融通岁岁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岁岁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	融通岁岁添利定期开放债券	
基金主代码	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	
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	1,224,951,431.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	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
下属分级基金的交易代码:	161618	161619
报告期末下属分级基金的份额总额	1,058,006,539.90份	166,944,891.35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	一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	属于证券投资基金中的较低风险品种

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	徐卫东	洪渊
	联系电话	(0755)26948666	(010)66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话?		400-883-8088、(0755)26948088	95588
传真		(0755)26935005	(010)66105798

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		2013年	
	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	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	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
本期已实现收益	17,605,415.01	6,759,271.45	16,501,375.67	10,662,167.91	42,823,811.92	53,488,114.38
本期利润	33,141,360.85	12,341,244.45	33,670,119.43	21,256,076.00	30,902,043.61	41,026,112.79
加权平均基金份额本期利润	0.1700	0.1633	0.1377	0.1384	0.0271	0.0260
本期基金份额净值增长率	16.40%	15.91%	12.89%	12.58%	-0.07%	-0.47%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0606	0.0565	0.0525	0.0521	-0.0313	-0.0320
期末基金资产净值	1,193,971,033.50	187,688,615.99	164,211,949.22	74,639,419.49	250,091,949.41	157,502,339.83
期末基金份额净值	1.129	1.124	1.052	1.052	0.969	0.968

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

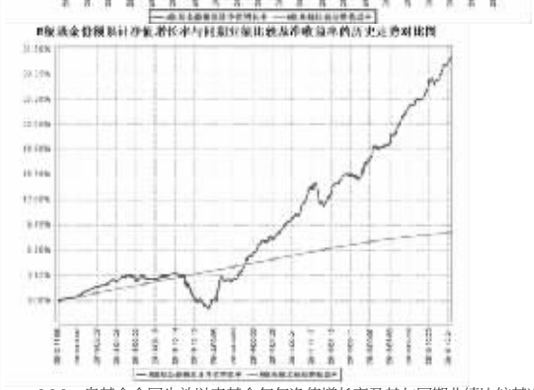
融通岁岁添利定期开放债券A类

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	4.32%	0.10%	0.39%	0.01%	3.93%	0.09%
过去六个月	9.43%	0.10%	0.87%	0.01%	8.56%	0.09%
过去一年	16.40%	0.12%	2.12%	0.01%	14.28%	0.11%
过去三年	31.32%	0.14%	8.09%	0.01%	23.23%	0.13%
自基金合同生效起至今	31.97%	0.14%	8.55%	0.01%	23.42%	0.13%

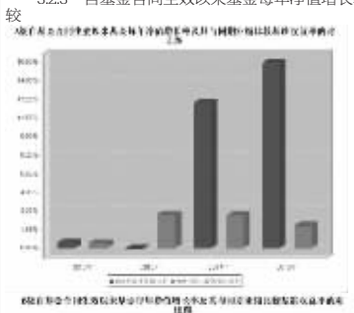
融通岁岁添利定期开放债券B类

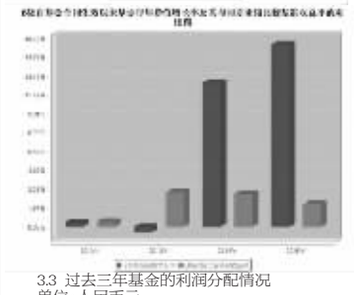
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.14%	0.10%	0.39%	0.01%	3.75%	0.09%
过去六个月	9.16%	0.11%	0.87%	0.01%	8.29%	0.10%
过去一年	15.91%	0.12%	2.12%	0.01%	13.79%	0.11%
过去三年	29.87%	0.14%	8.06%	0.01%	21.81%	0.13%
自基金合同生效起至今	30.39%	0.14%	8.55%	0.01%	21.84%	0.13%

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





3.3 过去三年基金的利润分配情况
单位:人民币元

融通岁岁添利定期开放债券A类

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	0.900	12,295,784.83	1,782,443.69	14,078,228.52	?-
2014	0.403	8,357,272.13	2,079,949.24	10,437,221.37	?-
2013	0.340	32,978,664.78	11,377,267.53	44,355,932.31	?-
合计	1.643	53,631,721.74	15,239,660.46	68,871,382.20	?-

单位:人民币元

融通岁岁添利定期开放债券B类

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	0.900	3,110,871.74	3,340,796.78	6,451,668.52	?-
2014	0.363	3,533,077.48	2,407,114.33	5,940,191.81	?-
2013	0.300	34,017,849.23	20,923,181.64	54,941,030.87	?-
合计	1.563	40,661,798.45	26,671,092.75	67,332,891.20	?-

§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 Asset Management 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		
王超	本基金、融通通瑞债券、融通通源短融债券、融通债券、融通四季添利债券(LOF)、融通标普中国可转债指数增强的基金经理	2015年3月14日	-	7	金融工程硕士,经济学、数学双学士,具有证券从业资格。2007年7月至2012年8月在深圳发展银行(现更名为平安银行)工作,主要从事债券自营交易盘投资与理财投资管理。2012年8月加入融通基金管理公司任投资经理。
蔡奕奕	本基金、融通四季添利债券(LOF)、融通月月添利债券、融通易支付货币的基金经理	2012年11月6日	2015年3月14日	9	管理科学硕士,具有证券从业资格。2006年3月至2006年11月,就职于万家基金管理有限公司,担任交易员职务,从事股票债券交易工作;2006年12月至2008年8月,就职于银河基金管理有限公司,担任交易员职务,从事债券交易工作;2008年9月至今,就职于融通基金管理有限公司,历任交易员、行业研究员职务。

注:任职日期和离任日期指公司董事会作出决定之日;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《融通基金管理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 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年宏观经济增速继续下行。三期叠加下经济动能减弱,新的增长点仍需培育,内需不振,投资低迷。地产销量和价格在一系列政策刺激下略有回暖,但并未传导至投资。南华工业品价格持续下跌,四季度稍有反弹,但整体仍然疲弱,PPI同比全年继续为负,未见起色。央行全年多次降准降息,货币政策宽松延续。股市大跌之后债市资金流入加快,资产配置行情持续了近两个季度。在基本面、流动性和供需三重因素作用下,债券收益率明显下行。四季度,中长端利率债加速下行,年末略有反弹。

投资方面,本基金在二季度提升了组合久期及杠杆水平,在年末适度缩减了久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期融通岁岁添利定期开放债券A类份额净值增长率为16.40%,融通岁岁添利定期开放债券B类份额净值增长率为15.91%,同期业绩比较基准收益率为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

展望2016年,机会和风险并存。经济预计仍然保持低位运行,在利润难言改善和投资回报率下降的大背景下,企业和居民加杠杆动力不强。地方政府受制于财政和债务约束,杠杆能力受限,中央政府负债率的提升预计只能对冲经济下滑,提振空间不大。基本面仍然利好债市。在宏观大背景下,预计央行仍将采用公开市场操作、降准、MLF等手段保证市场的流动性,利用利率走廊维持基准利率的稳定,保证经济运行在合理区间。

但四季度以来,债券市场不稳定因素增多。美国进入加息周期,人民币贬值压力对短期资金面形成扰动。在杠杆操作盛行的市场环境下,债券收益率波动加剧。四季度长端利率债下行过快,基本已经透支了目前基本面和货币政策放松的预期。信用利差压缩至低位,信用风险事件频发,信用债承压。短期内债券利率存在上行的压力。

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7月14日实施2015年第1次利润分配,以2015年6月30日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.50元,融通岁岁添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.50元;

(2)本基金于2015年10月20日实施2015年第2次利润分配,以2015年9月30日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.40元,融通岁岁添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.40元;

(3)本基金于2016年1月18日实施2015年第3次利润分配,以2015年12月31日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A每10份基金份额派发红利0.31元,融通岁岁添利定期开放债券B每10份基金份额派发红利0.30元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§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

本报告期内,本基金托管人在对融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了2次利润分配,分配金额为2,0529,897.04元。

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

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§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21168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:融通岁岁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	13,710,610.27	2,485,354.83
结算备付金	10,242,076.93	2,884,341.09
存出保证金	1,969.73	27,803.65
交易性金融资产	1,847,512,719.03	367,168,384.90
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,847,512,719.03	367,168,384.90
资产支持证券投资	-	-
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	-	-
应收利息	29,126,533.89	6,777,506.80
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,900,593,909.85	379,343,391.27
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	509,058,905.41	139,599,755.00
应付证券清算款	9,011,068.73	485,261.02
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	397,767.10	116,619.17
应付托管费	119,330.12	34,985.73
应付销售服务费	37,902.29	22,473.01
应付交易费用	27,438.98	9,301.04
应交税费	165,601.43	165,601.43
应付利息	66,246.30	8,026.16
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	50,000.00	50,000.00
负债合计	518,934,260.36	140,492,022.56
所有者权益:		
实收基金	1,224,951,431.25	226,967,446.28
未分配利润	156,708,218.24	11,883,922.43
所有者权益合计	1,381,659,649.49	238,851,368.71
负债和所有者权益总计	1,900,593,909.85	379,343,391.27

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额总额1,224,951,431.25份;其中融通岁岁添利定期开放债券A类基金份额净值1.129元,基金份额为1,058,006,539.90份; 融通岁岁添利定期开放债券B类基金份额净值1.124元,基金份额为166,944,891.35份。

7.2 利润表
会计主体:融通岁岁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1月1日至2014年12月31日
一、收入	52,140,867.05	69,028,386.49
1.利息收入	26,487,417.49	39,393,532.23
其中:存款利息收入	234,589.99	600,256.80
债券利息收入	26,252,827.50	38,730,205.16
资产支持证券利息收入	-	63,070.27
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	4,535,530.72	1,872,202.41
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	4,535,530.72	1,568,711.18
资产支持证券投资收益	-	303,491.23
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	21,117,918.84	27,762,651.85
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	-	-
减:二、费用	6,658,261.75	14,102,191.06
1. 管理人报酬	1,774,457.06	2,439,156.31
2. 托管费	532,337.18	731,746.80
3. 销售服务费	290,150.74	548,451.81
4. 交易费用	14,926.80	14,851.68
5. 利息支出	3,722,951.79	9,879,189.41
其中:卖出回购金融资产支出	3,722,951.79	9,879,189.41
6. 其他费用	323,438.18	488,795.05
三、利润总额	45,482,605.30	54,926,195.43
减:所得税费用	-	-
四、净利润	45,482,605.30	54,926,195.43

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通岁岁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)	226,967,446.28	11,883,922.43	238,851,368.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,482,605.30	45,482,605.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	997,983,984.97	119,871,587.55	1,117,855,572.52
其中:1.基金申购款	1,054,028,998.16	126,325,643.63	1,180,354,641.79
2.基金赎回款	-56,045,013.19	-6,454,056.08	-62,499,069.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-20,529,897.04	-20,529,897.04
五、期末所有者权益(基金净值)	1,224,951,431.25	156,708,218.24	1,381,659,649.49
项目	上年度可比期间 2014年1月1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)	420,886,985.36	-13,292,696.12	407,594,289.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	54,926,195.43	54,926,195.43
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-193,919,539.08	-13,372,163.70	-207,291,702.78
其中:1.基金申购款	131,114,277.47	8,971,047.60	140,085,325.07
2.基金赎回款	-325,033,816.55	-22,343,211.30	-347,377,027.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-16,377,413.18	-16,377,413.18
五、期末所有者权益(基金净值)	226,967,446.28	11,883,922.43	238,851,368.71

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。

7.4.2 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。

7.4.3 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
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	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、基金代销机构
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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 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1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,774,457.06	2,439,156.31
其中:支付销售机构的客户维护费	375,886.52	650,137.82

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0.60%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× 0.60% / 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。

7.4.4.2.2 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1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	532,337.18	731,746.80

注:支付基金托管人 中国工商银行 的托管费按前一日基金资产净值0.18%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× 0.18% / 当年天数。

7.4.4.2.3 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	合计
中国工商银行	-	272,188.19	272,188.19
融通基金管理有限公司	-	9,636.87	9,636.87
合计	-	281,825.06	281,825.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1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	合计
中国工商银行	-	547,403.13	547,403.13
融通基金管理有限公司	-	66.21	66.21
合计	-	547,469.34	547,469.34

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。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
单位:人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	39,709,560.00	-	-	-	-
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

1.1.1.1.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

1.1.1.1.2 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

本报告期末及上年度末,基金管理人的主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

1.1.1.2 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
单位:人民币元

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1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	13,710,610.27	51,961.09	2,485,354.83	59,300.20

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

1.1.1.3 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及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、本基金本报告期及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)在承销期内承销的证券。

1.1.1.4 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须作说明的其他关联交易事项。

1.1.2 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

1.1.2.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
金额单位:人民币元

证券代码	证券名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
136120	15鲁能债	2015-12-24	2016-1-20	新债未上市	99.98	99.98	400,000	39,993,407.12	39,993,407.12	-
136098	15义市01	2015-12-17	2016-1-4	新债未上市	99.98	99.98	300,000	29,994,871.23	29,994,871.23	-
136113	15新燃01	2015-12-21	2016-2-2	新债未上市	99.97	99.97	300,000	29,990,321.10	29,990,321.10	-
136107	15糧工债	2015-12-22	2016-01-11	新债未上市	99.96	99.96	10,000	999,550.68	999,550.68	

1.1.2.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

1.1.2.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

1.1.2.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额463,058,905.41元,是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
150207	15国开07	2016-1-4	103.39	500,000	51,695,000.00
150302	15进出02	2016-1-4	101.25	500,000	50,625,000.00
150408	15农发08	2016-1-4	101.65	330,000	33,544,500.00
150417	15农发17	2016-1-4	101.42	1,300,000	131,846,000.00
150419	15农发19	2016-1-4	100.19	1,500,000	150,285,000.00
1282153	12川煤炭MTN1	2016-1-6	99.75	200,000	19,950,000.00
1280489	12德阳建投债	2016-1-6	85.32	200,000	17,064,000.00
1282458	12济宁矿MTN1	2016-1-6	99.24	100,000	9,924,000.00
1480438	14陕交建债	2016-1-6	114.97	62,000	7,128,140.00
合计				4,692,000	472,061,640.00

1.1.2.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,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46,000,000.00元,于2016年1月4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	1,847,512,719.03	97.21
	其中:债券	1,847,512,719.03	97.21
	资产支持证券	-	-
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	-