融通通福债券型证券投资基金(LOF)(原融通通福分级债券型证券投资基金) 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

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,自动转换为上市开放式基金(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将以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、账户更名等操作。在基金管理人办理注册登记信息完成后,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)场外的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)场外的A类份额,且均登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)场内的A类份额,仍登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、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通福分级债券型证券投资基金(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2016年12月31日止,其中:
转型前为2016年1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。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型后

基金简称	融通通福债券(LOF)
基金主代码	161626
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2016年12月13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	210,137,105.93份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017年1月10日
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	通福债 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	199,801,067.32份 10,336,038.61份

注:本基金由原融通通福分级债券型证券投资基金转型而来,上表中合同生效日为转型后本基金起始运作日。

转型前

基金简称	融通通福分级债券
基金主代码	161626
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2013年12月10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	263,008,505.53份
基金合同存续期	2013年12月10日至2016年12月12日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2014年1月27日
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

2.2 基金产品说明

转型后

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。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,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流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。
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。

转型前

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。在认真研判宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,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流动性的基础上,根据类属资产配置策略对投资组合类属资产进行最优化配置和调整。	
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。	
下属分级基金的风险收益特征	融通通福分级债券A:通福B分额具有较风险、较高预期收益的特征。	融通通福分级债券B

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
信息披露负责人	姓名	凌卫东	郭明
	联系电话	(0755)26948666	(010)66105799
	电子邮箱	service@mailrtfund.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 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、深圳证券交易所

§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

转型后

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年12月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	融通通福债券A	融通通福债券C
本期已实现收益	1,533,469.34	62,992.21
本期利润	-1,246,108.32	-52,321.41
加权平均基金份额本期利润	-0.0061	-0.0049
本期基金份额净值增长率	-0.20%	-0.30%
3.1.2 期末数据和指标	2016年12月31日	
期末可供分配基金份额利润	0.3676	0.1154
期末基金资产净值	198,923,287.86	10,286,488.62
期末基金份额净值	0.996	0.995

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)。

转型前

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年1月1日至2016年12月12日	2015年	2014年
本期已实现收益	37,604,144.86	24,315,330.95	37,840,470.09
本期利润	9,812,501.67	42,854,258.22	56,796,477.14
加权平均基金份额本期利润	0.0567	0.2177	0.1310
本期基金份额净值增长率	4.99%	24.98%	23.43%
3.1.2 期末数据和指标	2016年12月12日	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.3617	0.2809	0.1723
期末基金资产净值	263,008,505.53	259,004,454.34	262,502,984.70
期末基金份额净值	1.000	1.486	1.199

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

转型后

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

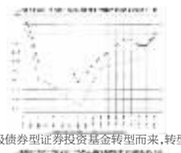
融通通福债券A

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
2016年12月13日-2016年12月31日	-0.20%	0.22%	-0.36%	0.25%	0.16%	-0.03%

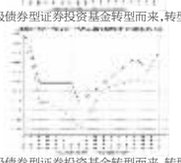
融通通福债券C

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
2016年12月13日-2016年12月31日	-0.30%	0.22%	-0.36%	0.25%	0.06%	-0.03%

3.2.2自基金转型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

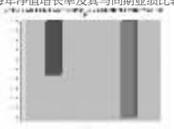


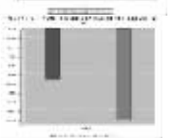
注:本基金由原融通通福分级债券型证券投资基金转型而来,转型日期为2016年12月13日。



注:本基金由原融通通福分级债券型证券投资基金转型而来,转型日期为2016年12月13日。

3.2.3自基金转型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



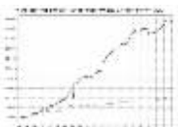


转型前

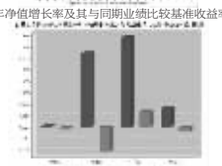
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.41%	0.14%	-1.97%	0.10%	1.56%	0.04%
过去六个月	3.15%	0.14%	-1.07%	0.08%	4.22%	0.06%
过去一年	4.99%	0.13%	-1.28%	0.07%	6.27%	0.06%
过去三年	61.98%	0.36%	9.58%	0.09%	52.40%	0.27%
自基金合同生效起至2016年12月12日	62.31%	0.35%	9.11%	0.09%	53.20%	0.26%

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过去五年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



3.3其他指标 (转型前)

其他指标	报告期末(2016年12月12日)
融通通福A与融通通福B份额配比	0.04254043:1
融通通福A参考净值	1.000
融通通福A累计参考净值	1.137
融通通福A份额	10,731,956.05
融通通福B份额参考净值	1.000
融通通福B累计参考净值	1.692
融通通福A年收益率	3.50%

注:本基金管理人于2016年6月3日发布公告《关于融通通福分级债券型证券投资基金之通福A份额第五个开放日后约定年基准收益率的公告》,通福A本次开放日(2016年6月8日)后的约定年基准收益率为2015年12月10日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币一年期银行定期存款利率(税后)+2%,即3.50%。

3.4过去三年基金的利润分配情况

转型前

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	-
2015	-	-	-	-	-
2014	-	-	-	-	-
合计	-		-	-	-

转型后

单位:人民币元

融通通福债券A					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

单位:人民币元

融通通福债券C					
年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§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、融通通棋债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通俊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(转型后)

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
王涛	本基金的基金经理	2016年12月13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部交易员、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,现任融通易支付货币、融通汇财宝货币(由原融通七天理财债券转型而来)、融通通福短融债券、融通增利债券、融通通安债券、融通月月添利定期开放债券、融通通福债券(LOF)(由原融通通福分级债券转型而来)、融通通利债券、融通通裕债券、融通通鑫债券、融通通穗债券的基金经理。

注:1.任免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。

2.本基金由“融通通福分级债券型证券投资基金”转型而来,转型日期为2016年12月13日,转型前、后基金经理均为王涛。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介(转型前)

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
王涛	本基金的基金经理	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部交易员、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,现任融通易支付货币、融通汇财宝货币(由原融通七天理财债券转型而来)、融通通福短融债券、融通增利债券、融通通安债券、融通月月添利定期开放债券、融通通福债券(LOF)(由原融通通福分级债券转型而来)、融通通利债券、融通通裕债券、融通通鑫债券、融通通穗债券的基金经理。
汪曦	本基金的基金经理	2015年8月6日	2016年9月2日	4	汪曦女士,纽约大学stern商学院硕士,清华大学工学学士。4年证券投资从业经历,具有基金从业资格。历任新于长城证券有限责任公司,担任长期策略研究收益研究员。2012年10月加入融通基金管理有限公司,现任融通通福债券、融通通福分级债券、融通月月添利定期开放债券基金的基金经理。

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 管理人对投资组合合规风控情况的说明

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 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,并涵盖投资、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。

4.3.2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。

4.3.3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 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。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回到年内最高水平。10年期金融债收益率全年上行50bp左右,主体AAA短融收益率全年上行100bp左右。

基金组合中加大了利率债的配置比例,并有波段操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

转型后(2016年12月13日 - 2016年12月31日):

本报告期A类基金份额净值增长率为-0.20%,C类基金份额净值增长率为-0.30% ,同期业绩比较基准收益率为-0.36%。

转型前(2016年1月1日 - 2016年12月12日):

本报告期基金份额净值收益率为4.99% ,同期业绩比较基准收益率为-1.28%。

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,债券市场机会仍存在。市场在适应货币政策边际收紧之后,焦点将重回基本面。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,但中长期看同业去杠杆、供给侧改革进程中整体经济中融资需求仍将逐步萎缩。货币政策暂时趋中偏紧,但央行仍将采用公开市场操作手段保证市场的流动性。利率债以及同业存单等已经具备了较好的配置价值。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§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通福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。

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,融通通福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通福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,融通通福债券型证券投资基金(LOF)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通福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(转型后)

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21186号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§6 审计报告(转型前)

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21218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(转型后)

7.1 资产负债表(转型后)

会计主体:融通通福分级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	本期末 2016年12月31日
资 产:	
银行存款	50,638,258.34
结算备付金	8,238,041.68
存出保证金	7,876.05
交易性金融资产	263,769,598.14
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	263,769,598.14
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	3,880,936.61
应收利息	5,438,327.85
应收股利	-
应收申购款	16,504.48
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	331,989,543.15

负债和所有者权益	本期末 2016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	70,000,000.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	62,464,226.08
应付管理人报酬	154,163.19
应付托管费	44,046.60
应付销售服务费	4,486.06
应付交易费用	2,448.50
应交税费	-
应付利息	2,718.05
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	107,677.29
负债合计	122,779,768.67
所有者权益:	
实收基金	134,579,350.26
未分配利润	74,630,426.22
所有者权益合计	209,209,776.48
负债和所有者权益总计	331,989,543.15

注:1.报告截止日2016年12月31日,融通通福债券型证券投资基金(LOF)份额总额210,137,105.93份;其中A类基金份额净值为0.996元,基金份额为199,801,067.32份;C类基金份额净值为0.995元,基金份额为10,336,038.61份 。

2、本基金由融通通福分级债券型证券投资基金转型而来,基金转型日为2016年12月13日,2016年度实际报告期间为2016年12月13日(基金转型日)至2016年12月31日。截止报告期末本基金转型未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.2 利润表

会计主体:融通通福债券型证券投资基金(LOF)

本报告期:2016年12月13日(基金转型日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年12月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
一.收入	-1,038,934.37
1.利息收入	1,834,085.24
其中:存款利息收入	12,567.98
债券利息收入	1,789,431.69
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	32,085.57
其他利息收入	-
2.投资收益	4,979.23
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	4,979.23
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	-
3.公允价值变动收益	-2,893,891.28
4.汇兑收益	-
5.其他收入	15,892.44
减:二.费用	258,406.36
1. 管理人报酬	92,817.90
2. 托管费	26,519.38
3. 销售服务费	2,203.89
4. 交易费用	87.43
5. 利息支出	128,347.81
其中:卖出回购金融资产支出	128,347.81
6. 其他费用	8,518.95
三.利润总额	-1,297,429.73
减:所得税费用	-
四.净利润	-1,297,429.73

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通通福债券型证券投资基金(LOF)

本报告期:2016年12月13日(基金转型日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年12月13日(基金合同生效日)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)	167,895,605.81	96,142,899.72	263,008,505.53
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,297,429.73	-1,297,429.73
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-33,296,255.55	-19,215,043.77	-52,501,299.32
其中:1.基金申购款	16,749.71	9,746.78	26,496.49
2.基金赎回款	-33,303,005.26	-19,224,790.55	-52,527,795.81
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)	134,579,350.26	74,630,426.22	209,209,776.48

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 颜锡康 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、会计估计与最近一期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。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 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、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、基金代销机构
新时代证券股份有限公司(“新时代证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东
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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未使用关联方的交易单元进行交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年12月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期应支付的管理费	92,817.90
其中:支付销售机构的客户维护费	2,368.24

注:1.支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.70%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:

日管理人报酬=前一日基金资产净值× 0.70% / 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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年12月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日
当期应支付的托管费	26,519.38

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%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:

日托管费=前一日基金资产净值× 0.20% / 当年天数。

7.4.3.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年12月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通通福债券A	融通通福债券C	合计
融通基金管理有限公司	-	54.40	54.40
中国工商银行	-	1,967.21	1,967.21
合计	-	2,011.61	2,011.61

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.40%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:

日销售服务费=前一日C类基金资产净值× 0.40% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期末,基金管理人未持有本基金份额。

7.4.3.4.2 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

本报告期末,基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

7.4.3.5 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12月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	50,638,258.34	5,508.14

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。6.1.1.1 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券;

2、本基金本报告期未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期内承销的证券。

6.1.1.2 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.1.2 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

6.1.2.1 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/增发而流通受限的证券。

6.1.2.2 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的股票。

6.1.2.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.2.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为零。

6.1.2.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额70,000,000.00元,其中60,000,000.00元于2017年1月3日到期,10,000,000.00元于2017年1月5日到期。该类交易要求本基金转入质