

融通通源短融债券型证券投资基金
2015 年年度报告摘要

2015 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

1.1 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

自 2015 年 11 月 16 日起，本基金实施份额分类。本基金增设 B 类份额的当日，若投资者持有的基金份额对应的资产净值大于等于 500 万元，则将该投资者持有的全部基金份额在增设 B 类份额的下一工作日一次性转换为 B 类份额，若投资者持有的基金份额对应的资产净值小于 500 万元，则自动划归为本基金 A 类基金份额。基金分类详情请参阅 2015 年 11 月 16 日在《上海证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

本基金 A 类基金份额报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

本基金 B 类基金份额报告期自 2015 年 11 月 16 日（基金份额分类日）起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通通源短融债券	
基金主代码	000394	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 10 月 30 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	532,937,595.30 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	融通通源短融债 A	融通通源短融债 B
下属分级基金的交易代码:	000394	001941
报告期末下属分级基金的份额总额	126,685,934.58 份	406,251,660.72 份

注：1. 本基金管理人于 2015 年 11 月 16 日，对本基金进行份额分类。

2. 分类原则：本基金根据单笔最低申购金额的不同限制，将基金份额分为 A、B 两类不同的类别，并设置不同的销售服务费、赎回费率。其中，具有较低的单笔最低申购金额限制的份额类别为 A 类份额（即原有基金份额），不收取申购、赎回费，收取销售服务费；具有较高的单笔最低申购金额限制的份额类别为 B 类份额，不收取申购费、销售服务费，并根据持有期限收取赎回费。

本基金 A 类和 B 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购的基金份额类别。A 类份额的基金代码保持不变，仍为 000394；B 类份额的基金代码为 001941。

3. 对本基金投资者已持有基金份额的处理：本基金增设 B 类份额的当日，若投资者持有的基金份额对应的资产净值大于等于 500 万元，则将该投资者持有的全部基金份额在增设 B 类份额的下一工作日一次性转换为 B 类份额，若投资者持有的基金份额对应的资产净值小于 500 万元，则自动划归为本基金 A 类基金份额。

4. 基金分类详情请参阅 2015 年 11 月 16 日在《上海证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

2.2 基金产品说明

投资目标	通过基金管理人以对短期融资券和超级短期融资券为主的债券的深入研究和对市场环境的判断，选择具有投资价值的债券，严格控制风险，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。
投资策略	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	一年期定期存款利率（税后）
风险收益特征	较低风险、较低收益的债券型基金产品

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	林葛
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66060069
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95599
传真		(0755) 26935005	(010) 68121816
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518053	100031
法定代表人		高峰	刘士余

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 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	2015 年		2014 年
	融通通源短融债 A	融通通源短融债 B	融通通源短融债券
本期已实现收益	3,355,780.45	1,648,559.63	-564,112.17
本期利润	7,376,608.28	2,805,483.78	-4,993,650.51
加权平均基金份额本期利润	0.0503	0.0068	-0.0121
本期基金份额净值增长率	5.22%	0.58%	-0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末		2014 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1003	0.1008	0.0710
期末基金资产净值	132,779,137.84	425,898,771.68	369,512,583.62
期末基金份额净值	1.048	1.048	0.996

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）。

4. 自 2015 年 11 月 16 日，本基金实施基金份额分类。融通通源短融债 B 的数据统计期间为 2015 年 11 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日。

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

融通通源短融债 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
过去三个月	0.96%	0.04%	0.38%	0.01%	0.58%	0.03%
过去六个月	1.85%	0.04%	0.86%	0.00%	0.99%	0.04%
过去一年	5.22%	0.05%	2.12%	0.01%	3.10%	0.04%
自基金合同生效起至今	4.80%	0.06%	2.60%	0.01%	2.20%	0.05%

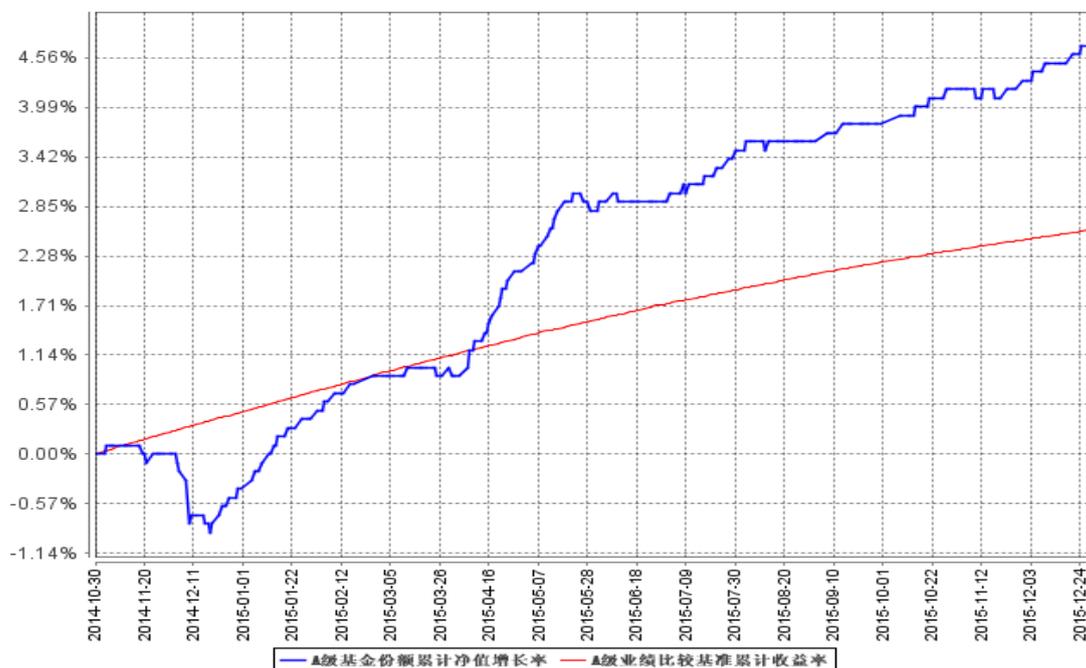
融通通源短融债 B

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
2015-11-16至 201-12-31	0.58%	0.05%	0.18%	0.00%	0.40%	0.05%

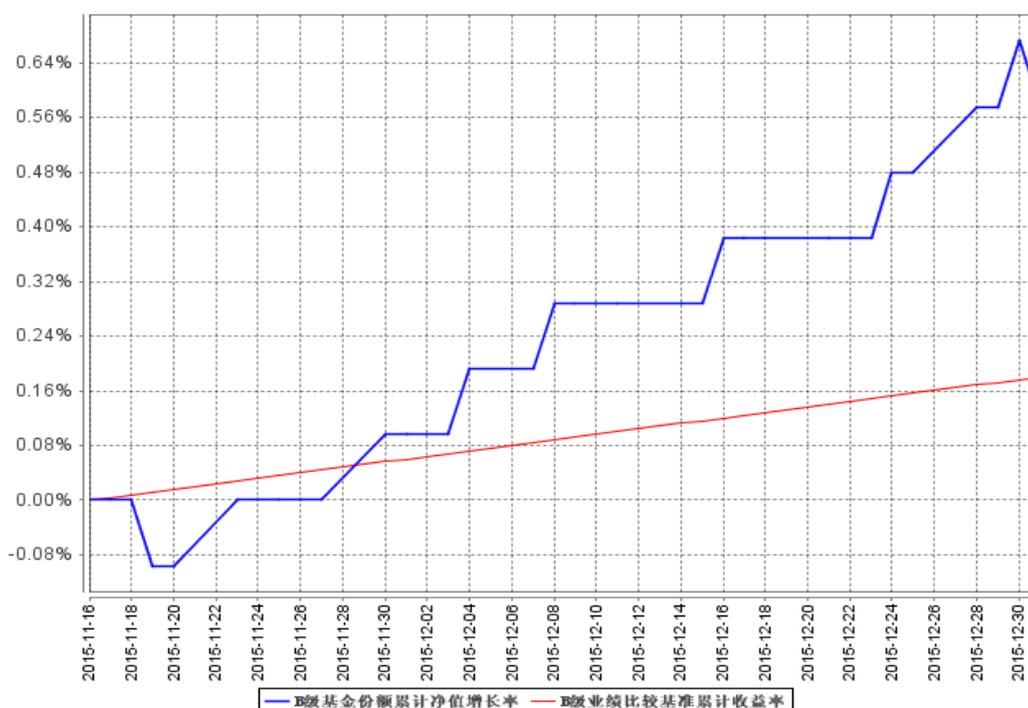
注：自 2015 年 11 月 16 日，本基金实施基金份额分类。融通通源短融债 B 的数据统计期间为 2015 年 11 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日。

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

A级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



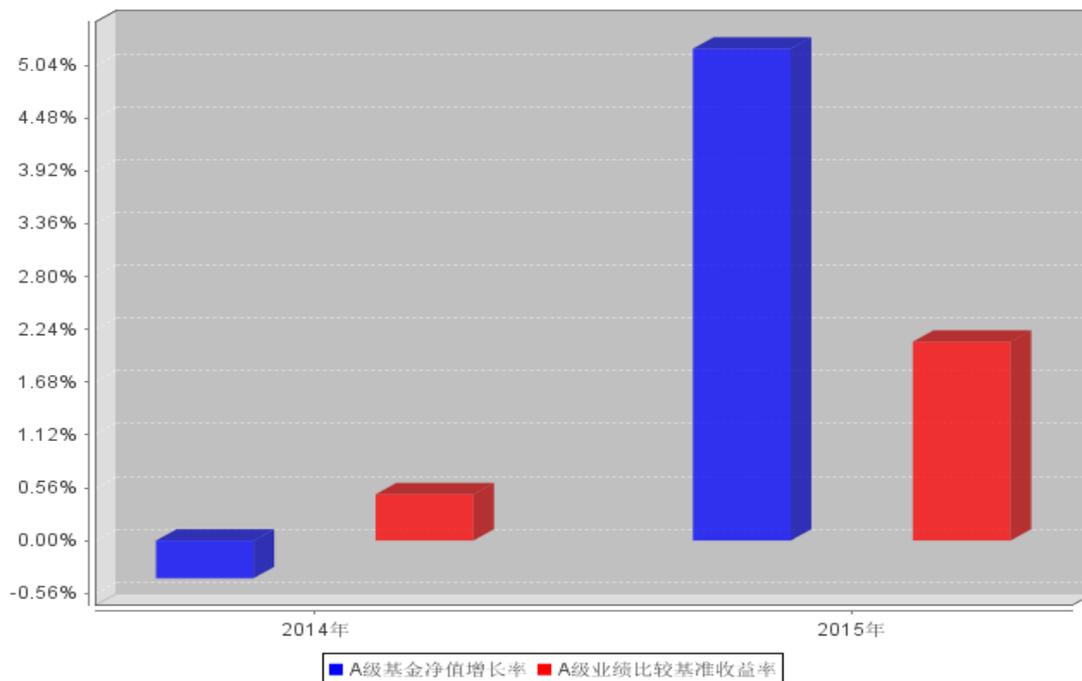
B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



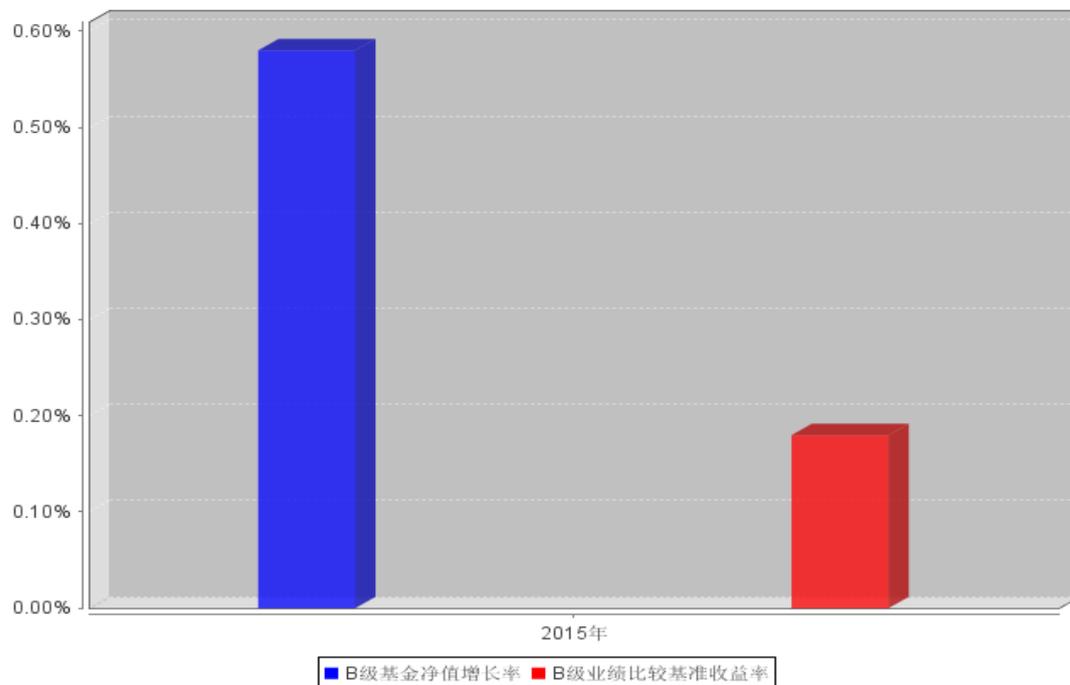
注：自 2015 年 11 月 16 日，本基金实施基金份额分类。融通通源短融债 B 的数据统计期间为 2015 年 11 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日。

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

A级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



B级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：自 2015 年 11 月 16 日，本基金实施基金份额分类。融通通源短融债 B 的数据统计期间为 2015 年 11 月 16 日至 2015 年 12 月 31 日。

3.1 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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 Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2015年12月31日，公司管理的基金共有三十七只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；三十六只开放式基金，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、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、融通农业分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金和融通成长30混合基金。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王涛	本基金、融通易支付货币、融通七天理财债券的基金经理	2015年1月21日	-	11	经济学硕士，具有基金从业资格。2003年7月至2007年7月，在中国工商银行深圳市分行工作，任外汇及衍生交易交易员；2007年7月至2013年1月，在招商银行总行工作，从事固定收益证券投资管理、理财产品开发及相关本、外币衍生交易等工作，担任交易员职务；2013年1月至2014年9月，在东莞证券工作，任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，任债券研究员。
王超	本基金、融通岁岁添利定期开放债券、融通通瑞债券、融通债券、融通四季添利债券 (LOF)、融通标普中国可转债指数增强的基金经理	2014 年 11 月 7 日	-	7	金融工程硕士，经济学、数学双学士，具有基金从业资格。2007 年 7 月至 2012 年 8 月在深圳发展银行（现更名为平安银行）工作，主要从事债券自营交易盘投资与理财投资管理。2012 年 8 月加入融通基金管理公司任投资经理。

注：任职日期指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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《融通通利系列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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015 年宏观经济增速继续下行，通胀水平不高，PPI 同比全年继续为负。央行全年多次降准降息，货币政策宽松延续。美元加息，人民币小幅贬值，热钱外流持续。股票市场波动大，市场资金面有一定扰动。央行通过 SLF、MLF 等创新性政策工具对冲流动性。债市资金流入加快，债券资产配置行情持续。在基本面、流动性等因素作用下，债券收益率明显下行。10 年期金融债收益率全年下行 90bp 左右，主体 AAA 短融收益率全年下行 180bp 左右。

本基金基金组合中加大了短融、超短融以及交易所公司债，加强了组合的流动性管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类基金份额净值增长率为 5.22%，同期业绩比较基准收益率为 2.12%。B 类基金份额净值增长率为 0.58%，同期业绩比较基准收益率为 0.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年在宏观供给侧改革大背景下，投资放缓，融资需求继续萎缩趋势难言逆转。面对美元加息周期重启，货币政策上央行仍将采用公开市场操作、MLF、降准等数量型手段保证市场的流动性，利用利率走廊等价格型工具指导基准利率、保证经济平稳运行。目前收益率曲线平坦，短端在未来将成为焦点，央行货币政策的节奏值得关注。配置上交易所高等级公司债、银行间 AA+短融值得配置，1-2 年国债相对价值值得关注。

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应用性的情况后及

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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合法律法规和基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

截至本报告期末，本基金存在连续二十个工作日以上基金资产净值低于五千万的情形。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—融通基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，融通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害

基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

本基金 2015 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(2016)第 21176 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：融通通源短融债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	2,234,429.05	17,042,947.20
结算备付金	4,287,694.48	2,404,022.94
存出保证金	18,904.04	255,924.02
交易性金融资产	767,500,427.40	446,728,714.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	767,500,427.40	446,728,714.00
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	-	8,672,442.17
应收利息	5,591,962.23	3,736,085.37
应收股利	-	-
应收申购款	300.00	6,300.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	779,633,717.20	478,846,435.70
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	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	190,999,680.00	101,999,726.80
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	29,565,673.36	6,581,468.17
应付管理人报酬	168,818.86	186,835.72
应付托管费	59,086.59	65,392.51
应付销售服务费	11,865.45	140,126.78
应付交易费用	13,321.28	255,517.20
应交税费	-	-
应付利息	47,362.14	14,784.90
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	90,000.00	90,000.00
负债合计	220,955,807.68	109,333,852.08
所有者权益：		
实收基金	493,102,301.06	343,170,772.82
未分配利润	65,575,608.46	26,341,810.80
所有者权益合计	558,677,909.52	369,512,583.62
负债和所有者权益总计	779,633,717.20	478,846,435.70

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额总额 532,937,595.30 份，其中融通通源短债 A 类份额 126,685,934.58 份，份额净值 1.048 元，融通通源短债 B 类份额 406,251,660.72 份，份额净值 1.048 元。

7.2 利润表

会计主体：融通通源短融债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 10 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2014 年 12 月 31 日
一、收入	13,918,531.87	-3,687,700.79
1. 利息收入	9,498,479.17	4,093,137.46
其中：存款利息收入	107,419.39	113,567.85
债券利息收入	9,348,212.90	3,702,731.14
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	42,846.88	276,838.47
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	-757,699.28	-3,351,299.91
其中：股票投资收益	-	-

基金投资收益	-	-
债券投资收益	-757,699.28	-3,351,299.91
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	5,177,751.98	-4,429,538.34
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	-	-
减：二、费用	3,736,439.81	1,305,949.72
1. 管理人报酬	840,465.09	401,565.32
2. 托管费	294,162.78	140,547.87
3. 销售服务费	469,126.94	301,174.01
4. 交易费用	18,601.02	12,448.38
5. 利息支出	1,767,772.56	364,961.03
其中：卖出回购金融资产支出	1,767,772.56	364,961.03
6. 其他费用	346,311.42	85,253.11
三、利润总额	10,182,092.06	-4,993,650.51
减：所得税费用	-	-
四、净利润	10,182,092.06	-4,993,650.51

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通通源短融债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	343,170,772.82	26,341,810.80	369,512,583.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,182,092.06	10,182,092.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	149,931,528.24	29,051,705.60	178,983,233.84
其中：1. 基金申购款	931,916,840.83	115,548,133.79	1,047,464,974.62
2. 基金赎回款	-781,985,312.59	-86,496,428.19	-868,481,740.78
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）	493,102,301.06	65,575,608.46	558,677,909.52
项目	上年度可比期间 2014年10月30日(基金合同生效日)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）	170,178,107.96	13,796,992.92	183,975,100.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-4,993,650.51	-4,993,650.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	172,992,664.86	17,538,468.39	190,531,133.25
其中：1. 基金申购款	767,127,309.10	62,940,103.89	830,067,412.99
2. 基金赎回款	-594,134,644.24	-45,401,635.50	-639,536,279.74
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）	343,170,772.82	26,341,810.80	369,512,583.62

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：

<u>孟朝霞</u>	<u>颜锡廉</u>	<u>刘美丽</u>
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 基金基本情况

融通通源短融债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型而来。根据《融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金基金合同》，融通通源一年目标触发式灵活配置混合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，融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金转型为融通通源短融债券型证券投资基金。融通通源一年目标触发式灵活配置混合型证券投资基金于 2014 年 10 月 21 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 10 月 29 日，自 2014 年 10 月 30 日起，本基金转型为融通通源短融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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据本基金的基金管理人于 2015 年 11 月 16 日发布的《融通基金管理有限公司关于融通通源短融债券型证券投资基金增设 B 类份额及修改基金合同相关事项的公告》，自 2015 年 11 月 16 日起对本基金进行份额分类，原有基金份额为 A 类份额，增设 B 类份额。具有较低的单笔最低申购金额限制的份额类别为 A 类份额（即原有基金份额），不收取申购、赎回费，收取销售服务费；具有较高的单笔最低申购金额限制的份额类别为 B 类份额，不收取申购费、销售服务费，并根据持有期限收取赎回费。本基金增设 B 类份额的当日，若投资者持有的基金份额对应的资产净值大于等于 500 万元，则将该投资者持有的全部基金份额在增设 B 类份额的下一工作日一次性转换为 B 类份额，若投资者持有的基金份额对应的资产净值小于 500 万元，则自动划归为本基金 A 类基金份额。

7.4.2 本报告期所采用的会计政策、会计估值与最近一期年度报告相一致的说明

7.4.2.1 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。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.3 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。

7.4.4 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
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人、基金代销机构
新时代股份有限公司（“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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期末租用关联方的交易单元。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年10月30日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	840,465.09	401,565.32
其中：支付销售机构的客户维护费	148,416.93	185,087.63

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0.40%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：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.40% ÷ 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。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年10月30日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	294,162.78	140,547.87

注：支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.14%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 × 0.14% ÷ 当年天数。

7.4.5.2.3 销售服务费

获得销售服务费各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年 12月31日	上年度可比期间 2014年10月30日(基金合同生效 日)至2014年12月31日
	当期应支付的销售服务费	

融通基金管理有限公司	198,462.95	236,156.72
中国农业银行	265,937.19	48,066.24
合计	464,400.14	284,222.96

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.30% 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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 A 类基金资产净值} \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	20,061,115.74	-	-	-	-
上年度可比期间 2014 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国农业银行	-	30,035,469.04	-	-	-	-

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 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本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.5.4.2 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

本报告期末及上年度末，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。

7.4.5.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2014 年 10 月 30 日(基金合同生效日)至 2014 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
中国农业银行	2,234,429.05	65,678.55	17,042,947.20	39,297.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、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、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的证券。

7.4.5.7 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。

7.4.6 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 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/增发而流通受限证券。

7.4.6.2 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。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

银行间市场债券正回购截至本报告期末 2015 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 79,999,680.00 元，是以如下债券作为质押：

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
071517004	15 东北证券 CP004	2016-1-5	100.06	300,000	30,018,000.00
041563014	15 国广 CP001	2016-1-5	100.20	200,000	20,040,000.00
041554072	15 河钢 CP003	2016-1-5	99.59	200,000	19,918,000.00
071506003	15 安信 CP003	2016-1-5	100.08	150,000	15,012,000.00
合计	-	-	-	850,000	84,988,000.00

7.4.6.3.1 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 111,000,000.00 元，于 2016 年 1 月 4 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，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 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：股票	-	-
2	固定收益投资	767,500,427.40	98.44
	其中：债券	767,500,427.40	98.44
	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	6,522,123.53	0.84
7	其他各项资产	5,611,166.27	0.72
8	合计	779,633,717.20	100.00

8.2 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	39,874,291.10	7.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	96,436,136.30	17.26
5	企业短期融资券	631,190,000.00	112.98
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	767,500,427.40	137.38

8.3 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	071539001	15 上海证券 CP001	500,000	50,025,000.00	8.95
2	011598144	15 杭金投 SCP003	500,000	50,010,000.00	8.95
3	041560117	15 内蒙电投 CP001	500,000	49,945,000.00	8.94
4	011599267	15 丹东港 SCP002	400,000	40,272,000.00	7.21

5	011599729	15 农垦 SCP004	300,000	30,087,000.00	5.39
---	-----------	-----------------	---------	---------------	------

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。

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.7.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.7.2 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。

8.7.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

8.8.3 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	18,904.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,591,962.23
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,611,166.27

8.8.4 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处于转股期的可转换债券。

§ 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
融通通源短融债 A	469	270,119.26	118,568,682.71	93.59%	8,117,251.87	6.41%
融通通源短融债 B	5	81,250,332.14	406,251,660.72	100.00%	0.00	0.00%
合计	474	81,520,451.40	524,820,343.43	193.59%	8,117,251.87	6.41%

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	融通通源短融债 A	22.26	0.0000%
	融通通源短融债 B	-	-
	合计	22.26	0.0000%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	融通通源短融债 A	0
	融通通源短融债 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通通源短融债 A	0
	融通通源短融债 B	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通通源短融债	融通通源短融债
	A	B
基金合同生效日(2014年10月30日)基金份额总额	170,569,235.10	-

本报告期期初基金份额总额	370,926,166.98	-
本报告期基金总申购份额	543,054,147.56	464,166,718.64
减:本报告期基金总赎回份额	787,294,379.96	57,915,057.92
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	126,685,934.58	406,251,660.72

§ 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 基金管理人重大人事变动

2015 年 1 月 30 日，2014 年年度股东会会议决议通过，聘任孟朝霞女士、黄庆华先生担任公司董事；奚星华先生、涂卫东先生不再担任公司董事。公司已于 2015 年 2 月 12 日向中国证券监督管理委员会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局。

2015 年 4 月 20 日至 4 月 22 日，股东会 2015 年第二次临时会议决议通过，聘任颜锡廉先生、薛迈雅先生担任公司董事；Blair Pickerell（裴布雷）先生、Frederick Reidenbach（弗莱德）先生不再担任公司董事。公司已于 2015 年 6 月 12 日向中国证券监督管理委员会备案，同时抄送中国证券监督管理委员会深圳监管局；

2015 年 6 月 18 日至 6 月 23 日，股东会 2015 年第四次临时会议决议通过，田德军先生不再担任公司董事长及董事职务，聘任高峰先生担任公司第五届董事会董事及公司第五届董事会董事长；本期间公司已履行完成高峰先生任职流程的监管审批程序，并于 2015 年 8 月 12 日完成董事长工商变更备案程序；

2015 年 9 月 2 日，公司发布公告，聘任刘晓玲女士为公司副总经理。该变更事项，经融通基金管理有限公司第五届董事会第一次会议审议并通过，并按规定向中国证券投资基金业协会报备；

经融通基金管理有限公司股东会 2015 年第五次临时会议审议并通过，聘任刘宇先生担任公司监事，已按规定完成监事工商变更备案程序。

11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

因中国农业银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，任命余晓晨先生主持本行托管业务部/养老金管理中心工作。余晓晨先生的基金行业高级管理人员任职资格已在中国基金业协会备案。

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 90,000.00 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
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	43,104,782.79	8.45%	97,999,000.00	2.10%	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	467,147,248.15	91.55%	4,576,900,000.00	97.90%	-	-

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

的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(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. 交易单元变更情况

本期新增 5 个交易单元：东兴证券、国泰君安、海通证券、新时代证券及招商证券，原申银万国证券交易单元和宏源证券交易单元因两机构合并统一变更为申万宏源证券交易单元。

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

本基金本报告期无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

融通基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日