融通增祥三个月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

基金托管人:江苏银行股份有限公司

期:二〇二〇年五月 重要提示 融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金(以下简称

"本基金")由融通增祥债券型证券投资基金转型而来。《关于融通增祥 债券型证券投资基金转型并修改基金合同有关事项的议案》经融通增祥 债券型证券投资基金基金份额持有人大会决议通过,内容包括融通增祥 债券型证券投资基金转型为发起式基金,运作方式由开放式变更为三个 月定期开放发起式,不再向个人投资者公开销售,修改基金投资范围、投 资组合比例限制、信息披露等并相应修订基金合同,并同意将"融通增祥

债券型证券投资基金"更名为"融通增祥三个月定期开放债券型发起式 证券投资基金"。上述基金份额持有人大会决议自通过之日起生效,并于 2019年7月11日正式实施基金转型。自基金转型实施之日起,《融通增祥 债券型证券投资基金基金合同》失效且《融通增祥三个月定期开放债券 型发起式证券投资基金基金合同》同时生效,融通增祥债券型证券投资 基金正式变更为融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金 基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书 经中国证监会注册,但中国证监会对本基金的变更注册,并不表明其对 本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没

投资有风险,投资人在申购本基金前应认真阅读本基金的招募说明 书、基金产品资料概要和基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投 资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险

有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断

证券投资基金是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低 投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能 够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份 额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。 本基金为债券型基金, 预期收益和预期风险高干货币市场基金,但 低于混合型基金、股票型基金。

本基金为发起式基金,发起资金提供方将运用发起资金申购本基金 的金额不低于1000万元,申购的基金份额持有期限不低于三年。发起资

金申购的基金份额持有期限满三年后,发起资金提供方将根据自身情况 决定是否继续持有 届时 发起资金提供方有可能赎回由购的太甚会其 全份额 早外 在其全会同生效三年后的对应日 若太其全的其全资产净 值低于两亿元,基金合同将自动终止,且无需召开基金份额持有人大会 审议, 目不得通过召开基金份额持有人大会的方式延续, 投资者将面临 基金合同可能终止的不确定性风险。 本基金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可达到或者超过50%。本基金不向个人投资者公开 销售。法律法规或监管机构另有约定的除外。

本基金如投资于科创板股票,会面临科创板机制下因投资标的、市 场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于市场风险、 流动性风险、信用风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。本基金可 根据投资策略需要或市场环境的变化, 选择将部分基金资产投资干科创 板股票或选择不将基金资产投资干科创板股票, 本基金并非必然投资干 科创板股票。 投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类

金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件, 了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、 资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管 理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。 投资人在获得基金投资收益的同时, 亦承担基金投资中出现的各类风 险,可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非 系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经 营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。 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

本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的"买者 自负"原则,在作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投 资风险,由投资人自行负担。 本更新招募说明书所载内容截止日为2020年4月23日,其中有关财 务数据截止日为2020年3月31日,净值表现截止日为2019年12月31日

基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业

绩并不预示其未来表现,基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对

(本招募说明书中的财务资料未经审计) 本招募说明书关于基金产品资料概要的编制、披露及更新等内容, 将不晚于2020年9月1日起执行。

一、基金合同生效日 2019年7月11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、15层 电话: (0755)26947517

联系人:赖亮亮 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% o

(二)、主要人员情况

1、现任董事情况

董事长高峰先生 全融学博士 现任融通其全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 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。

董事王利先生,工学学士,现任新时代证券股份有限公司总经理助 理,兼任投资银行业务内核负责人及场外市场部行政负责人。历任中石 化齐鲁分公司财务部会计,上海远东证券有限公司总经理助理兼稽核部 总经理,新时代证券股份有限公司合规管理部总经理、法律事务部总经 理、公司内核负责人、场外市场部负责人、投行业务条线负责人。2018年2

董事律磊先生,法学硕士,现任明天控股有限公司人力资源部总经 理。历任原国务院法制办公室秘书行政司副主任科员、主任科员、副处 长、调研员等。2019年8月至今,任公司董事。

董事Yuji Ooyagi(大柳雄二)先生,本科学历,现任日兴资产管理 有限公司执行副总裁。历任日兴证券投资组合经理,日兴资产管理有限 公司商务拓展部负责人、投资信托销售本部负责人、资深常务总监、日本 零售事业本部负责人等职务。2020年2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。

董事张帆先生, 丁商管理硕士, 清华大学EMBA。历任新时代证券经 纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月至 今,任公司董事。

2、现任监事情况

月至今,任公司董事。

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

经纪业务管理总部董事总经理、总经理助理、副总经理职务。2017年6月 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。 督察长涂卫东先生,法学硕士。曾在原国务院法制办公室财金司、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 许富强先生,北京大学经济学硕士,9年证券、基金行业从业经历,具 有基金从业资格。2011年7月加入融通基金管理有限公司,历任固定收益 部研究员、专户投资经理、融通通穗债券型证券投资基金基金经理 (2018年5月18日至2018年12月4日)、融通增祥债券型证券投资基金基 金经理(2018年5月18日至2019年7月10日)、融通通优债券型证券投资 基金基金经理(2018年5月18日起至2019年8月28日),现任融通通鑫灵 活配置混合型证券投资基金基金经理(2018年5月18日起至今)、融通通 安债券型证券投资基金基金经理(2018年5月18日起至今),融通通宸债 券型证券投资基金基金经理(2018年5月18日起至今)、融通可转债债券 型证券投资基金基金经理(2018年5月18日起至今)、融通增祥三个月定 期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2019年7月11日起至今)、 融通增享纯债债券型证券投资基金基金经理(2019年11月8日起至今)、 融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(2019

年11月8日起至今)、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理(2019年12

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、基金托管人

(一)基金托管人概况 1、基金托管人概况

住所:江苏省南京市中华路26号 办公地址:江苏省南京市中华路26号

法定代表人:夏平 成立时间:2007 年1 月22 日

组织形式:股份有限公司

注册资本:115.44亿元人民币 存续期间:持续经营

基金托管业务批准文号:证监许可【2014】619号 联系人:蔡越

名称:江苏银行股份有限公司(简称"江苏银行")

电话:025 - 51811157

江苏银行托管业务条线现有员工63名,来自于基金、券商、托管行等 不同的行业,具有会计、金融、法律、IT等不同的专业知识背景,团队成员 具有较高的专业知识水平、良好的服务意识、科学严谨的态度;部门管理 层有20 年以上金融从业经验,精通国内外证券市场的运作 3. 基金托管业务经营情况

2014年,江苏银行先后获得基金托管业务资格及保险资金托管业务 资格。江苏银行依靠严密科学的风险管理和内部控制体系以及先进的营 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。 目前江苏银行的托管业务产品线已涵盖公募基金、信托计划、基金专户、 基金子公司专项资管计划、券商资管计划、产业基金、私募投资基金等。 江苏银行将在现有的基础上开拓创新继续完善各类托管产品线。江苏银 行同时可以为各类客户提供提供现金管理、绩效评估、风险管理等个性

四、相关服务机构 (一)、基金份额销售机构

1、直销机构

(1)融通其金管理有限公司

地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14、15层 邮政编码:518053

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:100032 联系人:柴功 电话:(010)66190982

(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 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 网址:www.rtfund.com 办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14、15层 邮政编码:518053

联系人:韦荣涛 联系电话: (0755)26947504 传真:(0755)26948079

2. 其他销售机构 (1)渤海银行股份有限公司 注册地址:天津市海河东路218号 办公地址:天津市海河东路218号

法定代表人:李伏安 电话: 58316666

客服热线: 95541 公司网站:http://www.cbhb.com.cn (2)天相投资顾问有限公司

注册地址, 北京市西城区全融街19号章凯大厦B座701 办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座505

法定代表人: 林义相 电话: 010-66045182

传真: 010-66045518

客服热线:010-66045678

公司网站:www.txsec.con (3)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址:深圳市福田区福田街道民田路178号华融大厦27层2704 办公地址:北京市西城区宣武门外大街28号富卓大厦A座6层

法定代表人: 洪弘 电话:010-83363099

传真: 010-83363072 联系人: 文雯

客服热线: 400-166-1188 公司网站: 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

办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层 法定代表人: 王莉

电话: 010-85657353 传真: 010-65884788

联系人: 陈慧慧

客服热线: 4009200022 公司网站: http://licaike.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1501-1502室 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号1501-1502室

法定代表人: 陈洪生 电话: 0592-3122757

传真: 0592-3122701 联系人: 梁云波

客服热线: 400-6533-789

公司网站:www.xds.com.cn

(6)诺亚正行基金销售有限公司 注册地址:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址:上海市杨浦区长阳路1687号2号楼 法定代表人:汪静波

电话:400-821-5399 传直:021_80358749 联系人:郭哲晗

客服电话:4008-215-399

网址:www.noah-fund.com

(7)深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场 四层12-13室

办公地址:深圳市罗湖区笋岗街道笋西社区梨园路8号HALO广场 ·期四层12-13室

法定代表人: 薛峰

电话: 0755-33227950

传真:0755-33227951 联系人: 龚江江

客服热线: 4006-788-887 公司网站:www.zlfund.cn/ www.jjmmw.com (8)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:上海市徐汇区宛平南路88号金座大楼(东方财富大厦) 法定代表人:其实

电话:021-54509998 传真:021-64385308 联系人:屠彦洋 电话:021-54509977 传真:021-64385308

客服电话:95客服电话:95021 / 4001818188 公司网站: 1234567.com.cn (9)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号楼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 联系电话:021-36696312 传真:021-68596919

联系人:高源 客服电话:400-700-9665 网址: www.ehowbuy.com (10)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司 注册地址:浙江省杭州市余杭区五常街道文一西路969 3幢5层599

办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路 18 号黄龙时代广场 B 座 法人代表;祖国明 联系人:韩爱彬

客服电话:400-0766-123 网站:www.fund123.cn

(11)上海长量基金销售有限公司 注册地址: 上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址:上海市浦东新区东方路1267号11层 法定代表人: 张跃伟

电话: 021-2069-1831 传真: 021-2069-1861

联系人: 王敏 客服热线: 4008202899

公司网站: www.erichfund.com (12)浙江同花顺基金销售有限公司

注册地址:杭州市文二两路1号903室 办公地址:杭州市余杭区五常街道同顺街18号 同花顺大楼

法定代表人:凌顺平 电话:0571-88911818

传真:0571-86800423 联系人:董一锋 客服热线:4008-773-772

公司网站:www.5ifund.com (13)北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号 办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层

法定代表人: 闫振杰 电话:010-59601366-7024 传真:010-62020355

联系人:李静如 客服热线:4008188000 公司网站: http://www.mvfund.com/

(14)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: 上海市虹口区东大名路1098弄浦江国际金融广场53楼 法定代表人: 李兴春

电话: 021-50585353 传真: 021-61101630 联系人: 陈孜明

客服热线:95733 公司网站:www.leadfund.com.cn (15)北京汇成基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108号 办公地址:北京市西城区西直门外大街1号院2号楼19层 19C13

法定代表人:王伟刚 电话:010-62680527 传真:010-62680827

客服热线:400-619-9059

公司网站:www.hcjijin.com (16)一路财富(北京)基金销售有限公司 注册地址:北京市海淀区宝盛南路1号院20号楼9层101-14

办公地址:北京市海淀区奥北科技园-国泰大厦9层 法定代表人:吴雪秀 联系人:董宣

电话:010-88312877 传真:010-88312099 客户服务电话:400-001-1566

网址:www.vilucaifu.com (17)北京钱景基金销售有限公司

注册地址:北京市海淀区中关村东路18号1号楼11层B-1108 办公地址:北京市海淀区中关村东路18号1号楼11层B-1108 法定代表人: 王利刚 电话: 010-59422766

传真: 010-62565181 联系人: 姚付景

公司网站: www.qianjing.com

注册地址:上海市黄浦区黄河路333号201室A区056单元 办公地址:上海市徐汇区宜山路700号C5幢1楼

法定代表人: 金佶 电话: 021-34013996-3011

传真: 联系人: 甄宝林

客服热线: 021-34013999 公司网站: www.hotiiin.com (19)深圳富济基金销售有限公司

注册地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大 厦3203A单元

办公地址: 深圳市福田区福田街道岗厦社区金田路3088号中洲大 厦3203A单元

法定代表人: 祝中村

传真: 0755-83999926 联系人: 曾瑶敏

客服热线: 0755-83999907 公司网站:www.fujifund.cn

(20)上海陆金所基金销售有限公司

注册地址 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元 办公地址 上海市浦东新区陆家嘴环路1333号

法定代表人 王之光 联系人 宁博宇 电话 021-20665952 传真 021-22066653

客服电话 4008219031 网址: www.lufunds.com

(21)奕丰基金销售有限公司 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:0755-89460500

传真:0755-21674453 联系人:叶健 客服热线: 400-684-0500

公司网站:www.ifastps.com.c (22)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 型基金、混合型基金,高于货币市场基金。 圳市前海商务秘书有限公司)

办公地址:深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼E 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.kevnesasset.com 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

构销售本基金,并在基金管理人网站上更新。 (二)登记机构 名称:融诵基金管理有限公司 办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14、15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

经办律师:刘佳、刘翠

名称:上海源泰律师事务所 住所:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼 办公地址:上海市浦东新区浦东南路256号华夏银行大厦14楼 负责人:廖海

电话:021-51150298 传真:021-51150398 联系人:刘佳 (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)

(三)出具法律意见书的律师事务所

执行事务合伙人: 李丹 电话: (021)23238888

注册地址: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

联系人:俞伟敏

经办注册会计师:薛竞、俞伟敏

五、基金的名称

六、基金的类型

融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金

契约型、定期开放式、发起式 七、基金的投资目标

管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。 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(包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、 短期融资券、超短期融资券、中期票据、次级债券、可转换债券(含分离交

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资

资产支持证券、国债期货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)。 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。

易可转债)、可交换债券等国内依法发行的债券)、债券回购、银行存款

(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、同业存单、

基金的投资组合比例为: 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%,但应开放期 流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前10个工 作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述 比例限制。在开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需 缴纳的交易保证金后,持有的现金(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的投资比例不低于基金 资产净值的5%;在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日 日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易

保证金一倍的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)。 如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理 人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

九、基金的投资策略 本基金在封闭期与开放期采用不同的投资策略。

(一)封闭期投资策略

2、固定收益类资产投资策略

(1)利率策略

高债券组合收益率目的。

本基金封闭期内的具体投资策略包括资产配置策略、固定收益类资 产投资策略、股票投资策略、国债期货投资策略等部分。 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。

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 如和持个结构制定相应 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

(2)信田策略 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)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。 本基金从债券息票室、收益室曲线偏离度、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

择具有较高息票率日暂时被市场低估或估值合理的投资品种。 (4) 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。 3、股票投资策略 本基金的股票投资策略以精选个股为主,发挥基金管理人专业研究

团队的研究能力,从定量和定性两个方面考察上市公司的增值潜力。 定量方面综合考虑盈利能力、成长性、估值水平等多种因素,包括净 与市值比率(B/P)、每股盈利/每股市价(E/P)、年现金流/市值 (cashflow-to-price)和销售收入/市值(S/P)等价值指标以及净资产

收益率(ROE) 每股收益增长率和主营业条收入增长率等成长指标。

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 4.国债期货投资策略 本基金管理人可运用国债期货,以提高投资效率,更好地达到本基 金的投资目的。本基金在国债期货投资中根据风险管理的原则,以套期

密 以管理投资组合的利率风险,改善组合的风险收益特性。 (二)开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资, 在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动

保值为目的,在风险可控的前提下,本着谨慎原则,参与国债期货的投

性的投资品种,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。

十二、投资组合报告

十、基金的业绩比较基准 1、本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率 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

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、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票

本基金托管人江苏银行股份有限公司根据基金合同规定复核了本 报告中的投资组合报告等的内容,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2020年3月31日。

1. 报告期末基金资产组合情况 2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

票投资明细

1. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

6	中期票据		189,830,	00.000	69.29	
7	可转债(可交换债)		9,785,	890.60	3.57	
8	同业存单			-	-	
9	纯他			-	-	
10	合计		274,506,	890.60	100.20	
. 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 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(%)	

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 7. 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

8. 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

9. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

金属投资明细

9.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

9.3 本期国债期货投资评价

10. 投资组合报告附注 10.1 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。

10.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票

13. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

12 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

基金合同生效日为2019年7月11日,基金业绩截止日为2019年12月 31日。基金合同生效以来本基金份额净值增长室与同期业绩比较基准收 益率比较表如下

十四、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、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用:

8、基金的相关账户的开户及维护费用;

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、期货交易费用; 7、基金的银行汇划费用;

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

(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0.40%的年费率计提。管 理费的计算方法如下: H=E×0.40%÷当年天数

核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进 行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休

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管理费

E为前一日的基金资产净值

息日或不可抗力等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行 核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。 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

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人

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。由基金托管人根据与基金管理人 核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的账户路径进 行资全支付 其全管理人无雲面出具资全划拨指令 若遇法定节假日 休

核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。 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

息日或不可抗力等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行

(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

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 3、《融通增祥债券型证券投资基金基金合同》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

(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

管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。 十五、对招募说明书更新部分的说明 本招募说明书依据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及 其他有关法律法规的要求, 对本基金管理人于最近一期刊登的本基金

律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金

招募说明书进行了更新,主要更新内容如下: 一、在"重要提示"部分,明确了更新招募说明书内容截止日、更新 了有关财务数据及基金业绩的截止日期;

二、在"第三部分 基金管理人",根据最新资料进行了更新; 三、在"第四部分 基金托管人",根据最新资料进行了更新;

六、在"第十部分 基金的业绩",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; 七、在"第十七部分 风险揭示",根据最新资料进行了更新;

二〇二〇年五月十六日

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十名股

四、在"第五部分 相关服务机构",更新了销售机构的相关信息;

费用的项目。

五、在"第九部分基金的投资",对本基金2020年第1季度报告中的 投资组合数据进行了列示;

八、在"第二十二部分 其他应披露的事项",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。

融通基金管理有限公司