

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
送出日期:2016年3月30日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通通福分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同规定,于2016年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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信信用、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,也不保证基金份额净值不致其未来表现。投资者有风险,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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

| 2.1 基金基本情况 | |
|-----------------|-----------------|
| 基金名称 | 融通通福分级债券 |
| 基金代码 | 161626 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2013年12月10日 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 174,441,068.79份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市时间 | 2014年1月27日 |
| 下属分级基金的基金简称 | 融通通福分级债券A |
| 下属分级基金的基金代码 | 融通A |
| 下属分级基金的交易代码 | 161627 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,017,220.23份 |
| | 158,423,848.56份 |

| 2.2 基金业绩说明 | |
|-----------------|---|
| 投资目标 | 本基金以债券为主要投资对象,在严格控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | 本基金将采用自上而下的方法对基金资产进行动态的整体资产配置和属属资产配置,在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,根据整体资产配置策略确定大类金融资产的比例,在充分分析债券市场环境及市场流动性的基础上,根据属属资产配置策略对投资组合属属资产进行配置和调整。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中预期收益和风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币型基金,低于混合型基金和股票型基金。 |
| 下属分级基金的基金简称 | 融通通福分级债券A |
| 下属分级基金的基金代码 | 融通A |
| 下属分级基金的交易代码 | 161627 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 16,017,220.23份 |
| | 158,423,848.56份 |

| 2.3 基金管理人和基金托管人 | | | |
|-----------------|------|-----------------------------|---------------------|
| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
| 名称 | | 融通基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 洪涛 | 洪涛 |
| | 联系电话 | (0755)20948666 | (010)66105799 |
| | 电子邮箱 | service@mail.rtfund.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务热线 | | 400-883-8088、(0755)26948888 | 95588 |
| 传真 | | (0755)26950005 | (010)66105798 |

| 2.4 信息披露方式 | |
|------------|-------------------------|
| 信息披露网站 | 基金管理人网站、基金托管人网站、深圳证券交易所 |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人处、基金托管人处、深圳证券交易所 |

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

| 3.1 主要会计数据和财务指标 | | 金额单位：人民币元 | |
|-----------------|----------------|----------------|---------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2015年 | 2014年 | 2013年12月31日(基金合同生效日)2013年12月31日 |
| 本期已实现收益 | 24,315,336.95 | 37,840,470.09 | 1,505,030.77 |
| 本期公允价值变动损益 | 42,854,258.23 | 56,796,477.14 | 1,191,621.16 |
| 加:期初基金净值本期期初 | 0.3177 | 0.1310 | 0.0023 |
| 期末基金净值/净值增长率 | 24.98% | 23.73% | 0.26% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2015年年末 | 2014年年末 | 2013年年末 |
| 期末可供分配基金份额净值 | 0.3509 | 0.1428 | 0.0023 |
| 期末基金资产净值 | 259,094,454.34 | 262,502,984.70 | 528,240,282.44 |
| 期末基金份额净值 | 1.485 | 1.199 | 1.002 |

注:(1)本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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)期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润-期末基金份额总额,其中期末可供分配利润,如果期末未分配利润的未实现部分为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分,如果期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

注:本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。

融通通福分级债券型证券投资基金

2015 年度 报告 摘要

融通通福分级债券型证券投资基金

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

2015 年度 报告 摘要

1.7.3 期末国债期货投资资产

本基金本报告期末未持有国债期货。

1.8 投资组合报告附注

1.8.1 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。

1.8.2 期末其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|--------------|
| 1 | 卖出回购资金 | -- |
| 2 | 应收证券清算款 | -- |
| 3 | 应收利息 | 7,664,173.39 |
| 4 | 应收股利 | -- |
| 5 | 应收申购款 | -- |
| 6 | 其他应收款 | -- |
| 7 | 预摊费用 | -- |
| 8 | 其他 | -- |
| 9 | 合计 | 7,664,173.39 |

1.8.3 期末未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。

§ 2 基金份额持有人信息

2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

| 份额类别 | 持有人户 数(户) | 户均持有的基 金份额 | 机构投资者 持有份额 比例 | 个人投资者 持有份额 比例 |
|---------------|--------------|---------------|---------------------|---------------------|
| 融通通福分级 债券A | 256 | 62,567.27 | 0.00 | 100.00 |
| 融通通福分级 债券B | 406 | 390,206.52 | 135,564,099.12 | 85.57 |
| 合计 | 662 | 363,506.15 | 135,564,099.12 | 77.71 |

2.2 期末上市基金前十名持有人