

**融通通瑞债券型证券投资基金
更新招募说明书摘要
(2019年第2号)**

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

日期：二〇一九年十二月

重要提示

融通通瑞债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金转型而成。融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金经中国证监会《关于核准融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2013]1515号）和《关于融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2014]61号）注册。《融通通瑞债券型证券投资基金基金合同》于2014年11月14日正式生效。

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。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做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。基金投资者依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者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，投资者认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

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不构成对本基金业绩表现的保证。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者根据所持有的基金份额享受基金收益，同时承担相应的投资风险。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险、基金管理人在基金管理实施过程中产生的积极管理风险、债券市场的特殊风险等。

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。

本基金是债券型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金、股票型基金。

投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同、基金产品资料概要，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

本招募说明书中有关信息披露的内容截止日为2019年12月13日；有关财务数据截止日为2019年3月31日，净值表现数据截止日为2018年12月31日（本招募说明书中的财务资料未经审计）；其他所载内容截止日为2019年5月14日。

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

2014年11月14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%。

（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公司内核负责人、场外市场部负责人。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总经理助理兼合规管理部、法律事务部总经理。2018年2月至今，任公司董事。

董事杨宗兵先生，中国语言文学博士后，现任明天控股有限公司干部与业务管理中心副总裁。历任安徽省池州市第八中学高中语文教师，中国图书进出口(集团)总公司党委组织部部长，新兴际华集团有限公司党群工作部部长、党委书记、董事、集团党委副书记、机关党委书记（副厅级）。2018年3月至今，任公司董事。

董事王裕闵先生，工商管理学硕士，现任日兴资产管理有限公司联合全球投资主管兼联合首席投资官，兼任ARK Investment Management GP LLC董事会列席代表。历任M&T Bank分析员，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 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，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月起至今，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。

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月起至今，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。

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

（1）现任基金经理情况

何天翔先生，厦门大学经济学硕士、安徽大学理学学士，11年证券投资从业经历，具有基金从业资格。曾就职于华泰联合证券有限公司任金融工程分析师，2010年3月加入融通基金管理有限公司，历任金融工程研究员、专户投资经理，现任融通基金管理有限公司指数与量化投资部副总监以及融通深证100指数、融通军工分级、融通证券分级、融通新趋势灵活配置混合、融通通瑞债券、融通人工智能主题指数（LOF）基金的基金经理。

朱浩然先生，中央财经大学经济学硕士、经济学学士，7年证券投资从业经历，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司机构债券投资部信用研究员、交易管理部交易员、机构债券投资部基金研究员，上海毕朴斯投资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任固定收益部专户投资经理，现任融通通福债券（LOF）、融通月月添利定期开放债券、融通通源短融债券、融通通玺债券、融通通祺债券、融通通瑞债券、融通增悦债券、融通通捷债券、融通增辉定期开放债券发起式基金的基金经理。

（2）历任基金经理情况

自2014年3月21日起至2015年6月22日，由韩海平担任本基金的基金经理。

自2015年6月23日起至2015年7月16日，由王超担任本基金的基金经理。

自2015年7月17日起至2016年7月27日，由王超先生和汪曦女生共同担任本基金的基金经理。

自2016年7月28日起至2016年9月2日，由王超先生、汪曦女生和张一格先生共同担任本基金的基金经理。

自2016年9月3日起至2016年11月17日，由王超先生和张一格先生共同担任本基金的基金经理。

自2016年11月18日起至2017年1月23日，由张一格先生担任本基金的基金经理。

自2017年1月24日起至2018年3月23日，由张一格先生和何天翔先生共同担任本基金的基金经理。

自2018年3月24日起至今，由何天翔先生和朱浩然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）基本情况

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：田国立

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。中国建设银行于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）。

2018年6月末，中国建设银行资产总额228,051.82亿元，较上年末增加6,807.99亿元，增幅3.08%。上半年，中国建设银行盈利平稳增长，利润总额较上年同期增加93.27亿元至1,814.20亿元，增幅5.42%；净利润较上年同期增加84.56亿元至1,474.65亿元，增幅6.08%。

2017年，中国建设银行先后荣获香港《亚洲货币》“2017年中国最佳银行”，美国《环球金融》“2017最佳转型银行”、新加坡《亚洲银行家》“2017年中国最佳数字银行”、“2017年中国最佳大型零售银行奖”、《银行家》“2017最佳金融创新奖”及中国银行业协会“年度最具社会责任金融机构”等多项重要奖项。中国建设银行在英国《银行家》“2017全球银行1000强”中列第2位；在美国《财富》“2017年世界500强排行榜”中列第28名。

中国建设银行总行设资产托管业务部，下设综合与合规管理处、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，在安徽合肥设有托管运营中心，在上海设有托管运营中心上海分中心，共有员工315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

纪伟，资产托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行南通分行、总行计划财务部、信贷经营部任职，并在总行公司业务部、投资托管业务部、授信审批部担任领导职务。其拥有八年托管从业经历，熟悉各项托管业务，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长，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，资产托管业务部资深经理（专业技术一级），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。

郑绍平，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎，资产托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行国际业务部，长期从事海

外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作，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、(R)QFII、(R)QDII、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2018年二季度末，中国建设银行已托管857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。中国建设银行先后9次获得《全球托管人》“中国最佳托管银行”、4次获得《财资》“中国最佳次托管银行”、连续5年获得中债登“优秀资产托管机构”等奖项，并在2016年被《环球金融》评为中国市场唯一一家“最佳托管银行”、在2017年荣获《亚洲银行家》“最佳托管系统实施奖”。

四、相关服务机构

（一）基金销售机构

1、直销机构情况

（1）融通基金管理有限公司

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北京分公司

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

邮编：100032

联系人：柴玟

联系电话：(010) 66190982

传真：(010) 88091635

（3）融通基金管理有限公司上海分公司

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

邮编：200120

联系人：刘佳佳

联系电话：（021）38424889

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：韦荣涛

联系电话：（0755）26947504

传真：（0755）26948079

2、销售机构

（1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

法定代表人：田国立

联系人：王琳

客服电话：95533

（2）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

（3）宁波银行股份有限公司

办公地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号 24 层

法定代表人：陆华裕

客户服务电话：95574

联系人：邱艇

电话：0574-87050397

（4）苏州银行股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

办公地址：江苏省苏州市工业园区钟园路 728 号

法定代表人：王兰凤

传真：0512-69868370

联系人：葛晓亮

电话：0512-69868519

客服热线：96067

网址：www.suzhoubank.com。

（5）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 7 层

法定代表人：洪弘

联系人：文雯

电话：010-83363101

客服热线：400-166-1188

公司网站：8.jrj.com.cn

（6）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 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

办公地址：厦门市思明区鹭江道 2 号厦门第一广场西座 1501-1504 室

法定代表人：陈洪生

联系电话：0592-3122679

传真：0592-3122701

联系人：梁云波

客服热线：400-9180808

公司网站：www.xds.com.cn

（7）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：上海市杨浦区秦皇岛路 32 号 c 栋

法定代表人：汪静波

电话：021-38602377

传真：021-38509777

联系人：李娟

客服热线：400-821-5399

公司网站：www.noah-fund.com

（8）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

（9）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：赵荣春

电话：010-59422766

联系人：姚付景

公司网站：www.qianjing.com

客服电话：400-893-6885

（10）上海汇付基金销售有限公司

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号普天软件园C5幢

法定代表人：金佶

电话：021-34013996

联系人：甄宝林

客服热线：021-34013999

公司网站：www.hotjijin.com

（11）深圳富济基金销售有限公司

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：刘鹏宇

电话：0755-83999907-8814

传真：0755-83999926

联系人：刘勇

客服热线：0755-83999907

公司网站：www.fujifund.cn

（12）上海陆金所基金销售有限公司（仅销售前端）

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：胡学勤

联系人：程晨

电话：021-20665952

客户服务电话：4008219031

网址：www.lufunds.com

（13）珠海盈米基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

传真：020-89629011

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

客服热线：020-89629066

（14）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

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

（15）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号3幢5层599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：祖国明

联系人：韩爱彬

客服电话：4000-766-123

公司网址：www.fund123.cn

（16）深圳众禄基金销售股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼801

办公地址：深圳市罗湖区梨园路8号HALO广场4楼

法定代表人：薛峰

联系人：龚江江

电话：0755-33227950

传真：0755-33227951

网址：www.zlfund.cn

（17）北京展恒基金销售有限公司

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：01062020355

联系人：李静如

客服热线：4008188000

公司网站：<http://www.myfund.com/>

（18）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

联系人：潘世友

电话：021-54509977

传真：021-64385308

客服电话：95021 / 4001818188

网址：www.1234567.com.cn

（19）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

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

（20）北京增财基金销售有限公司

注册地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

办公地址：北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208室

法定代表人：罗细安

传真：010-67000988-6000

联系人：罗细安

客服电话：400-001-8811

（21）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号鄂尔多斯大厦903~906室

法定代表人：杨文斌

客服电话：400-700-9665

联系人：张茹

电话：021-20213600

传真：021-68596916

公司网站：www.ehowbuy.com

（22）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 号浦江国际金融广场 18 层

法定代表人：李兴春

电话：021-60195121

传真：021-61101630

联系人：郭丹妮

客服热线：95733

公司网站：www.leadfund.com.cn

（23）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 e 世界 A 座 1108 室

办公地址：北京市海淀区中关村 e 世界 A 座 1108 室

法人代表人：王伟刚

电话：010-56251471

传真：010-62680827

联系人：王骁骁

客服热线：010-56251471

公司网站：www.hcjijin.com

（24）一路财富（北京）基金销售股份有限公司

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

（25）上海万得基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座

办公地址：上海市浦东新区浦明路 1500 号万得大厦 11 楼

法定代表人：黄祎

电话：021-50712782

传真：021-50710161

联系人：徐亚丹

客服热线：400-799-1888

公司网站：www.fundsure.cn

（26）天津国美基金销售有限公司

注册地址：天津经济技术开发区第一大街 79 号 MSDC1-28 层 2801

办公地址：北京市朝阳区霄云路 26 号鹏润大厦 B 座 9 层

法定代表人：丁东华

电话：010-59287105

传真：010-59287825

联系人：郭宝亮

客服热线：400-111-0889

网址：www.gomefund.com

（27）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：袁顾明

联系人：何庭宇

电话：021-20324153

网址：<http://www.dtfunds.com>

（28）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.cn

（29）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：深圳市福田区福华路355号岗厦皇庭中心8楼DE

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

（30）上海中正达广基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

办公地址：上海市徐汇区龙腾大道2815号302室

法定代表人：黄欣

电话：021-33768132

传真：021-33768132-802

联系人：戴珉微

客服热线：400-6767-523

公司网站：www.zhongzhengfund.com

（31）北京虹点基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

办公地址：北京市朝阳区工人体育场北路甲2号裙房2层222单元

法定代表人：郑毓栋

电话：400-618-0707

传真：010-65951887

联系人：牛亚楠

客服热线：400-618-0707

网址：www.hongdianfund.com/

（32）北京肯特瑞基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

办公地址：北京市亦庄经济技术开发区科创十一街18号京东集团总部A做17层

法定代表人：江卉

电话：4000988511/ 4000888816

传真：010-89188000

联系人：徐伯宇

客服热线：95518

公司网站：jr.jd.com

（33）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区砖墙集镇78号

办公地址：南京市玄武区天时国贸大厦11层E座

法定代表人：吴言林

联系人：李跃

电话：025-56663409

客服热线：

025-66046166

网址：www.huilinbd.com

（34）通华财富（上海）基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区同丰路667弄107号201室

办公地址：上海市浦东新区金沪路55号通华科技大厦7层

法定代表人：沈丹义

联系人：杨徐霆

电话：021-60818249

客服热线：400-101-9301

网址：www.tonghuafund.com。

（35）深圳市锦安基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：广东省深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街一号前海深港合作区管理局

综合办公楼 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：广东省深圳市福田区新世界中心 4 楼

法定代表人：李学东

电话：0755-84669000

传真：0755-23982839

联系人：夏用功

客服热线：400-0719-888

公司网站：<http://www.annfund.com/>

(36) 天津万家财富资产管理有限公司

注册地址：天津自贸区（中心商务区）迎宾大道 1988 号滨海浙商大厦公寓 2-2413 室

办公地址：北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 5 层

法定代表人：李修辞

电话：010-59013842

传真：010-59013707

联系人：王芳芳

客服热线：010-59013842

公司网站：<http://www.wanjiawealth.com/>

(37) 大河财富基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

办公地址：贵州省贵阳市南明区新华路 110-134 号富中国际广场 1 栋 20 层 1.2 号

法定代表人：王荻

联系人：方凯鑫

电话：0851-88405606

传真：0851-88405599

客户服务电话：0851-88235678

网址：www.urainf.com

(38) 北京植信基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：北京市密云县兴盛南路 8 号院 2 号楼 106 室-67

办公地址：北京市朝阳区惠河南路盛世龙源 10 号

法定代表人：于龙

联系人：吴鹏

电话：010-56075718

传真：010-67767660

客户服务电话：4006-802-123

网址：www.zhixin-inv.com

（39）上海联泰基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室

办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8座3层

邮编：200335

法定代表人：尹彬彬

联系人：兰敏

电话：021-52822063

传真：021-52975270

客服电话：400-166-6788

公司网址：www.66liantai.com

（40）中证金牛（北京）投资咨询有限公司

注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号环球财讯中心A座5层

法定代表人：钱昊旻

电话：010-59336544

传真：010-59336586

联系人：沈晨

客服热线：4008-909-998

网址：www.jnlc.com

（41）上海华夏财富投资管理有限公司（仅销售前端）

注册地址：上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室

办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

法定代表人：毛淮平

电话：010-88066184

传真：010-63136184

联系人：张静怡客服热线：400-817-5666

公司网站：www.amcfortune.com

（42）上海挖财基金销售有限公司（仅销售前端）

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室

法定代表人：冷飞

电话：021-50810687

传真：021-58300279

联系人：孙琦

客服热线：021-50810673

网址：www.wacaijijin.com

（43）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507

办公地址：北京市朝阳区创远路34号院融新科技中心C座17层

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联系人：戚晓强

客服热线：4000618518

公司网站：<https://danjuanapp.com/>

（44）金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

办公地址：北京市西城区阜成门大街2号19层A2017

法定代表人：夏予柱

电话：010-68091380

传真：010-68091380

联系人：侯芳芳

客服热线：400-159-9288

公司网站：www.jhjfund.com

（45）江苏汇林保大基金销售有限公司

注册地址：南京市高淳区砖墙集镇 78 号

办公地址：南京市玄武区天时国贸大厦 11 层 E 座

法定代表人：吴言林

联系人：李跃

电话：025-56663409

客服热线：025-66046166

网址：www.huilinbd.com

（46）南京苏宁基金销售有限公司

注册地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

办公地址：江苏省南京市玄武区苏宁大道 1-5 号

法定代表人：王锋

电话：025-66996699

传真：025-66996699

联系人：张云飞

客服热线：025-66996699

公司网站：www.snjjin.com

（47）上海基煜基金销售有限公司

注册地址：上海市崇明县长兴镇路潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室

办公地址：上海市浦东新区银城中路 488 号太平金融大厦 1503 室

法定代表人：王翔

电话：021-65370077

传真：021-55085991

联系人：许付漪

客服热线：400-820-5369

公司网站：www.jiyufund.com.cn

（48）上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

电话：021-63333389

传真：021-63333390

联系人：冯强

客服热线：4006-433-389

网址：www.vstonewealth.com

（49）大连网金基金销售有限公司

注册地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层

办公地址：辽宁省大连市沙河口区体坛路22号诺德大厦2层

法定代表人：樊怀东

电话：0411-39027810

传真：0411-39027835

联系人：于秀

客服热线：4000899100

公司网站：www.yibaijin.com

（50）阳光人寿保险股份有限公司

注册地址：海南省三亚市迎宾路360-1号三亚阳光金融广场16层

办公地址：北京市朝阳区朝阳门外大街乙12号院1号昆泰国际大厦12层

法定代表人：李科

电话：010-85632771

传真：010-85632773

联系人：王超

客服热线：95510

公司网站：<http://fund.sinosig.com/>

（51）民商基金销售（上海）有限公司

注册地址：上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼A31室

办公地址：上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼

法定代表人：贲惠琴

电话：021-50206003

传真：021-50206001

联系人：杨一新

客服热线：021-50206003

公司网站：www.msftec.com

(52) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路618号

法定代表人：杨德红

联系人：朱雅崑

电话：（021）38676161

客服电话：4008888666

(53) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

法定代表人：王常青

联系人：刘畅

电话：（010）85130236

客户服务电话：400-8888-108或95587

(54) 中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

法定代表人：张佑君

联系人：马静懿

电话：（010）60838995

客服热线：0755-23835888

(55) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路222号1号楼2001

法人代表：杨宝林

联系人：孙秋月

电话：（0532）85023924

客服电话：95548

(56) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人：陈共炎

联系人：辛国政

电话：（010）66568292

客服热线：400-8888-888

（57）申万宏源证券股份有限公司

注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层

法定代表人：李梅

联系人：余敏

电话：（021）33388215

客服热线：（021）96250500

（58）长江证券股份有限公司

注册地址：湖北省武汉市江汉区新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：李新华

联系人：奚博宇

电话：（021）68751860

客服热线：400-8888-999、95579

（59）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元

法定代表人：王连志

联系人：刘志斌

电话：（0755）82558038

客服热线：4008001001

（60）渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

法定代表人：王春峰

联系人：王星

电话：（022）28451709

客服热线：400-651-5988

（61）华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市江东中路228号

法定代表人：周易

联系人：庞晓芸

电话：（0755）82492193

客服电话：95597

（62）东吴证券股份有限公司

注册地址：江苏省苏州市工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：杨俊帆

电话：（0512）65581136

客服热线：（0512）65588066或4008601555

（63）信达证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：张志刚

联系人：张晓辰

电话：（010）63080994

客户服务电话：400-800-8899

（64）招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：霍达

联系人：黄蝉君

电话：（0755）82943511

客服热线：95565、400-8888-111

（65）中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：丁学东

联系人：秦朗

电话：010-85679888-6035

客服电话：4009101166

（66）国金证券股份有限公司

注册地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪

电话：028-86690057

客服电话：4006-600109

（67）中信期货有限公司

注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层

法定代表人：张皓

联系人：刘宏莹

电话：0755-82791065

客服热线：4009908826

（68）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：周健男

联系人：李芳芳

电话：（021）22169111

客服电话：95525

（69）长城证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：曹宏

联系人：李嘉禾

电话：（0755）83516094

客服热线：400-6666-888、（0755）82288968

（70）东北证券股份有限公司

注册地址：吉林省长春市生态大街6666号

法定代表人：李福春

联系人：付静雅

电话：（0431）5096710

客服电话：95360

（71）新时代证券股份有限公司

注册地址：北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法定代表人：叶顺德

联系人：田芳芳

电话：（010）83561146

客服热线：400-6989-898

（72）平安证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路荣超大厦4036号16-20

法定代表人：何之江

联系人：王阳

电话：（021）38637436

客服热线：95511-8

（73）华安证券股份有限公司

注册地址：合肥市政务文化新区天鹅湖路198号

法定代表人：李工

联系人：樊忠亚

电话：（0551）65161821

客服电话：95318，4008096518

（74）国都证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：王少华

业务联系人：刘河斌

电话：（010）84183389

客服热线：400-818-8118

（75）国盛证券有限责任公司

注册地址：南昌市北京西路88号江信国际金融大厦

法定代表人：徐丽峰

联系人：占文驰

联系：0791-86281305

客服热线：4008222111

（76）第一创业证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民

联系人：王叔胤

电话：（0755）25831754

客服热线：4008881888

（77）中泰证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经七路86号

法定代表人：李玮

联系人：秦雨晴

电话：021-20315290

客服电话：95538

（78）西南证券股份有限公司

注册地址：重庆市江北区桥北苑8号

法定代表人：廖庆轩

联系人：周青

电话：023-63786141

客服电话：4008096096

（79）国信证券股份有限公司

办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人：何如

联系人：李颖

电话：0755-82130833

客服电话：95536

（80）北京晟视天下基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街甲六号万通中心D座28层

法定代表人：蒋煜

联系人：许爽

电话：010-58170925

客服电话：4008188866

（二）注册登记机构

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：广东嘉得信律师事务所

注册地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201

办公地址：深圳市罗湖区笋岗东路中民时代广场A座201

法定代表人：闵齐双

联系人：崔卫群

经办律师：闵齐双 崔卫群

电话：（0755）33382888（总机） （0755）33033936（直线） 13480989076

传真：（0755）33033086

（四）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：薛竞、俞伟敏

五、基金名称

融通通瑞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

本基金将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，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。

八、基金的投资范围

本基金主要投资于具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、公司债、可转换债券（含分离型可转换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。

本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%。本基金还可投资于股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的20%。本基金持有的现金（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不低于基金资产净值的5%。

基金管理人应当自转型为“融通通瑞债券型证券投资基金”起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

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。

九、基金的投资策略

基金将坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求目标回报。具体投资策略如下：

1、稳健资产配置

本基金80%以上的基金资产投资于债券资产，本基金权益类金融工具的投资比例上限不超过基金资产的20%，以便控制市场波动风险。随着股票市场的波动，基金管理人还将采取风险预算策略，在市场上涨幅度较大时采用止盈策略，在市场下跌较快时采用止损策略，以追求绝对回报为目标。

2、债券投资策略

本基金将在保持组合低波动性的前提下，运用多种积极管理增值策略，追求绝对回报。绝对回报投资组合的目标在于资本金保值、持续性地以绝对正回报的方式实现增值。

（1）久期调整策略

本基金将根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，降低组合久期，以规避债券价格下降的风险。

（2）收益率曲线策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化的预测，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

（3）债券类属配置策略

根据国债、金融债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。

（4）骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况（通常是收益率曲线短端的1-3年，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着基金持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，基金从而可获得资本利得收入。

（5）相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银行间的市场利差等。金融债与国债的利差由税收因素形成，利差的大小主要受市场资金供给充裕程度决定，资金供给越充分上述利差将越小。交易所与银行间的联动性随着市场改革势必渐渐加强，两市之间的利差能够提供一些增值机会。

（6）信用利差策略

企业债与国债的利差曲线理论上受经济波动与企业生命周期影响，相同资信等级的公司债在利差期限结构上服从凸性回归均衡的规律。内外部评级的差别与信用等级的变动会造成相对利差的波动，另外在经济上升或下降的周期中企业债利差将缩小或扩大。管理人可以通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资策略。

（7）回购放大策略

该策略在资金相对充裕的情况下是风险很低的投资策略。即在基础组合的基础上，使用基础组合持有的债券进行回购放大融入短期资金滚动操作，同时选择2年以下的交易所和银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债券与货币市场利率的利差。

（8）可转债投资策略

可转债不同于一般的企业债券，其投资人具有在一定条件下转股、回售的权利，因此其理论价值等于作为普通债券的基础价值加上可转债内含选择权的价值。本基金投资于可转债，主要目标是降低基金净值的下行风险，基金投资的可转债可以转股，以保留参与股票升值的收益潜力。

①积极管理策略

可转债内含选择权定价是决定可转债投资价值的关键因素。本基金将采取积极管理策略，重视对可转债对应股票的分析与研究，选择那些公司行业景气趋势回升、成长性好、估值水平偏低或合理的转债进行投资，以获取收益。

②一级市场申购策略

目前，可转债均采用定价发行，对于那些发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债，因供求不平衡，会产生较大的一、二级市场价差。因此，为增加组合收益，本基金将在充分研究的基础上，参与可转换债券的一级市场申购，在严格控制风险的前提下获得稳定收益。

（9）资产支持证券投资策略

对于资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等资产支持证券，其定价受多种因素影响，包括市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率等。本基金将深入分析上述基本面因素，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估其内在价值。

3、股票投资策略

（1）个股精选策略

本基金将主要采取自下而上的个股精选策略，投资于具备稳定内生增长、能给股东创造经济价值（EVA）的股票。基金将以超额收益（ α 值）为目标，利用“多因素选股模型”，综合考察股票所属行业发展前景、上市公司行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，挑选出预期表现将超过大盘的个股，构建核心组合。

（2）组合动态调整策略

本基金将根据市场波动性及其走向趋势，采用时间平均法调整建仓节奏，控制建仓成本，同时设置止赢止损点，在组合获利达到既定目标时及时兑现，以实现基金每年的绝对收益目标。

基金在构建股票组合时，会根据最近一段时间市场走势，预先设定建仓节奏。如市场振荡较大时，基金将放慢建仓节奏，如市场趋势明显、振荡不大时，基金将加快建仓节奏。时间平均法可有效控制建仓成本，降低组合波动。另外，基金将监控股票组合的表现，根据对市场走势和宏观经济的预期，预先设定组合止赢点，在止赢点附近，基金将部分变现，降低股票仓位，以兑现收益。

4、权证投资策略

本基金将在严格控制风险的前提下，主动进行权证投资。基金权证投资将以价值分析为基础，在采用数量化模型分析其合理定价的基础上，把握市场的短期波动，进行积极操作，追求在风险可控的前提下实现稳健的超额收益。

未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

十、基金的业绩比较基准

中债综合（全价）指数收益率

十一、基金的风险收益特征

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

十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国建设银行股份有限公司根据基金合同规定，于2019年6月11日复核了本报告的内容，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2019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	5,504,146.80	7.82
	其中：股票	5,504,146.80	7.82
2	基金投资	-	0.00
3	固定收益投资	61,555,899.86	87.49
	其中：债券	61,555,899.86	87.49
	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	1,689,616.91	2.40
8	其他资产	1,608,097.26	2.29
9	合计	70,357,760.83	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	104,287.00	0.18
B	采矿业	139,745.00	0.24
C	制造业	3,291,094.80	5.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	130,557.00	0.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	44,499.00	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	70,544.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	377,763.00	0.66
J	金融业	484,408.00	0.84
K	房地产业	231,670.00	0.40
L	租赁和商务服务业	399,214.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	65,884.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	40,800.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	123,681.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	5,504,146.80	9.58

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601888	中国国旅	5,300	371,424.00	0.65
2	600801	华新水泥	12,200	279,380.00	0.49
3	002157	正邦科技	15,200	247,608.00	0.43
4	600031	三一重工	17,000	217,260.00	0.38
5	300630	普利制药	2,800	210,532.00	0.37
6	000568	泸州老窖	3,000	199,740.00	0.35
7	000338	潍柴动力	13,200	156,420.00	0.27
8	600585	海螺水泥	4,000	152,720.00	0.27
9	000661	长春高新	400	126,796.00	0.22
10	002110	三钢闽光	7,500	123,675.00	0.22

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	40,567,000.00	70.62
	其中：政策性金融债	40,567,000.00	70.62
4	企业债券	13,350,843.00	23.24
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	2,643,500.00	4.60
7	可转债（可交换债）	4,994,556.86	8.69
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	61,555,899.86	107.15

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	180210	18国开10	100,000	10,260,000.00	17.86
2	180202	18国开02	100,000	10,166,000.00	17.70
3	180211	18国开11	100,000	10,141,000.00	17.65
4	190201	19国开01	100,000	10,000,000.00	17.41
5	136833	G17三峡1	50,000	5,084,000.00	8.85

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。

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、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。

9、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

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。

9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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基金合同规定的备选股票库。

10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,477.99
2	应收证券清算款	501,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,097,794.28
5	应收申购款	824.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,608,097.26

10.4 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	113509	新泉转债	1,078,300.00	1.88
2	113015	隆基转债	979,840.00	1.71
3	113019	玲珑转债	564,850.00	0.98
4	128035	大族转债	439,800.00	0.77
5	113013	国君转债	355,230.00	0.62
6	110038	济川转债	338,610.00	0.59

10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

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2014年11月14日，基金业绩截止日为2018年12月31日。

自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：

1、融通通瑞债券 A/B

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
2014年度	-1.70%	0.30%	-0.91%	0.19%	-0.79%	0.11%
2015年度	9.46%	0.56%	4.19%	0.08%	5.27%	0.48%
2016年度	-4.55%	0.25%	-1.63%	0.09%	-2.92%	0.16%
2017年度	4.58%	0.12%	-3.38%	0.06%	7.96%	0.06%
2018年度	-1.40%	0.19%	4.79%	0.07%	-6.19%	0.12%

2、融通通瑞债券 C

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
2014年度	-1.80%	0.30%	-0.91%	0.19%	-0.89%	0.11%
2015年度	8.66%	0.56%	4.19%	0.08%	4.47%	0.48%
2016年度	-5.81%	0.27%	-1.63%	0.09%	-4.18%	0.18%
2017年度	4.08%	0.13%	-3.38%	0.06%	7.46%	0.07%
2018年度	-1.72%	0.19%	4.79%	0.07%	-6.51%	0.12%

十四、基金费用概览

（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、基金的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、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他费用。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

（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

本基金管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

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

本基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 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、公休假等，支付日期顺延。

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 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，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取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

3、基金的销售服务费

融通通瑞债券型证券投资基金之通瑞 A、通瑞 B 份额不收取销售服务费，通瑞 C 份额收取销售服务费，其销售服务费将专门用于本基金通瑞 C 份额的销售与基金份额持有人服务。

在通常情况下，销售服务费按前一日通瑞 C 份额基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为通瑞 C 份额每日应计提的销售服务费

E 为通瑞 C 份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由托管人根据与管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内从基金资产中划出，分别支付给各个基金销售机构。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，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

上述（一）基金费用的种类中第4—8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，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；
- 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）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率（但根据法律法规的要求提高该等报酬费率标准的除外），须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（五）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。

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金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

本招募说明书根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《融通通瑞债券型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的要求，对本基金管理人最近一期刊登的本基金招募说明书及摘要进行了更新，主要更新的内容如下：

根据2019年9月1日生效的《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及本基金基金合同、托管协议的修订，更新招募说明书的“重要提示”、“一、绪言”、“二、释义”、“三、基金管理人”、“八、基金份额的申购、赎回与转换”、“十二、基金资产的估值”、“十三、基

金的收益分配”、“十四、基金费用与税收”、“十五、基金的会计与审计”、“十六、基金的信息披露”、“十八、基金合同的变更、终止与基金财产的清算”、“十九、基金合同的内容摘要”、“二十、基金托管协议的内容摘要”等章节内容。

融通基金管理有限公司

二〇一九年十二月十三日