

融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金  
2013 年半年度报告

2013 年 6 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

送出日期：2013 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。本半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岁岁添利定期开放债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2013 年 8 月 23 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 期末按债券品种分类的债券投资组合	33
7.3 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	34
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	34
7.5 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	34
7.6 投资组合报告附注	34
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b>	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	35
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b>	<b>36</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b>	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议	36
10.2 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	36

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	36
10.4 基金投资策略的改变 .....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	36
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	36
10.8 其他重大事件 .....	38
<b>§ 11 备查文件目录 .....</b>	<b>38</b>

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金	
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	
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	3, 141, 685, 496. 61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	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	1, 306, 478, 764. 90 份	1, 835, 206, 731. 71 份

### 2.2 基金产品说明

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

### 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	涂卫东	赵会军
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798
注册地址		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 55 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 55 号
邮政编码		518053	100140

法定代表人	田德军	姜建清
-------	-----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》《证券日报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	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
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)	报告期(2013年1月1日 - 2013年6月30日)
本期已实现收益	25,984,042.70	33,241,056.34
本期利润	31,199,506.97	40,536,420.96
加权平均基金份额本期利润	0.0240	0.0222
本期加权平均净值利润率	2.37%	2.19%
本期基金份额净值增长率	2.41%	2.31%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
期末可供分配利润	2,097,247.15	2,411,814.94
期末可供分配基金份额利润	0.0016	0.0013
期末基金资产净值	1,314,214,290.45	1,845,529,880.41
期末基金份额净值	1.006	1.006
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2013年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.92%	2.72%

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

#### 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

融通岁岁添利定期开放债券 A 类

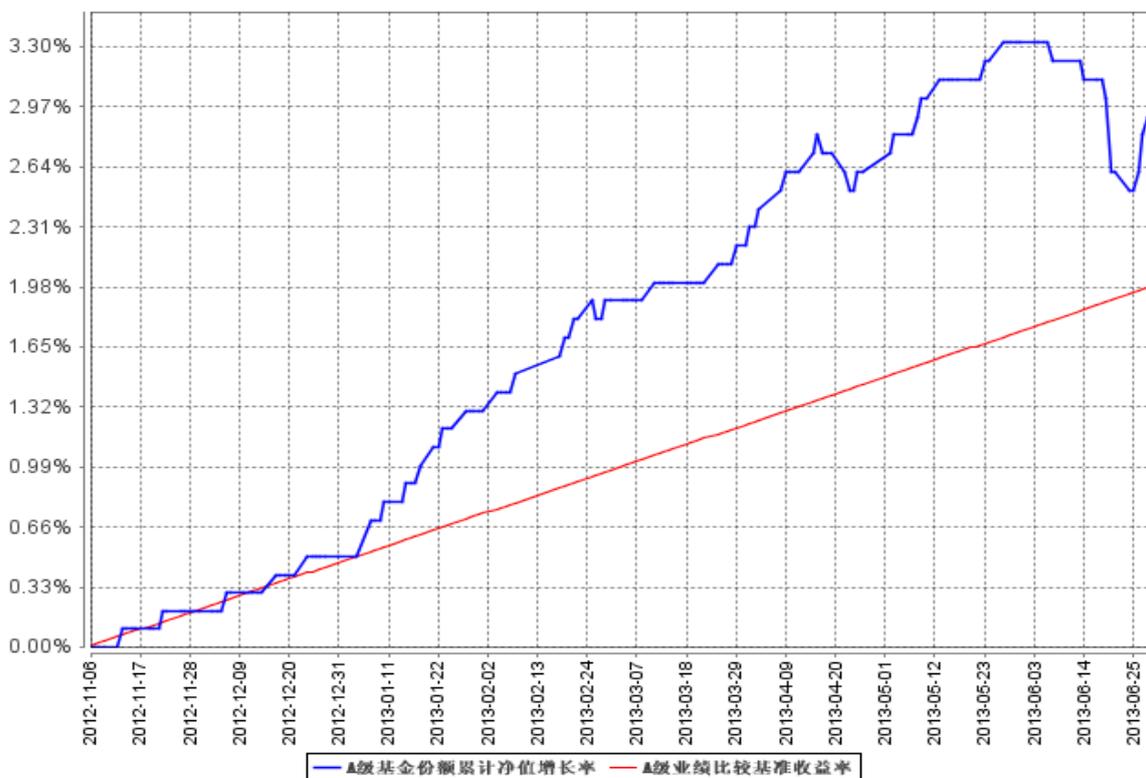
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.39%	0.12%	0.25%	0.01%	-0.64%	0.11%
过去三个月	0.69%	0.09%	0.76%	0.01%	-0.07%	0.08%
过去六个月	2.41%	0.07%	1.51%	0.01%	0.90%	0.06%
自基金合同生效起至今	2.92%	0.06%	1.98%	0.01%	0.94%	0.05%

融通岁岁添利定期开放债券 B 类

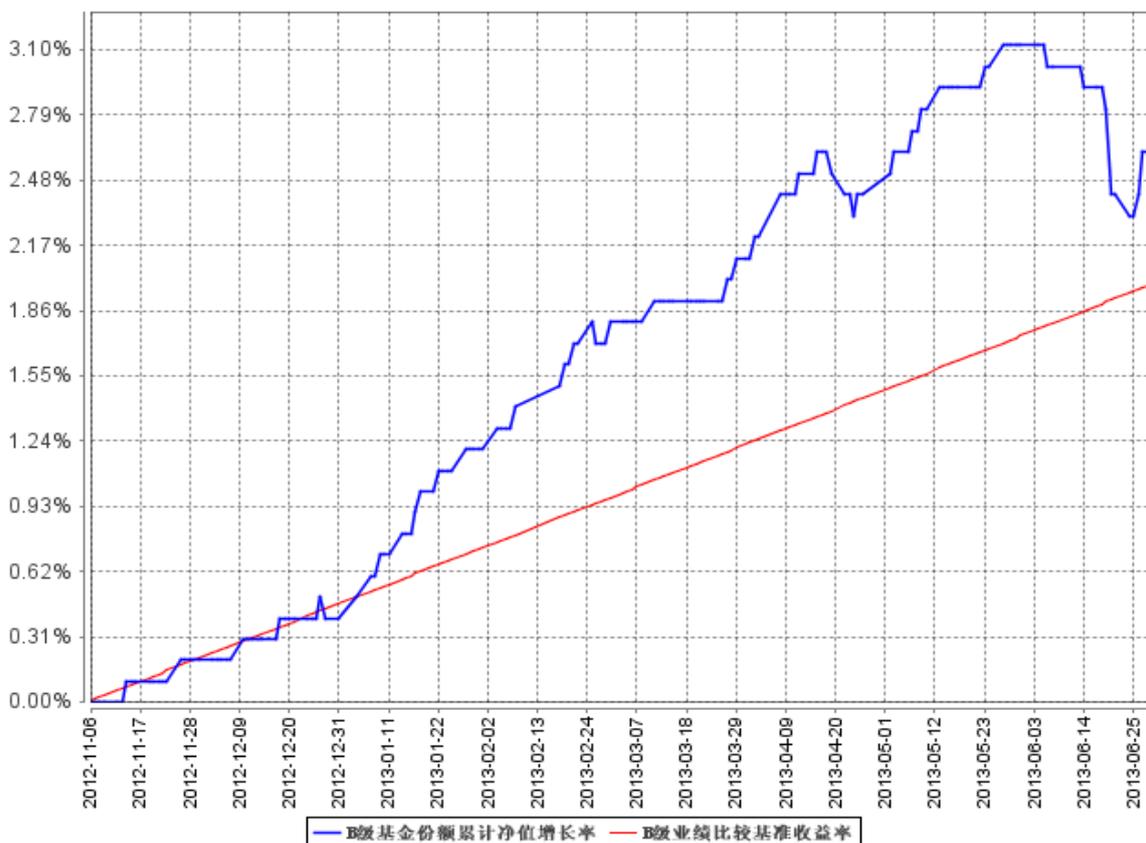
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.39%	0.12%	0.25%	0.01%	-0.64%	0.11%
过去三个月	0.60%	0.09%	0.76%	0.01%	-0.16%	0.08%
过去六个月	2.31%	0.07%	1.51%	0.01%	0.80%	0.06%
自基金合同生效起至今	2.72%	0.06%	1.98%	0.01%	0.74%	0.05%

### 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：本基金的基金合同生效日为 2012 年 11 月 6 日，截止本报告期末，基金成立未满 1 年；

本基金建仓期为本基金合同生效之日起 6 个月，建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## § 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 2013 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有二十只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；十九只开放式基金，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和融通通泰保本混合基金。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		
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 年 11 月 6 日	-	7	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：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

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、《融通岁岁添利定期开放债券型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（1 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。

### 4.3.2 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 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

上半年宏观经济增速整体呈现弱复苏行情，持续下跌的大宗商品价格和较弱的需求使得通胀压力较小、PPI 始终处于负值区间，同时人民币稳步升值，外汇占款流入较大，流动性充裕；整体环境利好债券市场，期间债市核查风暴、央行对于影子银行和地方融资平台的清理、新政府上台后主张的“控货币、调结构”对债市收益率有所冲击，但在宏观面和资金面的配合下，整体收益率水平呈现陡峭化下行的态势，信用利差进一步收窄，短端利率中枢小幅抬升。上半年表现最好品种为城投债，其隐含的政府信用以及银行理财对于高收益产品的刚性配置需求令市场对于城投债的认可度逐步提高；而民营企业信用债则由于其企业属性表现相对较差。

出于对于流动性乐观的判断，本基金在今年以来采取相对积极的建仓策略，年初积极增持中高等级信用债；结构上，基于本基金定期开放的特点，我们以投资短久期的短融和 3 年附近中高等级中期票据为主；期限上严格控制组合久期，做到了组合久期与封闭期的基本匹配。

#### 4.4.2 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 2.41%，融通岁岁添利定期开放债券 B 类份额净值增长率为 2.31%，同期业绩比较基准收益率为 1.51%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济弱复苏或呈乏力态势，6 月末银行间市场经历的流动性冲击会令机构积极进行去杠杆操作，从而令下半年债市情绪会较为谨慎；央行收缩同业资产和清理影子银行的态度会令市场担忧去杠杆的进程和幅度会大过此前预期，从而对经济的负面冲击加大。从流动性来看，随着美国 QE3 退出步伐的临近，外汇占款大概率将呈现下降趋势，从而下半年银行间流动性将较上半年趋紧。近期评级公司开始纷纷行动，部分企业将面临评级下调风险，接下来随着评级下调的企业增多、以及对于违约的担忧加重将令信用利差逐步扩大。近期政府出台的金十条以及不让经济滑出下限等积极信号有利于稳定市场预期，债市或将在流动性、政策信号、债券供需、机构行为的作用下做出方向性选择。

下一阶段本基金仍将密切关注信用类债券的投资机会，通过深入的信用研究，防范信用风险，择时提高组合杠杆率，同时进一步优化信用债的配置结构，提升整体信用资质水平。而由于企业利润下滑可能带来的调降信用评级和信用债券供给的放大是我们将密切关注的主要风险所在。

#### 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、登记清算部和监察稽核部指定人员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，风险管理部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

1、本基金于 2013 年 1 月 30 日实施 2013 年第 1 次利润分配，以 2013 年 1 月 22 日的可分配收益为基准，融通岁岁添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.03 元，融通岁岁添利定期开放债券 B 每 10 份基金份额派发红利 0.03 元；

2、本基金于 2013 年 2 月 28 日实施 2013 年第 2 次利润分配，以 2013 年 2 月 20 日的可分配收益为基准，融通岁岁添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.04 元，融通岁岁添利定期开放债券 B 每 10 份基金份额派发红利 0.03 元；

3、本基金于 2013 年 3 月 26 日实施 2013 年第 3 次利润分配，以 2013 年 3 月 20 日的可分配收益为基准，融通岁岁添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.04 元，融通岁岁添利定期开放债券 B 每 10 份基金份额派发红利 0.03 元；

4、本基金于 2013 年 5 月 3 日实施 2013 年第 4 次利润分配，以 2013 年 4 月 22 日的可分配收益为基准，融通岁岁添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.03 元，融通岁岁添利定期开放债券 B 每 10 份基金份额派发红利 0.04 元；

5、本基金于 2013 年 5 月 27 日实施 2013 年第 5 次利润分配，以 2013 年 5 月 20 日的可分配收益为基准，融通岁岁添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.03 元，融通岁岁添利定期开放债券 B 每 10 份基金份额派发红利 0.02 元；

6、本基金于 2013 年 6 月 27 日实施 2013 年第 6 次利润分配，以 2013 年 6 月 20 日的可分配收益为基准，融通岁岁添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.04 元，融通岁岁添利定期开放债券 B 每 10 份基金份额派发红利 0.04 元；

## § 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岁岁添利定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，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，融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金的投资运作、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，融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了 6 次利润分配，分配金额为 27,350,731.41 元。

### 5.3 托管人对本半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岁岁添利定期开放债券型证券投资基金 2013 年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	274,854,716.93	5,158,291.78
结算备付金		26,418,226.05	9,913,142.81
存出保证金		14,452.80	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,069,964,879.24	3,151,108,566.03
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,019,194,879.24	3,080,710,566.03
资产支持证券投资		50,770,000.00	70,398,000.00
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	254,701,092.55	420,001,070.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	65,794,764.29	18,581,328.23
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		3,691,748,131.86	3,604,762,398.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2012 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		330,000,000.00	471,998,541.50
应付证券清算款		190,231,378.94	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,564,249.02	1,590,412.18
应付托管费		469,274.69	477,123.64
应付销售服务费		532,886.49	541,397.02
应付交易费用	6.4.7.7	20,756.90	31,294.58
应交税费		-	-
应付利息		424,590.45	84,055.89
应付利润		8,386,136.38	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	374,688.13	38,454.79
负债合计		532,003,961.00	474,761,279.60
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	3,141,685,496.61	3,121,780,833.17
未分配利润	6.4.7.10	18,058,674.25	8,220,286.08
所有者权益合计		3,159,744,170.86	3,130,001,119.25
负债和所有者权益总计		3,691,748,131.86	3,604,762,398.85

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额总额 3,141,685,496.61 份；其中融通岁岁添利定期开放债券 A 类基金份额净值 1.006 元，基金份额为 1,306,478,764.90 份；融通岁岁添利定期开放债券 B 类基金份额净值 1.006 元，基金份额为 1,835,206,731.71 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
一、收入		96,437,182.73
1. 利息收入		77,377,432.43
其中：存款利息收入	6.4.7.11	534,675.64
债券利息收入		72,180,974.94
资产支持证券利息收入		1,250,742.32
买入返售金融资产收入		3,411,039.53
其他利息收入		-
2. 投资收益		6,548,921.41
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	7,516,928.39
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-968,006.98

衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	-
3. 公允价值变动收益	6.4.7.16	12,510,828.89
4. 汇兑收益		-
5. 其他收入	6.4.7.17	-
<b>减：二、费用</b>		24,701,254.80
1. 管理人报酬	6.4.10.1.1	9,412,449.14
2. 托管费	6.4.10.1.2	2,823,734.68
3. 销售服务费		3,205,328.71
4. 交易费用	6.4.7.18	23,910.28
5. 利息支出		8,932,157.83
其中：卖出回购金融资产支出		8,932,157.83
6. 其他费用	6.4.7.19	303,674.16
<b>三、利润总额</b>		71,735,927.93
减：所得税费用		-
<b>四、净利润</b>		71,735,927.93

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 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）	3,121,780,833.17	8,220,286.08	3,130,001,119.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	71,735,927.93	71,735,927.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	19,904,663.44	175,879.31	20,080,542.75
其中：1. 基金申购款	19,904,663.44	175,879.31	20,080,542.75
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-62,073,419.07	-62,073,419.07
五、期末所有者权益（基金净值）	3,141,685,496.61	18,058,674.25	3,159,744,170.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_  
奚星华

\_\_\_\_\_  
朱建华

\_\_\_\_\_  
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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

融通岁岁添利定期开放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[2012]第 1151 号《关于同意融通岁岁添利定期开放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《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 3,117,219,191.24 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 403 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2012 年 11 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,119,837,355.31 份基金份额,其中认购资金利息折合 2,618,164.07 份基金份额,其中融通岁岁添利定期开放债券 A 类基金份额总额为 1,298,949,186.13 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,056,294.89 份基金份额;融通岁岁添利定期开放债券 B 类基金份额总额为 1,820,888,169.18 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,561,869.18 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通岁岁添利定期开放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、银行存款等固定收益类金融工具。本基金投资于债券类金融工具的比例不低于基金资产的 80%。本基金不参与一级市场新股申购或增发新股,也不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,本基金可参与一级市场及二级市场可转换债券的投资,因持有可转债转股所形成的股票以及因投资可分离债券而产生的权证将于 30 个工作日内卖出。

在开放期,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%,在非开放期,本基金不受该比例的限制。

本基金投资于债券类金融工具的比例不低于基金资产的 80%,但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内(如遇市场情况急剧变化的情形,基金管理人可在履行适当程序后,根据实际情况延长),基金投资不受上述比例限制。本基金的业绩比较基准为:本基金业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。

## 6.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和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。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 年 1 月 1 日至 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

### 6.4.4.1 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。

### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 6.4.4.3 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。

本基金目前持有的股票投资和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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 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，于交易日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已宣告但尚未发放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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。当本基金依法 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。

#### 6.4.4.7 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 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)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。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。

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，其公允价值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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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(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)为正数,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(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。

#### 6.4.4.12 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,不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 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。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 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。

#### 6.4.5.2 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。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。
- (2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
活期存款	216,854,716.93
定期存款	58,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	58,000,000.00
其他存款	-
合计：	274,854,716.93

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
债券	交易所市场	700,833,256.61	707,691,879.24
	银行间市场	2,305,149,488.39	2,311,503,000.00
	合计	3,005,982,745.00	3,019,194,879.24
资产支持证券	50,580,392.32	50,770,000.00	189,607.68
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,056,563,137.32	3,069,964,879.24	13,401,741.92

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	254,701,092.55	-
合计	254,701,092.55	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应收活期存款利息	11,761.51
应收定期存款利息	135,723.92
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	10,699.38
应收债券利息	64,339,544.39
应收买入返售证券利息	553,500.15
应收申购款利息	-
其他	743,534.94
合计	65,794,764.29

### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	20,756.90
合计	20,756.90

### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付税金	112,784.07
预提费用	261,904.06
合计	374,688.13

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

融通岁岁添利定期开放债券 A 类		
项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,299,578,444.77	1,299,578,444.77
本期申购	6,900,320.13	6,900,320.13
本期申购	-	-
本期赎回	-	-
本期末	1,306,478,764.90	1,306,478,764.90

金额单位：人民币元

融通岁岁添利定期开放债券 B 类		
项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,822,202,388.40	1,822,202,388.40
本期申购	13,004,343.31	13,004,343.31
本期赎回	-	-
本期末	1,835,206,731.71	1,835,206,731.71

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

融通岁岁添利定期开放债券 A 类			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,451,557.93	371,495.21	3,823,053.14
本期利润	25,984,042.70	5,215,464.27	31,199,506.97
本期基金份额交易产生的变动数	12,377.93	51,318.92	63,696.85
其中：基金申购款	12,377.93	51,318.92	63,696.85
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-27,350,731.41	-	-27,350,731.41
本期末	2,097,247.15	5,638,278.40	7,735,525.55

单位：人民币元

融通岁岁添利定期开放债券 B 类
------------------

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,876,345.53	520,887.41	4,397,232.94
本期利润	33,241,056.34	7,295,364.62	40,536,420.96
本期基金份额交易产生的变动数	17,100.73	95,081.73	112,182.46
其中：基金申购款	17,100.73	95,081.73	112,182.46
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-34,722,687.66	-	-34,722,687.66
本期末	2,411,814.94	7,911,333.76	10,323,148.70

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
活期存款利息收入	103,757.56
定期存款利息收入	301,779.48
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	129,077.13
其他	61.47
合计	534,675.64

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
卖出债券成交总额	1,714,925,172.73
减：卖出债券成本总额	1,673,261,296.04
减：应收利息总额	34,146,948.30
债券投资收益	7,516,928.39

#### 资产支持证券投资收益

卖出资产支持证券成交总额	115,372,488.98
减：卖出资产支持证券成本总额	115,993,240.77
减：应收利息总额	347,255.19
资产支持证券投资收益	-968,006.98

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
1. 交易性金融资产	12,510,828.89
——股票投资	-
——债券投资	11,571,461.98
——资产支持证券投资	939,366.91
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	12,510,828.89

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
交易所市场交易费用	910.28
银行间市场交易费用	23,000.00
合计	23,910.28

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日
审计费用	54,547.97
信息披露费	198,356.09
其他项目	3,400.00
银行汇划费用	29,370.10
债券帐户维护费	18,000.00
合计	303,674.16

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截止资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期末租用关联方的交易单元。

##### 6.4.10.1 关联方报酬

###### 6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	9,412,449.14
其中：支付销售机构的客户维护费	5,596,197.36

注：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 0.60%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 × 0.60% / 当年天数。

###### 6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,823,734.68

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.18%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 × 0.18% / 当年天数。

### 6.4.10.1.3 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
中国工商银行	-	3,196,121.34	3,196,121.34
融通基金管理有限公司	-	461.72	461.72
合计	-	3,196,583.06	3,196,583.06

### 6.4.10.2 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。

### 6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

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

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 6.4.10.3.2 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。

### 6.4.10.4 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 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	216,854,716.93	103,757.56

### 6.4.10.5 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。

### 6.4.10.6 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。

### 6.4.11 利润分配情况

融通岁岁添利定期开放债券 A 类

金额单位：人民币元

序	除息日	每 10 份	现金形式	再投资形式	本期利润分
---	-----	--------	------	-------	-------

号	权益 登记日	场内	场外	基金份额分红 数	发放总额		配 合计	备注
1	2013 年 6 月 27 日		2013 年 6 月 27 日	0.0400	3,870,983.51	1,349,560.27	5,220,543.78	
2	2013 年 5 月 27 日		2013 年 5 月 27 日	0.0300	2,906,304.46	1,006,125.46	3,912,429.92	
3	2013 年 5 月 3 日		2013 年 5 月 3 日	0.0300	2,910,292.88	999,175.12	3,909,468.00	
4	2013 年 3 月 26 日		2013 年 3 月 26 日	0.0400	3,890,036.62	1,317,360.89	5,207,397.51	
5	2013 年 2 月 28 日		2013 年 2 月 28 日	0.0400	3,879,136.34	1,323,021.85	5,202,158.19	
6	2013 年 1 月 30 日		2013 年 1 月 30 日	0.0300	2,929,960.62	968,773.39	3,898,734.01	
合计	-		-	0.2100	20,386,714.43	6,964,016.98	27,350,731.41	

融通岁岁添利定期开放债券 B 类

金额单位：人民币元

序 号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分 配 合计	备注
		场内	场外					
1	2013 年 6 月 27 日		2013 年 6 月 27 日	0.0400	4,515,152.87	2,814,471.17	7,329,624.04	
2	2013 年 5 月 27 日		2013 年 5 月 27 日	0.0200	2,259,972.23	1,402,074.31	3,662,046.54	
3	2013 年 5 月 3 日		2013 年 5 月 3 日	0.0400	4,536,649.77	2,776,458.75	7,313,108.52	
4	2013 年 3 月 26 日		2013 年 3 月 26 日	0.0300	3,414,152.52	2,064,533.97	5,478,686.49	
5	2013 年 2 月 28 日		2013 年 2 月 28 日	0.0300	3,430,449.34	2,042,165.46	5,472,614.80	
6	2013 年 1 月 30 日		2013 年 1 月 30 日	0.0300	3,449,785.16	2,016,822.11	5,466,607.27	
合计	-		-	0.1900	21,606,161.89	13,116,525.77	34,722,687.66	

6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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。

#### 6.4.12.2 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。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2013 年 6 月 30 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余额 330,000,000.00 元, 于 2013 年 7 月 2 日到期。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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是债券基金, 主要投资于固定收益类金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险, 并设定适当的风险限额及内部控制流程, 通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策, 在董事会下设立风险控制与审计委员会, 主要负责公司运行合规性的监督、核查以及公司内外部审计的沟通、监督和核查工作。委员会对董事会负责; 在管理层层面设立风险控制委员会, 负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施, 审定公司的业务风险管理政策, 审定公司内控管理组织实施方案, 审定公司的业务授权方案, 审定基金资产组合的风险状况评价分析报告, 审定公司各项风险与内控状况评价报告, 审定业务风险损失责任人的责任, 审定重大业务可行性风险论证, 协调突发性重大风险事件的处理; 各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规, 遵守公司业务管理制度, 具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的直接责任人, 部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人, 对部门风险控制措施的实施情况进行管理; 风险管理部负责制定相关业务风险的识别和度量方法, 指导业务部门实施风险的管理和控制, 并定期出具投资组合风险报告, 进行投资风险分析与绩效评估; 督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况, 确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行, 发现内控缺失和管理漏洞, 提出改进要求和建议, 并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的信用类债券占基金资产净值比例为 97.16%。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

短期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
A-1	1,330,553,000.00	2,133,344,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	1,330,553,000.00	2,133,344,000.00

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
AAA	237,179,862.80	240,712,251.50
AAA 以下	1,502,232,016.44	777,052,314.53
未评级	-	-
合计	1,739,411,879.24	1,017,764,566.03

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃

而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券除在证券交易所上市外，其余亦可在银行间同业市场交易，因此金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	274,854,716.93	-	-	-	274,854,716.93
结算备付金	26,418,226.05	-	-	-	26,418,226.05
存出保证金	14,452.80	-	-	-	14,452.80
交易性金融资产	1,457,016,762.50	1,475,588,116.74	137,360,000.00	-	3,069,964,879.24

买入返售金融资产	254,701,092.55	-	-	-	254,701,092.55
应收利息	-	-	-	65,794,764.29	65,794,764.29
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,013,005,250.83	1,475,588,116.74	137,360,000.00	65,794,764.29	3,691,748,131.86
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	330,000,000.00	-	-	-	330,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	190,231,378.94	190,231,378.94
应付管理人报酬	-	-	-	1,564,249.02	1,564,249.02
应付托管费	-	-	-	469,274.69	469,274.69
应付销售服务费	-	-	-	532,886.49	532,886.49
应付交易费用	-	-	-	20,756.90	20,756.90
应付利息	-	-	-	424,590.45	424,590.45
应付利润	-	-	-	8,386,136.38	8,386,136.38
其他负债	-	-	-	374,688.13	374,688.13
负债总计	330,000,000.00	-	-	202,003,961.00	532,003,961.00
利率敏感度缺口	1,683,005,250.83	1,475,588,116.74	137,360,000.00	-136,209,196.71	3,159,744,170.86
上年度末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,158,291.78	-	-	-	5,158,291.78
结算备付金	9,913,142.81	-	-	-	9,913,142.81
交易性金融资产	2,363,770,251.50	656,576,314.53	130,762,000.00	-	3,151,108,566.03
买入返售金融资产	420,001,070.00	-	-	-	420,001,070.00
应收利息	-	-	-	18,581,328.23	18,581,328.23
资产总计	2,798,842,756.09	656,576,314.53	130,762,000.00	18,581,328.23	3,604,762,398.85
负债					
卖出回购金融资产款	471,998,541.50	-	-	-	471,998,541.50
应付管理人报酬	-	-	-	1,590,412.18	1,590,412.18
应付托管费	-	-	-	477,123.64	477,123.64
应付销售服务费	-	-	-	541,397.02	541,397.02
应付交易费用	-	-	-	31,294.58	31,294.58
应付利息	-	-	-	84,055.89	84,055.89
其他负债	-	-	-	38,454.79	38,454.79
负债总计	471,998,541.50	-	-	2,762,738.10	474,761,279.60
利率敏感度缺口	2,326,844,214.59	656,576,314.53	130,762,000.00	15,818,590.13	3,130,001,119.25

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变
----	--------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2013年6月30日）	上年度末（2012年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	8,239,883.42	7,785,456.32
	市场利率下降 25 个基点	-8,239,883.42	-7,785,456.32

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	3,069,964,879.24	83.16
	其中：债券	3,019,194,879.24	81.78
	资产支持证券	50,770,000.00	1.38
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	254,701,092.55	6.90
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	301,272,942.98	8.16
6	其他各项资产	65,809,217.09	1.78
7	合计	3,691,748,131.86	100.00

### 7.2 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	911,597,879.24	28.85
5	企业短期融资券	1,330,553,000.00	42.11
6	中期票据	777,044,000.00	24.59
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	3,019,194,879.24	95.55

### 7.3 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：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	1282527	12 鲁宏桥 MTN1	1,500,000	151,260,000.00	4.79
2	041260069	12 梅花 CP001	800,000	80,336,000.00	2.54
3	041251041	12 沙钢 CP002	800,000	80,176,000.00	2.54
4	124050	12 榆城投	700,000	72,660,000.00	2.30
5	041352012	13 第一农药 CP001	700,000	69,685,000.00	2.21

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	119023	侨城 01	290,000	29,000,000.00	0.92
2	061205001	12 上元 1A	400,000	12,160,000.00	0.38
3	061205002	12 上元 1B	100,000	9,610,000.00	0.30

### 7.5 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.6 投资组合报告附注

7.6.1 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。

#### 7.6.2 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	14,452.80

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	65,794,764.29
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	65,809,217.09

### 7.6.3 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处于转股期的可转换债券。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
融通岁岁添利定期开放债券 A 类	8,096	161,373.37	54,000,705.32	4.13%	1,252,478,059.58	95.87%
融通岁岁添利定期开放债券 B 类	11,426	160,616.73	100,110.83	0.01%	1,835,106,620.88	99.99%
合计	19,522	321,990.10	54,100,816.15	1.72%	3,087,584,680.46	98.28%

### 8.2 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	融通岁岁添利定期开放债券 A 类	0.00	0.0000%
	融通岁岁添利定期开放债券 B 类	7,009.54	0.0004%
	合计	7,009.54	0.0002%

注：(1) 本报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间：0；

(2) 本报告期末本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间：0。

## § 9 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 类	融通岁岁添利定期开放债券 B 类
基金合同生效日（2012 年 11 月 6 日）基金份额总额	1, 298, 949, 186. 13	1, 820, 888, 169. 18
本报告期期初基金份额总额	1, 299, 578, 444. 77	1, 822, 202, 388. 40
本报告期基金总申购份额	6, 900, 320. 13	13, 004, 343. 31
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1, 306, 478, 764. 90	1, 835, 206, 731. 71

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 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

(1) 本基金本报告期基金管理人无重大人事变更。

(2) 本基金本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变更。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期，为本基金提供审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司。

### 10.6 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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元数量	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	备注
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	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) 实力雄厚，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

本基金本报告期无交易单元变更情况。

## 10.7.2 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

中信建投	82,314,193.15	55.71%	19,044,800,000.00	91.23%	-	-
中信证券	44,410,976.35	30.06%	-	-	-	-
申银万国	21,029,378.54	14.23%	1,831,000,000.00	8.77%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金第二次分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、管理人网站	2013-1-28
2	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金第三次分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、管理人网站	2013-2-25
3	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金第四次分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、管理人网站	2013-3-22
4	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金第五次分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、管理人网站	2013-4-26
5	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金第六次分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、管理人网站	2013-5-23
6	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金第六次分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》、《证券日报》、管理人网站	2013-6-25

## § 11 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) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

基金管理人、基金托管人处

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。