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: 2014年3月27日

融通通泰保本混合型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31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泰保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金")基金合同规定,于2014年3月20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(特殊普通合伙)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2013年5月30日(基金合同生效日)起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	融通通泰保本混合
基金主代码	000142
交易代码	000142
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5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	466,640,068.91份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过运用组合保险策略,在为符合保本条件的投资金额提供保本保障的基础上,追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用时间不变性投资组合保险策略(TIPP,Time Invariant Portfolio Protection)和基于期权的组合保险策略(OBPI,Option-Based Portfolio Insurance)相结合的投资策略,通过量化技术动态调整资产配置比例,以达到保证本金安全的基本目标。
业绩比较基准	三年期银行定期存款税后收益率
风险收益特征	本基金属保本混合型基金,在证券投资基金中属于低风险品种。

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

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	2013年5月30日(基金合同生效日)-2013年12月31日
本期已实现收益	13,668,845.06
本期利润	918,160.41
加权平均基金份额本期利润	0.0018
本期基金份额净值增长率	0.10%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.0013
期末基金资产净值	467,242,652.47
期末基金份额净值	1.001

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)。

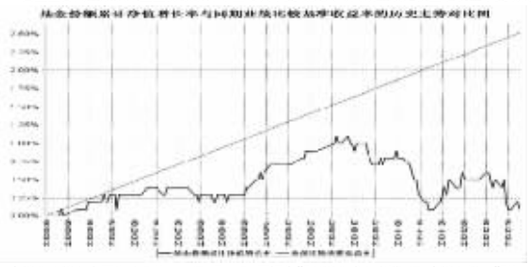
4、本基金合同生效日为2013年5月30日。

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

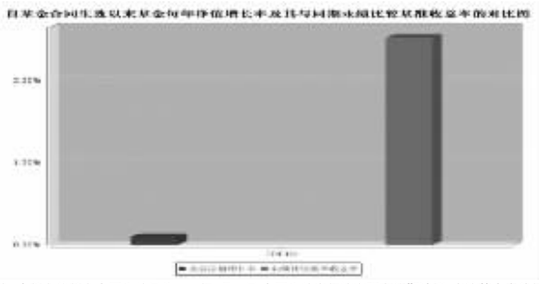
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.79%	0.10%	1.07%	0.01%	-1.86%	0.09%
过去六个月	-0.20%	0.08%	2.14%	0.01%	-2.34%	0.07%
自基金合同生效起至今	0.10%	0.08%	2.52%	0.01%	-2.42%	0.07%

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



注:本基金的基金合同生效日为2013年5月30日,至报告期末基金成立未满1年。本基金建仓期为六个月,至建仓期结束,各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注:本基金的基金合同生效日为2013年5月30日,合同生效当年按实际存续期计算,未按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

融通通泰保本混合					
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
2013	-	-	-	-	
合计	-	-	-	-	

§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12月31日,公司管理的基金共有二十四只:一只封闭式基金,即融通通乾封闭基金;二十三只开放式基金,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、融通通泰保本混合基金、融通通泽一年目标触发式混合基金、融通通祥一年目标触发式混合基金、融通通福分级债券基金和融通通源一年目标触发式混合基金。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		
韩海平	本基金的基金经理、融通债券及融通通福分级债的基金经理,固定收益部总监	2013年5月30日	-	11	CFA,FRM,中国科学技术大学经济学硕士,管理科学和计算机科学与技术双学士,11年证券从业经验,具有证券从业资格。2003年10月至2007年4月在招商基金管理有限公司工作,从事数量化投资策略研究工作;2007年5月至2012年9月在国投瑞银基金管理有限公司工作,历任高级研究员、基金经理、固定收益组副总监;2012年9月加入融通基金管理有限公司。

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、《融通通泰保本混合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

在中央托底经济政策作用下,2013年三季度经济企稳回升,再加上经历6月份"钱慌"冲击后,银行提高备付,压缩表外资产和理财规模的影响,债券市场走熊,债券收益率曲线大幅上行。从5月末到年底,10年期国债和金融债收益率上行112bp和171bp;5年期AAA,AA+和AA中票收益率分别上行178bp、200bp和218bp,市场调整的幅度和速度非常罕见。股票走势震荡,转债在9月份脉冲上涨之后,一路下行。

融通通泰保本基金成立于5月末,在运作上按照CPPI策略,以积累安全垫为主,保持了比较高的银行存款配置,并逐步增加债券配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为0.10%,同期业绩比较基准收益率为2.52%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年四季度GDP环比已经开始回落,考虑到货币市场流动性偏紧以及处于高位的信用债券收益率,企业的融资成本上升,会对制造业投资造成负面影响;另外严控地方政府债务,也不利于基础设施建设投资,预计2014年经济将继续走弱。预计全年央行仍将维持中性的货币政策操作,不过边际上将较去年改善,流动性对债市的制约将减弱。此外国务院107号文出台后,各个部委对表外融资趋严,这也将会制约非标产品的发展。全年来看,通过债券获取绝对收益的可能性在上升。

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

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§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通泰保本混合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,融通通泰保本混合型证券投资基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通通泰保本混合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。

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通泰保本混合型证券投资基金2013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2013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(特殊普通合伙)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(2014)第21296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:融通通泰保本混合型证券投资基金

报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日
资 产:	
银行存款	100,955,627.46
结算备付金	7,991,106.14
存出保证金	45,804.72
交易性金融资产	588,736,609.21
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	588,736,609.21
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	10,313,078.50
应收利息	9,350,443.75
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	717,392,669.78
负债和所有者权益	**本期末 2013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	240,015,282.35
应付证券清算款	9,024,940.60
应付赎回款	401,922.80
应付管理人报酬	485,648.59
应付托管费	80,941.42
应付销售服务费	-
应付交易费用	2,590.00
应交税费	-
应付利息	32,539.67
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	106,151.88
负债合计	250,150,017.31
所有者权益:	
实收基金	466,640,068.91
未分配利润	602,583.56
所有者权益合计	467,242,652.47
负债和所有者权益总计	717,392,669.78

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.001元,基金份额总额466,640,068.91份。

7.2 利润表

会计主体:融通通泰保本混合型证券投资基金

本报告期:2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	8,002,652.44
1.利息收入	19,482,265.25
其中:存款利息收入	7,829,562.88
债券利息收入	10,530,867.87
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	1,121,834.50
其他利息收入	-
2.投资收益	958,026.16
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	958,026.16
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	-12,750,684.65
4.汇兑收益	-
5.其他收入	313,045.68
减:二、费用	7,084,492.03
1.管理人报酬	3,598,584.40
2.托管费	599,764.07
3.销售服务费	-
4.交易费用	4,156.38
5.利息支出	2,689,535.84
其中:卖出回购金融资产支出	2,689,535.84
6.其他费用	192,451.34
三、利润总额	918,160.41
减:所得税费用	-
四、净利润	918,160.41

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:融通通泰保本混合型证券投资基金

本报告期:2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年5月30日(基金合同生效日)至2013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)	528,653,648.94	-	528,653,648.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	918,160.41	918,160.41
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-62,013,580.03	-315,576.85	-62,329,156.88
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-62,013,580.03	-315,576.85	-62,329,156.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	466,640,068.91	602,583.56	467,242,652.47

报表附注为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:

_____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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

融通通泰保本混合型证券投资基金(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")证监许可[2013]219号《关于核准融通通泰保本混合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《融通通泰保本混合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528,443,473.21元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2013)第322号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》于2013年5月30日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为528,653,648.94份基金份额,其中认购资金利息折合210,175.73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(以下简称"中国工商银行")。

根据《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》的有关约定,本基金的保本周期每三年为一个周期。本基金第一个保本周期自基金合同生效之日起至三个公历年后对应日止,如该对应日为非工作日,则保本周期到期日顺延至下一个工作日。第一个保本周期届满时,在符合保本基金存续条件下,本基金继续存续并进入下一保本周期。本基金第一个保本周期由中国投资担保有限公司担任保证人,为本基金的保本提供不可撤销的连带责任保证。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通泰保本混合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金融工具,可分为风险资产和保本资产两类,其中风险资产包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它权益类资产;保本资产包括债券(包含国债、央行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、资产支持债券、债券回购等)、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其它固定收益类资产。本基金的投资组合比例为:本基金的投资组合比例由保本策略决定,并对比例范围有如下限制:股票、权证等风险资产占基金资产的比例不超过40%;债券、货币市场工具及其它资产的比例合计不低于基金资产的60%,其中基金保留的现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准为三年期银行定期存款税后收益率。

7.4.2 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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通通泰保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间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12月31日的财务状况以及2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

本基金目前以交易目的持有的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其他各类应收款项等。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卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 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,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。

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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。由于赎回引起的实收基金变动于基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 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。已实现平准金指在赎回基金份额时,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。未实现平准金指在赎回基金份额时,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。损益平准金于基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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,其处置价格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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 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为正数,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,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,即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。

7.4.4.12 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,不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

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,本基金计算影子价格过程中确定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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 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
深圳市融通资本财富管理有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期无通过关联方交易单元的交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,598,584.40
其中:支付销售机构的客户维护费	2,370,420.50

注:1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	599,764.07

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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,基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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,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。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	本期 2013年5月30日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	955,627.46	37,333.16

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按适用利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期未买入管理人、托管人的投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。

7.4.8.7 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。

7.4.9 期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末,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87,699,548.45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
1282527	12鲁宏桥MTN1	14/01/06	96.69	400,000	38,676,000.00
130243	13国开43	14/01/06	99.30	300,000	29,790,000.00
1182394	11新扬子MTN1	14/01/06	99.30	200,000	19,860,000.00
合计				900,000	88,326,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额152,315,733.90元,于2014年1月2日、2014年1月3日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券,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	588,736,609.21	82.07
	其中:债券	588,736,609.21	82.07
	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	108,946,733.60	15.19
6	其他各项资产	19,709,326.97	2.75
7	合计	717,392,669.78	100.00

8.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末投资股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末投资股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末