融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013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:2014年3月27日

§1 重要提示

1.1 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。

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2014年3月21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	420,886,985.36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类	融通岁岁添利定期开放债券B类
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	258,177,799.36份	162,709,186.00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	属于证券投资基金中的较低风险品种

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		2012年11月6日(基金合同生效日)-2012年12月31日	
	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	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
本期已实现收益	42,823,811.92	53,488,114.38	6,048,042.48	7,516,484.58
本期利润	30,902,043.61	41,026,112.79	6,419,061.60	8,036,378.49
加权平均基金份额本期利润	0.0271	0.0260	0.0049	0.0044
本期基金份额净值增长率	-0.07%	-0.47%	0.50%	0.40%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末		2012年末	
期末可供分配基金份额利润	-0.0313	-0.0320	0.0027	0.0021
期末基金资产净值	250,091,949.41	157,502,339.83	1,303,401,497.91	1,826,599,621.34
期末基金份额净值	0.969	0.968	1.003	1.002

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

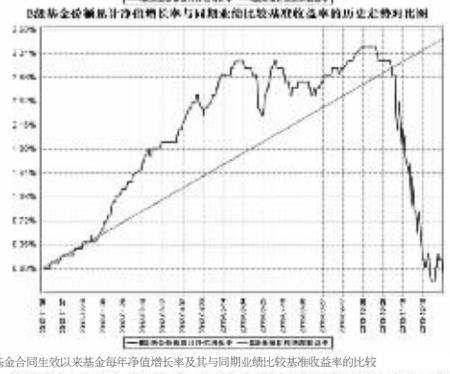
融通岁岁添利定期开放债券A类

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	-3.00%	0.20%	0.77%	0.01%	-3.77%	0.19%
过去六个月	-2.42%	0.15%	1.51%	0.01%	-3.93%	0.14%
过去一年	-0.07%	0.12%	3.00%	0.01%	-3.07%	0.11%
自基金合同生效起至今	0.43%	0.11%	3.46%	0.01%	-3.03%	0.10%

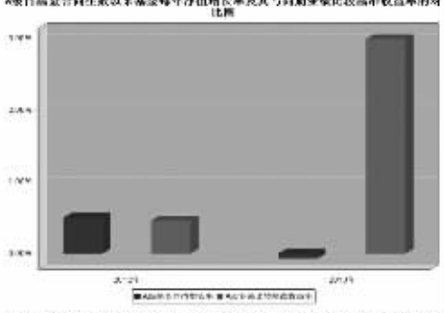
融通岁岁添利定期开放债券B类

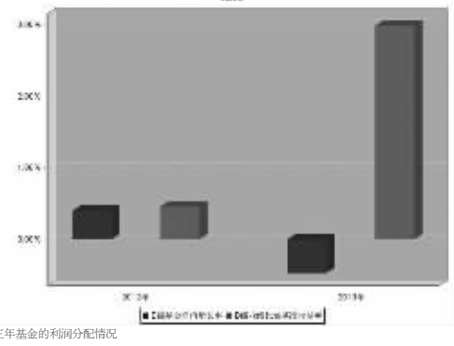
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.20%	0.20%	0.77%	0.01%	-3.97%	0.19%
过去六个月	-2.72%	0.15%	1.51%	0.01%	-4.23%	0.14%
过去一年	-0.47%	0.12%	3.00%	0.01%	-3.47%	0.11%
自基金合同生效起至今	-0.07%	0.11%	3.46%	0.01%	-3.53%	0.10%

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 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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

融通岁岁添利定期开放债券A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
2013	0.3400	32,978,664.78	11,377,267.53	44,355,932.31	
2012	0.0200	1,966,749.82	631,148.68	2,597,898.50	
合计	0.3600	34,945,414.60	12,008,416.21	46,953,830.81	

单位:人民币元

融通岁岁添利定期开放债券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
2013	0.3000	34,017,849.23	20,923,181.64	54,941,030.87	
2012	0.0200	2,324,926.33	1,316,849.54	3,641,775.87	
合计	0.3200	36,342,775.56	22,240,031.18	58,582,806.74	

§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		
蔡奕奕	本基金的基金经理、融通易支付货币基金的基金经理、融通四季添利债券基金的基金经理	2012年11月6日	-	8	管理科学硕士,具有证券从业资格,2006年3月至2006年11月,就职于万家基金管理有限公司,担任交易员职务,从事股票债券交易工作;2006年12月至2008年8月,就职于银河基金管理有限公司,担任交易员职务,从事债券交易工作;2008年9月至今,就职于融通基金管理有限公司,历任交易员、行业研究员职务。

注:任职日期指公司董事会作出决定之日;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、《融通岁岁添利定期开放债券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

2013年债券市场经历罕见熊市,2013年年初在流动性宽松的背景下,一季度债市延续2011年四季度以来的牛市行情,债券收益率持续下行,高收益债券表现相对出色;进入二季度,央行货币政策趋向收紧,直到"620钱荒"银行间市场资金利率骤然飙升使得市场对资金面宽松的预期产生逆转,债券市场在之后的资金利率平台式上升以及银行配置偏好转向的共同作用下步入大幅持续调整,收益率曲线面临全面重估,其中长端利率债上行幅度最大,信用债收益率也随之大幅上行。

本基金在2013年第一个运作期保持以短融为主的配置结构"的操作策略,杠杆比例始终保持在较低水平,令本基金第一个运作期业绩好于市场平均水平;进入第二个运作期,由于本基金遭遇大比例赎回,杠杆比例大幅上升,而四季度债市仍处于下跌之中,令基金净值遭受损失。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期融通岁岁添利定期开放债券A类份额净值增长率为-0.07%,融通岁岁添利定期开放债券B类份额净值增长率为-0.47%,同期业绩比较基准收益率为3.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们判断2014年将是风险偏好回归的一年,整体上高等级和流动性较好的债券相对表现更好。一方面美国QE退出今新兴市场流动性承压、国内债务风险加剧;另一方面,央行仍将保持偏紧的货币政策推动金融机构去杠杆,短期内在看不到流动性放松的迹象下,债市仍将呈现弱势,债券投资应以防御为主,同时考虑到流动性的收缩和债务成本的抬升会导致信用事件的爆发,应重点防范信用风险。但社会融资成本的抬升和投资增速的下降加大,债市可以博亲货币政策放松的机会。

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,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

(1)本基金管理人于2013年1月30日实施利润分配,以2013年1月22日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.03元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.03元;

(2)本基金管理人于2013年2月28日实施利润分配,以2013年2月20日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.04元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.03元;

(3)本基金管理人于2013年3月26日实施利润分配,以2013年3月20日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.04元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.03元;

(4)本基金管理人于2013年5月3日实施利润分配,以2013年4月22日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.03元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.04元;

(5)本基金管理人于2013年5月27日实施利润分配,以2013年5月20日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.03元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.02元;

(6)本基金管理人于2013年6月27日实施利润分配,以2013年6月20日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.04元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.04元;

(7)本基金管理人于2013年7月26日实施利润分配,以2013年7月22日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.04元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.03元;

(8)本基金管理人于2013年8月27日实施利润分配,以2013年8月20日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.02元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.02元;

(9)本基金管理人于2013年9月30日实施利润分配,以2013年9月23日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.04元,融通岁岁添利定期开放债券B类每10份基金份额派发现金红利0.04元;

(10)本基金管理人于2013年10月28日实施利润分配,以2013年10月21日的可分配收益为基准,融通岁岁添利定期开放债券A类每10份基金份额派发现金红利0.03元,融通岁岁添利定期开放债券B类每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

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10次利润分配,分配金额为99,296,963.18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岁岁添利定期开放债券型证券投资基金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21298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:融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金

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	上年度末 2012年12月31日
资产:		
银行存款	42,798,830.63	5,158,291.78
结算备付金	21,357,215.13	9,913,142.81
存出保证金	74,841.00	-
交易性金融资产	774,102,316.28	3,151,108,566.03
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	766,827,316.28	3,080,710,566.03
资产支持证券投资	7,275,000.00	70,398,000.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	420,001,070.00
应收证券清算款	25,744,948.40	-
应收利息	15,217,016.45	18,581,328.23
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	879,295,167.89	3,604,762,398.85
负债和所有者权益	**本期末 2013年12月31日**	**上年度末 2012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	470,744,575.90	471,998,541.50
应付证券清算款	194,329.07	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	208,461.74	1,590,412.18
应付托管费	62,538.54	477,123.64
应付销售服务费	46,996.10	541,397.02
应付交易费用	28,392.73	31,294.58
应交税费	165,601.43	38,454.79
应付利息	30,983.14	84,055.89
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	219,000.00	-
负债合计	471,700,878.65	474,761,279.60
所有者权益:		
实收基金	420,886,985.36	3,121,780,833.17
未分配利润	-13,292,696.12	8,220,286.08
所有者权益合计	407,594,289.24	3,130,001,119.25
负债和所有者权益总计	879,295,167.89	3,604,762,398.85

注:1.报告截止日2013年12月31日,融通岁岁添利基金份额总额420,886,985.36份;其中A类基金份额净值为0.969元,基金份额为258,177,799.36份;B类基金份额净值为0.968元,基金份额为162,709,186.00份(于2012年12月31日,融通岁岁添利基金份额总额3,121,780,833.17份;其中A类基金份额净值为1.003元,基金份额为1,299,578,444.77份;B类基金份额净值为1.002元,基金份额为1,822,202,388.40份)。

2.本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年11月6日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间。

7.2 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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年11月6日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	119,170,500.64	19,416,692.50
1.利息收入	150,019,525.30	18,493,229.46
其中:存款利息收入	10,573,169.49	7,518,461.28
债券利息收入	128,224,330.23	10,033,823.27
资产支持证券利息收入	2,112,960.15	279,436.01
买入返售金融资产收入	9,109,065.43	661,508.90
其他利息收入	-	-
2.投资收益	-6,465,254.76	21,673.02
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-6,586,286.15	21,673.02
资产支持证券投资收益	121,031.39	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益	-24,383,769.90	890,913.03
4.汇兑收益	-	-
5.其他收入	-	10,876.99
减:二、费用	47,242,344.24	4,961,252.41
1.管理人报酬	16,576,336.46	2,819,116.82
2.托管费	4,972,900.88	845,735.01
3.销售服务费	5,617,939.32	959,704.59
4.交易费用	57,299.35	25,049.29
5.利息支出	19,420,060.43	273,214.91
其中:卖出回购金融资产支出	19,420,060.43	273,214.91
6.其他费用	597,807.80	38,431.79
三、利润总额	71,928,156.40	14,455,440.09
减:所得税费用	-	-
四、净利润	71,928,156.40	14,455,440.09

7.3 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:2013年1月1日至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1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)	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)	-	71,928,156.40	71,928,156.40
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,700,893,847.81	5,855,824.58	-2,695,038,023.23
其中:1.基金申购款	185,155,650.59	-1,567,815.73	183,587,834.86
2.基金赎回款	-2,886,049,498.40	7,423,640.31	-2,878,625,858.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-99,296,963.18	-99,296,963.18
五、期末所有者权益(基金净值)	420,886,985.36	-13,292,696.12	407,594,289.24

项目	上年度可比期间 2012年11月6日(基金合同生效日)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)	3,119,837,355.31	-	3,119,837,355.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,455,440.09	14,455,440.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,943,477.86	4,520.36	1,947,998.22
其中:1.基金申购款	1,943,477.86	4,520.36	1,947,998.22
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-6,239,674.37	-6,239,674.37
五、期末所有者权益(基金净值)	3,121,780,833.17	8,220,286.08	3,130,001,119.25

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

融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2012]第1151号《关于同意融通岁岁添利定期开放债券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《融通岁岁添利定期开放债券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3,117,219,191.24元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第403号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于2012年11月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,119,837,355.31份基金份额,其中认购资金利息折合2,618,164.07份基金份额,其中融通岁岁添利基金A类基金份额总额为1,298,949,186.13份基金份额,其中认购资金利息折合1,056,294.89份基金份额;融通岁岁添利基金B类基金份额总额为1,820,888,169.18份基金份额,其中认购资金利息折合1,561,869.18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。

根据《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用的,称为A类基金份额;不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为B类基金份额。

本基金以定期开放的方式运作,本基金的封闭期为自基金合同生效之日起(包括基金合同生效之日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务,也不上市交易。本基金办理申购与赎回业务的开放期为本基金每个封闭期结束之后第一个工作日起不超过10个工作日的期间,具体时间由基金管理人在开始办理申购和赎回的具体日期前依照《证券投资基金信息披露管理办法》的有关规定在至少一家指定媒体上予以公告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通岁岁添利定期开放债券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固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、中期票据、短期融资券、公司债、可转换债券(含分离债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款等固定收益类金融工具。本基金投资于债券类金融工具的比例不低于基金资产的80%。本基金不参与一级市场新股申购或增发新股,也不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,本基金可参与一级市场及二级市场可转换债券的投资,因持有可转债转股所形成的股票以及因投资可分离债券而产生的权证将于30个工作日内卖出。在开放期,本基金持有的现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,在非开放期,本基金不受该比例的限制。本基金业绩比较基准为一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》、《融通岁岁添利定期开放债券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年度和2012年11月6日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间的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日和2012年12月31日的财务状况以及2013年度和2012年11月6日(基金合同生效日)至2012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。本财务报表的实际编制期间为2013年度和2012年11月6日(基金合同生效日)至2012年12月31日止期间。

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和资产支持证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或资产支持证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和资产支持证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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及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。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或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。损益平准金于基金申购确认日或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