

融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）

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四季添利债券型证券投资基金（LOF）（以下简称“本基金”）基金合同规定，于2017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先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。

本财务报告数据已经审计。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

基金名称	融通四季添利债券（LOF）
简称/简称	融通添利
基金代码	301034
交易代码	301034
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2015年3月11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	399,413,538.19份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的交易场所	深圳证券交易所
上市日期	2015年4月9日

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，判断经济周期和市场化固定收益类金融工具的价格水平，在严格控制风险的基础上，合理配置资产，实现基金资产的增值。
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低于股票市场基金，低于混合基金、股票型基金。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
办公地址	深圳市福田区	深圳
信息披露负责人	姓名：王宇 联系电话：(0755) 20684966 电子邮箱：wangyu@rtfund.com.cn	(010) 66106799 wangyu@icbc.com.cn
客户服务电话	400-885-0088、(0755) 20684000	96588
传真	(0755) 20685606	(010) 66106798

2.4 信息披露方式

募集资金年度报告正文的刊登网站	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 期间指标	2016年	2015年	2014年
本期利润总额	9,776,278.08	6,473,603.68	400,333.84
本期利润	136,718.63	7,356,436.01	39,306,466.06
加权平均基金份额本期利润	0.0006	0.0184	0.0097
基金净值增长率	4.44%	8.47%	13.72%
3.1.2 基金业绩指标	2016年	2015年	2014年
基金净值增长率	4.44%	8.47%	13.72%
基金净值增长率与业绩比较基准之差	0.0333	0.0333	0.0333
期末基金份额净值	923.38/4.022	74.25/12.037	138.107/20.708
期末基金份额净值	1.038	1.112	1.094

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据；

（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；

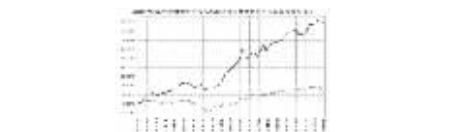
（3）期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期未未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期未未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

3.2 基金净值表现

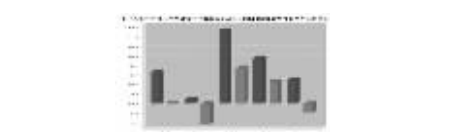
3.2.1 基金净值增值率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-③
过去三个月	0.01%	0.00%	-2.23%	0.16%	2.23%
过去六个月	3.67%	0.11%	-3.42%	0.11%	5.02%
过去一年	4.44%	0.10%	-1.63%	0.09%	6.07%
过去三年	8.80%	0.17%	9.18%	0.10%	13.64%
自基金合同生效以来	37.77%	0.14%	5.38%	0.09%	32.39%

3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩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：上图所示为2012年度数据统计期为2012年3月1日（基金合同生效日）至2012年12月31日，未覆盖自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份额现金红利	再投资形式发放红利	年度利润分配合计	备注
2016	1.2370	8,272,363.174	1,432,173.16	9,704,536.37
2015	0.0184	6,464,231.914	162,387.98	6,626,619.89
2014	0.0090	7,919,947.798	132,402.90	8,052,350.69
2013	2.1220	19,676,411.60	1,729,187.12	21,405,598.72

§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]18号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万人民币。本公司的股东及出资比例为：新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理公司（Nikko Asset Management 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、融通医疗健康混合基金、融通岁步添利定期开放债券基金、融通丰利四分化（ODII-FOF）基金、融通财富宝货币市场基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通泽洋混合基金、融通通利混合基金、融通通源短融债券基金、融通通源债券基金、融通通月添利基金、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、融通军工二级指数基金、融通证券分级指数基金、融通中证大农业指数基金（LOF）、融通跨境成长混合基金、融通新兴混合基金、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、融通通鑫债券基金、融通增鑫债券基金、融通增祥债券基金、融通通源消费混合基金、融通通丰债券基金、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、融通通源债券基金、融通通源债券基金和融通通源债券基金。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	在基金公司的基金经理任职期限	期间内任职年限	说明
李志刚先生	2016年10月28日	-	16
王宇先生	2016年3月14日	-	9

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工作的时间为计算标准。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通四季添利债券型证券投资基金合同》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，无损害基金持有人合法权益的行为。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加强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间交易的交易价差进行了分析，各投资组合的间向交易价差均处于合理范围之内。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.4 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人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

2016年宏观经济运行平稳，前三季度地产销售火爆，但投资增速始终转弱，10月初地产调控政策密集出台，销售和投资开始回落。基建投资前高后低，托底乏力，制造业底部企稳，但民间投资仍然处于下滑态势。经济虽稳，动力不足。库存低位加之供给侧改革，PPI持续上行，CPI全年V型反转，通胀预期开始显现。四季度，随着央行货币政策的边际趋紧，金融去杠杆愈演愈烈，资金面收紧导致债市大幅调整。全年来看，四月份信用债的无序违约形成了年内收益率的第一个高点，年末资金面的持续紧张导致收益率高涨。

投资方面，本基金在三季度提升了组合久期和杠杆，在四季度降低了组合久期和杠杆水平。

4.4.2 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4.44%，同期业绩比较基准收益率为-1.63%。

4.5 管理人宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年，债券市场机会仍存。市场在供应货币政策边际收紧之后，焦点将重回基本面，在金融数据见顶回落，供给侧改革的强力推动下，经济进一步下台阶的概率较大，将带来债券收益率的重新下行。此外，经过2016年年末的调整，部分信用债已经具备了较好的配置价值，在供需矛盾下，有望带来债券市场的新机会。

4.6 管理人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验，估值委员会成员不包含基金估值。

估值委员会定期对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、事中和事后的审核工作。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 管理人报告期内基金利润分配情况的说明

1. 本基金于2016年1月20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，每10份基金份额派发现金红利0.26元。
2. 本基金于2016年7月15日实施2016年第1次利润分配，以2016年6月30日的可分配收益为基准，每10份基金份额派发现金红利0.30元。
3. 本基金于2016年10月26日实施2016年第2次利润分配，以2016年9月30日的可分配收益为基准，每10份基金份额派发现金红利0.637元。

§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四季添利债券型证券投资基金（LOF）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。

4.2 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，融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）的管理人——融通基金管理有限公司在融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）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，融通四季添利债券型证券投资基金（LOF）对基金份额持有人进行了3次利润分配，分配金额为9,704,523.87元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等相关内容的真实、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四季添利债券型证券投资基金（LOF）2016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21194号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

计报告全文。

§7 年度财务报表

会计主体：融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	本报告期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	31,311,732.31	724,288.27
结算备付金	92,062.03	3,264,975.08
存出保证金	6,097.67	2,448.12
交易保证金	883,169,434.54	96,379,507.88
其中：股票投资	51,111,147.24	-
基金投资	-	-
债券投资	867,109,767.30	96,379,507.88
资产支持证券投资	24,947,000.00	-
应收利息	-	104,131.08
买入返售金融资产	-	-
其他金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收股利	-	-
应收利息	5,274.24	-
其他资产	-	-
资产总计	924,504,286.82	106,038,817.28

负债和所有者权益	本报告期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负债：		
短期借款	-	-
应付短期融资券	-	-
应付交易款	-	-
应付利息	-	-
应付赎回款	387,071.80	48,246.04
应付管理人报酬	469,532.39	27,897.34
应付托管费	156,510.00	12,452.64
应付交易费	7,686.39	1,430.00
其他负债	640.00	960.00
负债合计	1,011,195.21	70,536.02
所有者权益：		
实收资本	88,013,538.19	66,756,797.22
未分配利润	33,378,886.44	7,467,416.68
所有者权益合计	924,504,286.82	74,224,213.90
负债和所有者权益总计	924,504,286.82	106,038,817.28

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.038元，基金份额总额890,013,538.19份。

7.2 利润表

会计主体：融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)

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	8,483,380.88	9,414,692.02
1.利息收入	8,162,301.90	2,227,470.00
其中：存款利息收入	140,104.76	64,170.00
债券利息收入	7,642,484.68	7,163,300.00
资产支持证券利息收入	81,170.99	-
买入返售金融资产收入	276,272.52	-
其他收入	-	-
2.投资收益	3,969,822.97	356,228.57
其中：股权投资收益	-	-
债券投资收益	3,969,822.97	356,228.57
资产支持证券投资收益	-	-
其他投资收益	-	-
公允价值变动损益	-	-
3.公允价值变动损益	-9,481,662.36	1,823,744.33
4.公允价值变动损益	-	-
5.其他收入	12,966.30	9,164.01
二、费用	2,346,314.43	2,112,198.02
1.管理人报酬	1,201,021.01	964,256.00
2.托管费	409,302.27	338,106.61
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	9,897.78	4,354.38
5.利息支出	370,275.26	1,080,228.97
其中：应付短期融资券支出	370,275.26	1,080,228.97
6.其他费用	206,422.97	282,170.35
三、利润总额	6,136,718.52	7,298,493.01
减：所得税费用	-	-
四、净利润	6,136,718.52	7,298,493.01

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	66,756,797.22	7,467,416.68
二、本期基金份额变动产生的基金净值变动（本期申购）	-	136,718.63
三、本期基金份额赎回产生的基金净值变动（本期赎回）	823,217,030.06	36,489,194.13
四、本期基金份额申购赎回产生的基金净值变动（本期申购）	841,474,303.29	36,611,231.07
五、本期基金份额赎回产生的基金净值变动（本期赎回）	-18,266,062.33	-1,122,130.84
六、本期基金份额申购赎回产生的基金净值变动（本期申购）	880,013,538.19	33,378,886.44
七、期末所有者权益（基金净值）	924,504,286.82	924,504,286.82

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	128,580,262.81	9,527,017.97
二、本期基金份额变动产生的基金净值变动（本期申购）	-	7,356,436.01
三、本期基金份额赎回产生的基金净值变动（本期赎回）	-61,748,040.69	-6,178,969.04
四、本期基金份额申购赎回产生的基金净值变动（本期申购）	6,203,404.85	89,107.67
五、本期基金份额赎回产生的基金净值变动（本期赎回）	-66,887,868.48	-6,264,672.31
六、本期基金份额申购赎回产生的基金净值变动（本期申购）	880,013,538.19	33,378,886.44
七、期末所有者权益（基金净值）	66,756,797.22	7,467,416.68

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____ 颜耀耀____
____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

</