

融通通利系列证券投资基金之债券投资基金

[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

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通债券投资基金(以下简称“本基金”)2015年第4季度报告。

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,并对其中内容的真实性、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《融通通利系列证券投资基金基金合同》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 基金产品概况

基金简称 融通债券

交易代码 161603

基金运作方式 封闭式

基金合同生效日 2003年9月30日

报告期末基金份额总额 2,031,632,271.96份

投资目标 在强调基金安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略 以组合化为基本策略,利用收益曲线模型和债券品种定价模型,在利率较低的短期债券的基础上,捕捞市场出现的中期投资机会。

业绩比较基准 中证综合债(全价·总值)指数收益率

风险收益特征 属于中低风险的债券型基金

基金管理人 融通基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

基金类别 债券型基金

基金分级 融通债券A类

基金代码 161603

基金分级基金前一日净值 1.0000

基金分级基金前一日代码 161603

基金分级基金前一日净值 1.0000

报告期末基金的份额总额 633,376,041.06份

1,308,257,230.40份

注:本基金自2015年10月1日起使用新的业绩比较基准,中债综合(全价·总值)指数收益率。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)

融通债券A/B类 融通债券C类

1.本期已实现收益 6,522,711.70 13,847,620.02

2.本期利润 16,676,041.33 33,867,907.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.0068 0.0023

4.期末基金份额净值 775,390,046.21 1,696,700,001.22

5.期末基金份额净值 1.224 1.213

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将低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金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

融通债券A类

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 2.94% 0.09% 1.81% 0.08% 1.13% 0.01%

融通债券C类

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 2.98% 0.09% 1.81% 0.08% 0.99% -0.01%

3.2.2 本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A类基金份额净值增长率计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用“银行间债券综合指数”,2010年1月1日起至2015年9月30日(含此日)采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合(全价·总值)指数收益率”;本基金C类基金份额净值增长率计算,其中:2012年10月20日(含此日)之前采用“中信标普全债指数收益率”,2015年10月1日起采用新基准“中债综合(全价·总值)指数收益率”。

5.4 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间 证券从业年限 说明

王超 本基金,融通岁岁添利债券、融通蓝筹成长债券基金经理,融通通利系列证券投资基金基金经理,融通通利系列证券投资基金基金经理,融通通利系列证券投资基金托管人,融通基金管理有限公司基金经理

注:任职日期和在任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的工作时间为计算标准。

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,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,为基金持有人谋取最大利益,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 平等交易制度的执行情况

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、交易和业绩评价等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,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行为。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内未发生异常交易行为。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内未发生异常交易行为。

4.6 报告期内基金持有数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

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)

融通债券A/B类 融通债券C类

1.本期已实现收益 6,522,711.70 13,847,620.02

2.本期利润 16,676,041.33 33,867,907.06

3.加权平均基金份额本期利润 0.0068 0.0023

4.期末基金份额净值 775,390,046.21 1,696,700,001.22

5.期末基金份额净值 1.224 1.213

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将低于所列数字。

3.2.3 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

融通债券投资基金

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 23.94% 1.70% 12.81% 1.26% 11.13% 0.46%

3.2.4 本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:本基金自2015年10月1日起使用新的业绩比较基准,中债300指数收益率×75%+中债综合(全价·总值)指数收益率×25%。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》。

5.3 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)

融通债券A/B类 融通债券C类

1.本期已实现收益 118,834,120.24

2.本期利润 207,566,150.42

3.加权平均基金份额本期利润 0.02795

4.期末基金份额净值 1,043,881,826.26

5.期末基金份额净值 1.434

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将低于所列数字。

3.2.5 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

融通债券投资基金

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 23.94% 1.70% 12.81% 1.26% 11.13% 0.46%

3.2.6 本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:本基金自2015年10月1日起使用新的业绩比较基准,中债300指数收益率×75%+中债综合(全价·总值)指数收益率×25%。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》。

5.4 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间 证券从业年限 说明

王超 本基金,融通岁岁添利债券、融通蓝筹成长债券基金经理,融通通利系列证券投资基金基金经理,融通通利系列证券投资基金基金经理,融通通利系列证券投资基金托管人,融通基金管理有限公司基金经理

注:任职日期和在任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的工作时间为计算标准。

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,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,为基金持有人谋取最大利益,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 平等交易制度的执行情况

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、交易和业绩评价等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,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行为。

4.4 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内未发生异常交易行为。

4.5 报告期内基金持有数或基金资产净值预警说明

无。

5.1 报告期末基金资产组合情况

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)

融通债券A/B类 融通债券C类

1.本期已实现收益 118,834,120.24

2.本期利润 207,566,150.42

3.加权平均基金份额本期利润 0.02795

4.期末基金份额净值 1,043,881,826.26

5.期末基金份额净值 1.434

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将低于所列数字。

3.2.7 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

融通债券投资基金

阶段 净值增长率① 净值增长率差② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率差④ ①-③ ②-④

过去三个月 23.94% 1.70% 12.81% 1.26% 11.13% 0.46%

3.2.8 本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:本基金自2015年10月1日起使用新的业绩比较基准,中债300指数收益率×75%+中债综合(全价·总值)指数收益率×25%。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》。

5.3 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)

融通债券A/B类 融通债券C类

1.本期已实现收益 1