融通通利系列证券投资基金之融通债券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31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3月29日

§1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本年度报告摘要为融通通利系列证券投资基金之子基金融通债券投资基金(以下简称"本基金")2012年年度报告摘要。

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《融通通利系列证券投资基金基金合同》的规定,于2013年3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中的财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通债券	
基金主代码	161603	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2003年9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	
报告期末基金份额总额	715,048,890.34份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	融通债券A/B类	融通债券C类
下属分级基金的交易代码:	161603	161693
下属分级基金的前端交易代码	161603	–
下属分级基金的后端交易代码	161653	–
报告期末下属分级基金的份额总额	243,118,207.33份	471,930,683.01份

2.2 基金产品说明

投资目标	在强调本金安全的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	以组合优化为基本策略,利用收益曲线模型和债券品种定价模型,在获取较好的稳定收益的基础上,捕捉市场出现的中短期投资机会。
业绩比较基准	中信标普全债指数收益率
风险收益特征	属于相对低风险的基金品种

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年		2011年	2010年
	融通债券A/B类	融通债券C类	融通债券A/B类	融通债券A/B类
本期已实现收益	4,046,330.41	10,383,611.35	3,855,107.19	11,298,617.60
本期利润	17,451,020.88	8,131,548.42	-11,116,473.51	8,827,403.76
加权平均基金份额本期利润	0.0806	0.0176	-0.0460	0.0231
本期基金份额净值增长率	8.36%	7.40%	-4.10%	2.26%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末		2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.0282	0.0258	0.0073	0.0798
期末基金资产净值	249,978,384.33	484,125,792.17	196,152,372.86	330,433,844.58
期末基金份额净值	1.028	1.026	1.007	1.080

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)。

4、自2012年2月20日,本基金实施基金份额分类。融通债券C类的数据统计期间为2012年2月20日至本报告期末止。

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

1、融通债券A/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
过去三个月	1.06%	0.05%	1.02%	0.02%	0.04%	0.03%
过去六个月	0.96%	0.05%	1.12%	0.03%	-0.16%	0.02%
过去一年	8.36%	0.10%	4.03%	0.04%	4.33%	0.06%
过去三年	6.27%	0.15%	10.13%	0.06%	-3.86%	0.09%
过去五年	18.09%	0.15%	22.86%	0.11%	-4.77%	0.04%
自基金合同生效起至今	62.40%	0.19%	37.18%	0.10%	25.22%	0.09%

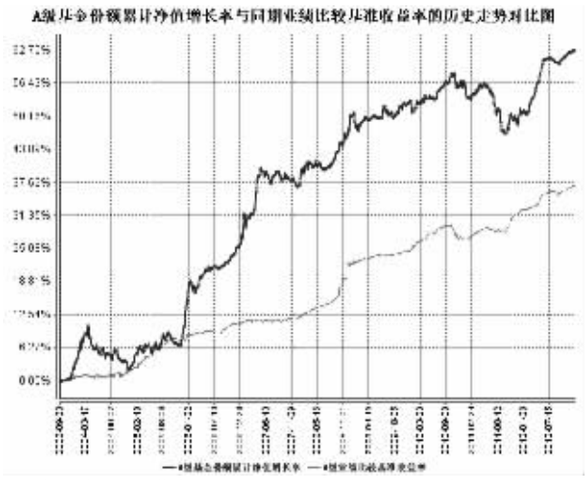
注:本基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用"银行间债券综合指数",2010年1月1日起使用新基准即"中信标普全债指数收益率"。

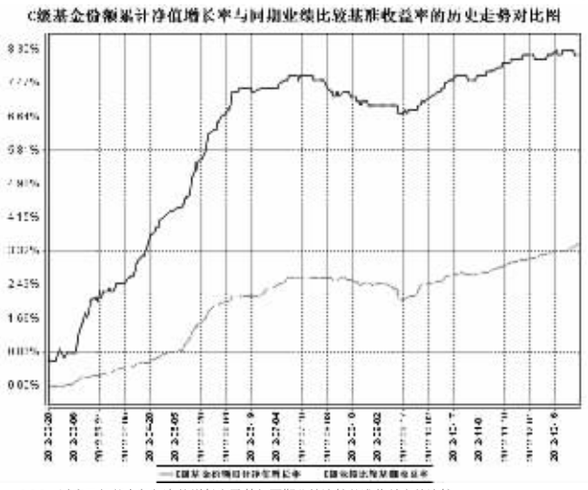
2、融通债券C类

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
过去三个月	1.06%	0.05%	1.02%	0.02%	0.04%	0.03%
过去六个月	0.77%	0.06%	1.12%	0.03%	-0.35%	0.03%
自基金合同生效起至今	7.40%	0.09%	3.53%	0.04%	3.87%	0.05%

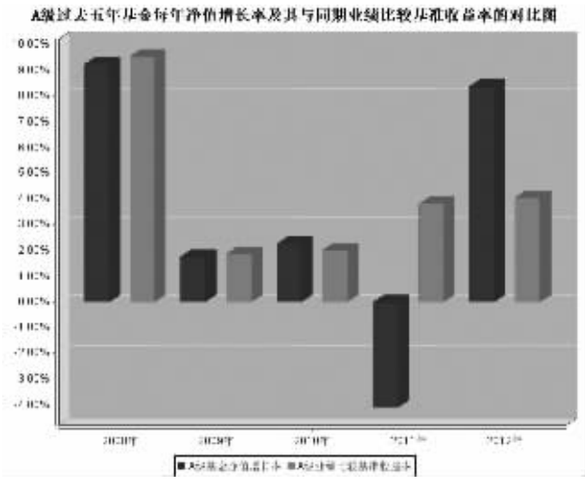
注:融通债券C类基金合同生效日为2012年2月20日。

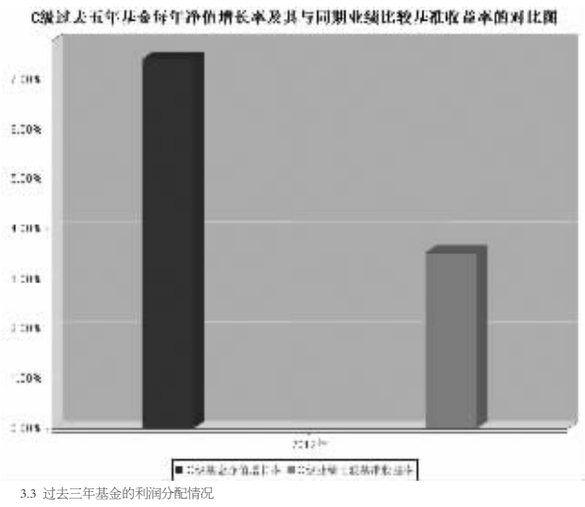
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较





3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

融通债券A/B类					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2012	0.620	4,201,576.39	9,640,331.86	13,841,908.25	-
2011	0.300	3,476,859.13	5,994,744.12	9,471,603.25	-
2010	0.800	13,911,664.97	18,500,311.09	32,411,976.06	-
合计	1.720	21,590,100.49	34,135,387.07	55,725,487.56	-

融通债券C类					
年度	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	年度利润分配合计	备注
2012	0.550	20,110,534.70	7,579,271.83	27,689,806.53	-
2011	-	-	-	-	-
2010	-	-	-	-	-
合计	0.550	20,110,534.70	7,579,271.83	27,689,806.53	-

§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2012年12月31日,公司管理的基金共有十六只:一只封闭式基金,即融通通乾封闭基金;十五只开放式基金,即融通蓝筹混合基金、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和融通岁岁添利定期开放债券基金。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		
张李陵	本基金的基金经理	2012-8-29	-	7	清华大学经济学硕士、理学学士,具有证券从业资格。2006年7月至2012年7月在招商银行总行工作,主要从事债券投资和交易。2012年7月加入融通基金管理有限公司。
乔羽夫	本基金的基金经理、融通四季添利债券基金基金经理	2008-3-31	2012-8-31	8	经济学硕士,具有证券从业资格。2000年9月至2001年10月,就职于深圳远永盛投资有限责任公司,从事证券交易工作;2004年9月至今,就职于融通基金管理有限公司,先后从事债券交易、债券研究以及债券投资等工作。

注:任职日期和离任日期均指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》及其他有关法律法规、《融通通利系列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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待,本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》,公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动,并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系,加强交易执行环节的内部控制,并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时,本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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

去年上半年,经济和通胀逐步下行,央行采取了较为宽松的货币政策,在2月和5月两次下调存款准备金率,于6月和7月两次降息。与此同时,央行提高了存款上浮比例的上限和贷款下浮比例的下限,在利率市场化改革的方向上迈出了重要的一步。市场一度对宏观经济见底的预期有所增强,并带动债券市场收益出现调整,但随着4月份公布的经济数据低于预期,以及央行推行宽松的货币政策,债券市场收益率大幅下行,并在7月份触及底部。8月以来,央行开始采取逆回购调控流动性,市场对于央行继续降准降息的预期落空,而此时债券供给放量,市场心态发生转变,各个期限债券的收益开始调整。进入4季度后,经济见底的迹象越发明显,债券市场收益率保持震荡上行。

投资运作上,上半年融通债券基金积极参与高收益债投资,把握住了上半年债券市场上涨的行情,在享受息票收入的同时获得了价差收入。下半年,随着债券市场转向,融通债券基金对组合进行了调整,适度降低了久期,加大了中票和公司债的投资,获得了稳定的息票收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,融通债券A/B类份额净值增长率为8.36%,同期业绩比较基准收益率为4.03%。融通债券C类份额净值增长率为7.40%,同期业绩比较基准收益率为3.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在稳健货币政策和积极财政政策的配合下,中国宏观经济正逐步复苏,但接下来复苏的力度取决于政府进一步的政策取向。目前看来,通胀在短期内仍处于低位,央行维持偏松的货币政策不变,债券走势有望保持平稳。二季度以后,若宏观经济向好的趋势得到数据验证,CPI逐步上行,市场的关注点有可能切换到通胀上,届时债券市场将面临一定的风险。

随着利率市场化的稳步推进,信用债市场快速发展,债券融资主体更加多元化。与此同时,债券出现实质性违约的概率也在加大。融通债券基金将采取谨慎的投资策略,精选信用资质良好的个券进行投资,兼顾投资的收益性和安全性,以获得稳定的回报。

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、金融工程小组、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、本基金管理人于2012年1月17日实施利润分配,以2011年12月31日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.07元。

2、本基金管理人于2012年5月18日实施利润分配,以2012年5月8日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.15元。

3、本基金管理人于2012年7月11日实施利润分配,以2012年7月2日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.10元。

4、本基金管理人于2012年8月13日实施利润分配,以2012年8月1日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.10元。

5、本基金管理人于2012年12月26日实施利润分配,以2012年12月17日的可分配收益为基准,每10份基金份额派发现金红利0.20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

2012年,本基金托管人在对融通债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

2012年,融通债券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通债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,融通债券投资基金对基金份额持有人进行了5次利润分配,分配金额为41,531,714.78元。

5.3 托管人对本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债券投资基金2012年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 审计报告

本基金2012年年度财务会计报告已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2013)第20120号),投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:融通债券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	91,334,974.91	4,278,401.35
结算备付金	15,865,013.60	731,195.41
存出保证金	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	986,185,578.31	248,660,815.71
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	986,185,578.31	248,660,815.71
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	17,396,362.73	5,660,673.26
应收股利	-	-
应收申购款	4,881,669.13	1,253,914.30
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,115,913,598.68	260,835,000.03
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	289,999,750.00	55,999,865.00
应付证券清算款	80,220,154.39	-
应付赎回款	7,918,259.64	5,568,415.22
应付管理人报酬	411,231.41	97,594.79
应付托管费	137,077.11	32,531.56
应付销售服务费	165,298.18	-
应付交易费用	59,998.87	114,017.83
应交税费	2,564,490.27	2,527,026.27
应付利息	10,747.43	36,693.79
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	322,414.88	306,482.71
负债合计	381,809,422.18	64,682,627.17
所有者权益:		
实收基金	715,048,890.34	194,722,753.54
未分配利润	19,055,286.16	1,429,619.32
所有者权益合计	734,104,176.50	196,152,372.86
负债和所有者权益总计	1,115,913,598.68	260,835,000.03

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额总额715,048,890.34份。其中融通债券A/B类基金份额净值为1.028元,基金份额为243,118,207.33份;融通债券C类基金份额净值为1.026元,基金份额为471,930,683.01份。

7.2 利润表

会计主体:融通债券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	35,357,015.54	-7,237,109.55
1.利息收入	30,860,042.95	9,507,371.48
其中:存款利息收入	289,259.17	101,378.80
债券利息收入	30,503,616.93	9,405,992.68
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	67,166.85	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-6,749,517.97	-1,868,964.98
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-6,749,517.97	-1,868,964.98
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益	11,152,627.54	-14,971,580.70
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	93,863.02	96,064.65
减:二、费用	9,774,446.24	3,879,363.96
1. 管理人报酬	3,790,798.41	1,496,855.19
2. 托管费	1,263,599.48	498,951.77
3. 销售服务费	1,430,021.17	-
4. 交易费用	27,468.02	8,466.59
5. 利息支出	2,801,250.20	1,479,713.55
其中:卖出回购金融资产支出	2,801,250.20	1,479,713.55
6. 其他费用	461,308.96	395,376.86
三、利润总额	25,582,569.30	-11,116,473.51
减:所得税费用	-	-
四、净利润	25,582,569.30	-11,116,473.51

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通债券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31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)	194,722,753.54	1,429,619.32	196,152,372.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,582,569.30	25,582,569.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	520,326,136.80	33,574,812.32	553,900,949.12
其中:1.基金申购款	2,424,488,428.34	106,160,304.16	2,530,648,732.50
2.基金赎回款	-1,904,162,291.54	-72,585,491.84	-1,976,747,783.38
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-41,531,714.78	-41,531,714.78
五、期末所有者权益(基金净值)	715,048,890.34	19,055,286.16	734,104,176.50
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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)	306,026,274.66	24,407,569.92	330,433,844.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,116,473.51	-11,116,473.51
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-111,303,521.12	-2,389,873.84	-113,693,394.96
其中:1.基金申购款	1,014,562,059.16	30,523,079.48	1,045,085,138.64
2.基金赎回款	-1,125,865,580.28	-32,912,953.32	-1,158,778,533.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-9,471,603.25	-9,471,603.25
五、期末所有者权益(基金净值)	194,722,753.54	1,429,619.32	196,152,372.86

注:后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:奚星华 主管会计工作负责人:颜锡廉 会计机构负责人:刘美丽

7.4 报表附注

7.4.1 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。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错内容和更正金额。

7.4.3 关联方关系

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	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司("新时代证券")	基金管理人股东、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。

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,790,798.41	1,496,855.19
其中:支付销售机构的客户维护费	268,821.06	59,885.16

注:支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理费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:日基金管理费=前一日基金资产净值×0.60%÷当年天数。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,263,599.48	498,951.77

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0.20%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×0.20%÷当年天数。

7.4.4.2.3 销售服务费

获得销售服务费各关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通债券A/B类	融通债券C类	合计
融通基金管理有限公司	-	189,905.70	189,905.70
中国工商银行股份	-	1,081,140.79	1,081,140.79
合计	-	1,271,046.49	1,271,046.49

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期 2012年1月1日至2012年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	9,919,234.97	-	-	-	-

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.4.4.2 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。

7.4.4.5 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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	91,334,974.91	162,415.79	4,278,401.35	94,996.22

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和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、本基金本报告期和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)在承销期承销的证券。

7.4.4.7 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。

7.4.5 期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
1280478	12巢湖城投债	2012-12-24	2013-1-7	网下申购新债	99.94	99.94	200,000	19,987,726.03	19,987,726.03	-

7.4.5.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.5.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31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99,999,750.00元,是以如下债券作为质押:

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
110013	11附息国债13	2013-1-4	100.34	500,000	50,170,000.00
120019	12附息国债19	2013-1-4	100.07	500,000	50,035,000.00
合计				1,000,000	100,205,000.00

7.4.5.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31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款余额190,000,000.00元,于2013年1月4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和/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。

§8 投资组合报告

8.1 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	986,185,578.31	88.37
	其中:债券	986,185,578.31	88.37
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	107,199,988.51	9.61
6	其他各项资产	22,528,031.86	2.02
7	合计	1,115,913,598.68	100.00

8.2 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	169,803,000.00	23.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	473,759,578.31	64.54
5	企业短期融资券	20,006,000.00	2.73
6	中期票据	322,617,000.00	43.95
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	986,185,578.31	134.34

8.3 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	1182386	11宁发电MTN1	500,000	51,415,000.00	7.00
2	110013	11附息国债13	500,000	50,170,000.00	6.83
3	120019	12附息国债19	500,000	50,035,000.00	6.82
4	122153	12京能01	500,000	49,890,000.00	6.80
5	019211	12国债11	500,000	49,750,000.00	6.78

8.4 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.5 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

本基金不进行主动权证投资,本报告期末未持有因投资可分离转债而获配的权证。

8.6 投资组合报告附注

8.6.1 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。

8.6.2 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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	17,396,362.73
5	应收申购款	4,881,669.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,528,031.86

8.6.3 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
融通债券A/B类	15,191	16,004.10	50,724,904.63	20.86%	192,393,302.70	79.14%
融通债券C类	1,435	328,871.56	272,784,054.69	57.80%	199,146,628.32	42.20%
合计	16,626	344,875.66	323,508,959.32	45.24%	391,539,931.02	54.76%

9.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	融通债券A/B类	18,589.38	0.0076%
	融通债券C类	8,970