融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018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:2018 年 8 月 27 日

§ 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 2018 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	
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	178, 769, 755.41 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	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	149, 822, 740.30 份	28, 947, 015.11 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	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。

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	凌卫东	郭明
	联系电话	(0755)26948666	(010)66105798
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@cbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088/(0755)26948088	95588
传真		(0755)26935005	(010)66105799

2.4 信息披露方式

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

§ 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	融通岁岁添利定期开放债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	- 2, 535, 747.82	- 979, 516.81
本期利润	7, 922, 051.03	1, 327, 460.78
加权平均基金份额本期利润	0.0441	0.0391
本期基金份额净值增长率	3.79%	3.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)	
期末可供分配基金份额利润	- 0.0027	- 0.0066
期末基金资产净值	163, 967, 902.28	31, 556, 836.95
期末基金份额净值	1.094	1.090

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

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	0.37%	0.16%	0.12%	0.00%	0.25%	0.16%
过去三个月	1.39%	0.20%	0.37%	0.00%	1.02%	0.20%
过去六个月	3.79%	0.16%	0.74%	0.00%	3.05%	0.16%
过去一年	5.17%	0.12%	1.50%	0.00%	3.67%	0.12%
过去三年	16.98%	0.11%	4.62%	0.00%	12.36%	0.11%
自基金合同生效起至今	41.07%	0.13%	12.30%	0.01%	28.77%	0.12%

融通岁岁添利定期开放债券 B

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	0.37%	0.16%	0.12%	0.00%	0.25%	0.16%
过去三个月	1.30%	0.21%	0.37%	0.00%	0.93%	0.21%
过去六个月	3.61%	0.16%	0.74%	0.00%	2.87%	0.16%
过去一年	4.89%	0.12%	1.50%	0.00%	3.39%	0.12%
过去三年	15.82%	0.11%	4.62%	0.00%	11.20%	0.11%
自基金合同生效起至今	38.34%	0.13%	12.30%	0.01%	26.04%	0.12%

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

§ 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:新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司 (Nikko AssetManagement Co., Ltd.) 40%。

截至 2018 年 6 月 30 日,公司共管理六十六只开放式基金: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、融通动力先锋混合基金、融通领先成长混合基金(LOF)、融通内需驱动混合基金、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、融通医疗保健混合基金、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、融通汇财宝货币基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通福债券基金(LOF)、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利定期开放债券基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长 30 混合基金、融通中国风 1 号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金、融通通穗债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金(LOF)、融通新动力混合基金、融通收益增强债券基金、融通中国概念债券基金(QDII)、融通逆向策略混合基金、融通通裕定期开放债券发起式基金、融通红利机会主题精选混合基金、融通通昊定期开放债券发起式基金、融通新能源汽车主题精选混合基金。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		
王超	本基金的基金经理、固定收益部总监	2015年 3 月 14 日	-	11	王超先生,金融工程硕士,经济学、数学双学士,11 年证券投资从业经历,具有基金从业资格,现任融通基金管理有限公司固定收益部总监。历任深圳发展银行(现更名为平安银行)债券自营交易盘投资与理财投资管理经理。2012 年 8 月加入融通基金管理有限公司,现任融通债券、融通四季添利债券(LOF)、融通岁岁添利定期开放债券、融通增鑫债券、融通增益债券、融通增裕债券、融通通泰保本、融通通福债券、融通现金宝货币、融通稳利债券基金的基金经理。

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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》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 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(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,债券收益率先上后下。一月份市场预期金融监管会加码;叠加外围市场加息及大宗商品价格上涨,市场甚至预期央行大概率需要加息来应对通胀;而且股市表现良好,导致债市资金分流。在这些负面信息的共同冲击下,10 年期国开债收益率大幅上行至 5.13%;由于市场预期过于悲观,且经过 2016 年四季度以来的调整,债券收益率处于历史高位,市场的底部经过这次冲击反而被探明。随后发布的社融数据较去年同期大幅回落,叠加意外的资金宽松,导致市场情绪好转,债券收益率转而下行。此后中美贸易战及 4 月中旬降准等利多因素集中释放,推动长期限利率债收益率快速大幅下行。

本基金组合在上半年提升了久期和杠杆。

4.4.2 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 1.094 元,本报告期基金份额净值增长率为 3.79%;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 1.090 元, 本报告期基金份额净值增长率为 3.61%;同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望三季度,社融年初以来持续的回落或将在随后的经济数据上有所体现;此外,市场资金面略微趋松,央行对流动性维持紧平衡态度的同时传递出一定呵护倾向,对债市相对有利。但同时,也不应忽视信贷放量、财政发力等潜在可能的利空因素出现。整体看来,市场多空因素交织,情绪随着中美贸易摩擦、央行政策微调、资金面松紧程度而摆动,短期内多空力量或被平衡在一个窄幅区间当中,待到经济数据显示出走弱趋势,可能会再次推动利率债收益率下行。

信用市场方面,信用风险事件可能继续点状爆发,进而导致信用债继续维持高低等级资质分化、国企民企资质分化、区域分化的特征,防范违约风险和估值风险是信用债投资的第一要务。

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、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、参考独立第三方估值服务机构的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本基金基金经理。

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,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与基金托管人核对,同时负责对外进行信息披露。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。本基金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。

截至本报告期末,本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议,由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2018 年 1 月 16 日实施 2017 年第 2 次利润分配,以 2017 年 12 月 31 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 0.12 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 0.10 元。

4.8 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

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 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 1 次利润分配,分配金额为 2,083,955.37 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 2018 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:2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
资产:		
银行存款	135, 187.32	1, 073, 930.98
结算备付金	5, 980, 284.16	1, 374, 577.05
存出保证金	11, 683.23	11, 250.34
交易性金融资产	302, 629, 410.80	951, 112, 018.10
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	302, 629, 410.80	951, 112, 018.10
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	-	13, 985, 260.98
应收证券清算款	-	-
应收利息	5, 940, 024.49	17, 454, 066.68
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	314, 696, 590.00	985, 011, 104.13

负债和所有者权益	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
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	118, 519, 527.22	-
应付证券清算款	21, 226.18	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	95, 817.19	500, 704.77
应付托管费	28, 745.18	150, 211.44
应付销售服务费	9, 022.06	29, 863.24
应付交易费用	7, 852.15	7, 537.14
应交税费	190, 940.52	165, 601.43
应付利息	105, 321.77	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	193, 398.50	80, 000.00
负债合计	119, 171, 850.77	933, 918.02
所有者权益:		
实收基金	178, 769, 755.41	923, 350, 594.90
未分配利润	16, 754, 983.82	60, 726, 591.21
所有者权益合计	195, 524, 739.23	984, 077, 186.11
负债和所有者权益总计	314, 696, 590.00	985, 011, 104.13

注:报告截止日 2018 年 6 月 30 日,基金份额总额 178,769,755.41 份;其中融通岁岁添利定期开放债券 A 类基金份额净值 1.094 元,基金份额为 149,822,740.30 份; 融通岁岁添利定期开放债券 B 类基金份额净值 1.090 元,基金份额为 28,947,015.11 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:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入	12, 354, 305.98	11, 682, 250.23
1.利息收入	7, 385, 669.20	28, 156, 954.76
其中:存款利息收入	60, 806.13	156, 586.77
债券利息收入	7, 321, 021.43	26, 969, 919.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3, 841.64	1, 030, 448.73
其他利息收入	-	-
2.投资收益	- 7, 796, 139.66	- 18, 265, 157.29
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	- 7, 796, 139.66	- 18, 265, 157.29
资产支持证券投资收益	-	-
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	12, 764, 776.44	1, 790, 452.76
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	-	-
减:二、费用	3, 104, 794.17	7, 499, 128.47
1、管理人报酬	671, 465.35	2, 886, 182.78
2、托管费	201, 439.60	865, 854.86
3、销售服务费	62, 889.59	172, 461.56
4、交易费用	11, 223.30	14, 496.49
5、利息支出	1, 915, 552.87	3, 342, 283.51
其中:卖出回购金融资产支出	1, 915, 552.87	3, 342, 283.51
6.税金及附加	22, 266.77	-
7、其他费用	219, 956.69	217, 849.27
三、利润总额	9, 249, 511.81	4, 183, 121.76
减:所得税费用	-	-
四、净利润	9, 249, 511.81	4, 183, 121.76

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:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 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)	923, 350, 594.90	60, 726, 591.21	984, 077, 186.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9, 249, 511.81	9, 249, 511.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 744, 580, 839.49	- 51, 137, 163.83	- 795, 718, 003.32
其中:1.基金申购款	440, 839.86	26, 323.90	467, 163.76
2.基金赎回款	- 745, 021, 679.35	- 51, 163, 487.73	- 796, 185, 167.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	- 2, 083, 955.37	- 2, 083, 955.37
五、期末所有者权益(基金净值)	178, 769, 755.41	16, 754, 983.82	195, 524, 739.23

项目	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 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)	925, 196, 465.79	53, 661, 944.38	978, 858, 410.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4, 183, 121.76	4, 183, 121.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	- 1, 845, 870.89	- 135, 345.01	- 1, 981, 215.90
其中:1.基金申购款	2, 679, 873.68	126, 204.38	2, 806, 078.06
2.基金赎回款	- 4, 525, 744.57	- 261, 549.39	- 4, 787, 293.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	- 9, 875, 299.32	- 9, 875, 299.32
五、期末所有者权益(基金净值)	923, 350, 594.90	47, 834, 421.81	971, 185, 016.71

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:

_____ 张帆 _____ _____ 颜锡廉 _____ _____ 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 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

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

6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未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 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	671, 465.35	2, 886, 182.78
其中:支付销售机构的客户维护费	93, 866.67	181, 925.10

注:1、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。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	201, 439.60	865, 854.86

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。

6.4.4.2.3 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 2018年 1 月 1 日至 2018 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	融通岁岁添利定期开放债券 B	合计
中国工商银行	-	51, 472.29	51, 472.29
融通基金管理有限公司	-	7, 372.57	7, 372.57
合计	-	58, 844.86	58, 844.86

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 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	融通岁岁添利定期开放债券 B	合计
中国工商银行	-	69, 983.01	69, 983.01
融通基金管理有限公司	-	81, 803.16	81, 803.16
合计	-	151, 786.17	151, 786.17

注: 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 B 类基金资产净值 0.35%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:

日销售服务费=前一日 B 类基金资产净值× 0.35% / 当年天数。

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

本报告期内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。

6.4.4.5 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 2018年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	135, 187.32	29, 792.63	10, 521, 260.17	56, 986.47

6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

6.4.5 期末(2018 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 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款余额 48,519,527.22 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
101800190	18陕煤化 MTN001	2018年 7 月 12 日	102.43	100, 000	10, 243, 000.00
101800227	18川交投 MTN003	2018年 7 月 12 日	101.55	100, 000	10, 155, 000.00
101800290	18越秀集团 MTN001	2018年 7 月 12 日	101.57	60, 000	10, 157, 000.00
101552037	15中油投 MTN002	2018年 7 月 3 日	99.25	100, 000	9, 925, 000.00
101800140	18糖高速 MTN001	2018年 7 月 3 日	101.57	50, 000	10, 157, 000.00
101800299	18金融街 MTN001B	2018年 7 月 3 日	102.12	100, 000	10, 212, 000.00
合计				510, 000	60, 849, 000.00

6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末 2018 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 70,000,000.00 元, 于 2018 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。

§ 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	302, 629, 410.80	96.17
	其中:债券	302, 629, 410.80	96.17
	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	6, 115, 471.48	1.94
7	其他各项资产	5, 951, 707.72	1.89
8	合计	314, 696, 590.00	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	36, 136, 307.80	18.48
2	央行票据	-	-
3	金融债券	59, 630, 000.00	30.50
	其中:政策性金融债	59, 630, 000.00	30.50
4	企业债券	113, 510, 903.00	58.05
5	企业短期融资券	4, 930, 000.00	2.52
6	中期票据	88, 422, 200.00	45.22
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	302, 629, 410.80	154.78

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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	170215	17国开 15	300, 000	29, 826, 000.00	15.25
2	170210	17国开 10	200, 000	19, 548, 000.00	10.00
3	010303	03国债(3)	184, 190	18, 264, 280.40	9.34
4	124027	12增国投	400, 000	16, 156, 000.00	8.26
5	019547	16国债 19	178, 180	15, 578, 277.40	7.97

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 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末持有国债期货。

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

本基金本报告期末持有国债期货。

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	名称	金额
1	存出保证金	11, 683.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5, 940, 024.49
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5, 951, 707.72

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	