融通医疗保健行业混合型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

§1 重要提示

本基金的管理人于2015年8月7日发布公告,根据2014年8月8日实施的《公开募集证券投资基金动作管理办法》第三十条的相关规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商,并报中国证监会备案,自2015年8月7日起,本基金名称由原“融通医疗保健行业股票型证券投资基金”更名为“融通医疗保健行业混合型证券投资基金”,本次基金更名不改变基金投资范围,对基金份额持有人利益无实质性不利影响。

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通医疗保健混合
交易代码	161616
前端交易代码	161616
后端交易代码	161617
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月26日
报告期末基金份额总额	1,660,613,214.91份
投资目标	本基金主要投资于医疗保健行业股票,在合理控制投资风险的基础上,获取基金资产的长期增值,力争实现超越业绩基准的长期收益。
投资策略	本基金主要投资于医疗保健行业股票,立足行业未来发展主要驱动力“变革与创新”,把握医疗政策改革机遇,发展以药物创新为主的核心竞争力,根据“高增长+核心竞争力”的选股原则精选个股,力争获取超越业绩基准的业绩表现。
业绩比较基准	申万医药生物行业指数收益率×80% +中债综合全价(总值)指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为主动股票型行业基金,属于预期风险收益水平较高的基金品种,其预期收益和风险高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金自2015年10月1日起启用新的业绩比较基准:“申万医药生物行业指数收益率×80% +中债综合全价(总值)指数收益率×20%”。详见本基金管理人于2015年11月11日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	37,363,219.19
2.本期利润	628,220,924.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.3663
4.期末基金资产净值	2,645,485,414.02
5.期末基金份额净值	1.593

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字;

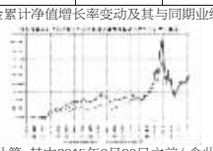
(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	29.30%	2.17%	20.43%	1.55%	8.87%	0.62%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金业绩基准项目分段计算,其中2015年9月30日之前(含此日)采用“申万医药生物行业指数收益率×80% +中信标普全债指数收益率×20%”,本基金业绩基准项目分段计算,其中2015年9月30日之前(含此日)采用“申万医药生物行业指数收益率×80% +中债综合全价(总值)指数收益率×20%”。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋秀蕾	本基金、融通健康产业灵活配置混合的基金经理	2012年9月6日	-	8	药物化学硕士学位,具有基金从业资格。2006年8月起,先后担任朗生医药(深圳)有限公司产品经理、招商证券研发中心研究员、嘉联融丰投资有限公司投资经理。2009年2月加入融通基金管理有限公司,先后担任研究策划部行业研究员、行业组长。

注:任职日期指根据基金管理人对外披露的任职日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年第四季度,市场反弹态势明确,创业板为代表的中小型上市公司反弹为龙头,一大批战略新兴产业板块如新能源、影视传媒、虚拟现实、精准医疗表现持续活跃,转型和创新是四季度A股市场的主题词,而传统产业继续处于去库存去产能的阶段,除地产、券商外基本没有明显机会。医药行业本身行业数据显示(1-11月份统计局公布行业收入增长9%,利润增长13.6%)继续延续低增长状态,子行业来看,中药行业涨幅最大。第四季度申万医药指数上涨25.3%,跑赢沪深300指数8.9个百分点,整体涨跌幅居28个申万一级子行业第12位。

医疗保健行业基金在第四季度格遵循基金契约要求,按照资产配置预案要求,坚持“创新+转型”的核心配置思路,在医药传统板块增速下滑的不利环境下,积极调整策略,仓位上偏进攻,重点布局精准医疗板块、第三方影像板块和转型大健康产业个股,并积极阶段性配置养老、康复等代表医疗服务未来发展趋势的新兴方向。

展望16年一季度,供给侧改革带动传统产业去产能、国企改革以及创新都孕育着很大的机会,流动性继续保持宽松环境,资本市场在去杠杆结束后将逐步恢复常态。医药行业内部,医疗体制改革和年底的药品招标将带动行业走出底部,行业经济数据预计将企稳回升,创新类资产上精准医疗和医药电商依然是行业未来发展的大方向,此外养老、康复、第三方影像等新兴方向将支撑未来医药行业发展的新格局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内基金份额净值增长率为29.30%,同期业绩比较基准收益率为20.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无

§5 投资组合报告

5.1 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	2,445,242,573.74	87.77
	其中:股票	2,445,242,573.74	87.77
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	325,273,595.91	11.68
8	其他资产	15,548,174.85	0.56
9	合计	2,786,064,344.50	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农,林,牧,渔业	179,690,985.76	6.79
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,411,947,887.45	53.37
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	581,936,619.39	22.00
G	交通运输,仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	30,120,000.00	1.14
J	金融业	-	-
K	房地产业	127,556,545.75	4.82
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	78,014,535.39	2.95
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	-	-
R	文化,体育和娱乐业	35,976,000.00	1.36
S	综合	-	-
	合计	2,445,242,573.74	92.43

5.3 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	300109	新开源	2,036,300	211,877,015.00	8.01
2	000078	海王生物	8,000,000	191,680,000.00	7.25
3	600422	昆药集团	4,499,985	179,189,402.70	6.77
4	600682	南京新百	5,000,000	164,900,000.00	6.23
5	600085	同仁堂	3,080,014	137,399,424.54	5.19
6	300171	东富龙	4,299,956	128,912,680.88	4.87
7	300341	麦迪电气	4,662,528	127,799,892.48	4.83
8	300143	星河生物	3,475,476	102,735,070.56	3.88
9	000403	ST生化	2,999,961	88,018,855.74	3.33
10	600645	中源协和	1,200,039	78,014,535.39	2.95

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内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、处罚的情形。

本基金投资的ST生化(000403)在报告编制日(2015年12月31日)前一年内受到过公开谴责、处罚,分别是14年7月2日、14年8月8日和14年9月16日公告收到中国证券监督管理委员会山西监管局《行政监管措施决定书》的公告,公司经过整改后于14年12月20日发布整改情况说明公告,公告显示公司已经对“唯康药业公司治理结构、内控、老厂区土地转让会计核算不规范、停建公告和整体搬迁改造过程中运作不规范情况”进行了整改。公司后面又于15年1月10日收到中国证监会行政处罚决定书的公告,公告显示针对公司13年底因一些违法事实(主要是信息披露方面的问题)证监会立案调查后,公司积极配合调查,证监会给出了相应的行政处罚决定(主要是罚款和当事人给予警告),公司公告接受证监会的处罚,不申请行政复议和提起行政诉讼,称在规定时间内缴纳罚款,并诚恳地向投资者致歉。另外,公司又于15年12月18日收到中国证监会行政处罚决定书的公告,显示公司在筹划重大资产重组过程中存在信息披露不及时不准确的问题,给予公司出具警示函的监管措施。

本基金本着严格的公司流程和基本面的分析投资ST生化,内外部报告、人股票库和投资环节都符合相关投资决策规定。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,369,188.60
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	52,146.43
5	应收申购款	13,126,839.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,548,174.85

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600682	南京新百	164,900,000.00	6.23	重大资产重组事项
2	600645	中源协和	78,014,535.39	2.95	临时停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,811,657,723.54
报告期期间基金总申购份额	199,007,667.63
减:报告期期间基金总赎回份额	350,052,176.26
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,660,613,214.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,135,935.48
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,135,935.48
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.19

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)《融通医疗保健行业混合型证券投资基金基金合同》

(二)《融通医疗保健行业混合型证券投资基金托管协议》

(三)《融通医疗保健行业混合型证券投资基金招募说明书》及其更新

(四)中国证监会批准融通医疗保健行业股票型证券投资基金设立的文件

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2016年1月22日

融通行业景气证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通行业景气混合
交易代码	161606
前端交易代码	161606
后端交易代码	161656
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年4月29日
报告期末基金份额总额	1,273,330,954.80份
投资目标	通过把握行业发展趋势、行业景气程度以及市场运行趋势为持有人获取长期稳定的投资收益。
投资策略	在对市场趋势判断的前提下,重视仓位选择和行业配置,强调以行业为导向进行个股选择,投资于具有良好成长性的行业及其上市公司股票,把握由市场需求、技术进步、国家政策、行业整合等因素带来的行业性投资机会。公司基本面是行业投资价值的直接反映,将结合行业景气情况选择该行业内最具代表性的上市公司作为投资对象。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%
风险收益特征	在锁定可承受风险的基础上,追求较高收益
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

注:本基金自2015年10月1日起启用新的业绩比较基准:“沪深300指数收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×30%”。详见本基金管理人于2015年11月11日发布的《融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金变更业绩比较基准及修改相关基金合同的公告》。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)
1.本期已实现收益	152,752,916.46
2.本期利润	393,503,295.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.3461
4.期末基金资产净值	1,580,357,692.88
5.期末基金份额净值	1.241

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

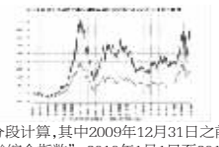
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	38.66%	2.38%	12.08%	1.17%	26.58%	1.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金业绩基准项目分段计算,其中2009年12月31日之前(含此日)采用“70%×上证综合指数+30%×银行间债券综合指数”,2010年1月1日至2015年9月30日采用“沪深300指数收益率×70%+中信标普全债指数收益率×30%”,2015年10月1日起使用新基准即“沪深300指数收益率×70%+中债综合全价(总值)指数收益率×30% 。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邹曦	本基金的基金经理	2012年7月3日	-	14	中国人民银行研究生部金融学硕士,具有基金从业资格。1996年至1998年就职于中国航空技术进出口总公司福建分公司;2001年至今就职于融通基金管理有限公司,历任市场拓展部总监助理、机构理财部总监助理、行业分析师、宏观策略分析师、基金管理部总监、研究策划部总监。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年四季度,A股市场见底后震荡上行,整个季度沪深300指数上涨16.5%。在经历二三季度的连续暴跌之后,利空因素得到释放,泡沫程度减小,市场流动性有所恢复,出现了一定幅度的反弹。

四季度本基金一直将股票仓位维持在高位,保持了影视IP、农业养殖、新能源汽车、房地产等板块的重点配置,取得了较好的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

从本季度的投资结果来看,本基金净值上涨38.66%,跑赢比较基准,在同业中排名靠前。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 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	1,493,176,996.32	89.66
	其中:股票	1,493,176,996.32	89.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	38,048,600.00	2.28
	其中:债券	38,048,600.00	2.28
	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	119,670,038.16	7.19
8	其他资产	14,516,603.38	0.87
9	合计	1,665,412,237.86	100.00

5.2 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	285,512,321.89	18.07
B	采矿业	-	-
C	制造业	644,210,868.81	40.76
D	电力,热力,燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	19,535,500.00	1.24
F	批发和零售业	18,742,112.45	1.19
G	交通运输,仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输,软件和信息技术服务业	51,242,773.70	3.24
J	金融业	-	-
K	房地产业	133,441,782.75	8.44
L	租赁和商务服务业	34,408,323.24	2.18
M	科学研究和技术服务业	11,215,562.64	0.71
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	-	-
R	文化,体育和娱乐业	281,514,810.84	17.81
S	综合	13,352,940.00	0.84
	合计	1,493,176,996.32	94.48

5.3 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	002292	奥飞动漫	2,826,874	146,177,654.54	9.25
2	002458	益生股份	3,493,187	132,042,468.60	8.36
3	300364	中文在线	717,862	127,779,436.00	8.09
4	600622	嘉宝集团	7,458,225	126,715,242.75	8.02
5	002343	禾欣股份	2,054,897	124,732,247.90	7.89
6	002475	立讯精密	3,725,057	119,015,571.15	7.53
7	002234	民和股份	5,796,730	104,225,206.40	6.60
8	002466	天齐锂业	704,824	99,203,978.00	6.28
9	002407	多氟多	710,409	54,175,790.34	3.43
10	002299	圣农发展	2,239,411	49,244,647.89	3.12

5.4 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	38,048,600.00	2.41
	其中:政策性金融债	38,048,600.00	2.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	38,048,600.00	2.41

5.5 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	150215	15国开15	300,000	30,039,000.00	1.90
2	150202	15国开02	80,000	8,009,600.00	0.51

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

截止本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10.2 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。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,177,635.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	672,810.34
5	应收申购款	12,666,157.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,516,603.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 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中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	1,130,775,003.57
报告期期间基金总申购份额	303,048,833.37
减:报告期期间基金总赎回份额	160,492,882.14
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	1,273,330,954.80

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准融通行业景气证券投资基金设立的文件

(二)《融通行业景气证券投资基金基金合同》

(三)《融通行业景气证券投资基金托管协议》

(四)《融通行业景气证券投资基金招募说明书》及其更新

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
二〇一六年一月二十二日

融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

[2015] 第四季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通月月添利定期开放债券	
交易代码	000437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年8月29日	
报告期末基金份额总额	993,107,570.28份	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值,力争获取高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金主要投资于固定收益类品种,不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略、可转换债券投资策略以及资产支持证券的投资策略等部分。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中的较低风险品种,其预期风险与收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	融通月月添利定期开放债券A	融通月月添利定期开放债券B
下属分级基金的交易代码	000437	000438
报告期末下属分级基金的份额总额	992,246,176.37份	861,393.91份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日 - 2015年12月31日)	
	融通月月添利定期开放债券A	融通月月添利定期开放债券B
1. 本期已实现收益	15,575,419.28	12,679.12
2. 本期利润	33,316,012.18	28,053.54
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0336	0.0326
4. 期末基金资产净值	1,058,312,250.15	917,573.29
5. 期末基金份额净值	1.067	1.065

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通月月添利定期开放债券A

主要财务指标	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

融通月月添利定期开放债券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
过去三个月	3.08%	0.09%	0.39%	0.00%	2.69%	0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:(1)本基金合同生效日为2014年8月29日。

(2)本基金至报告期末已完成建仓,符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪曦	本基金、融通通瑞债券、融通通福分级的基金经理	2015年8月6日	-	3	清华大学工学学士,纽约大学硕士。3年证券从业经验,具有基金从业资格。曾任职于长城证券有限责任公司,担任宏观策略部固定收益研究员。2013年10月加入融通基金管理有限公司,任宏观、利率研究员。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为,本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2015年,宏观经济增长进一步下滑,这已经是第五年增速放缓。尽管2015年宏观救助政策和托底政策不断出台,但是与2013-2014年不同的是,这些政策并没有阻挡住经济下滑的趋势,作为宏观经济产出的主力部门——工业和制造业价格水平一路下滑,到2015年4季度更是加速下跌,其中PPI同比增速创造了超过40个月的下跌纪录。羸弱的宏观基本面背景下,债券市场持续了整年的牛市行情。四季度,特别是12月份,中长期基础利率呈现下滑的态势,节奏快,幅度大。

投资方面,本基金适当加大了杠杆和拉长了久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期A类基金份额净值增长率