融通丰利四分法证券投资基金（QDII-FOF） 2016年年度报告摘要

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:2017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丰利四分法证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同规定,于2017年3月27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2016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	融通丰利四分法(QDII-FOF)
基金主代码	161620
前端交易代码	161620
后端交易代码	161621
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年2月5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	30 770 914.31份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过全球化的资产配置和组合管理,有效地分散投资风险;在降低组合波动性的同时,实现基金资产的长期增值;通过投资较高分红回报的资产力求实现稳定的分红。
投资策略	本基金通过全球化的均衡资产配置和组合管理,投资于获取较高分红回报的资产,带来长期稳定的分红和资产增值,降低单一区域和单一品种的投资风险。 本基金主要投资于具有良好流动性的四大类高息资产 包括美国高息债券(US High-yield Bond)、能源类的业主有限合伙制企业(MLPS)、亚太房地产投资信托基金(REITs)及亚太高息股票。
业绩比较基准	巴克莱美国高收益流通总收益指数(Barclays Capital US Corporate High-Yield Very Liquid Total Return Index)×30%+Alerian MLP价格指数(Alerian MLP Price Index)×20%+MSCI亚太(除日本)高息股票价格指数(MSCI AC Asia Pacific ex Japan High Dividend Yield Price Index)×25%+MSCI亚太REIT价格指数(MSCI AC Asia Pacific IMI REIT Price Index)×20%+人民币活期存款收益率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为基金中基金,属于中等风险中等预期收益的基金品种,其预期收益和风险高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

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
信披负责人	姓名	徐卫东	郭明
	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 境外投资顾问和境外资产托管人

项目		境外投资顾问	境外资产托管人
名称	英文	Nikko Asset Management Co. Ltd.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	日兴资产管理有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		107-6242 日本东京都港区赤坂九丁目七番一号	140 Broadway New York NY 10005
办公地址		107-6242 日本东京都港区赤坂九丁目七番一号	140 Broadway New York NY 10005
邮政编码		107-6242	NY 10005

2.5 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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-2 364 094.85	-318 037.52	-158 050.83
本期利润	90 481.18	-3 670 301.30	1 533 962.96
加权平均基金份额本期利润	0.0027	-0.0645	0.0063
本期基金份额净值增长率	0.36%	-16.87%	1.96%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1742	-0.1773	-0.0431
期末基金资产净值	25 410 668.97	28 624 612.96	125 039 149.49
期末基金份额净值	0.826	0.823	0.990

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;

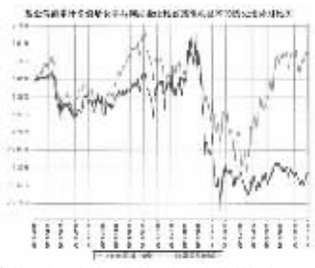
3、期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润:如果期末未分配利润的未实现部分为正数
则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分
如果期末未分配利润的未实现部分为负数
则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分扣除未实现部分)。

3.2 基金净值表现

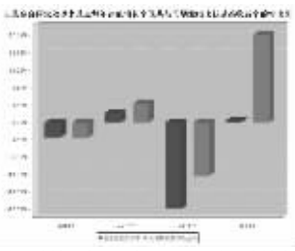
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.72%	0.39%	0.89%	0.39%	-1.61%	0.00%
过去六个月	-1.31%	0.39%	5.17%	0.44%	-6.48%	-0.05%
过去一年	0.36%	0.48%	17.19%	0.70%	-16.83%	-0.22%
过去三年	-14.93%	0.70%	8.92%	0.64%	-23.85%	0.06%
自基金合同生效起至今	-17.40%	0.64%	5.71%	0.61%	-23.11%	0.03%

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



注:本基金合同生效日为2013年2月5日。合同生效当年按实际存续期计算,未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未实施利润分配。

§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 AssetManagement Co. Ltd.)40%。

截至2016年12月31日,公司共管理六十二只开放式基金: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(QDII-FOF)基金、融通汇财宝货币市场基金、融通可转债债券基金、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、融通中证大农业指数基金(LOF)、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长30混合基金、融通中国风1号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通增丰债券基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通通景混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通新优选混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金和融通通穗债券基金。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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
胡允骞	本基金的基金经理	2013-2-5	-	9	胡允骞先生,加拿大麦基尔大学经济及金融管理学士,美国特许金融分析师(CFA),9年证券投资从业经历。具有基金从业资格及香港证监会颁发的1,4,9号牌的从业资格。历任日亚证券有限公司(香港)证券研究部副总裁,三井住友资产管理有限公司(香港)大中华区投资研究部投资分析员,摩根大通银行(日本东京总行)债券坐盘交易部分析员,富达基金有限公司(香港及东京分行)财务部财务分析员。2011年6月加入融通基金管理有限公司,现任融通丰利四分法(QDII-FOF)基金的基金经理。
王浩宇	本基金的基金经理	2016-9-9	-	7	王浩宇先生,香港城市大学和巴黎第九大学金融数学硕士、中国人民大学数学学士,金融风险管理师(FRM),7年证券投资从业经历,具有基金从业资格及香港证监会颁发的1,4,9号牌的从业资格。曾任职于国家外汇管理局中央外汇业务中心,担任投资部组合经理。2015年7月加入融通基金管理有限公司,现任融通丰利四分法(QDII-FOF)、融通沪港深智慧生活灵活配置混合基金的基金经理。

注:任免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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职位	证券从业年限	说明
Peter Sartori	日兴资产亚洲,亚洲股票部主管	26	Peter Sartori先生分管日兴资产亚洲的除日本股外的亚洲股票团队。他于新加坡管理超过10名亚股专家组成的团队,并共同管理亚洲区的产品。Sartori先生有着26年资产管理行业的丰富经验,并于日兴资产管理2013年收购其于2005年设立的Treasury Asia Asset Management(TAAM)时加入本公司。在设立TAAM前,Sartori先生曾于澳大利亚担任瑞士信贷资产管理公司的亚洲股票部门主管,更早之前曾任Scudder Investments Singapore的亚太股票基金经理以及Colonial Investments的多个职位。Sartori先生拥有商业学士学位并为澳大利亚金融服务学会成员。
Koh Liang Choon	日兴资产亚洲,固定收益部主管	23	Liang Choon先生拥有23年亚洲和新加坡固定收益投资组合管理经验。他曾任职于星展资产管理公司的固定收益团队,并于2005年加入APS Komaba Asset Management Pte Ltd。Liang Choon负责管理机构的投资委托契约,包括新加坡、亚洲和全球的债券投资策略。此前任职于野村证券新加坡与德累斯顿银行(Dresdner Bank),负责亚洲固定收益和货币市场的交易。Liang Choon毕业于加拿大Simon Fraser大学,主修金融与国际商业,之后获得新加坡国立大学应用金融硕士学位,并拥有特许金融分析师资格(CFA)。

4.3 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。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 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。

4.4.2 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。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发生异常交易。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2016年,全球金融市场可用极致波动和充满着意外来形容,资产表现主要受几个大宏观黑天鹅事件所影响。总体来看,虽然环球风险资产如股票和原油等等在2016年普遍收涨,但年内的表现却非常反复波动,呈现大跌大涨的态势,反映市场恐慌和风险的VIX指数多次创下2016年新高,升穿20的水平。

具体来看,上半年影响市场的主要因素有:1)中国股市熔断机制启动导致A股暴跌;2)人民币急速贬值,加剧资金外流;3)油价大跌引发债务违约危机;4)欧洲银行再被卷入金融风暴中心,市场忧虑欧洲各主要银行盈利前景和应对市场动荡能力;5)英国公投结束,出乎意料决定退出欧盟,导致英国首相辞任总理一职。退欧结果引发市场怀疑欧盟体制会否全面崩溃,触发欧元和英镑大幅贬值。下半年加剧市场波动的主要原因有:6)意大利公投结果不如意导致总理被逼下台,事件再次引发市场担忧欧盟体制前景,并且严重冲击当地银行业;7)美国总统大选出现意外结果,特朗普当选美国总统,市场担心其领导的新政府将实行保护主义,推行不利全球贸易的政策,导致环球股市大幅震荡暴跌;8)市场对2016年底加息悬念加深,美国收益率曲线上移,引发外汇市场大幅波动,新兴市场货币急速贬值,严重影响投资收益。此外,市场对全球其他大央行可否延续宽松政策持怀疑态度,进一步利空市场;9)市场忧虑OPEC成员不能达成冻产协议,加剧油价下行风险,进一步削弱风险偏好。

从全球市场表现来看,美国主要指数涨6%-13%;欧洲主要股指涨1%-7%;日本股微涨0.4%。新兴市场则涨跌不一,表现最差是港H股和中国A股下跌2%-14%,其他主要新兴市场则上涨3%-19%,当中以印尼和泰国的涨幅最大。

截至2016年末,基金的运作情况如下:

资产类别占净值比例

资产类别	季末占净值比例%
亚洲高息股票	12.54
亚洲REITs	6.94
MLP	13.66
美国高息债券	18.15
其他证券	23.05
现金	25.67

投资区域分布情况

资产类别	季末占净值比例%
亚洲高息股票	10.09
亚洲REITs	7.70
MLP	18.19
美国高息债券	18.21

持仓前十名证券

资产类别	季末占净值比例%
亚洲高息股票	10.09
亚洲REITs	7.70
MLP	18.19
美国高息债券	18.21
其他证券	17.69
现金	28.11
投资区域	季末占净值比例%
美国	36.40

4.5.2 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0.36%,同期业绩比较基准收益率为17.19%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为2017年,全球投资环境依然会是充满着挑战和不确定性,市场震荡格局将不会有变。 风险资产表现会继续受不同宏观事件影响,而当中关键变量有三点:1)特朗普政府。特朗普上任后已签署多项行政命令,其中移民政策,边境政策和贸易政策在美国国内和海外都引起相当大的风波和反对声音。虽然有些行政命令极具争议性,但完全无损他兑现竞选时所承诺政策的决心。无可否认,国际社会上很多人普遍不接受特朗普,因为他经常口出狂言,但从经济角度来看,我们却开始对他越来越有信心,主要因为他有信用,这一点能大大提升其政策实施进程的透明度和预测性。兑现程度将是决定"特朗普经济"强化还是逆转的关键。2017年一季度末或者会是一个验证时点,因为美国需要处理债务上限和2018年财政预算细节等问题。 无论好与否,我们都必须要接受在未来一段时间特朗普所发表的言论和执行的政策将必定会对金融市场带来影响。2)地缘和政治局势。3月将是英国退欧的截止时间,同时2017年荷兰,法国和德国等主要欧盟成员国都会举行大选。当中法国选举最值得市场关注,因为万一极右派的候选人当选,法国将会模仿英国启动退欧,欧盟体制将会受到大冲击,拖累环球金融市场。此外,中国会在2017下半年会举行中共第十九次全国代表大会选出政治局常委等最高领导层。全球潜在政治和地缘风险不容忽视。 3)货币政策和利率走向。 2017年随着油价及其他商品价格回升和主要经济体的经济状况有好转,环球通胀压力有机会较市场的预期大。在此背景下,全球主要央行未必有空间继续执行超宽松货币政策。 事实上,自美国总统大选后,美国国债利率已显著上升。由此可见,超宽松周期和长周期低息时代可能已过,未来利率和货币政策只会进一步正常化。美联储逐步加息必定会抑制全球资产价格表现,影响投资收益。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配,符合法律法规和基金合同的规定。

§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丰利四分法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,融通丰利四分法证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通丰利四分法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,融通丰利四分法证券投资基金未进行利润分配。

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丰利四分法证券投资基金2016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2016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(2017)第21195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:融通丰利四分法证券投资基金
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款	6 497 315.52	6 557 780.83
结算备付金	-	822 857.14
存出保证金	-	-
交易性金融资产	19 072 928.75	21 364 362.20
其中:股票投资	-	859 285.10
基金投资	19 072 928.75	20 505 077.10
债券投资	-	-
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	44.13	572.63
应收股利	13 551.58	33 590.61
应收申购款	881.02	4 940.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	25 584 721.00	28 784 104.12
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	58 008.62	27 580.83
应付管理人报酬	38 543.91	43 449.44
应付托管费	7 494.63	8 448.50
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	70 004.87	80 012.39
负债合计	174 052.03	159 491.16
所有者权益:		
实收基金	30 770 914.31	34 795 445.03
未分配利润	-5 360 245.34	-6 170 832.07
所有者权益合计	25 410 668.97	28 624 612.96
负债和所有者权益总计	25 584 721.00	28 784 104.12

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.826元,基金份额总额30
770
914.31份。

7.2 利润表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	898 436.02	-2 130 467.64
1.利息收入	50 230.98	88 423.05
其中:存款利息收入	16 762.73	24 373.89
债券利息收入	-	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	33 468.25	64 049.16
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-2 094 978.61	-624 502.53
其中:股票投资收益	-118 112.47	-1 020 780.14
基金投资收益	-2 608 030.51	-532 421.55
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	631 164.37	928 699.16
3.公允价值变动收益	2 454 576.03	-3 352 263.78
4.汇兑收益	394 447.40	1 677 452.86
5.其他收入	94 160.22	80 422.76
减:二、费用	807 954.84	1 539 833.66
1. 管理人报酬	501 027.09	992 399.37
2. 托管费	97 421.93	192 966.49
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	39 481.82	182 443.80
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	170 024.00	172 024.00
三、利润总额	90 481.18	-3 670 301.30
减:所得税费用	-	-
四、净利润	90 481.18	-3 670 301.30

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通丰利四分法证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	34 795 445.03	-6 170 832.07	28 624 612.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	90 481.18	90 481.18
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-4 024 530.72	720 105.55	-3 304 425.17
其中:1.基金申购款	91 535 147.37	-16 260 136.58	75 275 010.79
2.基金赎回款	-95 559 678.09	16 980 242.13	-78 579 435.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	30 770 914.31	-5 360 245.34	25 410 668.97
项目	上年度可比期间 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)	126 319 436.96	-1 280 287.47	125 039 149.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-3 670 301.30	-3 670 301.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-91 523 991.93	-1 220 243.30	-92 744 235.23
其中:1.基金申购款	67 508 248.63	-9 850 506.85	57 657 741.78
2.基金赎回款	-159 032 240.56	8 630 263.55	-150 401 977.01
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	34 795 445.03	-6 170 832.07	28 624 612.96

注: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:

_____高 峰_____ _____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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需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、基金销售机构
布朗兄弟哈里曼银行	境外资产托管人
新时代证券股份有限公司(“新时代证券”)	基金管理人股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东、基金境外投资顾问
深圳市融通资本管理股份有限公司(原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未通过关联方交易单元进行证券交易。

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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	501 027.09	992 399.37
其中:支付销售机构的客户维护费	222 166.35	451 963.54

注:1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值1.80%的年费率计提,逐日累计至每月月末,按月支付。其计算公式为:日基金管理费=前一日基金资产净值×1.80%/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 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	97 421.93	192 966.49

注:支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值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:日基金托管费=前一日基金资产净值×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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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。

7.4.4.4.2 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

本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.4.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	311 125.61	8 964.13	641 933.58	16 562.97
布朗兄弟哈里曼银行	6 186 189.91	4 901.10	5 915 847.25	1 575.37

注:本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管,按适用利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.4.7 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均无其他关联交易事项。

7.4.5 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

§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:普通股	-	-
	存托凭证	-	-
	优先股	-	-
	房地产信托凭证	-	-
2	基金投资	19 072 928.75	74.55
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6 497 315.52	25.40
8	其他各项资产	14 476.73	0.06
9	合计	25 584 721.00	100.00

8.2 期末在各个国家(地区)证券市场的权益投资分布

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

本基金本报告期末未持有股票及存托凭证。

8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

本基金本报告期未买入股票及存托凭证。

8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位:人民币元

序号	公司名称(英文)	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	BAIDU INC-SPON ADR	BIDU US	746 407.23	2.61

注:“卖出金额”是指卖出股票成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位:人民币元

买入成本(成交)总额	-
卖出收入(成交)总额	746 407.23

注:表中“买入成本(成交)总额”及“卖出收入(成交)总额”均指成交金额,即成交单价乘以成交数量,相关交易费用不考虑。8.5 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位:人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	JPMORGAN ALERIAN MLP INDEX