

## 融通通瑞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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人和中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月20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	融通通瑞债券
交易代码	000466
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年11月14日
报告期末基金份额总额	241,725,777,777.98
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，通过积极的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现资产的长期稳健增值。
投资策略	本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。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金，高于货币市场基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	融通通瑞债券A/B 融通通瑞债券C
下级基金的交易代码	000466 000959
下级基金的前一日净值	0.9996 0.9999
下级基金的后一日交易代码	000466 000959
下级基金的后一日净值	0.9998 -
报告期末下属分级基金的份额总额	229,118,469.94份 13,607,317.06份

注：本基金由“融通瑞一年目标风险债券型证券投资基金”转型而来。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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)
融通通瑞债券A/B	融通通瑞债券C
1.本期已实现收益	6,476,294.73 364,565.00
2.本期利润	12,171,710.94 72,456.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094 0.0099
4.期末基金份额净值	245,483,946.36 14,520,949.94
5.期末基金资产净值	1,076 1,067

注：1.本期已实现收益指本基金本期利息收入、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.本基金所列示的基本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将低于所列数字。

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

融通通瑞债券A/C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.07%	1.81%	0.08%	4.30%	0.05%

融通通瑞债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.06%	0.07%	1.81%	0.08%	4.25%	0.05%

3.2.2 自基金转型以来基金份额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

融通通瑞债券A/C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.07%	1.81%	0.08%	4.30%	0.05%

融通通瑞债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.06%	0.07%	1.81%	0.08%	4.25%	0.05%

3.2.3 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

融通通瑞债券A/C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.07%	1.81%	0.08%	4.30%	0.05%

融通通瑞债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.06%	0.07%	1.81%	0.08%	4.25%	0.05%

3.2.4 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

融通通瑞债券A/C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.07%	1.81%	0.08%	4.30%	0.05%

融通通瑞债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.06%	0.07%	1.81%	0.08%	4.25%	0.05%

3.2.5 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

融通通瑞债券A/C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.07%	1.81%	0.08%	4.30%	0.05%

融通通瑞债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.06%	0.07%	1.81%	0.08%	4.25%	0.05%

3.2.6 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

融通通瑞债券A/C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.07%	1.81%	0.08%	4.30%	0.05%

融通通瑞债券C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.06%	0.07%	1.81%	0.08%	4.25%	0.05%

3.2.7 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

融通通瑞债券A/C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业债类风险收益③	业债类风险收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.11%	0.07%	1.81%	0.08%	4.30%	0.05%

融通通瑞债券C

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业债类风险收益③ | 业债类风险收益标准差④ | ①-③ |<th
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |