融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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
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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通月月添利定期开放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25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

基金简称	融通月月添利定期开放债券	
基金主代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	993,107,570.28份	
基金合同存续期	不定期	
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

2.2 基金产品说明

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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	林蔚
	联系电话	(0755)26948966	(010)66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话?		400-883-8088,(0755)26948088	95599
传真		(0755)26935005	(010)68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§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8月29日(基金合同生效日)-2014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	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
本期已实现收益	63,122,681.21	27,862.09	13,431,761.62	3,572.29
本期利润	107,361,259.24	50,237.48	17,025,742.21	4,599.62
加权平均基金份额本期利润	0.1249	0.1202	0.0213	0.0200
本期基金份额净值增长率	12.73%	12.23%	2.10%	2.00%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0104	0.0091	0.0168	0.0156
期末基金资产净值	1,058,312,250.15	917,573.29	817,835,103.85	234,038.00
期末基金份额净值	1.067	1.065	1.021	1.020

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)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)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

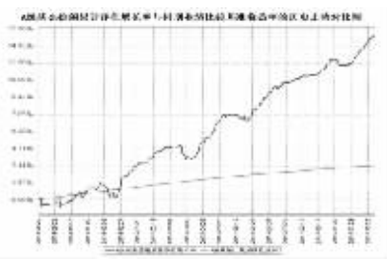
融通月月添利定期开放债券A

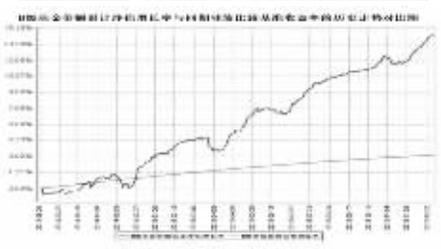
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.27%	0.09%	0.39%	0.00%	2.88%	0.09%
过去六个月	7.22%	0.08%	0.86%	0.00%	6.36%	0.08%
过去一年	12.73%	0.10%	2.12%	0.00%	10.61%	0.10%
自基金合同生效起至今	15.10%	0.14%	3.12%	0.00%	11.98%	0.14%

融通月月添利定期开放债券B

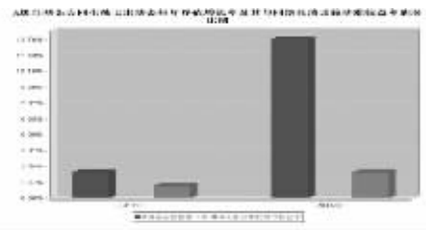
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.08%	0.09%	0.39%	0.00%	2.69%	0.09%
过去六个月	6.94%	0.08%	0.86%	0.00%	6.08%	0.08%
过去一年	12.23%	0.10%	2.12%	0.00%	10.11%	0.10%
自基金合同生效起至今	14.47%	0.14%	3.12%	0.00%	11.35%	0.14%

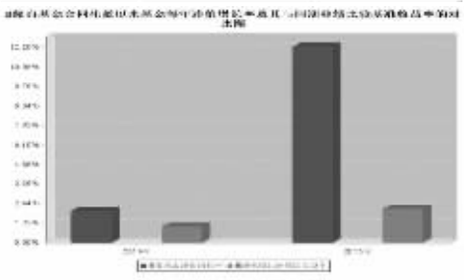
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注:本基金合同生效日为2014年8月29日,合同生效当年按实际存续期计算,未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

融通月月添利定期开放债券A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.8000	71,095,319.69	4,437.46	71,099,757.15	?
2014	-	-	-	-	?
合计	0.8000	71,095,319.69	4,437.46	71,099,757.15	?

单位:人民币元

融通月月添利定期开放债券B					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	0.7600	28,655.98	4,903.05	33,559.03	?
2014	-	-	-	-	?
合计	0.7600	28,655.98	4,903.05	33,559.03	?

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司(以下简称"本公司")经中国证监会证监基字[2001]8号文批准,于2001年5月22日成立,公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为:新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司(Nikko AssetManagement Co., Ltd.)40%。

截至2015年12月31日,公司管理的基金共有三十七只:一只封闭式基金,即融通通乾封闭基金;三十六只开放式基金,即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金(LOF)、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金(LOF)、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法(ODII-FOF)基金、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金和融通成长30混合基金。其中,融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外,公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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、融通通福分级债券基金经理	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,担任宏观策略高级定收益研究员。2013年10月加入融通基金管理有限公司,任宏观、利率研究员。
王纯	本基金的基金经理	2014年11月29日	2015年8月6日	8	经济学硕士,具有证券从业资格,2007年9月至2007年12月在中诚信国际工作,任信用分析师;2008年1月至2008年12月在招商证券工作,任债券研究员;2009年1月至2013年10月在中投证券工作,任债券研究员;2013年12月加入融通基金管理有限公司,任债券研究员。

注:任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写;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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待,本基金管理人制定了《融通基金有限公司公平交易制度》,公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时,本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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,在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下(日内、3日内、5日内)公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析,各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内本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为12.73%,B类基金份额净值增长率为12.23%,同期业绩比较基准为2.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前债券收益率处于历史上相对低位,继续下行的空间相较2015和2014年相对有限。展望2016年,我们认为,通胀仍然处于下降的大趋势中,对于央行货币政策继续放松不构成制约。宏观经济继续低迷,制造业,基建和房地产投资仍然处在历史地位。一二线城市地产销售回升明显,与三四线城市分化显著,但对于投资的有效拉动仍然有限。整体债券市场仍然处于牛市的氛围中。

其中最大的一个不确定因素是汇率,外围市场的波动和货币政策分化对国内政策的影响日益增加。最近一次的央行货币政策报告中明确提到稳定汇率和资产价格的重要性,同时强调过于宽松的货币政策及预期会强化资产贬值和增加资金外流。"稳汇率"放在首要条件之后,央行的货币政策放松或许会慢于市场预期,带来市场的大幅波动。

因此,2016年我们认为债券市场会呈现"小牛市,大波动"的特征,适合波段交易。同时如果市场调整到位,可以择机配置一些静态票息较高的信用债券。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行,公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部共同组成的估值委员会,通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合,减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历,估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价,金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核,登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值,每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总,供估值委员会参考,监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定,参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突,截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

(1)本基金于2015年1月9日实施利润分配,以2014年12月31日的可分配收益为基准,融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.10元,融通月月添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.10元,该次利润分配为2014年度利润分配,在2015年度实施;

(2)本基金于2015年7月14日实施利润分配,以2015年6月30日的可分配收益为基准,融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.18元,融通月月添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.18元;

(3)本基金于2015年8月10日实施利润分配,以2015年7月31日的可分配收益为基准,融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.15元,融通月月添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.13元;

(4)本基金于2015年9月10日实施利润分配,以2015年8月31日的可分配收益为基准,融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.12元,融通月月添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.12元;

(5)本基金于2015年10月20日实施利润分配,以2015年9月30日的可分配收益为基准,融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.10元,融通月月添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.10元;

(6) 本基金于2015年11月13日实施利润分配, 以2015年10月31日的可分配收益为基准,融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.09元,融通月月添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.07元;

(7) 本基金于2015年12月10日实施利润分配, 以2015年11月30日的可分配收益为基准,融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.06元,融通月月添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.06元。

(8)本基金于2016年1月18日实施利润分配,以2015年12月31日的可分配收益为基准,融通月月添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.06元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管融通月月添利定期开放债券型证券投资基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》、《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金托管协议》的约定,对融通月月添利定期开放债券型证券投资基金管理人—融通基金管理有限公司 2015年1 月 1日至 2015年 12 月31 日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为, 融通基金管理有限公司在融通月月添利定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,融通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的融通月月添利定期开放债券型证券投资基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

本基金2015年年度财务会计报告已经审计,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(普华永道中天审字(2016)第21180号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:		
银行存款	3,343,337.95	2,960,851.51
结算备付金	32,065,537.22	29,390,999.77
存出保证金	10,237.21	44,656.46
交易性金融资产	1,540,961,990.00	1,138,896,359.68
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,514,986,990.00	1,103,066,359.68
资产支持证券投资	25,975,000.00	35,830,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	856,000.00	-
应收利息	20,970,182.36	16,715,697.21
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,598,207,284.74	1,188,008,564.63
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	538,000,000.00	369,000,000.00
应付证券清算款	-	237,536.07
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	624,664.65	480,062.42
应付托管费	178,475.55	137,160.68
应付销售服务费	270.53	68.66
应付交易费用	10,497.51	4,594.95
应交税费	-	-
应付利息	83,553.06	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	80,000.00	80,000.00
负债合计	538,977,461.30	369,939,422.78
所有者权益:		
实收基金	993,107,570.28	801,038,800.02
未分配利润	66,122,253.16	17,030,341.83
所有者权益合计	1,059,229,823.44	818,069,141.85
负债和所有者权益总计	1,598,207,284.74	1,188,008,564.63

注:报告截止日2015年12月31日,融通月月添利基金份额总额993,107,570.28份;其中A类基金份额净值为1.067元,基金份额为992,246,176.37份;B类基金份额净值为1.065元,基金份额为861,393.91份。

7.2 利润表

会计主体:融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年8月29日(基金合同生效日)至2014年12月31日
一、收入	124,722,199.03	22,866,111.64
1.利息收入	68,908,881.83	18,029,088.60
其中:存款利息收入	759,264.44	226,180.61
债券利息收入	66,497,273.36	16,975,200.59
资产支持证券利息收入	1,649,353.40	101,938.74
买入返售金融资产收入	2,990.63	725,767.66
其他利息收入	-	-
2.投资收益	11,552,363.78	1,242,015.12
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	11,342,367.89	1,242,015.12
资产支持证券投资收益	209,995.89	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益	44,260,953.42	3,595,007.92
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	-	-
减:二、费用	17,310,702.31	5,835,769.81
1. 管理人报酬	6,325,450.86	1,911,198.48
2. 托管费	1,807,271.55	546,056.67
3. 销售服务费	1,535.44	273.53
4. 交易费用	11,733.56	2,758.40
5. 利息支出	8,742,063.93	3,213,794.45
其中:卖出回购金融资产支出	8,742,063.93	3,213,794.45
6. 其他费用	422,646.97	161,688.28
三、利润总额	107,411,496.72	17,030,341.83
减:所得税费用	-	-
四、净利润	107,411,496.72	17,030,341.83

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	801,038,800.02	17,030,341.83	818,069,141.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	107,411,496.72	107,411,496.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	192,068,770.26	12,813,730.79	204,882,501.05
其中:1.基金申购款	192,792,252.85	12,858,728.20	205,650,981.05
2.基金赎回款	-723,482.59	-44,997.41	-768,480.00
四、本期向基金分配持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-71,133,316.18	-71,133,316.18
五、期末所有者权益(基金净值)	993,107,570.28	66,122,253.16	1,059,229,823.44
项目	上年度可比期间 2014年8月29日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	801,038,800.02	-	801,038,800.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	17,030,341.83	17,030,341.83
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金分配持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	801,038,800.02	17,030,341.83	818,069,141.85

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

_____孟朝霞_____ _____颜锡廉_____ _____刘美丽_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
新时代证券股份有限公司("新时代证券")	基金管理人的股东
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本财富管理有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年8月29日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,325,450.86	1,911,198.48
其中:支付销售机构的客户维护费	8,106.20	888.00

注:1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.70% / 当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年8月29日(基金合同生效日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,807,271.55	546,056.67

注:支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值× 0.20% / 当年天数。

7.4.3.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
融通基金管理有限公司	-	440.69	440.69
中国农业银行	-	347.80	347.80
合计	-	788.49	788.49
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年8月29日(基金合同生效日)至2014年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
融通基金管理有限公司	-	145.16	145.16
中国农业银行	-	120.93	120.93
合计	-	266.09	266.09

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日B类基金资产净值0.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日销售服务费=前一日B类基金资产净值×0.35%/ 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年8月29日(基金合同生效日)至2014年12月31日	
中国农业银行	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	3,343,337.95	112,511.63	2,960,851.51	94,690.52

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券;

2、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期承销的证券。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

7.4.4 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购,因此没有在银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额538,000,000.00元,于2016年1月5日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,540,961,990.00	96.42
	其中:债券	1,514,986,990.00	94.79
	资产支持证券	25,975,000.00	1.63
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	35,408,875.17	2.22
7	其他各项资产	21,836,419.57	1.37
8	合计	1,598,207,284.74	100.00

8.2 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,603,000.00	2.89
2	央行票据	-	-
3	金融债券	146,620,000.00	13.84
	其中:政策性金融债	146,620,000.00	13.84
4	企业债券	803,879,990.00	75.89
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	533,884,000.00	50.40
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,514,986,990.00	143.03

8.3 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150213	15国开13	800,000	83,368,000.00	7.87
2	122041	09招金债	800,000	80,824,000.00	7.63
3	124149	13镇水投	700,000	71,820,000.00	6.78
4	124367	13揭城投	646,000	68,695,640.00	6.49
5	101456071	14石国投MTN005	600,000	64,182,000.00	6.06

8.4 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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	119128	14长热04	100,000	10,000,000.00	0.94
2	1489162	14上银1B	100,000	9,975,000.00	0.94
3	119127	14长热03	60,000	6,000,000.00	0.57

8.5 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.6 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。

8.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.7.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

8.7.2 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。

8.7.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告