

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。

本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。

本年度报告摘要源自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告全文。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性守信情况的说明

本报告期内,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。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

为了保证旗下不同的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,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。

4.3.3 公平交易制度的执行情况

本基金管理人严格按照公平交易制度执行,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。

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

2016年宏观经济运行平稳,前三季度度地产销售火爆,但投资增速始终平稳,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。

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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内未发生异常交易。

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。

4.4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.5 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,前三季度度地产销售火爆,但投资增速始终平稳,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。

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。

4.4.6 管理人对宏观经济、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。市场在适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,供给侧结构性改革的强力推动下,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的机会。

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2017年,债券市场机会仍存。市场在适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,供给侧结构性改革的强力推动下,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的机会。

4.6 管理人对报告期内基金的估值政策等事项的说明

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,减少或避免偏差值的偏差。估值委员会的相关成员均具备相应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下及时修订估值方法,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0.28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。

4.8 管理人报告

4.8.1 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

会字[2001]8号文批准,于2001年6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2016年1月31日,公司共管理6十二只开放式基金;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)、融通支付货币基金、融通动力先锋基金、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、融通四季添利定期开放债券基金、融通丰利四分法(ODII-FOF)基金、融通财宝货币市场基金、融通可转债债券基金、融通泰本保混合基金、融通通泽混合基金、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。

4.8.2 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

注:上图所示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,未按整个自然年度进行折算。

4.8.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额	最近一次发放	两次发放	两次发放	备注
2016	1.270	8,272,361.21	1,432,172.16	9,704,523.87	
2015	0.0300	3,404,219.04	162,247.08	3,646,467.07	
2014	0.4000	7,019,847.06	132,402.00	8,052,290.06	
合计	3.270	16,696,419.40	1,726,072.12	21,403,391.92	

4.8.4 管理人报告

4.8.4.1 基金管理人遵规守信情况说明

本报告期内,基金管理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内容的准确、完整和完整发

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。

5.4 审计报告

本基金2016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。

5.5 托管人报告

5.5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况说明

本报告期内,基金管理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的义务。

5.5.2 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。

5.5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的准确、完整和完整发

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。

5.6 审计报告

本基金2016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。

5.7 托管人报告

5.7.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况说明

本报告期内,基金管理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的义务。

5.7.2 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)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。

5.7.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的准确、完整和完整发

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。

5.8 审计报告

本基金2016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。

5.9 审计报告

本基金2016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。

5.10 审计报告

本基金2016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。

5.11 审计报告

本基金2016年度财务会计报告已经审计,普华永