

## 融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

# 【2014】半年度报告摘要

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:2014年1月1日至2014年6月30日

单位:人民币元

项目	本期		
	实收基金	本期分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	420,886,985.36	-13,292,696.12	407,594,289.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,295,437.81	31,295,437.81
三、本期基金份贻交易产生的基金净值变动数	1,140,220.80	21,518.05	1,161,738.85
四、中、期末基金申购款	1,140,220.80	21,518.05	1,161,738.85
2.基金赎回款	-	-	-
五、本期基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-4,206,870.11	-4,206,870.11
六、期末所有者权益(基金净值)	422,027,206.16	-	435,842,595.79

项目	上年度可比期间		
	实收基金	本期分配利润	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、本期基金份贻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: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

注: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:  
\_\_\_\_\_  
\_\_\_\_\_  
\_\_\_\_\_  
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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明  
本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。  
6.4.2 差错更正的说明  
本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。  
6.4.3 关联方关系  
6.4.3.1 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。  
6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

关联方名称		与本基金关系
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	

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。  
6.4.4 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。  
6.4.4.1 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。  
6.4.4.2 关联方报酬  
6.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	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	1,249,147.21	9,412,449.14
其中:支付销售机构的客户维护费	333,442.49	5,596,197.36

注:支付给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。  
6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	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	374,744.10	2,823,734.48

注:支付给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。  
6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

项目	本期		
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
获得销售服务费的各关联方名称			
中国工商银行	-	280,947.87	280,947.87
融通基金管理有限公司	-	36.10	36.10
合计	-	280,983.97	280,983.97

注:支付给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。  
6.4.4.2.3 销售服务费

单位:人民币元

项目	本期		
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
获得销售服务费的各关联方名称			
中国工商银行	-	280,947.87	280,947.87
融通基金管理有限公司	-	36.10	36.10
合计	-	280,983.97	280,983.97

6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。  
6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况  
6.4.4.4.1 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基金管理人均未运用固有资金投资本基金。  
6.4.4.4.2 报告期未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贻。  
6.4.4.5 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	上年度可比期间
	2014年1月1日至2014年6月30日	2013年1月1日至2013年6月30日
中国工商银行	2,327,706.81	22,955.19
融通基金管理有限公司	216,854,716.93	103,757.56

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况  
1.本基金本报告期及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.本基金本报告期及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)在承销期内承销的证券。  
6.4.4.7 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。  
6.4.5 利润分配情况

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
						现金	合计	
1	-	2014年6月3日	0.1000	2,074,738.65	507,039.29	2,581,777.94	-	-
合计	-	-	0.1000	2,074,738.65	507,039.29	2,581,777.94	-	-

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
						现金	合计	
1	-	2014年6月3日	0.1000	972,392.61	654,699.56	1,627,092.17	-	-
合计	-	-	0.1000	972,392.61	654,699.56	1,627,092.17	-	-

6.4.6 期末(2014年6月30日)本基金持有的流通受限证券  
6.4.6.1 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/增发而流通受限的证券。  
6.4.6.2 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。  
6.4.6.3 期末投资正回购交易中作为抵押的债券  
6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购  
截至本报告期末2014年6月30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余额92,499,584.25元,是以如下债券作为抵押:

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
1128268	11国债新发	2014年7月1日	101.61	30,000	3,048,300.00
1282463	12国债新发	2014年7月1日	100.15	100,000	10,015,000.00
1282475	12国债新发	2014年7月1日	99.95	300,000	29,985,000.00
140203	14国债新发	2014年7月2日	104.62	500,000	52,310,000.00
合计				930,000	95,358,300.00

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购截止本报告期末2014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311,999,895.90元,于2014年7月1日到期。该笔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。  
6.7 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	789,111,317.53	93.60
其中:债券	-	-	-
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	31,262,881.40	3.71
7	其他各项资产	22,729,659.31	2.70
8	合计	843,103,858.24	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	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	789,111,317.53	93.60
其中:债券	-	-	-
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	31,262,881.40	3.71
7	其他各项资产	22,729,659.31	2.70
8	合计	843,103,858.24	100.00

7.3 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)
1	140203	14国债新发	500,000
2	101354016	10国债新发	400,000
3	101456044	14国债新发	400,000
4	122204	12国债新发	400,000
5	1282527	12国债新发	400,000

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	52,310,000.00	12.00
4	企业债券	52,310,000.00	12.00
5	企业短期融资券	425,086,317.53	97.67
6	中期票据	311,115,000.00	71.38
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	789,111,317.53	181.05

7.3 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)
1	140203	14国债新发	500,000
2	101354016	10国债新发	400,000
3	101456044	14国债新发	400,000
4	122204	12国债新发	400,000
5	1282527	12国债新发	400,000

7.4 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		金额单位:人民币元	
序号	债券代码	债券名称	数量(张)
1	140203	14国债新发	500,000
2	101354016	10国债新发	400,000
3	101456044	14国债新发	400,000
4	122204	12国债新发	400,000
5	1282527	12国债新发	400,000

7.4 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。  
7.5 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。  
7.6 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。  
7.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明  
7.7.1 本期国债期货投资策略  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
7.7.2 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。  
7.7.3 本期国债期货投资评价  
本基金本报告期末未投资国债期货。  
7.8 投资组合报告附注  
7.8.1 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。  
7.8.2 期末其他各项资产构成

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	140203	14国债新发	500,000	52,310,000.00	12.00
2	101354016	10国债新发	400,000	40,096,000.00	9.34
3	101456044	14国债新发	400,000	40,064,000.00	9.19
4	122204	12国债新发	400,000	39,916,000.00	9.16
5	1282527	12国债新发	400,000	39,768,000.00	9.12

7.8.3 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

份贻单位:份

序号	名称	金额	份贻
1	存出保证金	28,998.08	-
2	应收证券清算款	-	1,919,949.82
3	应收股利	-	-
4	应收利息	-	20,780,811.41
5	应收申购款	-	-
6	其他应收款	-	-
7	待摊费用	-	-
8	其他	-	-
9	合计	22,729,659.31	-

7.8.3 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

份贻单位:份

份贻类别	持有人户数(户)	户均持有的基金份贻	持有人结构			
			机构投资者	个人投资者	机构投资者持有份贻比例	个人投资者持有份贻比例
融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	1,229	210,475.91	151,941,676.22	88,745.16	106,733,020.48	41.26%
融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	1,266	104,311.82	0.00	0.00%	163,352,309.26	100.00%
合计	2,595	150,949.00	151,941,676.00	88,745.16	270,085,330.00	64.00%

项目	份贻类别	持有份贻总额(份)	占基金总份贻比例
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型证券投资基金A类	0.00	0.0000%
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型证券投资基金B类	1,001.31	0.0006%
合计		1,001.31	0.0002%

项目	份贻类别	持有基金份贻总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	合计	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	合计	0

项目	份贻类别	持有基金份贻总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	合计	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	合计	0

项目	份贻类别	持有基金份贻总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	合计	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	合计	0

项目	份贻类别	持有基金份贻总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	合计	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金A类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金B类	0
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金开放式基金	合计	0

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
本报告期初基金份额总额	258,177,799.36	162,709,186.00