基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
送出日期:2014年3月28日

万家添利分级债券型证券投资基金

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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014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。

本报告财务资料已经审计。安永华明会计师事务所为本基金出具了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	万家添利分级债券	
基金主代码	161908	
基金运作方式	创新型封闭式	
基金合同生效日	2011年6月2日	
基金管理人	万家基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,265,374,757.05份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2011-08-29	
下属分级基金的基金简称:	万家利A	万家利B
下属分级基金的交易代码:	161909	150038
报告期末下属分级基金的份额总额	492,103,345.68份	773,271,411.37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,追求当期较高收入和投资总回报。
投资策略	本基金在充分研究宏观市场形势以及微观市场主体的基础上,采取积极主动地投资管理策略,通过定性与定量分析,对利率变化趋势、债券收益率曲线移动方向、信用利差等影响债券价格的因素进行评估,对不同投资品种运用不同的投资策略,并充分利用市场的非有效性,把握各类套利的机会。在风险可控的前提下,充分发挥在封闭期内基金规模稳定的优势,寻求组合流动性与收益的最佳配比,实现基金收益的最大化。此外,本基金通过对首次发行(IPO)股票和增发新股的上市公司内在价值和一级市场申购收益率的全面分析,制定相应的新股申购策略,以获得较为安全的新股申购收益。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金是债券型证券投资基金,属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。

	万家利A	万家利B
下属分级基金的风险收益特征	封闭期内,A级份额将表现出低风险、低收益的明显特征,其预期收益和预期风险要低于普通的债券型基金份额	封闭期内,B级份额则表现出高风险、高收益的显著特征,其预期收益和预期风险要高于普通的债券型基金份额

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		万家基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	胡涛
	联系电话	021-38619810	010-68858112
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		95538转6、4008880800	95580
传真		021-38619888	010-66858120

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.wjasset.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区浦电路360号陆家嘴投资大厦9楼基金管理人办公场所

§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	2011年6月2日(基金合同生效日)-2011年12月31日
本期已实现收益	137,649,657.40	188,047,409.62	51,727,171.09
本期利润	77,002,633.81	287,589,355.28	-6,096,074.61
加权平均基金份额本期利润	0.0368	0.1330	-0.0025
本期基金份额净值增长率	5.53%	15.38%	-1.80%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配基金份额利润	0.1715	0.0809	-0.0178
期末基金资产净值	1,513,005,277.49	2,169,951,337.85	1,579,608,132.32
期末基金份额净值	1.1957	1.1330	0.9820

注:(1)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;

(2)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;

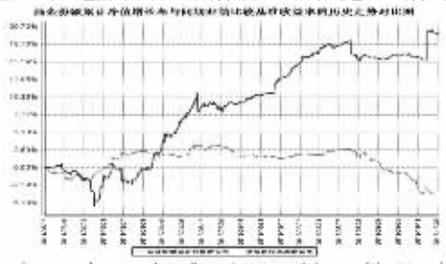
(3)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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	2.69%	0.44%	-3.13%	0.14%	5.82%	0.30%
过去六个月	2.85%	0.31%	-5.73%	0.12%	8.58%	0.19%
过去一年	5.53%	0.26%	-5.28%	0.11%	10.81%	0.15%
自基金合同生效起至今	19.57%	0.27%	-3.88%	0.10%	23.45%	0.17%

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2013 年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所审计,注册会计师签字出具了安永华明(2014)审字第60778298_B11号标准无保留意见的审计报告。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:万家添利分级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	400,097,626.95	63,587,503.48
结算备付金	1,822,297.42	1,781,691.16
存出保证金	402,361.06	500,000.00
交易性金融资产	967,224,826.78	1,981,665,665.28
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	965,844,826.78	1,944,979,965.28
资产支持证券投资	1,380,000.00	36,685,700.00
贵金属投资		
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	132,000,380.00	459,001,523.50
应收证券清算款	5,358,534.12	-
应收利息	23,351,802.37	46,254,631.97
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,530,257,828.70	2,552,791,015.39
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	13,400,000.00	370,898,811.65
应付证券清算款	-	8,291,758.71
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	972,289.37	1,341,237.33
应付托管费	277,796.97	383,210.68
应付销售服务费	486,144.66	670,618.63
应付交易费用	35,019.08	64,194.14
应交税费	1,658,968.16	53,187.96
应付利息	4,138.05	256,658.44
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	418,194.92	880,000.00
负债合计	17,252,551.21	382,839,677.54
所有者权益:		
实收基金	1,265,374,757.05	1,915,255,244.76
未分配利润	247,630,520.44	254,696,093.09
所有者权益合计	1,513,005,277.49	2,169,951,337.85
负债和所有者权益总计	1,530,257,828.70	2,552,791,015.39

注:报告截止日2013年12月31日,基金份额净值1.1957元,基金份额总额1,265,374,757.05份,其中添利A份额参考净值1.1174元,份额总额492,103,345.68份;添利B份额参考净值1.2455元,份额总额773,271,411.37份。

7.2 利润表

会计主体:万家添利分级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1月1日至2012年12月31日
一、收入	117,480,677.84	334,590,103.13
1.利息收入	115,179,308.61	125,736,724.18
其中:存款利息收入	7,929,673.91	1,756,415.99
债券利息收入	92,796,528.24	110,825,864.92
资产支持证券利息收入	662,028.45	222,267.53
买入返售金融资产收入	13,791,078.01	12,932,175.74
其他利息收入	-	-
2.投资收益 (损失以“-”填列)	62,658,392.82	109,308,679.41
其中:股票投资收益	6,633,266.91	29,171,045.92
基金投资收益	-	-
债券投资收益	55,988,238.91	79,888,512.49
资产支持证券投资收益	36,887.00	10,621.00
贵金属投资收益		
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	238,500.00
3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	-60,647,023.59	99,541,945.66
4.汇兑收益 (损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入 (损失以“-”号填列)	290,000.00	2,753.88
减:二、费用	40,478,044.03	47,000,747.85
1.管理人报酬	17,076,059.62	16,221,010.54
2.托管费	4,878,874.10	4,634,574.42
3.销售服务费	8,538,029.86	8,110,505.11
4.交易费用	181,070.10	708,163.43
5.利息支出	9,327,610.35	16,850,094.35
其中:卖出回购金融资产支出	9,327,610.35	16,850,094.35
6.其他费用	476,400.00	476,400.00
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	77,002,633.81	287,589,355.28
减:所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	77,002,633.81	287,589,355.28

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家添利分级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)	1,915,255,244.76	254,696,093.09	2,169,951,337.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	77,002,633.81	77,002,633.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-649,880,487.71	-84,068,206.46	-733,948,694.17
其中:1.基金申购款	1,090,150,576.56	101,482,874.74	1,191,633,451.30
2.基金赎回款	-1,740,031,064.27	-185,551,081.20	-1,925,582,145.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,265,374,757.05	247,630,520.44	1,513,005,277.49
项目	上年度可比期间 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)	1,608,305,096.65	-28,696,964.33	1,579,608,132.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	287,589,355.28	287,589,355.28
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	306,950,148.11	-4,196,297.86	302,753,850.25
其中:1.基金申购款	1,934,003,116.84	96,993,195.62	2,030,996,312.46
2.基金赎回款	-1,627,052,968.73	-101,189,493.48	-1,728,242,462.21
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,915,255,244.76	254,696,093.09	2,169,951,337.85

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:

毕玉国 李杰 陈广益

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

万家添利分级债券型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]242号文《关于核准万家添利分级债券型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人万家基金管理有限公司自2011年5月16日至2011年5月27日止向社会公开发行募集,基金合同于2011年6月2日正式生效,首次设立募集规模为2,635,617,840.86份基金份额。本基金为契约型。本基金合同生效后三年内(含三年)为封闭期。封闭期间,添利A自基金合同生效日起每满半年开放一次申购赎回,添利B在深圳证券交易所上市交易。封闭期届满后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司,基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金通过基金收益分配的安排,将基金份额分成预期收益与风险不同的两个级别,即稳健收益级基金份额(基金份额简称“添利A”)和积极收益级基金份额(基金份额简称“添利B”)。在封闭期末,本基金净资产优先分配添利A基金份额的本金及约定应得收益,即添利A为低风险且预期收益相对稳定的基金份额;本基金在优先分配添利A基金份额的本金及约定应得收益后的剩余净资产分配予添利B基金份额,即添利B为高风险且预期收益相对较高的基金份额。按照上述本基金资产及收益分配规则,在封闭期末对添利A与添利B单独进行基金份额净值计算,并按各自的基金份额净值进行资产分配。

本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%。本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规获中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金还可以参与一级市场新股申购或增发新股,并可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离债券而产生的权证等以及法律法规或中国证监会允许投资的其他非固定收益类品种,但不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金在封闭运作期间,投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%,其中,现金或者到期日在一年以内政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为中国债券总指数。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5 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。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

7.4.6.2 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

7.4.6.3 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
齐鲁证券有限公司	基金管理人股东、基金代销机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人股东
上海久事公司	基金管理人原股东
深圳市中航投资管理有限公司	基金管理人原股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人控股子公司

注:1、本报告期内,新疆国际实业股份有限公司受让上海久事公司和深圳市中航投资管理有限公司持有的本基金管理人万家基金管理有限公司各20%的股权,该两起股权转让事项于2013年2月经中国证券监督管理委员会核准,并已办理完毕工商变更登记手续。本次股权转让后,基金管理人的股权结构变更为:齐鲁证券有限公司持股49%,新疆国际实业股份有限公司持股40%,山东省国有资产投资控股有限公司持股11%。

2、报告期内,基金管理人子公司万家共赢资产管理有限公司于2013年2月正式成立,基金管理人持有其51%股份。

3、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
齐鲁证券有限公司	-	-	54,334,887.92	18.33%

债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
齐鲁证券有限公司	3,112,235,186.14	67.04%	2,589,951,150.07	54.10%

债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日	
	回购成交金额	占当期回购债券成交总额的比例	回购成交金额	占当期回购债券成交总额的比例
齐鲁证券有限公司	10,023,000,000.00	98.57%	60,424,500,000.00	100.00%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
齐鲁证券有限公司	47,390.82	18.69%	8.40	18.78%

注:上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

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1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,076,059.62	16,221,010.54
其中:支付销售机构的客户维护费	3,131,068.75	3,431,689.80

注:基金管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.70%/当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.2 基金托管费

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1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,878,874.10	4,634,574.42

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.20%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.20%/当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2.3 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 2013年1月1日至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
万家基金管理有限公司	4,837,163.84
中国邮政储蓄银行股份有限公司	3,235,145.16
合计	8,072,309.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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
万家基金管理有限公司	4,239,378.28
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,916,556.30
合计	7,155,934.58

注:基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.35%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.35%÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日基金资产净值

基金销售服务费自基金合同生效之日起每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,基金托管人复核无误后于次月首日起5个工作日内从基金资产中一次性支付给基金销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

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

单位:人民币元

本期 2013年1月1日至2013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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	19,939,690.41	243,460,000.00	52,577.93	-	-
上年度可比期间 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	20,010,566.99	99,964,896.71	0.00	0.00	0.00	0.00

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

本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均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

份额单位:份

万家利A				
关联方名称	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
齐鲁证券有限公司	0.00	0.00%	186,915,887.85	16.37%

份额单位:份

万家利B				
关联方名称	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
齐鲁证券有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金添利B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

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	97,626.95	617,645.94	63,587,503.48	1,193,452.16

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司,2013年度获得的利息收入为人民币89,678.31元(2012年度获得的利息收入为552,184.54元),2013年末结算备付金余额为1,822,297.42元(2012年末结算备付金余额为1,781,691.16元)。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

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2013年12月31日止,本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,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13,400,000.00元,于2014年1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。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	967,224,826.78	63.21
	其中:债券	965,844,826.78	63.12
	资产支持证券	1,380,000.00	0.09
3	贵金属投资		
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	132,000,380.00	8.63
	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	401,919,924.37	26.26
7	其他各项资产	29,112,697.55	1.90
8	合计	1,530,257,828.70	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投资。

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投资。

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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000731	四川美丰	54,086,602.17	2.49

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000731	四川美丰	60,719,869.08	2.80

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	54,086,602.17
卖出股票收入(成交)总额	60,719,869.08

8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	92,680,000.00	6.13
	其中:政策性金融债	92,680,000.00	6.13
4	企业债券	407,273,826.78	26.92
5	企业短期融资券	338,725,000.00	22.39
6	中期票据	127,166,000.00	8.40
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	965,844,826.78	63.84

8.6 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	041364024	13甘国投CP001	1,000,000	99,420,000.00	6.57
2	122980	09津投3	1,000,000	98,000,000.00	6.48
3	130224	13国开24	1,000,000	92,680,000.00	6.13
4	122928	09铁岭债	800,000	79,760,000.00	5.27
5	041361026	13津城建CP001	700,000	69,566,000.00	4.60

8.7 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	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	061202001	12通元1A	200,000	1,380,000.00	0.09

8.8 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投资。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不投资于股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不投资于国债期货

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	402,361.06
2	应收证券清算款	5,358,534.12
3	应收股利	-
4	应收利息	23,351,802.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,112,697.55

8.12.4 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