

融通岁岁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

基金管理人的董事会及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18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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§ 2 基本概况

基金简称	融通岁岁添利定期开放债券
交易代码	161618
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月6日
报告期末基金份额总额	1,224,061,431.26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，力争在同类基金中取得较好的收益。
投资策略	本基金主要投资于信用类品种，不直接买入股票、股票等权益类资产。本基金侧重的投资策略包括久期与到期期限匹配策略、利率策略、期限配置策略、券种选择策略、转换投资策略以及资产配置策略等部分。
业债比较基准	一年期定期存款税后收益率
风险收益特征	属于投资于货币市场的稳健风格品种
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
报告期天数	105天
下一报告期的基金份额总额	1,061,006,539.0份
报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细	融通岁岁添利定期开放债券A类
报告期净收入	106,944,891.26份
报告期期间费用	1,129份
报告期期间费用率	1.12%

§ 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)	
	融通岁岁添利定期开放债券 A类	
1. 本期已实现收益	7,484,869.67	2,348,172.78
2. 本期利润	14,467,906.06	4,014,012.61
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0465	0.0467
4. 期末基金份额净值	1,193,071,035.00	1,197,088,615.09
5. 利润基金的份额净值	1.129	1.124

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

融通岁岁添利定期开放债券A类

阶段	净值增长率为①	业绩比较基准收益率为②	业绩比较基准收益率差额③=①-②	④③	⑤④
过去三个月	4.32%	0.10%	0.39%	0.01%	3.93%

融通岁岁添利定期开放债券B类

阶段	净值增长率为①	业绩比较基准收益率为②	业绩比较基准收益率差额③=①-②	④③	⑤④
过去三个月	4.14%	0.10%	0.39%	0.01%	3.75%

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



5.4 报告期内按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券资产投资明细

本基金本报告期末未持有债券资产。

5.5 报告期内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。

5.6 报告期内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。

5.7 报告期末未本基投资的国债期货交易情况说明

5.7.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.7.2 报告期内基金投资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。

5.7.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,969.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,126,533.69
5	应付申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,128,503.62

5.8.3 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。

5.8.4 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通岁岁添利定期开放债券A类	融通岁岁添利定期开放债券B类
报告期期初基金份额总额	166,923,749.46	22,614,362.76
报告期期初基金份额总额	924,010,427.26	127,447,904.08
减: 报告期赎回基金份额	22,927,063.00	33,117,376.20
报告期期初基金份额变动的额	-	-
报告期末基金份额总额	1,061,006,539.00	106,944,891.26

5.7 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。

5.8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一) 中国证监会批准融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金设立的文件

(二) 融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金合同

(三) 融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金托管协议

(四) 融通岁岁添利定期开放债券型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，或登陆本基金基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通内需驱动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

基金管理人的董事会及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18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。

本报告中财务数据未经审计。

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	-	-
其中：股票	-	-	
2	固定收益投资	1,847,612,719.03	97.21
其中：债券	1,847,612,719.03	97.21	
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
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	23,952,687.20	1.26
7	其他资产	29,128,503.62	1.53
8	合计	1,900,593,909.85	100.00

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，力争在同类基金中取得较好的收益。

投资策略

本基金主要投资于信用类品种，不直接买入股票、股票等权益类资产。本基金侧重的投资策略包括久期与到期期限匹配策略、利率策略、期限配置策略、券种选择策略、转换投资策略以及资产配置策略等部分。

业债比较基准

一年期定期存款税后收益率

风险收益特征

属于投资于货币市场的稳健风格品种

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

报告期天数

105天

下一报告期的基金份额总额

1,061,006,539.0份

报告期末持有的处于转股期的可转换债券

融通岁岁添利定期开放债券A类

报告期净收入