融通月月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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	融通月月添利定期开放债券
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,336,180,826.10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。
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
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	1,251,112,998.93份 / 84,067,827.17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)	
	融通月月添利定期开放债券A	融通月月添利定期开放债券B
1. 本期已实现收益	12,692,992.15	777,780.33
2. 本期利润	-47,988,819.63	-3,283,530.44
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0384	-0.0392
4. 期末基金资产净值	1,265,629,153.31	84,972,903.49
5. 期末基金份额净值	1.012	1.011

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

融通月月添利定期开放债券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	-3.64%	0.22%	0.38%	0.00%	-4.02%	0.22%

融通月月添利定期开放债券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	-3.67%	0.23%	0.38%	0.00%	-4.05%	0.23%

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		
张一格	融通易支付货币市场证券投资基金、融通通盈保本混合型证券投资基金、融通增裕债券型证券投资基金、融通增祥债券型证券投资基金、融通增丰债券型证券投资基金、融通瑞债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通通利债券型证券投资基金、融通融享灵活配置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的基金经理。	2016年8月24日	-	10	张一格先生,中国人民银行研究生部经济学硕士,南开大学法学学士,美国特许金融分析师(CFA),10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总经理。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券型发起式证券投资基金(国泰上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国泰信用债券型证券投资基金、国泰民益灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、国泰策略益灵活配置混合型证券投资基金、国泰安康养老定期支付混合型证券投资基金基金经理。2015年6月加入融通基金管理有限公司,2015年11月17日起至今任"融通易支付货币市场证券投资基金"基金经理,2016年3月15日起至今任"融通通盈保本混合型证券投资基金"基金经理,2016年4月28日起至今任"融通增裕债券型证券投资基金"基金经理,2016年5月13日起至今任"融通增祥债券型证券投资基金"基金经理,2016年7月19日起至今任"融通增丰债券型证券投资基金"基金经理,2016年7月28日起至今任"融通瑞债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月9日起至今任"融通通优债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月24日起至今任"融通月月添利定期开放债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月30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,2016年9月22日起至今任"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"基金经理,2016年11月2日起至今任"融通通裕债券型证券投资基金"基金经理。
王涛	融通易支付货币市场证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通利债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金、融通通裕债券型证券投资基金、融通通利债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金、融通通裕债券型证券投资基金、融通通盛债券型证券投资基金、融通通稳健债券型证券投资基金的基金经理。	2016年8月24日	-	13	王涛先生,南开大学经济学硕士,13年证券投资从业经历,具有基金从业资格。历任中国工商银行深圳市分行外汇及衍生品交易员,招商银行总行金融市场客交易员、东莞证券固定收益类产品投资经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司,2015年1月6日起至今任"融通易支付货币市场证券投资基金"基金经理,2015年1月21日起至今任"融通通源短融债券型证券投资基金"基金经理,2016年4月1日起至今任"融通增利债券型证券投资基金"基金经理,2016年7月21日起至今任"融通通安债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月24日起至今任"融通月月添利定期开放债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月24日起至今任"融通通福债券型证券投资基金(自原融通稳健分级债券型证券投资基金转型而来)"基金经理,2016年11月2日起至今任"融通通裕债券型证券投资基金"基金经理,2016年11月10日起至今任"融通通利债券型证券投资基金"基金经理,2016年12月21日起至今任"融通通裕债券型证券投资基金"基金经理,2016年12月22日起至今任"融通通盛债券型证券投资基金"基金经理,2016年12月27日起至今任"融通通稳健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年四季度宏观经济呈现企稳向好走势,大宗商品价格上涨,CPI以及PPI回升,通胀预期升温。四季度美元加息一次,美国总统大选后政策超预期,美元指数飙升,人民币贬值。央行仍使用定向宽松的货币政策并在关键时点加大公开市场逆回购操作力度。但监管称称银行表外理财将纳入广义信贷,这引发债券市场的去杠杆操作。资金面起波澜,流动性一度极度紧张,非银行等金融机构流动性压力巨大。债券市场收益率快速走高,长端收益率大幅走高50-90bp,短端则上行150-200bp。

本基金四季度配置了地方政府债,维持了一定杠杆比例。

展望2017年一季度经济和金融数据料将平稳,目前受益于房地产市场的居民信用扩张令宏观经济短暂企稳,但中长期看供给侧改革进程中整体经济中融资需求仍将逐步萎缩。货币政策稳中偏紧,但央行仍将采用公开市场操作手段保证市场的流动性。资金市场结构分化,非银行机构仍可能面临流动性压力,把握收益率调整后中长期金融债的配置机会。

4.5 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-3.64%,B类基金份额净值增长率为-3.67%,同期业绩比较基准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	2,069,407,010.00	85.38
	其中:债券	2,069,407,010.00	85.38
	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	46,500,189.75	1.92
	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	275,195,336.67	11.35
8	其他资产	32,682,662.53	1.35
9	合计	2,423,785,198.95	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	128,888,000.00	9.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	218,827,000.00	16.20
	其中:政策性金融债	218,827,000.00	16.20
4	企业债券	852,296,010.00	63.10
5	企业短期融资券	59,884,000.00	4.43
6	中期票据	341,286,000.00	25.27
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	468,226,000.00	34.67
10	合计	2,069,407,010.00	153.22

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	150218	15国开18	1,500,000	148,995,000.00	11.03
2	140163	16辽宁11	1,350,000	133,704,000.00	9.90
3	140018	16天津08	1,000,000	98,890,000.00	7.32
4	130915	16河北07	1,000,000	98,510,000.00	7.29
5	140270	16贵州20	1,000,000	97,450,000.00	7.22

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

5.5 本基金本报告期末未持有资产支持证券。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	17,614.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,665,047.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,682,662.53

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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	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
报告期期初基金份额总额	1,109,217,023.52	80,301,999.35
报告期期间基金总申购份额	143,742,961.24	3,768,827.97
减:报告期期间基金总赎回份额	1,846,985.83	3,000.15
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-	-
报告期末基金份额总额	1,251,112,998.93	84,067,827.17

§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月月添利定期开放债券型证券投资基金设立的文件

(二)《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金合同》

(三)《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金托管协议》

(四)《融通月月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

融通增丰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:中国建设银行股份有限公司
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。

基金托管人中国建设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	融通增丰债券
交易代码	002522
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年7月19日
报告期末基金份额总额	200,002,848.63份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过积极主动的投资管理,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的具体投资策略包括资产配置策略、固定收益类资产投资策略、股票投资策略、权证投资策略以及国债期货投资策略等部分。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§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	953,325.29
2.本期利润	-74,962.16
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0004
4.期末基金资产净值	200,914,336.18
5.期末基金份额净值	1.005

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损益。

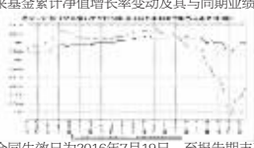
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	0.00%	0.06%	-2.32%	0.15%	2.32%	-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



注:1、本基金合同生效日为2016年7月19日,至报告期末基金成立未满1年。

2、本基金的建仓期为合同生效日起6个月。截至报告期末,本基金尚在建仓期内。

§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		
张一格	融通易支付货币市场证券投资基金、融通通盈保本混合型证券投资基金、融通增裕债券型证券投资基金、融通增祥债券型证券投资基金、融通增丰债券型证券投资基金、融通瑞债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通通利债券型证券投资基金、融通融享灵活配置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、融通稳裕债券型证券投资基金的基金经理。	2016/7/19	-	10	张一格先生,中国人民银行研究生部经济学硕士,南开大学法学学士,美国特许金融分析师(CFA),10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总经理。历任兴业银行资金营运中心投资经理。2015年6月加入融通基金管理有限公司,2015年11月17日起至今任"融通易支付货币市场证券投资基金"基金经理,2016年4月28日起至今任"融通增裕债券型证券投资基金"基金经理,2016年5月13日起至今任"融通增祥债券型证券投资基金"基金经理,2016年7月19日起至今任"融通增丰债券型证券投资基金"基金经理,2016年7月28日起至今任"融通瑞债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月9日起至今任"融通通优债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月24日起至今任"融通月月添利定期开放债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月30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,2016年9月22日起至今任"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"基金经理,2016年11月2日起至今任"融通稳裕债券型证券投资基金"基金经理。
余志勇	融通通源灵活配置混合基金、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、融通增丰债券型证券投资基金、融通瑞丰债券型证券投资基金、融通通盛灵活配置混合型证券投资基金、融通通尚灵活配置混合型证券投资基金、融通四季添利债券证券投资基金(LOF)、融通新优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。	2016/8/2	-	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副总监。历任湖北省农业厅研究员、国泰证券公司研究员、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"融通通源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15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5月13日起至今任"融通增祥债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月2日起至今任"融通增丰债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月19日起至今任"融通通盛灵活配置混合型证券投资基金"基金经理,2016年10月19日起至今任"融通通尚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"融通四季添利债券证券投资基金(LOF)"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、融通通源短融债券型证券投资基金、融通四季添利债券证券投资基金(LOF)、融通岁岁添利定期开放债券证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金、融通增裕债券型证券投资基金、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通增丰债券型证券投资基金、融通瑞安定货币市场基金、融通稳利债券型证券投资基金的基金经理。	2016/8/2	-	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)债券自营交易员及资产管理部投资经理。2012年8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(由原融通标普中国可转债指数型证券投资基金转型而来)"、"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"融通通源短融债券型证券投资基金"基金经理,2015年5月11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"融通通福债券型证券投资基金"基金经理,2016年5月11日起至今任"融通增裕债券型证券投资基金"、"融通通泰保本混合型证券投资基金"基金经理,2016年11月10日起至今任"融通通盛债券型证券投资基金"基金经理,2016年12月22日起至今任"融通通稳健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

本报告期内基金份额净值增长率为0.00%,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

截止于2016年12月27日,本基金连续二十个工作日出现基金份额持有人数量不满二百人。

§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	198,346,726.95	98.64
	其中:债券	198,346,726.95	98.64
	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	647,779.62	0.32
8	其他资产	2,088,790.95	1.04
9	合计	201,083,297.52	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票投资。

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

本基金本报告期末未持有股票投资。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,018,000.00	4.99
	其中:政策性金融债	10,018,000.00	4.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	177,187,800.00	88.19
6	中期票据	10,212,000.00	5.08
7	可转债(可交换债)	928,926.95	0.46
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	198,346,726.95	98.72

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	011698261	16天士力SCP003	200,000	19,942,000.00	9.93
2	011698255	16丽珠SCP001	200,000	19,936,000.00	9.92
2	011698328	16华强SCP001	200,000	19,936,000.00	9.92
3	041651040	16富通CP002	200,000	19,900,000.00	9.90
4	041664038	16徐工机械CP002	200,000	19,894,000.00	9.90
5	041656023	16珠轨交CP001	200,000	19,870,000.00	9.89

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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,没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,025.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,085,765.47
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,088,790.95

5.10.4 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	123001	蓝标转债	928,926.95	0.46

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票投资。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	200,042,720.99
报告期期间基金总申购份额	52,193.28
减:报告期期间基金总赎回份额	92,065.64
报告期期末基金份额总额	200,002,848.63

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金管理人本报告期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增丰债券型证券投资基金设立的文件

(二)《融通增丰债券型证券投资基金基金合同》

(三)《融通增丰债券型证券投资基金托管协议》

(四)《融通增丰债券型证券投资基金招募说明书》

(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

基金管理人处、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

融通增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:中信银行股份有限公司
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。

基金托管人中信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01日起至2016年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	融通增利债券
交易代码	002579
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月1日
报告期末基金份额总额	989,608,519.02份
投资目标	本基金在严格控制风险的前提下,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	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以及资产支持证券投资策略等部分。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

§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	7,639,688.53
2.本期利润	-6,432,045.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0065
4.期末基金资产净值	995,268,414.64
5.期末基金份额净值	1.006

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。

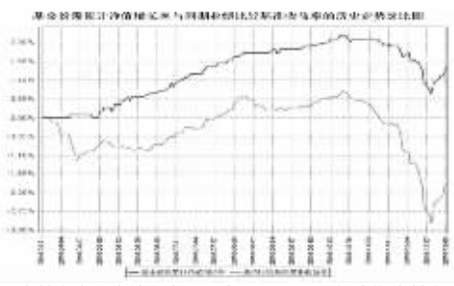
2、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.63%	0.09%	-2.32%	0.15%	1.69%	-0.06%

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



注:1、本基金合同生效日为2016年4月1日,至报告期末基金成立未满1年。

2、本基金的建仓期为自合同生效日起6个月,截止建仓期结束,各项资产配置比例符合规定。

§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		
王涛	融通易支付货币市场证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通增利债券型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通利债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金、融通通裕债券型证券投资基金、融通通盛债券型证券投资基金、融通通稳健债券型证券投资基金的基金经理。	2016年4月1日	-	13	王涛先生,南开大学经济学硕士,13年证券投资从业经历,具有基金从业资格。历任中国工商银行深圳市分行外汇及衍生品交易员、招商银行总行金融市场客交易员、东莞证券固定收益类产品投资经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司,2015年1月6日起至今任"融通易支付货币市场证券投资基金"基金经理,2015年1月6日起至今任"融通汇财宝货币市场基金(由原融通七天理财债券型证券投资基金转型而来)"基金经理,2016年1月21日起至今任"融通通源短融债券型证券投资基金"基金经理,2016年4月1日起至今任"融通增利债券型证券投资基金"基金经理,2016年7月21日起至今任"融通通安债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月24日起至今任"融通月月添利定期开放债券型证券投资基金"基金经理,2016年8月24日起至今任"融通