

融通通瑞债券型证券投资基金  
(原融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金转型)

2014 年年度报告摘要

2014 年 12 月 31 日

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：2015 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示

融通通瑞债券型证券投资基金是由“融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金”转型而来，根据《融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金基金合同》的约定，融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金在 2014 年 11 月 5 日达到封闭期提前到期触发条件并进入过渡期，过渡期结束后的下一工作日即 2014 年 11 月 14 日起，转型为“融通通瑞债券型证券投资基金”（以下简称“本基金”）。

转型后原基金合同、托管协议和招募说明书分别变更为《融通通瑞债券型证券投资基金基金合同》、《融通通瑞债券型证券投资基金托管协议》和《融通通瑞债券型证券投资基金招募说明书》，具体内容请参阅 2014 年 11 月 6 日在《中国证券报》、《证券时报》和管理人网站上刊登的相关公告。

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于 2015 年 3 月 20 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 2014 年 3 月 21 日（基金合同生效日）起至 2014 年 12 月 31 日止，其中：转型前（原融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金）报告期自 2014 年 3 月 21 日起至 2014 年 11 月 13 日止和转型后（融通通瑞债券型证券投资基金）报告期自 2014 年 11 月 14 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金	
基金简称	融通通瑞一年目标触发式债券
基金主代码	000466

基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2014 年 3 月 21 日
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
报告期末基金份额总额	148,596,745.32 份
基金合同存续期	2014 年 3 月 21 日至 2014 年 11 月 13 日

融通通瑞债券型证券投资基金		
基金简称	融通通瑞债券	
基金主代码	000466	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 11 月 14 日	
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	
报告期末基金份额总额	109,605,059.97 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	融通通瑞债券 A/B	融通通瑞债券 C
下属分级基金的交易代码	000466	000859
下属两级基金的前端交易代码	000466	000859
下属两级基金的后端交易代码	000858	-
报告期末下属分级基金的份额总额	89,879,048.92 份	19,726,011.05 份

## 2.2 基金产品说明

融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金	
投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过券种配置及个券选择，努力追求绝对收益，力争在最长封闭期内实现 6% 的目标回报。
投资策略	坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求目标回报。
业绩比较基准	年化收益率 6%。
风险收益特征	债券型基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

融通通瑞债券型证券投资基金	
投资目标	本基金将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，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	基金将坚持稳健投资，在严格控制风险的基础上，追求目标回报。
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，其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

## 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露	姓名	涂卫东	田青

负责人	联系电话	(0755) 26948666	(010) 67595096
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755)26948088	(010) 67595096
传真		(0755) 26935005	(010) 66275853

## 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

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金

#### 3.1.1 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	报告期(2014年3月21日 - 2014年11月13日)
本期已实现收益	11,525,324.30
本期利润	18,440,866.40
加权平均基金份额本期利润	0.0739
本期基金份额净值增长率	7.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年11月13日)
期末可供分配基金份额利润	0.0478
期末基金资产净值	159,864,616.63
期末基金份额净值	1.076

注：1、本基金转型前合同生效日为2014年3月21日，截至2014年11月13日，基金合同生效未满一年，相关数据根据实际存续期计算；

2、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；

3、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；

4、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）。

#### 3.1.2 基金净值表现

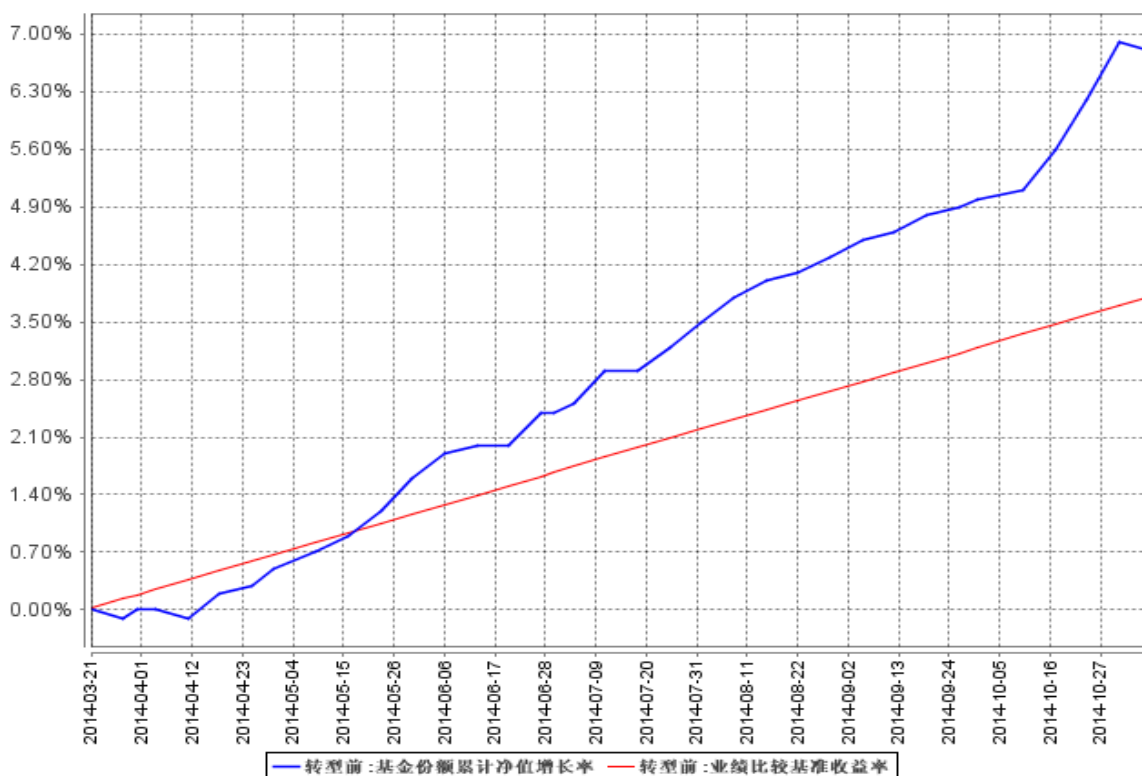
##### 3.1.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 (2014-10-1 至 2014-11-13)	2.48%	0.19%	0.72%	0.00%	1.76%	0.19%
过去六个月 (2014-7-1 至 2014-11-13)	5.08%	0.12%	2.24%	0.00%	2.84%	0.12%
自基金合同生效 起至 2014-11-13	7.60%	0.10%	3.91%	0.00%	3.69%	0.10%

3.1.2.2 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

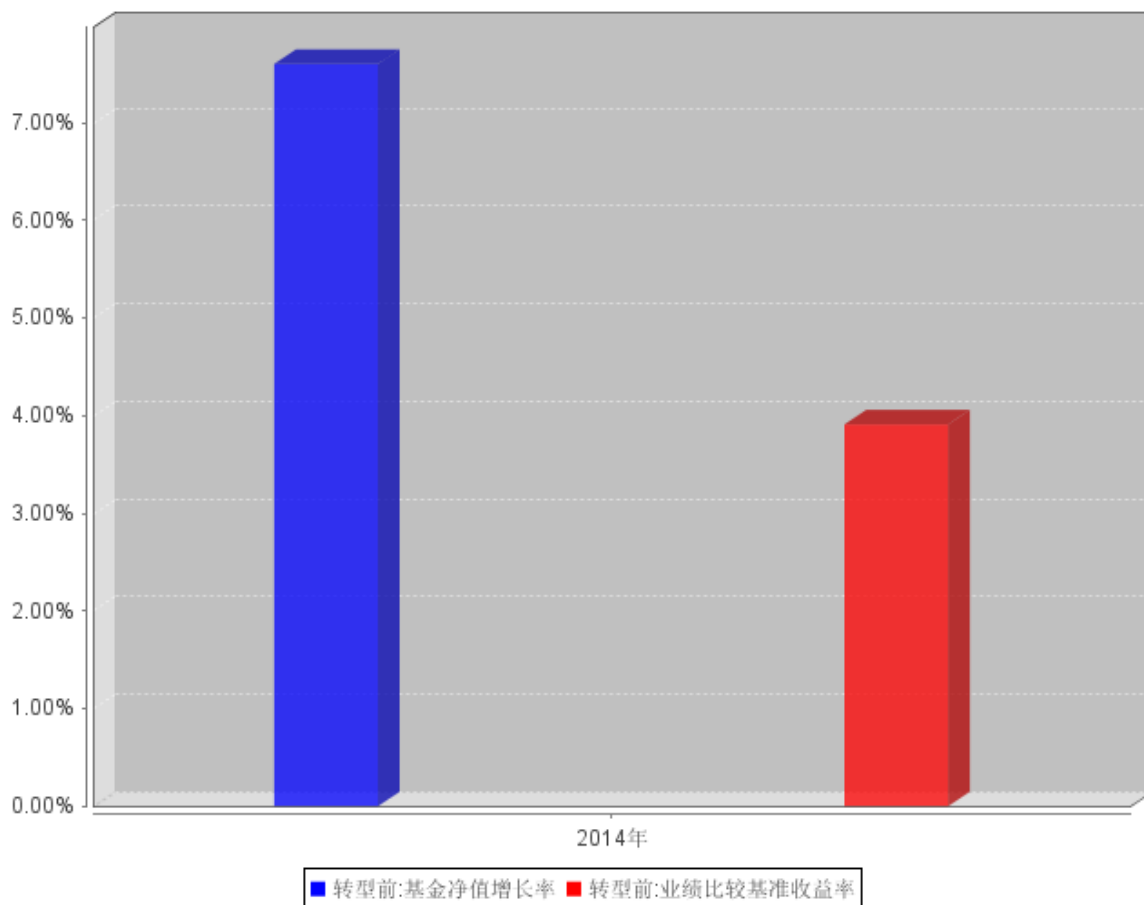
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金转型前合同生效日为 2014 年 3 月 21 日。截至 2014 年 11 月 13 日，基金合同生效未及一年。

3.1.2.3 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

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对比图



注：本基金转型前合同生效日为 2014 年 3 月 21 日，合同生效并转型前年按实际存续期计算，未按整个自然年度进行折算。

3.2 融通通瑞债券型证券投资基金

3.2.1 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	报告期（2014 年 11 月 14 日 — 2014 年 12 月 31 日）	
	融通通瑞债券 A/B	融通通瑞债券 C
本期已实现收益	1,876,954.57	224,961.04
本期利润	-2,968,044.36	-352,030.62
加权平均基金份额本期利润	-0.0205	-0.0223
本期基金份额净值增长率	-1.70%	-1.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014 年 12 月 31 日)	
期末可供分配基金份额利润	0.0525	-0.018
期末基金资产净值	88,339,109.29	19,370,952.47
期末基金份额净值	0.983	0.982

注：1、本基金转型后合同生效日为 2014 年 11 月 14 日，截止报告期末合同生效未满一年，相关数据根据实际存续期计算；

2、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；

3、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；

4、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）。

### 3.2.2 基金净值表现

#### 3.2.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通通瑞债券 A/B

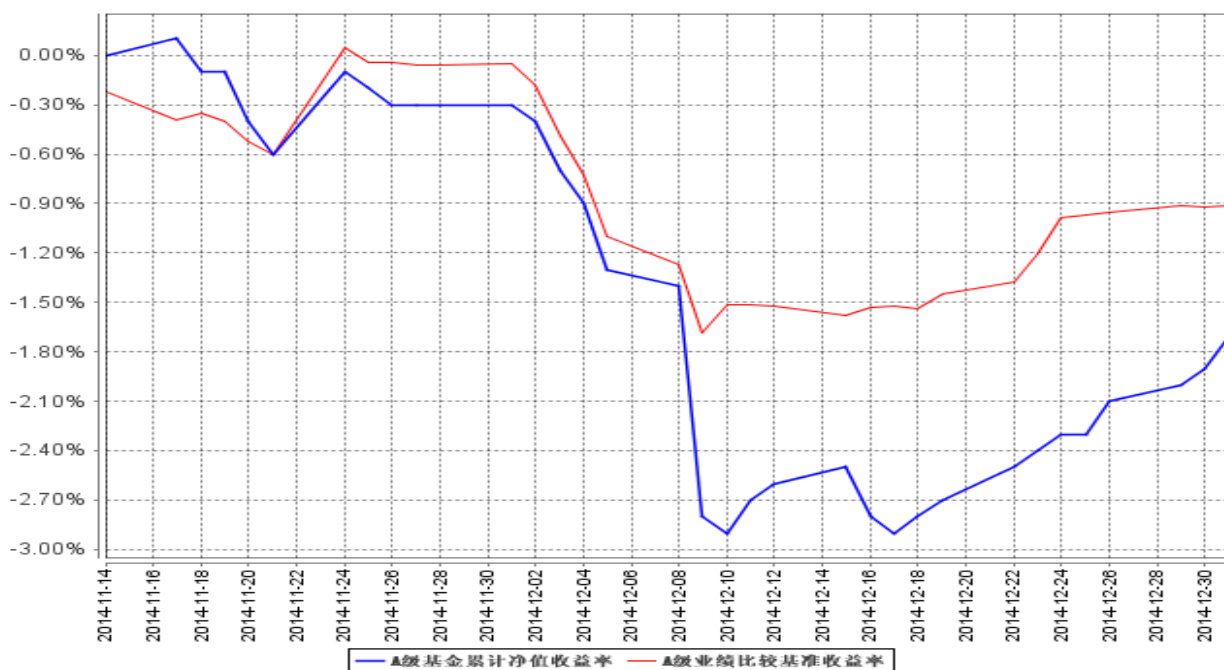
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
2014-11-14 至 2014-12-31	-1.70%	0.30%	-0.91%	0.19%	-0.79%	0.11%

融通通瑞债券 C

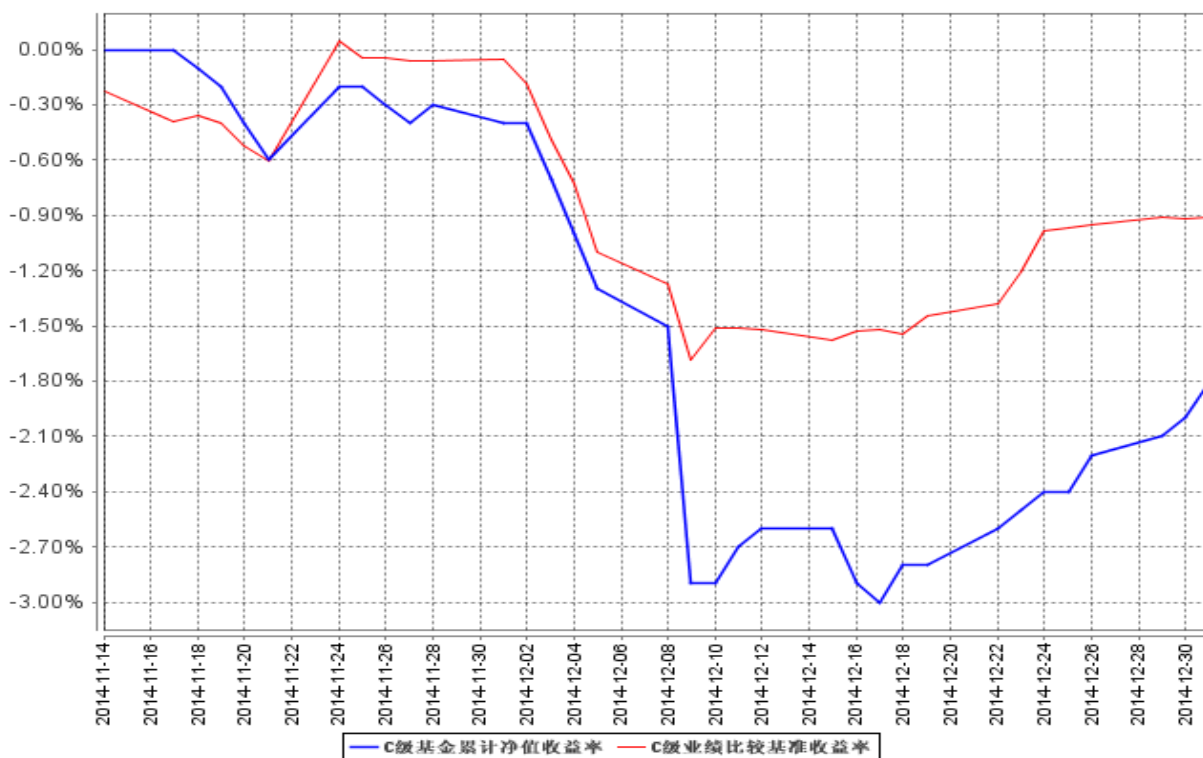
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
2014-11-14 至 2014-12-31	-1.80%	0.30%	-0.91%	0.19%	-0.89%	0.11%

3.2.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



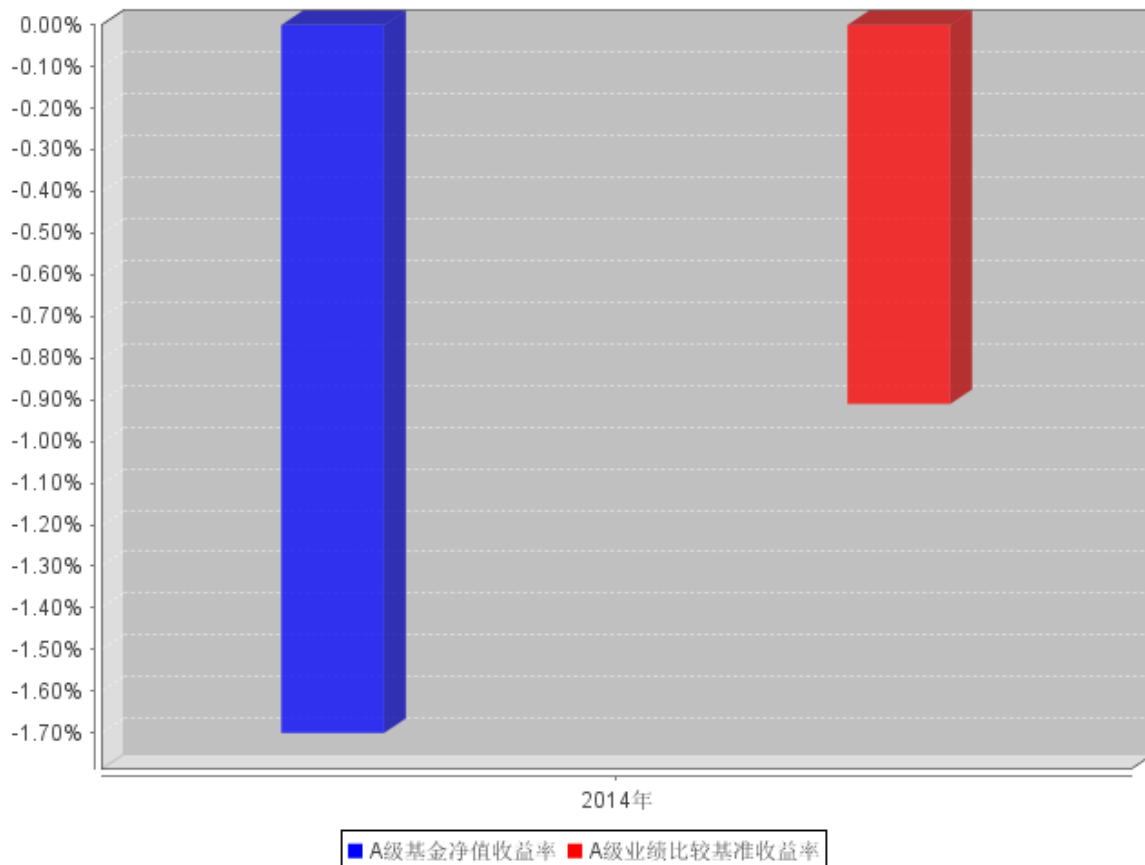
注：1、本基金转型后的合同生效日为 2014 年 11 月 14 日。截至报告期末，基金合同生效未满 1 年；



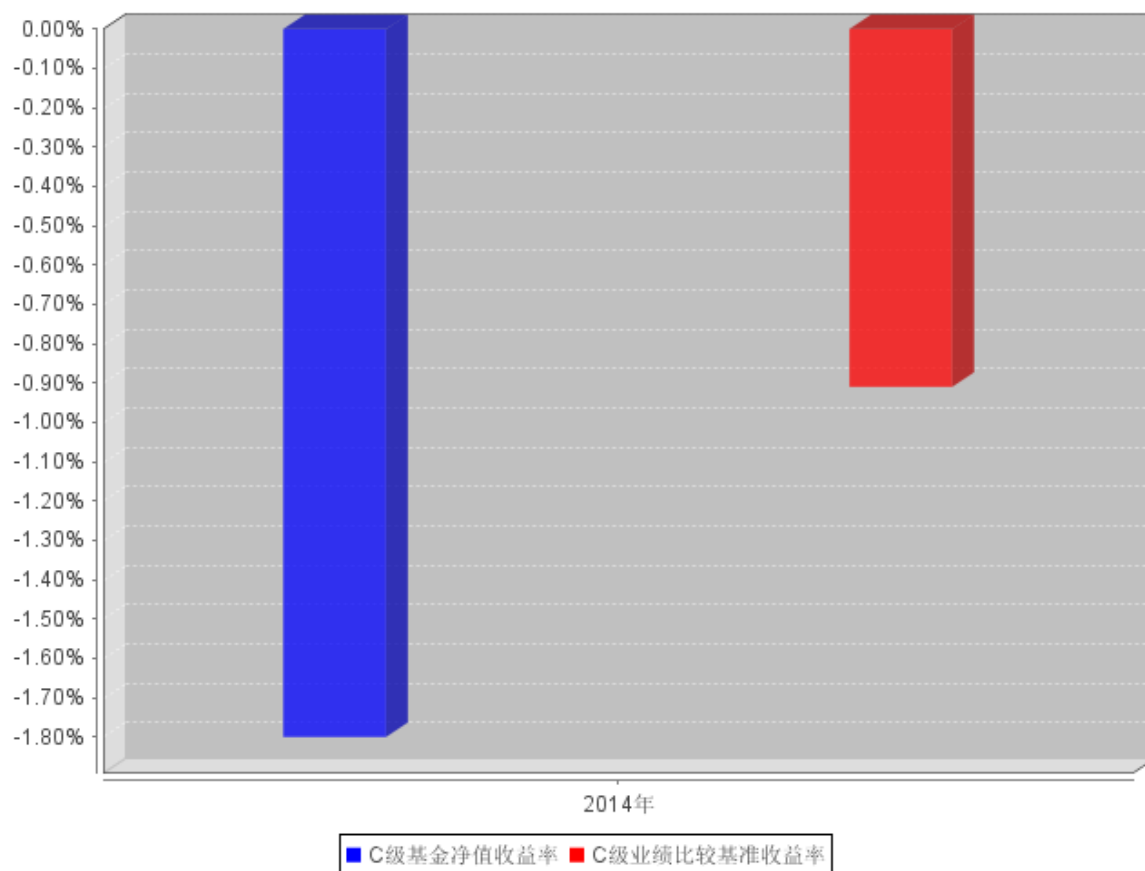
2、本基金转型后的建仓期为转型日起 6 个月。截至报告期末，本基金尚未完成建仓。

### 3.2.2.3 自基金转型以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### A级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### C级自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金转型后的合同生效日为2014年11月14日，转型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

本基金转型前后均未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 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金字[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：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2014年12月31日，公司管理的基金共有二十六只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；二十五只开放式基金，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、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金、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、融通医疗保健行业股票基金、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、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金、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、融通月月添利基金和融通健康产业基金。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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
韩海平	本基金的基金经理、融通通福分级债、融通债券、融通通泰保本的基金经理	2014 年 11 月 14 日	-	12	CFA, FRM, 中国科学技术大学经济学硕士、管理科学和计算机科学与技术双学士，具有基金从业资格。2003 年 10 月至 2007 年 4 月在招商基金管理有限公司工作，从事数量化投资策略研究工作；2007 年 5 月至 2012 年 9 月在国投瑞银基金管理有限公司工作，历任高级研究员、基金经理、固定收益组副总监；2012 年 9 月加入融通基金管理有限公司。

注：1、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。

2、本基金转型前基金经理：韩海平先生。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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 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。

#### 4.3.2 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说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年全年经济增速相对平稳，通胀水平保持低位，货币政策逐季宽松，央行通过 SLF 等创新性政策工具向市场注入流动性，并且通过下调正回购利率和存贷款基准利率等引导债券收益率下行，降低实体经济融资成本。2014 年，无论利率债和信用债，还是转债和股票表现都非常强劲，上半年债券收益率大幅下行，下半年股票市场大幅上升。全年 10 年期金融债收益率下行 173bp；5 年 AAA 中票收益率下行 150bp；中证转债指数和沪深 300 指数分别上涨 56.9%和 51.7%。

投资运作上，融通通瑞目标收益基金按照“短久期、高杠杆”的投资思路运作，成功达到触发目标收益并转型为开放式债基。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金转型前：份额净值增长率为 7.60%，同期业绩比较基准收益率为 3.91%；

本基金转型后：A/B 类份额净值增长率为-1.70%，C 类份额净值增长率为-1.80%，同期业绩比较基准收益率为-0.91%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2015 年经济增长动力仍然不足，去年四季度房地产成交显著上升，预计房地产市场今年上半年会持续回暖，房地产投资将于今年下半年企稳。国际油价和大宗商品价格大幅下跌，工业品通缩风险仍在加剧，消费品价格将保持稳定。面对经济下行压力，降低社会融资成本，央行货币政策仍将继续维持宽松。去年股票和债券市场收益率惊人，预计今年资本市场波动将会上升，灵活操作将尤为关键。本基金将降低基金杠杆水平，灵活操作股票和转债等风险资产。

#### 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其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

截至报告期末，本基金 A/B 类份额每份基金份额可供分配利润 0.0525 元，C 类份额每份基金份额可供分配利润-0.018 元，依据合同约定，暂不进行利润分配。

### § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

### 6.1 融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金

本基金 2014 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(2015)第 20520 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

### 6.2 融通通瑞债券型证券投资基金

本基金 2014 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(2015)第 20521 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 融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金

#### 7.1.1 资产负债表

会计主体：融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 11 月 13 日（转型前一日）

单位：人民币元

资产	本期末
	2014 年 11 月 13 日（转型前一日）
<b>资产：</b>	
银行存款	551,463.54
结算备付金	7,922,196.45
存出保证金	21,780.40
交易性金融资产	257,765,190.44
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	257,765,190.44
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	44,383,986.17
应收利息	3,466,264.41

应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	314,110,881.41
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>
	<b>2014年11月13日(转型前一日)</b>
<b>负 债:</b>	
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	119,999,578.00
应付证券清算款	-
应付赎回款	34,033,585.19
应付管理人报酬	-
应付托管费	17,916.60
应付销售服务费	-
应付交易费用	4,761.85
应交税费	-
应付利息	24,106.02
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	166,317.12
负债合计	154,246,264.78
<b>所有者权益:</b>	
实收基金	148,596,745.32
未分配利润	11,267,871.31
所有者权益合计	159,864,616.63
负债和所有者权益总计	314,110,881.41

注：1、报告截止日 2014 年 11 月 13 日（转型前一日），基金份额净值 1.076 元，基金份额总额 148,596,745.32 份。

2、本基金转型前合同生效日为 2014 年 3 月 21 日，无上年度末比较数据。

### 7.1.2 利润表

会计主体：融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2014 年 11 月 13 日（转型前一日）

单位：人民币元

项 目	本期
	2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年11月13日(转型前一日)
一、收入	23,578,157.73

1. 利息收入	11,686,101.59
其中：存款利息收入	110,179.03
债券利息收入	9,772,887.24
资产支持证券利息收入	1,303,189.04
买入返售金融资产收入	499,846.28
其他利息收入	-
2. 投资收益	4,976,514.04
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	4,161,483.91
资产支持证券投资收益	815,030.13
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	6,915,542.10
4. 汇兑收益	-
5. 其他收入	-
<b>减：二、费用</b>	<b>5,137,291.33</b>
1. 管理人报酬	2,509,532.36
2. 托管费	334,383.30
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	8,299.48
5. 利息支出	2,095,548.01
其中：卖出回购金融资产支出	2,095,548.01
6. 其他费用	189,528.18
<b>三、利润总额</b>	<b>18,440,866.40</b>
减：所得税费用	-
<b>四、净利润</b>	<b>18,440,866.40</b>

注：本基金合同生效日为 2014 年 3 月 21 日，无上年度同期比较数据。

### 7.1.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2014 年 11 月 13 日（转型前一日）

单位：人民币元

项目	2014 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2014 年 11 月 13 日（转型前一日）		
	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）	250,948,217.50	-	250,948,217.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	18,440,866.40	18,440,866.40



润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-102,351,472.18	-7,172,995.09	-109,524,467.27
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-102,351,472.18	-7,172,995.09	-109,524,467.27
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）	148,596,745.32	11,267,871.31	159,864,616.63

注：本基金合同生效日为 2014 年 3 月 21 日，无上年度同期比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1.1 至 7.1.4 财务报表由下列负责人签署：

孟朝霞

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

#### 7.1.4 报表附注

##### 7.1.4.1 基金基本情况

融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2013]第 1515 号《关于核准融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金募集的批复》核准，由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 250,818,598.30 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 102 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 3 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 250,948,217.50 份基金份额，其中认购资金利息折合 129,619.20 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金基金合同》的规定，本基金自基金合同生效日起封闭运作，不办理申购与赎回业务，达到封闭期提前到期触发条件或最长封闭期期满后的下一工作日起进入过渡期。过渡期结束后的下一日起，本基金转型为融通通瑞债券型证券投资基金。

根据实际运作情况，本基金 2014 年 11 月 3 日、2014 年 11 月 4 日及 2014 年 11 月 5 日的份额累计净值分别为 1.072 元、1.075 元及 1.075 元，即本基金累计份额净值已于 2014 年 11 月 5

日触发“连续 3 个工作日不低于 1.07 元”的封闭期提前到期条件，本基金的基金管理人按照基金合同的约定，提前结束本基金的封闭运作并进入过渡期。根据本基金的实际运作情况，本基金的过渡期结束日为 2014 年 11 月 13 日，自 2014 年 11 月 14 日起，本基金转型为融通通瑞债券型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、公司债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%。本基金还可投资于股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%。本基金业绩比较基准为年化收益率 6%。

#### **7.1.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.1.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.1.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2014 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2014 年 11 月 13 日(转型前一日)止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2014 年 11 月 13 日(转型前一日)的财务状况以及 2014 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2014 年 11 月 13 日(转型前一日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.1.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.1.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2014 年 3 月 21 日(基金合同生效日)至 2014 年 11 月 13 日(转型前一日)止期间。

##### **7.1.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。交易所上市的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本估值。

#### **7.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### **7.1.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### **7.1.4.4.8 损益平准金**

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### **7.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量**

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价

值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.1.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金收益分配采取现金方式。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.1.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.1.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.1.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2014 年颁布《企业会计准则第 39 号——公允价值计量》、《企业会计准则第 40 号——合营安排》、《企业会计准则第 41 号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第 2 号——长期股权投资》、《企业会计准则第 9 号——职工薪酬》、《企业会计准则第 30 号——财务报表列报》、《企业会计准则第 33 号——合并财务报表》以及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年 3 月 21 日（基金合同生效日）至 2014 年 11 月 13 日（转型前一日）止期间财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

##### 7.1.4.5.2 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。

##### 7.1.4.5.3 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。

##### 7.1.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。
- 2、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

##### 7.1.4.7 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司（“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。

**7.1.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****7.1.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.1.4.8.1.1 股票交易**

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

**7.1.4.8.1.2 权证交易**

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

**7.1.4.8.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期无应付关联方的交易佣金。

**7.1.4.8.2 关联方报酬****7.1.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年3月21日至2014年11月13日（转型前一日）
当期发生的基金应支付的管理费	2,509,532.36
其中：支付销售机构的客户维护费	724,018.12

注：1、本基金转型为“融通通瑞债券型证券投资基金”前，管理费按照集中赎回开放期开始前一日的基金份额累计净值大小进行分段设置，一次性计提。其计算公式为：

一次性计提的基金管理费=基金合同生效日的基金资产净值×1.00%

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。

**7.1.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期
	2014年3月21日至2014年11月13日（转型前一日）
当期发生的基金应支付的托管费	334,383.30

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%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=前一日的基金资产净值×0.20%/当年天数。

**7.1.4.8.2.3 销售服务费**

本基金转型为“融通通瑞债券型证券投资基金”前不收取销售服务费。

**7.1.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

**7.1.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****7.1.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

本报告期基金管理人未运用自有资金投资本基金。

**7.1.4.8.4.2 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。

**7.1.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

关联方名称	本期 2014年3月21日(基金合同生效日)至2014年11月13日(转型前一日)	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	551,463.54	39,043.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**7.1.4.8.6 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）在承销期承销的证券。

**7.1.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金无其他关联交易事项的说明。

**7.1.4.9 期末（2014年11月13日（转型前一日））本基金持有的流通受限证券****7.1.4.9.1 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。

**7.1.4.9.2 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。

**7.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.1.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 年 11 月 13 日（转型前一日）止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 67,999,578.00 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101454035	14 陕交建 MTN001	2014-11-18	103.87	200,000.00	20,774,000.00
101461020	14 北大荒 MTN001	2014-11-18	103.12	200,000.00	20,624,000.00
101472006	14 江阴公 MTN001	2014-11-18	103.06	100,000.00	10,306,000.00
101464041	14 复星 MTN001	2014-11-19	101.18	180,000.00	18,212,400.00



合计				680,000.00	69,916,400.00
----	--	--	--	------------	---------------

#### 7.1.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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 52,000,000.00 元，于 2014 年 11 月 14 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.2 融通通瑞债券型证券投资基金

#### 7.2.1 资产负债表

会计主体：融通通瑞债券型证券投资基金

报告截止日：2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 12 月 31 日
资产：	
银行存款	45,857,990.00
结算备付金	3,438,312.50
存出保证金	18,766.96
交易性金融资产	161,093,222.44
其中：股票投资	-
基金投资	-
债券投资	161,093,222.44
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	3,443,739.25
应收股利	-
应收申购款	136,108.25
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	213,988,139.40
负债和所有者权益	本期末 2014 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	62,999,770.00
应付证券清算款	20,200.91
应付赎回款	43,030,342.16

应付管理人报酬	96,115.99
应付托管费	27,461.72
应付销售服务费	6,827.30
应付交易费用	12,212.30
应交税费	-
应付利息	2,867.92
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	82,279.34
负债合计	106,278,077.64
所有者权益：	
实收基金	103,348,986.43
未分配利润	4,361,075.33
所有者权益合计	107,710,061.76
负债和所有者权益总计	213,988,139.40

注：1、报告截止日 2014 年 12 月 31 日，本基金基金份额总额 109,605,059.97 份。其中：A/B 类基金份额净值 0.983 元，基金份额总额 89,879,048.92 份；本基金 C 类基金份额净值 0.982 元，基金份额总额 19,726,011.05 份。

2、本基金转型后合同生效日为 2014 年 11 月 14 日，无上年度末比较数据。

### 7.2.2 利润表

会计主体：融通通瑞债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 11 月 14 日(转型后首日)至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 11 月 14 日(转型后首日)至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	-2,614,522.65
1. 利息收入	1,447,209.96
其中：存款利息收入	20,483.30
债券利息收入	1,423,296.54
资产支持证券利息收入	3,331.51
买入返售金融资产收入	98.61
其他利息收入	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,344,828.31
其中：股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	1,344,828.31
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（损失以“-”号填列）	-5,421,990.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	15,429.67
减：二、费用	705,552.33
1. 管理人报酬	142,782.55
2. 托管费	41,670.97
3. 销售服务费	8,070.22
4. 交易费用	1,526.51
5. 利息支出	473,601.92
其中：卖出回购金融资产支出	473,601.92
6. 其他费用	37,900.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-3,320,074.98
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-3,320,074.98

注：本基金转型后合同生效日为 2014 年 11 月 14 日，无上年度同期比较数据。

### 7.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通瑞债券型证券投资基金

本报告期：2014 年 11 月 14 日（转型后首日）至 2014 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 11 月 14 日（转型后首日）至 2014 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）	148,596,745.32	11,267,871.31	159,864,616.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,320,074.98	-3,320,074.98
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-45,247,758.89	-3,586,721.00	-48,834,479.89
其中：1. 基金申购款	29,069,216.76	457,513.58	29,526,730.34
2. 基金赎回款	-74,316,975.65	-4,044,234.58	-78,361,210.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	103,348,986.43	4,361,075.33	107,710,061.76

注：本基金转型后合同生效日为 2014 年 11 月 14 日，无上年度同期比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.2.1 至 7.2.4 财务报表由下列负责人签署：

孟朝霞

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

## 7.2.4 报表附注

### 7.2.4.1 基金基本情况

融通通瑞债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金转型而来。根据《融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金基金合同》，融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金自基金合同生效日起封闭运作，不办理申购与赎回业务，达到封闭期提前到期触发条件或最长封闭期期满后的下一工作日起进入过渡期。过渡期结束后的下一日起，融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金转型为融通通瑞债券型证券投资基金。融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金于 2014 年 11 月 5 日触发封闭期提前到期条件，基金管理人按照基金合同的约定，提前结束该基金的封闭运作并进入过渡期。根据实际运作情况，本基金的过渡期结束日为 2014 年 11 月 13 日，自 2014 年 11 月 14 日起，本基金转型为融通通瑞债券型证券投资基金。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金基金合同》以及基金管理人的实际安排，融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金自 2014 年 11 月 7 日至 2014 年 11 月 13 日(转型前一日)止期间开放集中赎回，在上述过渡期的集中赎回期内未赎回的基金份额在融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金转型为融通通瑞债券型证券投资基金后的第一个工作日(2014 年 11 月 14 日)末自动转换为融通通瑞债券型证券投资基金的 A 类基金份额并进行份额折算，折算后 A 类基金份额净值为 1.000 元。本基金的基金管理人融通基金管理有限公司作为本基金的注册登记机构，负责对融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金转入的基金份额持有人的基金份额实施变更登记。本基金自 2014 年 11 月 14 日(转型后首日)至 2014 年 11 月 28 日止期间开放集中申购，集中申购期内不开放赎回，不设申购规模上限。

根据《融通通瑞债券型证券投资基金基金合同》和《融通通瑞债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案，本基金根据申购费用、赎回费用及销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取前端申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额为融通通瑞债券基金 A 类份额；在投资者赎回时收取后端申购费用和赎回费用的基金份额为融通通瑞债券基金 B 类份额；在基金资产中计提销售服务费、不收取申购费用，对于持有期限不少于 30 日的本类别基金份额的赎回亦不收取赎回费，但对持有期限少于 30 日的本类别基金份额的赎回收取赎回费的基金份额为融通通瑞债券基金 C 类份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通瑞债券型证券投资基金基金合同》的有

关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、公司债、可转换债券(含分离型可转换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款及中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，本基金还可投资于股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证等中国证监会允许基金投资的其它金融工具，但上述权益类金融工具的投资比例合计不超过基金资产的 20%，本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准为中债综合(全价)指数收益率。

#### 7.2.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通通瑞债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.2.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2014 年 11 月 14 日(转型后首日)至 2014 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2014 年 12 月 31 日的财务状况以及 2014 年 11 月 14 日(转型后首日)至 2014 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.2.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.2.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2014 年 11 月 14 日(转型后首日)至 2014 年 12 月 31 日。

##### 7.2.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.2.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.2.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.2.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证

具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.2.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.2.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.2.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.2.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.2.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小

的则按直线法计算。

#### 7.2.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若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，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.2.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.2.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.2.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2014年颁布《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第40号——合营安排》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和修订后的《企业会计准则第2号——长期股权投资》、《企业会计准则第9号——职工薪酬》、《企业会计准则第30号——财务报表列报》、《企业会计准则第33号——合并财务报表》以及《企业会计准则第37号——金融工



具列报》，要求除《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》自 2014 年度财务报表起施行外，其他准则自 2014 年 7 月 1 日起施行。上述准则对本基金本报告期无重大影响。

#### 7.2.4.5.2 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。

#### 7.2.4.5.3 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。

#### 7.2.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

2、对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

#### 7.2.4.7 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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司（“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。

#### 7.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易，无应付关联方的交易佣金。

##### 7.2.4.8.2 关联方报酬

###### 7.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014 年 11 月 14 日(转型后首日)至 2014 年 12 月 31 日

当期发生的基金应支付的管理费	142,782.55
其中：支付销售机构的客户维护费	29,721.33

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 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：日基金管理费 = 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。

#### 7.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014 年 11 月 14 日 (转型后首日) 至 2014 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	41,670.97

注：支付基金托管人中国建设银行的基金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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% ÷ 当年天数。

#### 7.2.4.8.2.3 销售服务费

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2014 年 11 月 14 日 (转型后首日) 至 2014 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通通瑞债券 A/B	融通通瑞债券 C	合计
融通基金管理有限公司	-	2.36	2.36
中国建设银行	-	8,037.81	8,037.81
合计	-	8,040.17	8,040.17

注：1、本基金 A/B 类基金份额不收取销售服务费。

2、支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 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 = 融通通瑞债券 C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.40% ÷ 当年天数。

#### 7.2.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.2.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.2.4.8.4.2 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。

**7.2.4.8.5 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 2014年11月14日(转型后首日)至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	45,857,990.00	6,492.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

**7.2.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

1、本基金本报告期末未买入管理人、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、本基金本报告期末未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的证券。

**7.2.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

本基金无其他关联交易事项的说明。

**7.2.4.9 期末（2014年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.2.4.9.1 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/增发证券而流通受限的证券。

**7.2.4.9.2 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。

**7.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 19,999,770 元，是以如下债券作为抵押：

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
101472005	14 宁国投 MTN001	2015-1-5	101.14	100,000	10,114,000.00
101472006	14 江阴公 MTN001	2015-1-5	100.15	100,000	10,015,000.00
合计				200,000	20,129,000.00

**7.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2014 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 43,000,000.00 元，于 2015 年 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金

## 8.1.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	257,765,190.44	82.06
	其中：债券	257,765,190.44	82.06
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	8,473,659.99	2.70
7	其他各项资产	47,872,030.98	15.24
8	合计	314,110,881.41	100.00

## 8.1.2 期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 8.1.3 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。

## 8.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

本基金本报告期末投资股票。

## 8.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	93,426,190.44	58.44
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	164,339,000.00	102.80
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	257,765,190.44	161.24

## 8.1.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1480237	14 滇公路投债	199,000	21,501,950.00	13.45
2	101454035	14 陕交建 MTN001	200,000	20,774,000.00	12.99
3	101465011	14 玉渊潭 MTN001	200,000	20,638,000.00	12.91
4	101461020	14 北大荒 MTN001	200,000	20,624,000.00	12.90
5	101472005	14 宁国投 MTN001	200,000	20,590,000.00	12.88

## 8.1.7 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。

## 8.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.1.9 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。

## 8.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

## 8.1.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.1.10.2 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。

## 8.1.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 8.1.11 投资组合报告附注

## 8.1.11.1 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。

## 8.1.11.2 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,780.40
2	应收证券清算款	44,383,986.17
3	应收股利	-
4	应收利息	3,466,264.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,872,030.98

**8.1.11.3 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可转债。

**8.1.11.4 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。

**8.2 融通通瑞债券型证券投资基金**

**8.2.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	161,093,222.44	75.28
	其中：债券	161,093,222.44	75.28
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	49,296,302.50	23.04
7	其他各项资产	3,598,614.46	1.68
8	合计	213,988,139.40	100.00

**8.2.2 期末按行业分类的股票投资组合**

本基金本报告期末未持有股票。

**8.2.3 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。

**8.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动**

本基金本报告期末投资股票。

**8.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,015,000.00	9.30

	其中：政策性金融债	10,015,000.00	9.30
4	企业债券	91,204,222.44	84.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	59,874,000.00	55.59
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	161,093,222.44	149.56

#### 8.2.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1480237	14 滇公路投债	199,000	20,690,030.00	19.21
2	122070	11 海航 01	200,000	20,020,000.00	18.59
3	122323	14 凤凰债	200,000	19,987,616.44	18.56
4	101464041	14 复星 MTN001	200,000	19,868,000.00	18.45
5	122964	09 龙湖债	150,000	15,337,500.00	14.24

#### 8.2.7 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。

#### 8.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.2.9 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。

#### 8.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.2.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

##### 8.2.10.2 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。

##### 8.2.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 8.2.11 投资组合报告附注

8.2.11.1 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。

##### 8.2.11.2 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,766.96
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3,443,739.25
5	应收申购款	136,108.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,598,614.46

### 8.2.11.3 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可转债。

### 8.2.11.4 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
融通通瑞债券 A/B	505	177,978.31	44,059,778.53	49.02%	45,819,270.39	50.98%
融通通瑞债券 C	82	240,561.11	-	-	19,726,011.05	100.00%
合计	587	186,720.72	44,059,778.53	40.20%	65,545,281.44	59.80%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通通瑞债券 A/B	-	-
	融通通瑞债券 C	-	-
	合计	-	-

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	融通通瑞债券 A/B	0
	融通通瑞债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通通瑞债券 A/B	0
	融通通瑞债券 C	0
	合计	0



## § 10 开放式基金份额变动

## 10.1 融通通瑞一年目标触发式债券型证券投资基金

单位：份

基金合同生效日（2014年3月21日）基金份额总额	250,948,217.50
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	102,351,472.18
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	148,596,745.32

## 10.2 融通通瑞债券型证券投资基金

单位：份

	融通通瑞债券 A/B	融通通瑞债券 C
基金合同生效日（2014年11月14日）基金份额总额	148,596,745.32	-
本报告期期初基金份额总额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,843,161.80	21,772,737.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	76,506,953.92	2,046,726.45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	9,946,095.72	-
本报告期期末基金份额总额	89,879,048.92	19,726,011.05

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

## 11.2.1 基金管理人的重大变动

1、经公司董事会审议并经中国证监会核准，孟朝霞女士担任公司总经理职务，奚星华先生不再担任公司总经理职务。具体内容请参阅 2014 年 9 月 25 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

2、经公司董事会审议通过并报中国证券投资基金业协会和中国证券监督管理委员会深圳监管局备案，秦玮先生不再担任公司副总经理职务。具体内容请参阅 2014 年 12 月 31 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

## 11.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本年度应支付的审计费为人民币 50,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-

华泰证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资质雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、本基金交易单元均为本报告期新增交易单元，无其他变更。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	99,530,196.41	14.33%	209,500,000.00	1.93%	-	-
长江证券	30,242,167.81	4.35%	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	69,979,556.64	10.07%	481,444,000.00	4.45%	-	-
宏源证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	473,702,245.33	68.18%	10,139,300,000.00	93.62%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	21,346,221.23	3.07%	-	-	-	-

中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

融通基金管理有限公司  
二〇一五年三月二十六日