融通四季添利债券型证券投资基金

【2016】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:2017年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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2017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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通四季添利债券
场内简称	融通添利
交易代码	161614
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月1日
报告期末基金份额总额	890,013,538.18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。
投资策略	本基金将在基金合同约定的投资范围内,通过对宏观经济运行状况的研究,积极的调整和优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上,获得基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金属于债券基金,其预期风险和预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。
融通基金管理人	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

§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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)
1.本期已实现收益	3,441,345.96
2.本期利润	-2,938,397.96
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0045
4.期末基金资产净值	923,392,343.62
5.期末基金份额净值	1.038

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。

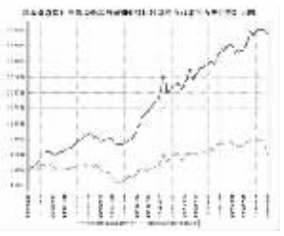
(2)本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

阶段	净值增长率①	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	0.04%	0.06%	-2.22%	0.15%	2.26%	-0.09%

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



§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
余志勇	融通通泽灵活配置混合、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通稳健灵活配置混合型证券投资基金、融通债券型证券投资基金、融通稳利债券型证券投资基金、融通增利债券型证券投资基金、融通稳健纯债债券型证券投资基金、融通稳丰债券型证券投资基金(LOF)、融通稳健纯债债券型证券投资基金(LOF)、融通稳健灵活资产配置混合型证券投资基金的基金经理。	2016年10月28日	-	16	余志勇先生,武汉大学金融学硕士,工商管理学学士,16年证券投资从业经历,具有证券从业资格,现任融通基金管理有限公司研究策划部总监。历任融通基金投资厂研究员、高级证券分析师、研究员,招商证券股份有限公司研究发展中心研究员,2007年4月加入融通基金管理有限公司,历任研究部行业研究员、行业组长,2015年2月26日起至今任"融通通泽灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2015年3月17日起至今任"融通通泰保本混合型证券投资基金"基金经理,2015年6月16日起至今任"融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2015年11月17日起至今任"融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2016年3月13日起至今任"融通稳利债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月25日起至今任"融通稳丰债券型证券投资基金"基金经理,2016年10月19日起至今任"融通稳健纯债债券型证券投资基金(LOF)"基金经理,2016年10月18日起至今任"融通通利灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2016年10月28日起至今任"融通通利债券型证券投资基金(LOF)"基金经理,2016年11月23日起至今任"融通稳健灵活资产配置混合型证券投资基金"基金经理。
王超	融通可转债债券型证券投资基金、融通债券投资基金、融通通鑫稳健债券型证券投资基金、融通通鑫稳利债券型证券投资基金、融通四季添利债券证券投资基金(LOF)、融通双享添利定期开放债券证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通增利债券型证券投资基金、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通通利债券型证券投资基金、融通稳金宝货币市场基金、融通稳利债券型证券投资基金的基金经理。	2015年3月14日	-	9	王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,9年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司固定收益部副总监。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易盘投资与预期投资管理经理、2012年4月加入融通基金管理有限公司,2013年12月27日起至今任"融通可转债债券型证券投资基金"由原融通标普中债可转债指数型证券投资基金转换而来)"、"融通通鑫稳健债券型证券投资基金"基金经理,2014年3月13日起至今任"融通通利灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2015年6月16日起至今任"融通通泰保本混合型证券投资基金"基金经理,2016年11月16日起至今任"融通稳金宝货币市场基金"基金经理,2016年11月18日起至今任"融通稳利债券型证券投资基金"基金经理。

注:任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写;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,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 公平交易专项说明

4.3.1 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,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度宏观经济运行平稳,10月初地产调控政策密集出台,地产销量和价格开始回落,投资仍未有起色。制造业投资底部企稳,基建托底乏力。经济虽稳,仍有隐忧。库存低位加之供给侧改革,PPI持续上行,但价格上涨并未引起销量反弹,CPI在四季度迎来年内第二高点。四季度货币政策中性偏紧,最后2个月,资金面收紧导致债市大规模去杠杆,收益率已回调至年内高位。

投资方面,本基金在四季度降低了组合久期和杠杆水平。

展望2017年一季度,债券市场仍有机会。经济和金融数据料将平稳,通胀大概率符合预期。经过12月份的调整,债券已经具备了一定的配置价值,年初银行保险等金融机构有较大的配置压力,而信用债一级发行量小,供需矛盾有望助力收益率继续向下。此外,MPA考核已过,春节前资金面扰动也被市场充分预期,央行也有意维持流动性的合理充裕,利空因素不多。一季度有望迎来配置行情。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为0.04%,同期业绩比较基准收益率为-2.32%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 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	51,111,147.24	5.53
	其中:股票	51,111,147.24	5.53
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	832,067,287.30	90.00
	其中:债券	807,109,787.30	87.30
	资产支持证券	24,947,500.00	2.70
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	33,223,794.34	3.59
8	其他资产	8,112,069.96	0.88
9	合计	924,504,298.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	27,066,262.28	2.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	24,044,894.96	2.60
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	51,111,147.24	5.54

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000903	云内动力	3,312,884	27,066,262.28	2.93
2	002344	海宁皮城	2,242,993	24,044,894.96	2.60

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	3,219,247.50	0.35
2	央行票据	-	-
3	金融债券	170,423,000.00	18.46
	其中:政策性金融债	170,423,000.00	18.46
4	企业债券	115,580,665.00	12.52
5	企业短期融资券	512,819,000.00	55.54
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	5,067,894.80	0.55
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	807,109,787.30	87.41

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	150207	15国开07	1,100,000	111,001,000.00	12.02
2	011698755	16鲁黄金SCP014	700,000	69,636,000.00	7.54
3	011698748	16吉利SCP003	500,000	50,040,000.00	5.42
4	160308	16进出08	500,000	49,720,000.00	5.38
5	011698752	16紫金矿业SCP009	500,000	49,700,000.00	5.38

5.6 报告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

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1689238	16苏元1A1	200,000	19,964,000.00	2.16
2	1689222	16金诚2A1	50,000	4,983,500.00	0.54

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期未投资国债期货。

5.9.2 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。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,097.87
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,101,698.04
5	应收申购款	5,274.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,112,069.96

5.11 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110032	三一转债	4,798,162.00	0.51
2	113008	电气转债	11,443.00	0.00

5.11.1 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000903	云内动力	27,066,262.28	2.93	非公开发行
2	002344	海宁皮城	24,044,894.96	2.60	非公开发行

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	63,631,441.37
报告期期间基金总申购份额	827,311,973.97
减:报告期期间基金总赎回份额	10,929,877.16
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	890,013,538.18

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	11,800,952.00
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	11,800,952.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.33

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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四季添利债券型证券投资基金设立的文件

(二)《融通四季添利债券型证券投资基金基金合同》

(三)《融通四季添利债券型证券投资基金托管协议》

(四)《融通四季添利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、深圳证券交易所。

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,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2017年1月20日

融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

【2016】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:2017年1月20日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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2017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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§2 基金产品概况

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	925,196,465.79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匹马匹配。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	
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	
下属分级基金的基金简称	融通岁岁添利定期开放债券A	融通岁岁添利定期开放债券B
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	930,223,598.57份	94,972,867.22份

§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(2016年10月1日 - 2016年12月31日)	
	融通岁岁添利定期开放债券A	融通岁岁添利定期开放债券B
1. 本期已实现收益	3,430,753.20	195,325.61
2. 本期利润	-23,642,377.30	-4,115,636.02
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0232	-0.0256
4. 期末基金资产净值	878,591,733.35	100,266,676.82
5. 期末基金份额净值	1.068	1.056

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

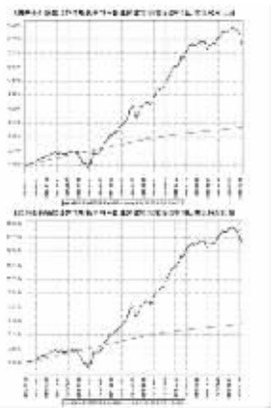
融通岁岁添利定期开放债券A

阶段	净值增长率①	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	-1.94%	0.13%	0.38%	0.01%	-2.32%	0.12%

融通岁岁添利定期开放债券B

阶段	净值增长率①	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	-1.99%	0.13%	0.38%	0.01%	-2.37%	0.12%

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



§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限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王超	融通可转债债券型证券投资基金、融通债券投资基金、融通通鑫稳健债券型证券投资基金(LOF)、融通岁岁添利定期开放债券证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通通利债券型证券投资基金、融通稳金宝货币市场基金、融通稳利债券型证券投资基金的基金经理。	2015年3月14日	-	9	王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,9年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司固定收益部副总监。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易盘投资与预期投资管理经理。2012年4月加入融通基金管理有限公司,2013年12月27日起至今任"融通可转债债券型证券投资基金(由原融通标普中债可转债指数型证券投资基金转换而来)"、"融通债券投资基金"基金经理,2014年11月7日起至2016年11月17日任"融通通鑫稳健债券型证券投资基金"基金经理,2015年3月14日起至今任"融通四季添利债券证券投资基金(LOF)"、"融通岁岁添利定期开放债券证券投资基金"基金经理,2015年6月23日起至2016年11月17日任"融通通瑞债券型证券投资基金"基金经理,2015年6月16日起至今任"融通通泰保本混合型证券投资基金"基金经理,2016年3月13日起至今任"融通增利债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月25日起至今任"融通通利债券型证券投资基金"基金经理,2016年10月18日起至今任"融通稳金宝货币市场基金"基金经理,2016年11月18日起至今任"融通稳利债券型证券投资基金"基金经理。

注:任职日期指根据基金管理人对外披露的任职日期填写;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 公平交易专项说明

4.3.1 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,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度宏观经济运行平稳,10月初地产调控政策密集出台,地产销量和价格开始回落,投资仍未有起色。制造业投资底部企稳,基建托底乏力。经济虽稳,仍有隐忧。库存低位加之供给侧改革,PPI持续上行,但价格上涨并未引起销量反弹,CPI在四季度迎来年内第二高点。四季度货币政策中性偏紧,最后2个月,资金面收紧导致债市大规模去杠杆,收益率已回调至年内高位。

投资方面,本基金在四季度降低了组合久期和杠杆水平。

展望2017年一季度,债券市场仍有机会。经济和金融数据料将平稳,通胀大概率符合预期。经过12月份的调整,债券已经具备了一定的配置价值,年初银行保险等金融机构有较大的配置压力,而信用债一级发行量小,供需矛盾有望助力收益率继续向下。此外,MPA考核已过,春节前资金面扰动也被市场充分预期,央行也有意维持流动性的合理充裕,利空因素不多。一季度有望迎来配置行情。

4.5 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-1.94%,融通岁岁添利定期开放债券B类份额净值增长率为-1.99%,同期业绩比较基准收益率为0.38%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	976,220,692.50	93.86
	其中:债券	976,220,692.50	93.86
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	45,779,031.77	4.40
8	其他资产	18,044,522.09	1.73
9	合计	1,040,044,206.36	100.00

5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,698,402.10	0.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	676,833,250.40	69.15
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	296,689,000.00	30.31	
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	976,220,692.50	99.73

5.3 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	136304	16蒙金01	800,000	78,016,000.00	7.97
2	112368	16BO001	700,000	68,600,000.00	7.01
3	136312	16皖投01	600,000	58,422,000.00	5.97
4	127386	16丹投债	500,000	49,570,000.00	5.06
5	101654023	16宝山钢铁MTN001	500,000	49,165,000.00	5.02

5.4 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.5 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。

5.6 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 报告期末本基金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

本基金本报告期未投资国债期货。

5.7.2 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。

5.7.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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	23,932.17
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,867,725.38
5	应收申购款	152,864.54
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,044,522.09

5.8.3 报告期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。

§6 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	融通岁岁添利定期开放债券B
报告期期初基金份额总额	1,068,493,277.76	169,349,368.77
报告期期间基金总申购份额	242,843,744.85	715,726.49
减:报告期期间基金总赎回份额	481,113,424.04	75,092,228.00
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	830,223,598.57	94,972,867.22

§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。

§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,或登陆本基金管理人网站http://www.rtfund.com查询。

融通基金管理有限公司
2017年1月20日

融通通福债券型证券投资基金(LOF)

【2016】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:2017年1月20日

§1 重要提示

融通通福债券型证券投资基金(LOF)是由"融通通福分级债券型证券投资基金"转型而来。根据基金合同的有关规定,融通通福分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同生效后3年期届满,本基金无需召开基金份额持有人大会,自动转为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"融通通福债券型证券投资基金(LOF)"。根据基金合同的有关规定,本基金份额转换基准日为2016年12月12日,在份额转换基准日日终,通福A和通福B以1:1各自的份额净值为基础,按照本基金的基金份额净值转换为融通通福债券型证券投资基金(LOF)的不同类别份额,基金管理人将进行注册登记变更,高尸"更名等操作。在基金管理人办理注册登记结束后,融通通福债券型证券投资基金(LOF)的不同类别基金份额将使用变更后的基金简称和对应的基金代码。

本基金转型前的通福A份额(场内简称:通福A,基金代码:161627)已转为融通通福债券型证券投资基金(LOF)场外0%C类份额,场外的通福B份额(场内简称:通福B,基金代码:150160)已转为融通通福债券型证券投资基金(LOF)场内0%A类份额,且均便记在注册登记系统下;本基金场内的通福B份额(场内简称:通福B,基金代码:150160)已转为融通通福债券型证券投资基金(LOF)场内0%A类份额,仍便记在证券登记结算系统下。基金份额转换完成后,融通通福债券型证券投资基金(LOF)A类份额的基金简称为"融通通福",基金代码为161626;融通通福债券型证券投资基金(LOF)C类份额的基金简称为"通福债C",基金代码为161627。

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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2017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。

本基金承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止,其中:

转型前为2016年10月1日起至2016年12月12日止,

转型后为2016年12月13日起至2016年12月31日止。

转型前:

§2 基金产品概况

基金简称	融通通福债券(LOF)
交易代码	161626
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月13日
报告期末基金份额总额	210,137,106.93份
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类属资产配置,在以最高效率实现资产配置策略的基础上,根据类属资产的预期风险收益特征,在有效控制风险的基础上,获得基金资产的稳定增值。根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行弹性化配置和调整。
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预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属分级基金的基金简称	融通通福债券A	融通通福债券C
下属分级基金的场内简称	融通通福	通福债C
下属分级基金的交易代码	161626	161627
报告期末下属分级基金的份额总额	189,801,067.22份	10,336,038.61份

注:本基金所属融通通福分级债券型证券投资基金转型而来,上表中涉及的下属分级基金名称均为转型前。

转型后:

基金简称	融通通福分级债券
交易代码	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
报告期末基金份额总额	263,008,505.53份
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类属资产配置,在以最高效率实现资产配置策略的基础上,根据整体资产配置策略动态调整大类金融资产的比例,在充分分析债券市场环境及市场收动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行弹性化配置和调整。
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预期风险较低的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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
下属分级基金的基金简称	融通通福分级债券A	融通通福分级债券B
下属分级基金的场内简称	通福A	通福B
下属分级基金的交易代码	161627	150160
报告期末下属分级基金的份额总额	10,731,956.05份	252,276,549.48份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年12月13日 - 2016年12月31日)	
	融通通福债券A	融通通福债券C
1.本期已实现收益	1,533,409.34	62,992.21
2.本期利润	-1,246,108.32	-52,321.41
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0061	-0.0049
4.期末基金资产净值	198,923,287.86	10,286,488.62
5.期末基金份额净值	0.996	0.995

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要低于所列数字。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日 - 2016年12月12日)
1.本期已实现收益	3,079,790.47
2.本期利润	-2,837,778.56
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0171
4.期末基金资产净值