自下而上精选具有投资潜力的股票构建投资组合。本基金将全面考察公司所处行业的产业竞争格局、业务发展模式、盈利增长模式、公司治理结构等基本面对公司等公司的投资价值进行分析对比及挖掘，包括净资产与市值比率（B/P）、每股收益/每股价格（E/P）、现金流/市值（cashflow-to-price）和销售收入/市值（S/P）等指标的增比分析（BOC）、研发投入、经营业绩、主营业务收入增长率、毛利率、净利率。定性方面考察上市公司所属行业发展前景、行业地位、竞争优势等多种因素，精选流动性好、成长性高、估值水平低的股票进行投资。

4. 权证投资策略

本基金将权证作为辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证的价格、基金资产趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本套利和合理行权操作。

5. 资产支持证券投资策略

资产支持证券投资主要指市场化利率、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。本基金通过对比资产支持证券资产结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的投资条款、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. 中小企业私募债券投资策略

与传统的信用债相比，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信用和现金流进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。方法为：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、治理结构等基本信息；②分析企业的长期预期；③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、成长性、现金流水平等方面进行综合评价；④评估发行人财务状况；⑤利用行业数据、市场估值以及资产质量等信息，估值私募债券发行人的违约及违约损失率；⑥考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、经营业绩、主营业务收入增长率等指标。定性分析结果、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。

7. 国债期货投资策略

本基金的国债期货投资将以风险管理为原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货，提高投资组合的运作效率。基金管理人将按照相关法律法规的规定，结合国债现货市场和期货市场的流动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，获取超额收益。

(二) 开放期投资策略

开放期，本基金为保持较高的组合流动性，方便投资者安排投资，在遵守本基金有关投资限制的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放赎回的需求。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中债综合全价（总值）指数收益率×80%+沪深300指数收益率×20%。

选择该业绩比较基准的理由主要如下：

1、中债综合全价（总值）指数能够较好的反映债券市场的整体，适合作为本基金债券投资的比较基准；

2、作为主动管理型指数提供的指数，中证指数公司提供的中证系列指数体系具有一定的优势和影响力；在中证系列指数中，沪深300指数的市场代表性较强，适合作为主动管理型指数的比较基准；

3、如参与股指期货交易，应符合法律法规规定和期货交易所风险控制要求，且交易策略应符合基金合同约定的股指期货交易策略。

如参与国债期货交易，应符合法律法规规定和期货交易所风险控制要求，且交易策略应符合基金合同约定的国债期货交易策略。

如参与股指期货交易，应符合法律法规规定和期货交易所风险控制要求，且交易策略应符合基金合同约定的股指期货交易策略。

如参与国债期货交易，应符合法律法规规定和期货交易所风险控制要求，且交易策略应符合基金合同约定的国债期货交易策略。