

融通七天理财债券型证券投资基金招募说明书摘要

2013年第1号

重要提示

融通七天理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证监会 2012 年 12 月 19 日证监许可[2012]1715 号文核准募集。本基金基金合同于 2013 年 3 月 14 日正式生效。

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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，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。

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，并经中国证监会核准。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。

除特别说明外，本招募说明书摘要所载内容截止日为 2013 年 9 月 13 日，有关财务数据截止日为 2013 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日期

2013 年 3 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

注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

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：田德军

电话：（0755）26948070

联系人：敖敬东

注册资本：12500 万元人民币

目前公司股东及出资比例为：新时代证券有限责任公司 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

董事长田德军先生，经济学博士，现任融通基金管理有限公司董事长。历任中信证券股份有限公司投资银行业务主管；上海远东证券有限公司董事长兼总经理；新时代证券有限责任公司总经理。2010 年 3 月至今，任公司董事长。

独立董事杜婕女士，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、执业律师。现任南开大学金融学教授（博士生导师）、金融发展研究院副院长（主持工作）。曾经就读伦敦大学伦敦商学院，执教于密歇根大学 WDI

研究所、北京大学光华管理学院、长江商学院。2011 年 1 月至今，任公司独立董事。

独立董事施天涛先生，教授。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。现任新时代证券有限责任公司名誉董事长。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 年至今，任公司董事。

董事奚星华先生，经济学硕士。现任融通基金管理有限公司总经理。历任长财证券经纪有限责任公司总裁；恒泰长财证券有限责任公司法定代表人。2012 年 1 月至今，任公司董事。

董事 Frederick Reidenbach (弗莱德) 先生，毕业于美国宾夕法尼亚州斯克兰顿大学，注册会计师。现任日兴资产管理有限公司执行副总裁兼首席财务官和首席营运官。历任日本富达投资首席行政官；富达投资 (Fidelity Investment) 旗下子公司 KVH 电信的首席执行长和首席营运官；日本 Aon Risk Service 的首席财务官和首席营运官。2010 年 3 月至今，任公司董事。

董事 Blair Pickerell (裴布雷) 先生，工商管理硕士。现任日兴资产管理香港有限公司亚洲区总裁及全球首席营销总监。历任摩根士丹利亚洲有限公司董事总经理。2012 年 1 月至今，任公司董事。

董事涂卫东先生，法学硕士。现任融通基金管理有限公司督察长。历任国务院法制办公室(原国务院法制局)财金司一处主任科员；中国证监会基金监管部监管一处处级干部；中国证监会公职律师。2009 年 4 月至今，任中共融通基金管理有限公司支部委员会副书记。2010 年 3 月至今，任公司董事。

2、现任监事情况

监事李华先生，经济学硕士，现任公司监察稽核部总监。曾任北京大学经济管理系讲师，1993 年起历任广东省南方金融服务总公司基金部副总经理、广东华侨信托投资公司规划发展部总经理、广州鼎源投资理财顾问有限公司总经理兼广东南方资信评估公司董事长、天一证券有限责任公司广州营业部总经理及华南业务总部总经理。2011 年至今任公司监事。

3、公司高级管理人员情况

总经理奚星华先生，经济学硕士。历任黑龙江省证券公司宏观行业研究员，北京时代博讯高科技投资有限公司投资业务副总经理，长财证券经纪有限责任公司总裁，恒泰长财证券有限责任公司执行董事、法定代表人。2011 年至今任公司总经理。

常务副总经理颜锡廉 (Allen Yan) 先生，工商管理硕士。历任美国富达投资公司财务分析员、日本富达投资公司财务经理，日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。2011 年至今任公司常务副总经理。

副总经理秦玮先生，工学硕士。历任中国工商银行深圳分行格兰信息咨询公司总经理助理，鹏华基金管理有限公司行政部总监，融通基金管理有限公司登记清算部总监、总经理助理等职务。2009 年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 年至今任公司督察长。

4、基金经理

张李陵先生，CFA，清华大学经济学硕士、理学学士，6 年证券从业经验，具有基金从业资格。2006 年 7 月至 2012 年 7 月在招商银行总行工作，主要从事债券投资和交易。2012 年 7 月加入融通基金管理有限公司。现任融通债券基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

公司投资决策委员会由总经理奚星华先生、常务副总经理颜锡廉（Allen Yan）先生、总经理助理陈晓生先生、基金管理部总监吴巍先生、研究策划部总监邹曦先生、基金交易部总监王冰心先生、基金经理郭恒先生组成。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人概况

1、基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 349,018,545,827 元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

2、主要人员情况

截至 2013 年 6 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 163 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、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，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2013 年 6 月，中国工商银行共托管证券投资基金 314 只，其中封闭式 3 只，开放式 311 只。自 2003 年以来，本行连续十年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 40 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

基金管理人通过在深圳设立的理财中心、在北京和上海设立的分公司以及网上直销为投资者办理开放式基金开户、认购、申购、赎回、基金转换等业务：

（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

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：关澜

联系电话：(0755) 26948004

传真：(0755) 26935139

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服务北京小组

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

邮编：100033

联系人：宋雅萍

联系电话：(010) 66190975

传真：(010) 88091635

(3) 融通基金管理有限公司机构理财部机构销售及服务上海小组

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

邮编：200120

联系人：居雯莉

联系电话：(021) 38424984

传真：(021) 38424884

(4) 融通基金管理有限公司网上直销

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：刘晶

联系电话：(0755) 26948105

传真：(0755) 26948079

2、代销机构

(1) 中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

联系人：杨菲

电话：(010) 66107909

(2) 深圳众禄基金销售有限公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号发展银行大厦 25 楼 I、J 单元

法定代表人：薛峰

联系人：童彩平

电话：(0755) 33227950

(3) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市浦东新区峨山路 613 号 6 幢 551 室

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3 号楼 C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：练兰兰

电话：(021) 54509998

(4) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 685 弄 37 号 4 号楼 449 室

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 903~906 室

法定代表人：杨文斌

联系人：张茹

电话：(021) 58870011

(5) 杭州数米基金销售有限公司

注册地址：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号

办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼

法定代表人：陈柏青

联系人：周嫵旻

电话：(0571)28829790 (021)60897869

客服电话：4000-766-123

(6) 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

法人代表：闫振杰

电话：010-62020088

传真：010-62020355

联系人：王婉秋

客服电话：400-888-6661

(7) 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：权唐

电话：(010) 85130577

客服电话：400-8888-108

(8) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：储晓明

联系人：曹晔

电话：(021) 33388215

客服电话：95523 或 4008895523

(9) 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：高冠江

联系人：唐静

联系电话：(010) 88656476

客服电话：4008008899

(10) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 楼

法定代表人：黄耀华

联系人：刘阳

电话：(0755) 83516289

客服电话：4006666888

(11) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

联系人：安岩岩

电话：(0431) 85096517

客服电话：4006000686

(12) 平安证券有限责任公司

办公地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场 8 楼

法定代表人：杨宇翔

联系人：郑舒丽

电话：(0755) 22626391

客服电话：95511-8

(13)恒泰证券股份有限公司

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：庞介民

联系人：王旭华

电话：(0471) 4972343

客服电话：(0471) 4961259

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代理销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

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：田德军

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：深圳市红岭中路国信证券大厦 12 楼

办公地址：深圳市红岭中路国信证券大厦 12 楼

法定代表人：闵齐双

联系人：尹小胜

经办律师：闵齐双 刘少华 尹小胜 崔卫群

电话：075533382888（总机） 075533033020（直线） 15302728596

传真：075533033086

（四）会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼（邮编：200120）

法人代表：杨绍信

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：刘莉

经办注册会计师：薛竞、王灵

五、基金的名称

融通七天理财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

在严格控制投资风险和保持资产流动性的前提下，追求稳定的当期收益，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。

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：现金，通知存款，一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单，剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，短期融资券，及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他固定收益类金融工具。

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

本基金主要投资于固定收益类品种。本基金采取自上而下的投资分析方法，在预判宏观经济形势的基础上，跟踪通胀走势和政策取向，对收益率曲线的变动进行分析和预测。在此基础上，综合使用各种投资策略，以确定组合构成。本基金的具体投资策略包括利率预期和资产配置策略、估值策略、久期控制和流动性管理策略、选时与套利策略等部分。

1、利率预期和资产配置策略

根据宏观经济指标（存贷款利率水平、CPI 指标、GDP 增长率、货币供应量、汇率等）判断当前经济周期所处的阶段，关注并预测未来利率变化趋势，以此决定基金投资组合的平均剩余期限；依照投资时钟理论，根据各大类属资产的收益水平、平均剩余期限、流动性特征（如平均日交易量、交易场所、机构投资者持仓情况、回购抵押情况等），决定基金投资组合中各类属资产的配置比例。

2、估值策略

根据以往债券收益率变动与宏观经济变量之间的联系，结合当期经济形势特点，建立不同品种债券的收益率曲线预测模型，并通过这些模型对债券进行估值，测算不同经济情景下各品种债券的价格中枢和变动趋势。根据收益率、流动性、风险匹配原则以及对债券估值变动的预测构建投资组合，合理选择不同市场中有投资价值的券种，并根据投资环境的变化相机调整。

3、久期控制和流动性管理策略

为控制风险、保证流动性，根据持有人的平均持有期限确定组合的平均持有期限，保证组合的平均剩余期限控制在 127 天以内。关注宏观经济指标和政策取向，预判资金面状况，提前安排资金以应对流动性紧张的市场环境。具体操作上，通过主动控制同业存款的比例、保留充足的可变现资产和平均安排回购到期期限，确保组合具有充足的流动性资产；预判市场流动性状况，提前对债券投资的比例和久期进行调整，在确保组合收益的前提下增强变现能力。

4、选时与套利策略

市场和品种的多样性以及风险收益差异提供了丰富的无风险套利机会，如：

（1）分析市场变动趋势，把握回购利率波动规律，对回购资产进行时间方向上的动态配置策略。根据回购利差进行回购品种的配置比例调整。

（2）把握大盘新股发行、季节因素、日历效应等，捕捉回购利率的高点。对银行间市场和交易所市场出现的跨市场套利机会，进行跨市场套利。

（3）对于跨期限套利，进行严格的实证检验，在控制风险的基础上进行操作。在短期债券的单个债券选择上利用收益率利差策略、收益率曲线策略选择收益率高或价值被低估的短期债券，进行投资决策。

5、其他衍生工具投资策略

本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向，一旦有新的产品推出市场，在履行适当程序后，将在届时相应法律法规的框架内，制订符合本基金投资目标的投资策略，同时结合对衍生工具的研究，在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下，谨慎进行投资。本基金将按照相关法律法规通过利用其他衍生金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，并通过灵活运用趋势投资策略获取收益。

（四）投资操作程序

投资决策委员会是公司投资方面最高层决策机构，定期就投资管理重大问题进行讨论，确定基金投资策略。

- 1、宏观分析师根据宏观经济形势、物价形势、货币政策等分析市场利率的走向；
 - 2、固定收益研究团队分析债券市场基本面、债券市场供求、收益率曲线变化情况；
 - 3、固定收益研究团队负责信用风险的评估、信用利差的分析及信用评级的调整；
 - 4、固定收益研究团队根据宏观经济形势和债券市场投资策略的研究结果，结合基金特点向基金经理提供债券投资策略和资产配置方案建议；
 - 5、基金经理参考固定收益研究团队投资建议，拟定下一阶段基金投资债券配置方案，报投资决策委员会讨论；
 - 6、投资决策委员会根据上报的投资策略建议和资产配置方案，进行久期决策并形成决议；
 - 7、根据投资决策委员会批准的资产配置决议，基金经理综合流动性、收益和久期策略构建资产组合和进行个券选择，并负责债券组合日常管理和动态优化；
 - 8、债券交易员接受指令进行询价和反馈后达成交易，并且跟踪券款交割情况；
 - 9、风险管理部负责完成基金内部业绩和风险评估，提交评价报告。
- 投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况，对上述管理程序作出调整。

（五）投资限制

1、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）向他人贷款或者提供担保；
 - （3）从事承担无限责任的投资；
 - （4）买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
 - （5）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
 - （6）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；
 - （7）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；
 - （8）依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他活动。
- ##### 2、本基金不得投资于以下金融工具：
- （1）股票、权证；
 - （2）可转换债券；
 - （3）剩余期限（或回售期限）超过 397 天的债券；
 - （4）信用等级在 A+ 级以下的企业债券；
 - （5）以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券，但市场条件发生变化后另有规定的，从其规定；
 - （6）非在全国银行间债券交易市场或证券交易所交易的资产支持证券；
 - （7）中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制后，本基金不受上述规定的限制。

3、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

- (1) 本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 127 天；
- (2) 投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的 10%；
- (3) 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%；
- (4) 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%；
- (5) 本基金的存款银行应为至少具有基金托管资格、基金代销资格或 QFII 托管人资格之一的商业银行；
- (6) 本基金投资于定期存款（根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款除外）的比例，不得超过基金资产净值的 30%；
- (7) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的协议存款，不得超过基金资产净值的 30%；存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款，不得超过基金资产净值的 5%；
- (8) 本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%；
- (9) 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%；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%；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%；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%；本基金应投资于信用级别评级为 AAA 以上（含 AAA）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；
- (10) 本基金投资的短期融资券的信用评级，应不低于以下标准：
 - 1) 国内信用评级机构评定的 A-1 级或相当于 A-1 级的短期信用级别；
 - 2) 根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券，其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一：
 - i) 国内信用评级机构评定的 AAA 级或相当于 AAA 级的长期信用级别；
 - ii) 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别（例如，若中国主权评级为 A-级，则低于中国主权评级一个级别的为 BBB+级）。
 - 3) 同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的，以国内信用级别为准。
 - 4) 本基金持有短期融资券期间，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 20 个交易日内予以全部减持。
- (11) 中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价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。

基金管理人应当自基金合同生效之日起 14 个交易日内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，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。

十、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：七天通知存款税后利率。

通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的

存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。

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，或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩基准时，经与基金托管人协商一致，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。

十一、基金的风险收益特征

本基金为债券型基金，预期收益和风险水平低于混合型基金、股票型基金，高于货币市场基金。

十二、基金投资组合报告

本基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于 2013 年 7 月 15 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 2013 年 6 月 30 日。本报告中所列财务数据未经审计。

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	固定收益投资	29,960,452.21	20.15
	其中：债券	29,960,452.21	20.15
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	117,515,932.92	79.05
4	其他资产	1,191,322.90	0.80
5	合计	148,667,708.03	100.00

2、报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	3.21	
	其中：买断式回购融资	0.00	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本基金合同约定：“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%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

3、基金投资组合平均剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 180 天。

3.2 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	66.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	12.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)-397 天(含)	20.19	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.40	-

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	摊余成本(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	19,959,913.69	13.45
	其中：政策性金融债	19,959,913.69	13.45
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	10,000,538.52	6.74
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	29,960,452.21	20.19
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	130218	13 国开 18	200,000	19,959,913.69	13.45
2	041362015	13 满世煤炭 CP001	100,000	10,000,538.52	6.74

6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0305%
报告期内偏离度的最低值	-0.2051%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0372%

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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、投资组合报告附注

8.1 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

8.2 本报告期内本基金没有出现持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利

率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况。

8.3 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。

8.4 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	441,322.90
4	应收申购款	750,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,191,322.90

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。

本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

基金业绩截止日为 2013 年 6 月 30 日。

融通七天理财债券 A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
2013 年 3 月 14 日（基金合同生效）起至 2013 年 6 月 30 日	0.9329%	0.0026%	0.4032%	0.0000%	0.5297%	0.0026%

融通七天理财债券 B

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 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
2013 年 3 月 14 日（基金合同生效）起至 2013 年 6 月 30 日	1.0223%	0.0026%	0.4032%	0.0000%	0.6191%	0.0026%

十四、基金费用与税收

（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。

（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 0.27% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

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 2 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 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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 2 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、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 A 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。

本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 B 类基金份额持有人的费率。

各类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下：

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

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金资产中划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“一、基金费用的种类中第 4—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 2013 年 3 月 4 日刊登的本基金招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

- 1、在“二 释义”部分,根据最新资料更新了《基金法》及《销售办法》相关信息;
- 2、在“三 基金管理人”部分,根据最新资料更新了董事及公司高管人员情况;
- 3、在“四 基金托管人”部分,对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况按照最新资料进行了更新;
- 4、在“五 相关服务机构”部分,更新了公司直销机构联系人信息;根据最新资料更新了代销机构信息;新增深圳众禄基金销售有限公司、上海天天基金销售有限公司、上海好买基金销售有限公司、杭州数米基金销售有限公司、北京展恒基金销售有限公司、中信建投证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司信达证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、平安证券有限责任公司及恒泰证券股份有限公司为本基金代销机构;
- 5、在“七 基金的募集”部分,根据实际募集结果更新了相关信息;
- 6、在“八 基金合同的生效”部分,根据基金合同的实际生效日期更新了相关信息;
- 7、在“十、基金的投资”部分,更新了“(十一)基金投资组合报告”的内容,更新数据为本基金 2013 年 2 季度报告中的投资组合数据;
- 8、在“十一、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“二十二、对基金份额持有人的服务”部分,更新了网上交易服务相关内容;
- 10、在“二十三、其他应披露事项”部分,对本基金自上次招募说明书披露日至 2013 年 9 月 14 日期间的公告信息进行了列示。

融通基金管理有限公司

2013年10月24日