

目录全部展开 目录全部收拢

- 重要提示
- 基金产品概况
- 基金基本情况
- 主要财务指标和基金净值表现
- 主要财务指标
- 基金净值表现
 - 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
 - 自基金合同生效以来基金累计份额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
- 其他指标
- 管理人报告
- 基金经理（或基金经理小组）简介
- 报告期内本基金运作遵规守信情况说明
- 公平交易专项说明
 - 公平交易专项说明
 - 公平交易制度和控制方法
 - 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较
 - 异常交易行为的专项说明
- 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明
 - 报告期内基金的业绩表现
 - 报告期内基金投资策略和运作分析
 - 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
- 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
- 投资组合报告
- 报告期末基金资产组合情况
- 报告期末按行业分类的股票投资组合
- 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股票投资明细
- 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
- 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
- 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名贵金属投资明细
- 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
- 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
 - 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
 - 本基金投资股指期货的投资政策
- 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
 - 本期国债期货投资政策
 - 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
 - 本期国债期货投资评价
- 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
- 投资组合报告附注
 - 受到调查以及处罚情况

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

其他资产构成

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

- 开放式基金份额变动
- 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
- 基金管理人持有本基金份额变动情况
- 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
- 影响投资者决策的其他重要信息
- 备查文件目录

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 2015 年 1 月 16 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 2014 年 10 月 1 日起至 2014 年 12 月 31 日止。

基金基本情况

项目 数值

基金简称 融通岁岁添利定期开放债券

场内简称 -

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 2012-11-06

报告期末基金份额总额 226,967,446.28

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 属于证券投资基金中的较低风险品种

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

基金保证人 -

下属 2 级基金的基金简称 融通岁岁添利定期开放债券 A 类 融通岁岁添利定期开放债券 B 类

下属 2 级基金的场内简称 - -
 下属 2 级基金的交易代码 161618 161619
 报告期末下属 2 级基金的份额总额 156025570.26 70941876.02
 下属 2 级基金的风险收益特征 - -

主要财务指标

单位：人民币元

项目	主基金(元)	A(元)	B(元)
本期已实现收益	-	9,376,177.88	6,597,976.78
本期利润	-	6,278,791.81	4,417,797.75
加权平均基金份额本期利润	-	0.0311	0.0356
期末基金资产净值	-	164,211,949.22	74,639,419.49
期末基金份额净值	-	1.052	1.052
期末还原后基金份额累计净值	-	-	-

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。

基金净值表现

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

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

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 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 1.73% 0.21% 0.73% 0.01% 1.00% 0.20%

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 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 1.64% 0.21% 0.73% 0.01% 0.91% 0.20%

自基金合同生效以来基金累计份额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

自基金合同生效以来基金累计份额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

自基金合同生效以来基金累计份额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 B

其他指标

单位：元

序号 其他指标 报告期（2014-10-01 至 2014-12-31）

序号 其他指标 报告期（2014-12-31）

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

蔡奕奕 本基金的基金经理、融通易支付货币基金的基金经理、融通四季添利债券基金的基金经理

2012-11-06 - 9 管理科学硕士，具有证券从业资格。2006年3月至2006年11月，就职于万家基金管理有限公司，担任交易员职务，从事股票债券交易工作；2006年12月至2008年8月，就职于银河基金管理有限公司，担任交易员职务，从事债券交易工作；2008年9月至今，就职于融通基金管理有限公司，历任交易员、行业研究员职务。

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、自2014年10月10日，本基金的基金经理蔡奕奕女士因个人原因（休产假）起暂离工作岗位，经公司研究决定，蔡奕奕休产假期间，基金经理相关职责由本公司基金经理王超代为履行。具体内容请参阅2014年10月11日在《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》及《证券日报》上刊登的相关公告。

报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

公平交易专项说明

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。

公平交易制度和控制方法

-

本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

-

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。

报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内基金的业绩表现

本报告期融通岁岁添利定期开放债券 A 类份额净值增长率为 1.73%，融通岁岁添利定期开放债券 B 类份额净值增长率为 1.64%，同期业绩比较基准收益率为 0.73%。

报告期内基金投资策略和运作分析

2014 年 4 季度，经济增速放缓，社融规模继续下滑；央行在公开市场两次下调了正回购利率，同时继续向市场注入 3 个月 MLF 资金近 3000 亿，随后在 11 月份首次降息；宽松的资金面和疲软的经济数据共同推动债券收益率出现了大幅下行，10 年国开债收益率大幅下跌至年底的 4.04% 水平。

投资方面，本基金在四季度根据市场走势灵活调整了仓位水平。

从经济基本面的角度来看，经济表现非常疲软，无论是从发布的领先指标 PMI 来看（PMI 继续下跌，主要的生产、订单、从业人员及原材料库存等分项数据均同步下滑），还是从同步的工业增加值及滞后的工业企业利润增速来看，宏观层面的经济表现基本上没有任何亮点。展望 1 季度，由于在去年 10 月份以后发改委批复了大量的基建投资项目，这些项目陆续实施后将在今年 1 季度对经济形成阶段性的提振，1 季度工业增加值等经济数据同比有望回升。资金方面，历来 1 季度为资金宽松时点，但由于股市行情火热，新股发行压力较大，对资金面冲击较大，但债券供给在 1 季度也相对偏少，高等级信用债依然具备不错的投资价值。

本基金一季度将保持目前杠杆水平，继续配置流动性好资质高的债券。

管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

-

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

无。

报告期末基金资产组合情况

金额单位：元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益类投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	367,168,384.90	96.79
	其中：债券	367,168,384.90	96.79
	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	5,369,695.92	1.42
7	其他资产	6,805,310.45	1.79
8	合计	379,343,391.27	100.00

报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：元

序号	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	-	-

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股票投资明细

金额单位：元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：元

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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	264,482,384.90	110.73
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	102,686,000.00	42.99
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	367,168,384.90	153.72

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：元

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	124027	12 瑞国投	400,000	40,624,000.00	17.01
2	122204	12 双良节	399,990	39,919,002.00	16.71
3	1480438	14 陕交建债	300,000	30,840,000.00	12.91
4	1480391	14 常房债	300,000	30,780,000.00	12.89
5	124098	12 达投资	299,640	30,347,539.20	12.71

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

金额单位：元

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	-------	-------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

金额单位：元

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有权证。

报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					
-					
股指期货投资本期收益(元)					
-					
股指期货投资本期公允价值变动(元)					
-					

本基金投资股指期货的投资政策

报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
公允价值变动总额合计(元)					
-					
国债期货投资本期收益(元)					
-					
国债期货投资本期公允价值变动(元)					
-					

本基金本报告期末未持有国债期货。

本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

单位：元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

投资组合报告附注

受到调查以及处罚情况

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。

申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

-

其他资产构成

单位：元

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	27,803.65
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,777,506.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,805,310.45

报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：元

序号 债券代码 债券名称 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

单位：元

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值（元） 占基金资产净值比例（%） 流通受限情况说明

投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

开放式基金份额变动（仅适用于开放式基金）

单位：份

项目 融通岁岁添利定期开放债券 融通岁岁添利定期开放债券 A 类 融通岁岁添利定期开放债券 B 类

基金合同生效日的基金份额总额 - - -

报告期期初基金份额总额 - 259,750,666.90 164,541,937.20

报告期间基金总申购份额 - 109,485,633.52 18,223,025.21

报告期间总赎回份额 - 213,210,730.16 111,823,086.39

报告期间基金拆分变动份额 - - -

报告期末基金份额总额 226,967,446.28 156,025,570.26 70,941,876.02

基金管理人运用自有资金投资本基金情况

基金管理人运用自有资金投资本基金交易明细

单位：份

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
合计			-		

影响投资者决策的其他重要信息

-

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