

融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金  
2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 18 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	融通岁岁添利定期开放债券
基金主代码	161618
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 11 月 6 日
报告期末基金份额总额	498,358,074.52 份
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，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类品种，不直接买入股票、权证等权益类金融工具。本基金封闭期的投资组合久期与封闭期剩余期限进行适当匹配。本基金的具体投资策略包括资产配置策略、利率策略、信用策略、类属配置与个券选择策略、可转换债券投资策略以及资产支持证券的投资策略等部分。
业绩比较基准	一年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中的较低风险品种，其预期风险与收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
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

下属分级基金的基金简称	融通岁岁添利定期开放债券 A	融通岁岁添利定期开放债券 B
下属分级基金的交易代码	161618	161619
报告期末下属分级基金的份额总额	364, 110, 536. 68 份	134, 247, 537. 84 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019 年 7 月 1 日-2019 年 9 月 30 日）	
	融通岁岁添利定期开放债券 A	融通岁岁添利定期开放债券 B
1. 本期已实现收益	5, 848, 391. 51	2, 021, 369. 63
2. 本期利润	5, 991, 852. 24	2, 074, 153. 89
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0165	0. 0155
4. 期末基金资产净值	403, 458, 625. 84	148, 413, 466. 15
5. 期末基金份额净值	1. 108	1. 106

注：1、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；

2、本报告所列示的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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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

融通岁岁添利定期开放债券 A

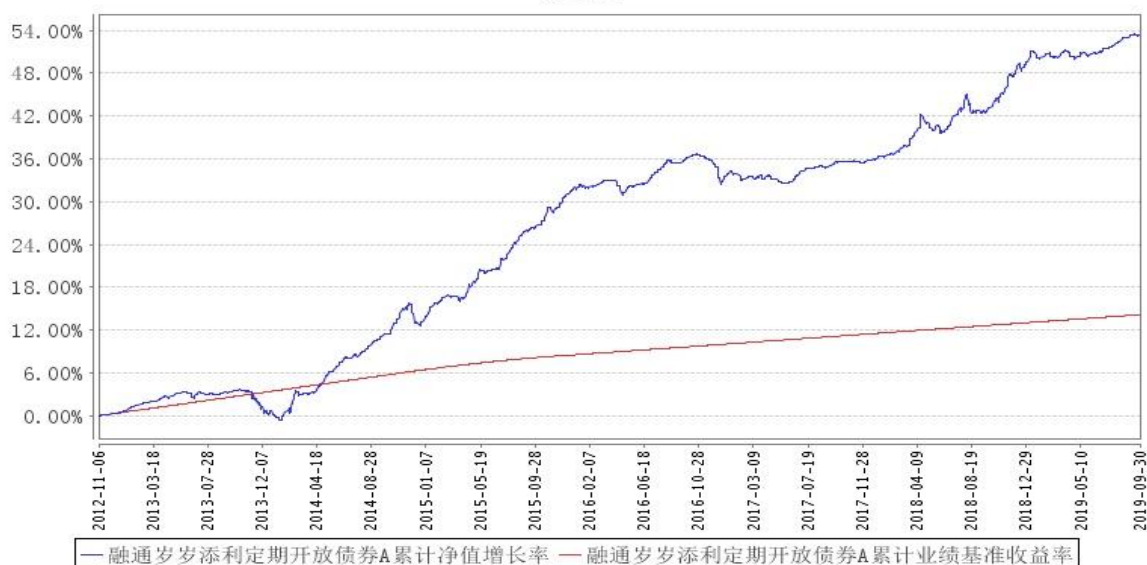
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1. 46%	0. 05%	0. 38%	0. 00%	1. 08%	0. 05%

融通岁岁添利定期开放债券 B

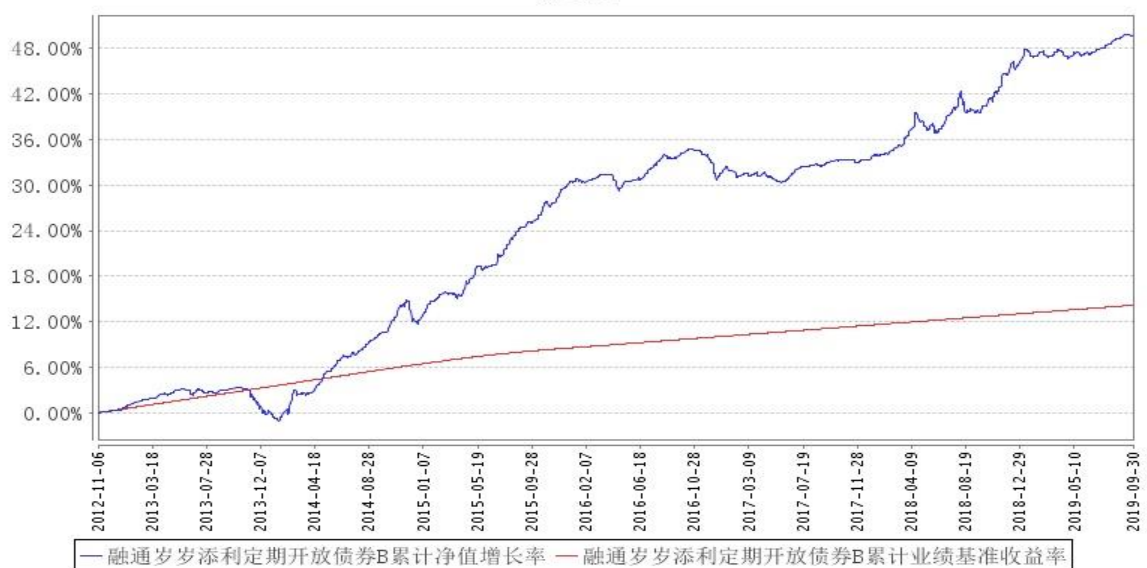
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1. 47%	0. 05%	0. 38%	0. 00%	1. 09%	0. 05%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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

融通岁岁添利定期开放债券A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



融通岁岁添利定期开放债券B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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）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		
王超	本基金的基金经理、固定收益部总监	2015-3-14	-	11	王超先生，厦门大学金融工程硕士，11年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2007年7月至2012年8月就职于平安银行金融市场产品部从事债券投资研究工作。2012年8月加入融通基金管理有限公

				<p>司，历任投资经理、融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通瑞债券型证券投资基金基金经理、融通增裕债券型证券投资基金基金经理、融通增丰债券型证券投资基金基金经理、融通现金宝货币市场基金基金经理、融通稳利债券型证券投资基金基金经理、融通可转债债券型证券投资基金基金经理、融通通泰保本混合型证券投资基金基金经理，现任固定收益部总监、融通债券投资基金基金经理、融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)基金经理、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通增鑫债券型证券投资基金基金经理、融通增益债券型证券投资基金基金经理、融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通通宸债券型证券投资基金基金经理、融通通优债券型证券投资基金基金经理、融通超短债债券型证券投资基金基金经理、融通增强收益债券型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 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，并制定了相应的制度和流程，在授权、研究、决策、交易和业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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。

##### 4.3.2 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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度债券市场收益率先下后上，7月底受到中美贸易冲突升级及海外风险偏好大幅下降的

影响，债券收益率快速下行；随着市场预期内的利多因素在 7-8 月中旬基本释放完毕，而债券收益率曲线处于历史极低水平，导致后期收益率开始出现了反弹。从季度角度来看，三季度末收益率基本与二季度末持平。

从组合操作来看，本基金组合在三季度保持了组合稳定，参与了长端利率债波段交易，并适度参与了转债投资。

展望后市，债券大概率处于牛市尾声阶段，经济基本面依然有利于债市，收益率存在下行空间，但从收益率及长短债利差水平来看，目前长债利率及利差均处于历史较低水平，从而导致收益率下行空间可能有限。短期内，市场面临通胀及政策发力的冲击，市场波动有可能加大。投资上，我们将以中短期信用债配置为主，利用市场波动择机参与长期限债券的交易机会博取价差。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通岁岁添利定期开放债券 A 基金份额净值为 1.108 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.46%；截至本报告期末融通岁岁添利定期开放债券 B 基金份额净值为 1.106 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.47%；同期业绩比较基准收益率为 0.38%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	647,349,559.73	97.54
	其中：债券	647,349,559.73	97.54
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,368,091.72	0.36
8	其他资产	13,937,722.54	2.10
9	合计	663,655,373.99	100.00

#### 5.2 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,394,000.00	3.70
	其中：政策性金融债	20,394,000.00	3.70
4	企业债券	325,869,053.60	59.05
5	企业短期融资券	20,113,000.00	3.64
6	中期票据	254,602,000.00	46.13
7	可转债（可交换债）	26,371,506.13	4.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	647,349,559.73	117.30

### 5.3 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	143265	17 泰达 02	330,000	33,155,100.00	6.01
2	143103	17 云投 G1	250,000	25,092,500.00	4.55
3	127812	18 万盛 02	200,000	20,776,000.00	3.76
4	101800681	18 农四师 MTN001	200,000	20,726,000.00	3.76
5	143673	18 伊泰 01	200,000	20,658,000.00	3.74

### 5.4 报告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

无。

### 5.5 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

无。

### 5.6 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权证投资明细

无。

### 5.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 5.7.1 本期国债期货投资政策

无。

#### 5.7.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

#### 5.7.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

### 5.8.2 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	19,288.96
2	应收证券清算款	913,581.75
3	应收股利	-
4	应收利息	13,004,851.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,937,722.54

### 5.8.3 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113011	光大转债	12,487,200.00	2.26
2	110053	苏银转债	4,337,600.00	0.79
3	132015	18 中油 EB	2,970,300.00	0.54
4	113021	中信转债	2,254,413.60	0.41
5	132005	15 国资 EB	1,170,000.00	0.21
6	110043	无锡转债	518,350.00	0.09
7	128059	视源转债	496,080.00	0.09
8	110054	通威转债	489,040.00	0.09
9	113509	新泉转债	416,800.00	0.08
10	123020	富祥转债	238,440.00	0.04

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通岁岁添利定期开放债券 A	融通岁岁添利定期开放债券 B
报告期期初基金份额总额	363,470,390.88	133,899,329.95
报告期期间基金总申购份额	640,145.80	348,207.89
减：报告期期间基金总赎回份额	-	-
报告期期间基金拆分变动份额	-	-
报告期期末基金份额总额	364,110,536.68	134,247,537.84

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况



无。

## § 8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登陆本基金管理人网站  
<http://www.rtfund.com> 查询。

融通基金管理有限公司

2019 年 10 月 25 日