

融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)

2014 半年度报告摘要

层面,上半年以来流动性持续宽松以及微刺激将反应到经济改善的层面,而经济改善的幅度和时间则决定了债市的牛市行情可以持续的长短。货币宽松的放开有助于风险偏好上升,未来若继续配合微刺激政策,则市场有望呈现“宽货币宽信贷”格局,信用利差将进一步压缩的可能,但经济的企稳回升,无风险利率水平的探底会令债市承压,风险资产的表现会相对更好。

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。

4.6 管理人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,公司的估值由研究员、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多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时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,其中研究员负责定期对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,每日对基金估值品种的公开信息、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 管理人报告期内基金利润分配情况的说明

1.本基金于2014年6月9日实施2014年第1次利润分配,以2014年5月20日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.16元。
2.本基金于2014年7月8日实施2014年第2次利润分配,以2014年6月20日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.02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

报告期内,本基金托管人在对融通四季添利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

报告期内,融通四季添利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四季添利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、基金费用开支等方面上,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有关规定进行。本报告期内,融通四季添利债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了1次利润分配,分配金额为3,332,882.55元。

5.3 托管人对本半年度报告中基金信息内容的真实、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四季添利债券型证券投资基金2014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。

5.6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)
报告截止日:2014年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
流动资产:		
银行存款	2,939,497.34	89,204,313.86
结算备付金	17,903,096.49	27,557,889.17
存出保证金	34,514.15	41,801.47
交易性金融资产	418,355,664.64	1,350,384,046.76
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	418,355,664.64	1,350,384,046.76
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	-	150,000,545.00
应收证券清算款	1,937,852.65	339,999,817.70
应收利息	12,056,575.46	35,407,693.98
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	30,247.07	-
资产总计	453,256,647.80	1,992,596,107.94
负债和所有者权益		
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	246,549,286.86	734,197,415.60
应付证券清算款	2,002,755.45	-
应付赎回款	1,869,949.80	-
应付管理人报酬	104,473.56	640,760.45
应付托管费	34,824.52	213,586.81
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	9,714.13	21,758.16
应交税费	640.00	640.00
应付利息	10,650.31	51,999.26
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	193,418.10	199,000.00
负债合计	250,775,712.73	735,325,160.28
所有者权益:		
实收基金	195,067,614.28	1,281,761,462.73
未分配利润	7,413,320.79	-24,900,515.07
所有者权益合计	202,480,935.07	1,257,207,947.66
负债和所有者权益总计	453,256,647.80	1,992,596,107.94

注:报告截止日2014年6月30日,基金份额净值1.038元,基金份额总额195,067,614.28份。

6.2 利润表

会计主体:融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013年6月30日
一、收入	34,293,503.62	52,666,325.93
1.利息收入	24,254,021.35	39,648,861.32
其中:存款利息收入	1,851,535.46	222,498.76
债券利息收入	20,911,969.33	39,426,362.56
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,490,515.56	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-23,795,086.24	30,726,064.05
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-23,795,086.24	30,726,064.05
资产支持证券投资	-	-
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	33,808,954.44	-17,708,599.44
4.汇兑收益	-	-
其中:汇兑损益	25,614.07	-
5.其他收入	-	-
减:二、费用	6,676,382.78	13,149,776.01
1.管理人报酬	1,862,244.45	3,885,039.09
2.托管费	620,748.12	1,295,013.03
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	20,953.04	16,594.74
5.利息支出	3,928,284.71	7,512,585.76
其中:卖出回购金融资产支出	3,928,284.71	7,512,585.76
6.其他费用	244,152.46	440,543.39
三、利润总额	27,617,120.84	39,516,549.92
减:所得税费用	-	-
四、净利润	27,617,120.84	39,516,549.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)
本报告期:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

金额单位:人民币元

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 418,355,664.64 92.30

其中:债券 418,355,664.64 92.30

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 2,939,497.34 0.63

7 其他各项资产 14,058,389.33 3.10

8 合计 453,256,647.80 100.00

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 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投资。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

1.基金买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

2.基金卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

3.买入股票成本占报告期基金资产净值的比例

4.卖出股票成本占报告期基金资产净值的比例

5.投资标的公允价值占基金资产净值比例

6.报告期内股票投资组合的重大变动

7.2 期末按行业分类的股票投资组合