

## 融通增丰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

融通增丰债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经2016年5月26日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)下发的《关于准予融通增丰债券型证券投资基金注册的批复》(证监许可[2016]1123号文)准予募集注册。本基金基金合同于2016年7月19日正式生效。2017年2月7日,本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于融通增丰债券型证券投资基金降低管理费率有关事项的议案》,本次大会决议自该日起生效。根据该议案,经与基金托管人协商一致,基金管理人已相应修改《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》和《融通增丰债券型证券投资基金托管协议》,将年管理费率由0.6%修订为0.4%,修订后的文件于本次会议决议生效日的下一个工作日生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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募集的注册,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或者保证。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。

投资有风险,投资人在认购(或申购)本基金前应认真阅读本基金的招募说明书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。

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,其长期平均预期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。

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,由投资人自行承担。

本招募说明书所载内容截止日为2017年1月19日,有关财务数据截止日为2016年12月31日,净值表现截止日为2016年12月31日(财务数据未经审计)。

#### 一、基金合同生效日

2016年7月19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

成立日期：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。

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。

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。

督察长涂卫东先生,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

余志勇先生,武汉大学金融学硕士、工商管理学学士,16年证券投资从业经历,具有证券从业资格,现任融通基金管理有限公司研究策划部副总监。历任湖北省农业厅研究员、闽发证券公司研究员、招商证券股份有限公司研究发展中心研究员。2007年4月加入融通基金管理有限公司,历任研究部行业研究员、行业组长,2015年2月25日起至今任“融通通泽灵活配置混合型证券投资基金”基金经理,2015年3月17日起至今任“融通通泰保本混合型证券投资基金”基金经理,2015年6月15日起至今任“融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金”基金经理,2015年11月17日起至今任“融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金”基金经理,2016年5月13日起至今任“融通增裕债券型证券投资基金”基金经理,2016年8月2日起至今任“融通增丰债券型证券投资基金”基金经理,2016年8月19日起至今任“融通通景灵活配置混合型证券投资基金”基金经理,2016年10月19日起至今任“融通通尚灵活配置混合型证券投资基金”基金经理,2016年10月28日起至今任“融通四季添利债券证券投资基金(LOF)”基金经理,2016年11月2日起至今任“融通新优选灵活配置混合型证券投资基金”基金经理。

王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,9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副总监。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“融通可转债债券型证券投资基金(由原融通标普中国可转债指数型证券投资基金转型而来)”、“融通债券投资基金”基金经理,2014年11月7日起至2016年11月17日任“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2016年11月17日任“融通通瑞债券型证券投资基金”基金经理,2016年5月5日起至今任“融通增鑫债券型证券投资基金”基金经理,2016年5月11日起至今任“融通增益债券型证券投资基金”基金经理,2016年5月13日起至今任“融通增裕债券型证券投资基金”、“融通通泰保本混合型证券投资基金”基金经理,2016年8月2日起至今任“融通增丰债券型证券投资基金”基金经理,2016年11月10日起至

今任“融通现金宝货币市场基金”基金经理，2016年11月18日起至今任“融通稳利债券型证券投资基金”基金经理。

张一格先生，中国人民银行研究生部经济学硕士、南开大学法学学士，美国特许金融分析师(CFA)。10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经理。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰信用债券型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金基金经理。2015年6月加入融通基金管理有限公司，2015年11月17日起至今任“融通易支付货币市场证券投资基金”基金经理，2016年3月15日起至今任“融通通盈保本混合型证券投资基金”基金经理，2016年4月28日起至今任“融通增裕债券型证券投资基金”基金经理，2016年5月13日起至今任“融通增祥债券型证券投资基金”基金经理，2016年7月19日起至今任“融通增丰债券型证券投资基金”基金经理，2016年7月28日起至今任“融通通瑞债券型证券投资基金”基金经理，2016年8月9日起至今任“融通通优债券型证券投资基金”基金经理，2016年8月24日起至今任“融通月月添利定期开放债券型证券投资基金”基金经理，2016年8月30日起至今任“融通通景灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2016年9月22日起至今任“融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金”、“融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金”基金经理，2016年11月2日起至今任“融通通裕债券型证券投资基金”基金经理。

#### (2) 历任基金经理情况

自2016年7月19日起至2016年8月1日，由张一格先生担任本基金的基金经理。

自2016年8月2日起至今，由张一格先生、余志勇先生和王超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，固定收益部副总监、基金经理王超先生，基金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)、基金托管人情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：王洪章

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：田青

联系电话：(010)6759 5096

中国建设银行成立于1954年10月，是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行，总部设在北京。本行于2005年10月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码939)，于2007年9月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码601939)。

2015年末,本集团资产总额18.35万亿元,较上年增长9.59%;客户贷款和垫款总额10.49万亿元,增长10.67%;客户存款总额13.67万亿元,增长5.96%。净利润2,289亿元,增长0.28%;营业收入6,052亿元,增长6.09%,其中,利息净收入增长4.65%,手续费及佣金净收入增长4.62%。平均资产回报率1.30%,加权平均净资产收益率17.27%,成本收入比26.98%,资本充足率15.39%,主要财务指标领先同业。

物理与电子渠道协同发展。营业网点“三综合”建设取得新进展,综合性网点数量达1.45万个,综合营销团队2.15万个,综合柜员占比达到88%。启动深圳等8家分行物理渠道全面转型创新试点,智慧网点、旗舰型、综合型和轻型网点建设有序推进。电子银行主渠道作用进一步凸显,电子银行和自助渠道账务性交易量占比达95.58%,较上年提升7.55个百分点;同时推广账号支付、手机支付、跨行付、龙卡云支付、快捷付等五种在线支付方式,成功实现绝大多数主要快捷支付业务的全行集中处理。

转型业务快速增长。信用卡累计发卡量8,074万张,消费交易额2.22万亿元,多项核心指标继续保持同业领先。金融资产1,000万以上的私人银行客户数量增长23.08%,客户金融资产总量增长32.94%。非金融企业债务融资工具累计承销5,316亿元,承销额市场领先。资产托管业务规模7.17万亿元,增长67.36%;托管证券投资基金数量和新增只数均为市场第一。人民币国际清算网络建设再获突破,继伦敦之后,再获任瑞士、智利人民币清算行资格;上海自贸区、新疆霍尔果斯特殊经济区主要业务指标居同业首位。

2015年,本集团先后获得国内外各类荣誉总计122项,并独家荣获美国《环球金融》杂志“中国最佳银行”、香港《财资》杂志“中国最佳银行”及香港《企业财资》杂志“中国最佳银行”等大奖。本集团在英国《银行家》杂志2015年“世界银行品牌1000强”中,以一级资本总额位列全球第二;在美国《福布斯》杂志2015年度全球企业2000强中位列第二。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、QFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、跨境托管运营处、监督稽核处等10个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工220余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

## (二)、主要人员情况

赵观甫,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力铮,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

## (三)、基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国

建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2016年一季度末,中国建设银行已托管584只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续六年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

#### 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深圳小组

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) 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北京小组

办公地址: 北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座1241-1243单元

邮政编码: 100140

联系人: 魏艳薇

电话: (010) 66190989

(3) 融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及上海小组

办公地址: 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: 518053

联系人: 殷洁

联系电话: (0755) 26947856

###### 2、其他销售机构

(1) 渤海银行股份有限公司

办公地址: 天津市河西区马场道201-205号

法定代表人: 刘宝凤

电话: (022) 58316666

联系人: 王宏

客户服务电话: 400-888-8811

(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](http://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: 杨懿

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](mailto: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](http://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](http://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

联系人: 童彩平

电话: 0755-33227950

传真: 0755-33227951

网址: [www.zlfund.cn](http://www.zlfund.cn)

(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: 上海市徐汇区龙田路195号3C座楼

法定代表人: 其实

电话: 021-54509998

传真: 021-64385308

联系人: 高莉莉、刘若云

客服热线: 4001818188

公司网站: [1234567.com.cn](http://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

电话: 021-20213600

传真: 021-68596916

联系人: 张茹

客服热线: 400-700-9665

公司网站: [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(10) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司

住所: 杭州市余杭区仓前街道文一西路1218号1栋202室

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6F

法定代表人: 陈柏青

联系人: 韩爱彬

客服电话: 4000-766-123

公司网址: [www.fund123.cn](http://www.fund123.cn)

(11) 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: 胡雪芹

电话: 021-2069-1806

客服热线: 400-089-1289

网址: [www.erichfund.com](http://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: 0571-86800423

联系人: 吴强

客服热线: 4008-773-772

公司网站: [www.5ifund.com](http://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.myfund.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: 上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人: 沈继伟

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/>

(16) 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 号 1 幢 A2008 室

办公地址: 北京市西城区阜成门大街 2 号万通新世界广场 A 座 2208

法定代表人: 吴雪秀

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](http://www.yilucaifu.com)

(17) 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](http://www.qianjing.com)

(18) 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](http://tty.chinapnr.com)

(19) 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：齐小贺

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

(20) 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

(21) 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

(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

(23) 北京汇成基金销售有限公司

地址：北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室

法人代表人：王伟刚

联系人：丁向坤

客户服务电话：400-619-9059

网址：www.fundzone.cn

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)、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、基金名称

融通增丰债券型证券投资基金

## 六、基金类型

契约型开放式

## 七、基金的投资目标

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管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。

## 八、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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（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、中期票据、次级债券、可转换债券（含分离交易可转债）、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、权证、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。

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%，股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%，其中，本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的 3%；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%。

## 九、投资策略

本基金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、权证投资策略以及国债期货投资策略等部分。

### 1、资产配置策略

本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征,通过自上而下的定性分析和定量分析,综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素,判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值,对各大类资产的风险收益特征进行评估,从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例,并依据各因素的动态变化进行及时调整。

### 2、固定收益类资产投资策略

#### (1) 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。

#### (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票率且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,包括净资产与市值比率(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务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

本基金将权证看作是辅助性投资工具,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,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、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避险和合理杠杆操作。

#### 5、国债期货投资策略

本基金在进行国债期货投资时,将根据风险管理原则,以套期保值为主要目的,采用流动性好、交易活跃的期货合约,通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究,结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征,运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 十、投资限制

#### 1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制:

(1) 本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%,股票、权证等权益类资产比例不超过基金资产的 20%;

(2) 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,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

(3) 本基金持有一家公司发行的证券,其市值不超过基金资产净值的 10%;

(4) 本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的 10%;

(5) 本基金持有的全部权证,其市值不得超过基金资产净值的 3%;

(6) 本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不得超过该权证的 10%;

(7) 本基金在任何交易日买入权证的总金额,不得超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

(8) 本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例,不得超过基金资产净值的 10%;

(9) 本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的 20%;

(10) 本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的 10%;

(11) 本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%;

(12) 本基金应投资于信用级别评级为 BBB 以上(含 BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出;

(13) 本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的 40%;债券回购最长期限为 1 年,债券回购到期后不得展期;

(14) 本基金投资国债期货后,应遵守如下限制:

1) 本基金在任何交易日日终,持有的买入国债期货合约价值,不得超过本基金资产净值的 15%;

2) 本基金在任何交易日日终,持有的卖出国债期货合约价值不得超过本基金持有的债券总市值的 30%;

3) 本基金所持有的债券(不含到期日在一年以内的政府债券)市值和买入、卖出国债期货合约价值,合计(轧差计算)应当符合基金合同关于债券投资比例的有关约定;

4) 本基金在任何交易日内交易(不包括平仓)的国债期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 30%;

(15) 本基金的基金总资产不得超过基金净资产的 140%;

(16) 本基金投资流通受限证券,基金管理人应根据中国证监会相关规定进行投资。基金管理人应制订严格的投资决策流程和风险控制制度,防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险;

(17) 法律法规及中国证监会规定的和基金合同约定的其他投资限制。

因证券市场波动、证券发行人合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的,基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的,从其规定。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在上述期间内,本基金的投资范围、投资策略应当符合基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资不再受相关限制或按照调整后的规定执行。

## 2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益,基金财产不得用于下列投资或者活动:

- (1) 承销证券;
- (2) 违反规定向他人贷款或者提供担保;
- (3) 从事承担无限责任的投资;
- (4) 向其基金管理人、基金托管人出资;
- (5) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
- (6) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他活动。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券,或者从事其他重大关联交易的,应当符合基金的投资目标和投资策略,遵循基金份额持有人利益优先原则,防范利益冲突,建立健全内部审批机制和评估机制,按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意,并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议,并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

法律、行政法规或监管部门取消或调整上述限制,如适用于本基金,基金管理人在履行适当程序后,则本基金投资按照取消或调整后的规定执行。

## 十一、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其他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。

## 十二、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型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

### 十三、基金投资组合报告

本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2017年1月30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2016年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

#### 8.1 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	198,346,726.95	98.64
	其中:债券	198,346,726.95	98.64
	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	647,779.62	0.32
8	其他资产	2,088,790.95	1.04
9	合计	201,083,297.52	100.00

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 8.3 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票投资明细

本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 8.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,018,000.00	4.99
	其中:政策性金融债	10,018,000.00	4.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	177,187,800.00	88.19
6	中期票据	10,212,000.00	5.08
7	可转债(可交换债)	928,926.95	0.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	198,346,726.95	98.72

#### 8.5 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	011698261	16天士力SCP003	200,000	19,942,000.00	9.93
2	011698255	16丽珠SCP001	200,000	19,936,000.00	9.92

				0	
2	011698328	16 华强 SCP001	200,000	19,936,000.00	9.92
3	041651040	16 富通 CP002	200,000	19,900,000.00	9.90
4	041664038	16 徐工机械 CP002	200,000	19,894,000.00	9.90
5	041656023	16 珠轨交 CP001	200,000	19,870,000.00	9.89

8.6 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。

8.7 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金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.9.2 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。

8.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1 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，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.10.2 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库。

8.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,025.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,085,765.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,088,790.95

8.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	928,926.95	0.46

8.12 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明



本基金本报告期末未持有股票投资。

#### 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。

本基金合同生效日为2016年7月19日。财务数据截止日为2016年12月31日，本基金基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较如下：

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
自基金合同生 效日(2016年7 月19日)至 2016-12-31日	0.50%	0.06%	-1.65%	0.12%	2.15%	-0.06%

#### 十五、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；
- 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；
- 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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.4%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.4\% \div \text{当年天数}$$

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、休息日等，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。

2017年2月7日，本基金基金份额持有人大会表决通过了《关于融通增丰债券型证券投资基金降低管理费率有关事项的议案》，本次大会决议自该日起生效。根据该议案，经与基金托管人协商一致，基金管理人已相应修改《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》和《融通增丰债券型证券投资基金托管协议》，将年管理费率由0.6%修订为0.4%，修订后的文件于本次会议决议生效日的下一个工作日生效。

###### 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0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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、休息日等,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。

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项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十六、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7月9日刊登的本基金更新招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“第一部分 重要提示”部分,根据最新资料进行了更新,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;

2、在“第三部分、基金管理人”部分,根据最新资料进行了更新;

3、在“第四部分 基金托管人”部分,根据最新资料进行了更新;

4、在“第五部分 相关服务机构”部分,根据最新资料对销售机构相关信息进行了更新;

5、在“第六部分 基金的募集”部分,根据最新资料进行了更新;

6、完善了“第七部分 基金合同的生效”部分的内容;

7、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2016年4季度报告中的投资组合数据;

8、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;

9、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服务相关内容;

10、在“二十二 其他应披露的事项”部分,对本报告期内的基金公告进行了列表说明。。

融通基金管理有限公司

2017年3月4日