

# 融通月月添利定期开放债券型证券投资基金 2015 年半年 度报告

2015 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2015 年 8 月 25 日

## § 1 重要提示及目录

### 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据融通月月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 2015 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	30
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.....	31
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	31
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.....	31
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.....	31
7.7 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	31
7.8 投资组合报告附注.....	32
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>32</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	32
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	33
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	33

<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>33</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>34</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	34
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	34
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	34
10.4 基金投资策略的改变.....	34
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	34
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	34
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	34
10.8 其他重大事件.....	35
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>36</b>
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>36</b>
12.1 备查文件目录.....	36
12.2 存放地点.....	37
12.3 查阅方式.....	37

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	融通月月添利定期开放债券型证券投资基金	
基金简称	融通月月添利定期开放债券	
基金主代码	000437	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014 年 8 月 29 日	
基金管理人	融通基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	801,039,269.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	融通月月添利定期开放债券 A	融通月月添利定期开放债券 B
下属分级基金的交易代码:	000437	000438
报告期末下属分级基金的份额总额	800,809,410.65 份	229,859.07 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	本基金业绩比较基准为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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	95599
传真	(0755) 26935005	(010) 68121816
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	518053	100031

法定代表人	高峰	刘士余
-------	----	-----

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

# § 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	融通月月添利定期开放债券 A	融通月月添利定期开放债券 B
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)	报告期(2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	24,983,380.10	6,740.21
本期利润	41,590,839.48	11,498.27
加权平均基金份额本期利润	0.0519	0.0500
本期加权平均净值利润率	4.99%	4.82%
本期基金份额净值增长率	5.14%	4.95%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	30,407,048.63	8,021.12
期末可供分配基金份额利润	0.0380	0.0349
期末基金资产净值	851,417,899.64	243,668.96
期末基金份额净值	1.063	1.060
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	7.35%	7.05%

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

融通月月添利定期开放债券 A

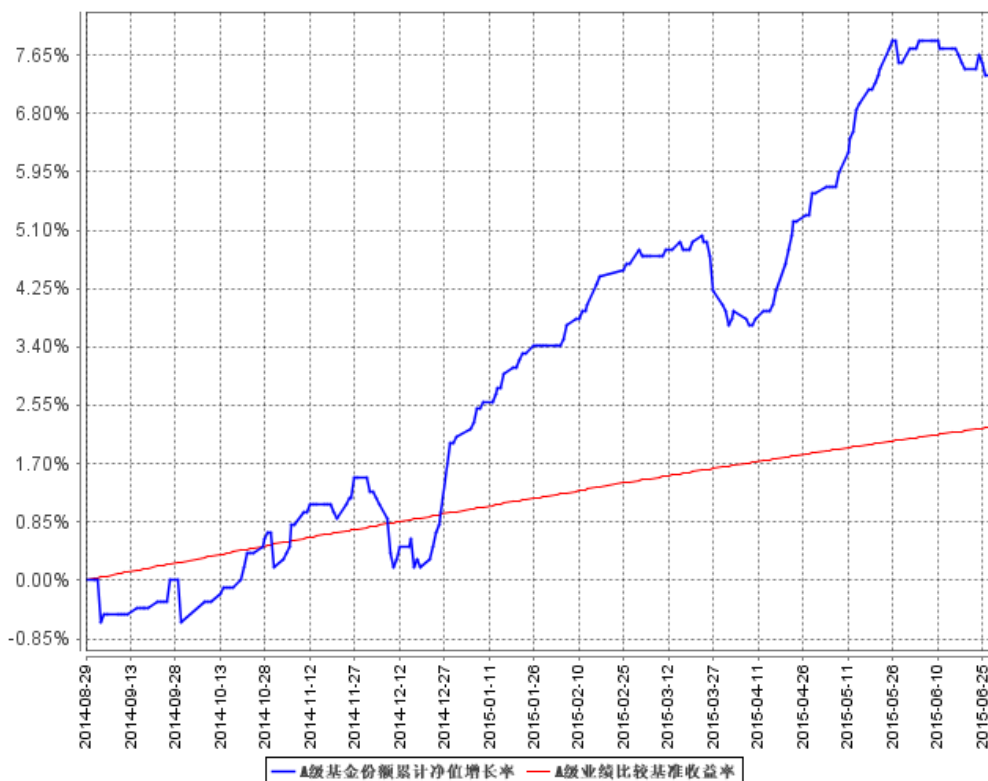
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.19%	0.09%	0.18%	0.01%	-0.37%	0.08%
过去三个月	3.30%	0.13%	0.59%	0.01%	2.71%	0.12%
过去六个月	5.14%	0.12%	1.24%	0.01%	3.90%	0.11%
自基金合同生效起至今	7.35%	0.16%	2.24%	0.01%	5.11%	0.15%

融通月月添利定期开放债券 B

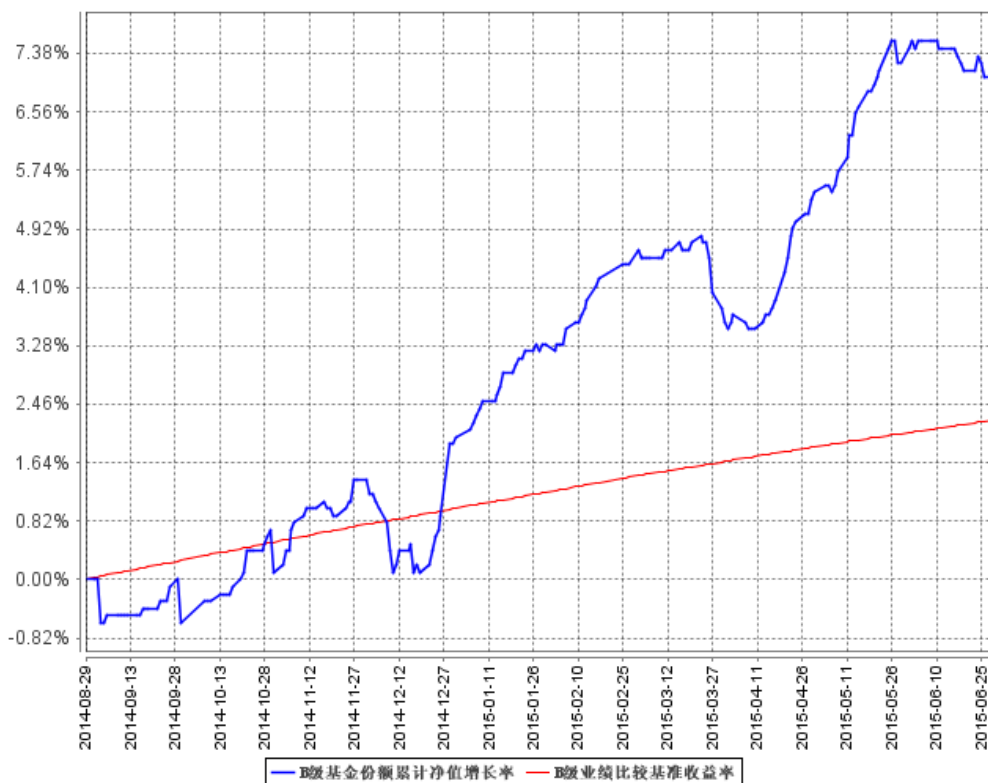
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.19%	0.09%	0.18%	0.01%	-0.37%	0.08%
过去三个月	3.31%	0.12%	0.59%	0.01%	2.72%	0.11%
过去六个月	4.95%	0.12%	1.24%	0.01%	3.71%	0.11%
自基金合同生效起至今	7.05%	0.16%	2.24%	0.01%	4.81%	0.15%

### 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

**A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



**B级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图**



注：1、本基金合同生效日为 2014 年 8 月 29 日。

2、本基金的建仓期为自基金合同生效日起 6 个月。截至报告期末，各项资产配置比例符合规



定。

## § 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 2015 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有三十一只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；三十只开放式基金，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、融通医疗保健行业混合基金、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、融通通泽混合基金、融通通福分级债券基金、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、融通健康产业灵活配置混合基金、融通转型三动力灵活配置混合基金、融通互联网传媒灵活配置混合基金、融通新区新经济灵活配置混合基金、融通通鑫灵活配置混合基金和融通新能源灵活配置混合基金。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		
王纯	本基金的基金经理	2014 年 11 月 29 日	2015 年 8 月 6 日	8	经济学硕士，具有证券从业资格。2007 年 9 月至 2007 年 12 月在中诚信国际工作，任信用分析师；2008 年 1 月至 2008 年 12 月在招商证券工作，任债券研究员；2009 年 1 月至 2013 年 10 月在中投证券工作，任债券研究员。2013 年 12 月加入融通基金管理有限公司，任

					债券研究员。
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、融通岁岁添利定期开放债券基金的基金经理。	2014 年 8 月 29 日	2015 年 3 月 14 日	9	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：（1）任免日期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。

（2）2015 年 8 月 6 日起，王纯女士不再担任本基金的基金经理，由汪曦先生担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2015 年 8 月 6 日在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 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。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

2015 年上半年经济仍在低位徘徊，虽央行数次降息、降准，并放开二套房购置条件，但仍未有效拉动经济上行。在央行宽松的货币政策影响下，债券市场出现牛陡行情，收益率曲线陡峭化下行趋势明显。1 季度在对政策预期落空、地方债供给超预期的背景下，收益率曲线出现了小幅上行；2 季度央行宽松意图明确，收益率曲线短端首先出现大幅下行，并带动中长端收益率小幅下行。信用市场虽出现了包括 ST 湘鄂债、ST 中富债等违约事件，但由于此前市场已预期较为充分，收益率未受到明显冲击，信用利差反倒小幅收窄。

融通月月添利基金今年以来积极配置中高等级信用债券和城投债，并适当提高了基金的杠杆水平。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类基金份额净值增长率为 5.14%，B 类基金份额净值增长率为 4.95%，同期业绩比较基准为 1.24%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前上半年全面放松的货币政策效果不佳，显示货币政策向实体经济传导的途径不畅通，因此未来经济调控手段或将发生较大变化。政策大概率将由宽货币转向宽信用，财政将全面发力，货币政策将配合财政政策由全面放松向定向放松转变。同于政策传导致实体经济仍需时间，因此三季度经济保持低迷的可能性较大；而四季度的经济状况则需看政策力度。货币政策上，央行有必要继续宽松货币，债券市场利率 3 季度大概率将继续下行。下一阶段本基金将继续关注信用债的投资机会，择机调整仓位水平。

## 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应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

本基金于 2015 年 1 月 9 日实施利润分配，以 2014 年 12 月 31 日的可分配收益为基准，融通月月添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.10 元，融通月月添利定期开放债券 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

无。

## § 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—融通基金管理有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，融通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，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

本托管人认为，融通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净

值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 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：融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,876,850.90	2,960,851.51
结算备付金		46,851,869.80	29,390,999.77
存出保证金		3,635.12	44,656.46
交易性金融资产	6.4.7.2	1,394,894,098.70	1,138,896,359.68
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,359,018,098.70	1,103,066,359.68
资产支持证券投资		35,876,000.00	35,830,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		9,506,528.24	-
应收利息	6.4.7.5	37,444,790.68	16,715,697.21
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,491,577,773.44	1,188,008,564.63
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2014 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		628,999,729.40	369,000,000.00
应付证券清算款		10,001,898.94	237,536.07
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		491,300.56	480,062.42
应付托管费		140,371.61	137,160.68
应付销售服务费		70.34	68.66

应付交易费用	6.4.7.7	10,994.21	4,594.95
应交税费		-	-
应付利息		3,400.68	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	268,439.10	80,000.00
负债合计		639,916,204.84	369,939,422.78
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	801,039,269.72	801,038,800.02
未分配利润	6.4.7.10	50,622,298.88	17,030,341.83
所有者权益合计		851,661,568.60	818,069,141.85
负债和所有者权益总计		1,491,577,773.44	1,188,008,564.63

注：报告截止日 2015 年 6 月 30 日，融通月月添利基金份额总额 801,039,269.72 份；其中 A 类基金份额净值为 1.063 元，基金份额为 800,809,410.65 份；B 类基金份额净值为 1.060 元，基金份额为 229,859.07 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		50,672,448.61
1. 利息收入		30,212,889.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	331,998.19
债券利息收入		28,946,134.86
资产支持证券利息收入		934,756.09
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益		3,847,342.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	3,847,342.03
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	-
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	16,612,217.44
4. 汇兑收益		-
5. 其他收入	6.4.7.18	-
<b>减：二、费用</b>		9,070,110.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,893,945.67

2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	826, 841. 57
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	414. 29
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	1, 395. 01
5. 利息支出		5, 133, 624. 51
其中：卖出回购金融资产支出		5, 133, 624. 51
6. 其他费用	6. 4. 7. 20	213, 889. 81
<b>三、利润总额</b>		<b>41, 602, 337. 75</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润</b>		<b>41, 602, 337. 75</b>

注：本基金合同生效日为 2014 年 8 月 29 日，无上年度同期比较数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	801, 038, 800. 02	17, 030, 341. 83	818, 069, 141. 85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	41, 602, 337. 75	41, 602, 337. 75
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	469. 70	7. 10	476. 80
其中：1. 基金申购款	469. 70	7. 10	476. 80
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	-	-8, 010, 387. 80	-8, 010, 387. 80
五、期末所有者权益（基金净值）	801, 039, 269. 72	50, 622, 298. 88	851, 661, 568. 60

注：本基金合同生效日为 2014 年 8 月 29 日，无上年度同期比较数据。

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：

孟朝霞

基金管理人负责人

颜锡廉

主管会计工作负责人

刘美丽

会计机构负责人

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

融通月月添利定期开放债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1435 号《关于核准融通月月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《融通月月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 800,996,561.61 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(2014)第 482 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2014 年 8 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 801,038,800.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 42,238.41 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

根据《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和《融通月月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。

本基金以定期开放方式运作，本基金的封闭期为自基金合同生效日起(包括基金合同生效日)或自每一开放期结束之日次日起(包括该日)一年的期间。本基金自基金合同生效日起每封闭一年集中开放申购与赎回一次，开放期不超过 10 个工作日。本基金封闭期内不办理申购与赎回业务，也不上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通月月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(含分离型可转换债券)、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。本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，但在每次开放期前三个月、开放期及开放期结束后三个月的期间内，基金投资不受上述比例限制；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。本基金的业绩比较基准为一年期银行定期存款税后收益率。

#### 6.4.2 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 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》和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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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

本基金本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告一致,会计估计与最近一期年度报告不一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日
活期存款	2,876,850.90
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	2,876,850.90

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	846,139,855.71	861,377,098.70
	银行间市场	492,547,017.63	497,641,000.00
	合计	1,338,686,873.34	1,359,018,098.70
资产支持证券	36,000,000.00	35,876,000.00	-124,000.00
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,374,686,873.34	1,394,894,098.70	20,207,225.36

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

###### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中所取得的债券。

## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	574.86
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	21,083.30
应收债券利息	36,658,533.72
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	764,598.80
合计	37,444,790.68

## 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	10,994.21
合计	10,994.21

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	268,439.10
合计	268,439.10

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

融通月月添利定期开放债券 A		
项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	800,809,361.64	800,809,361.64
本期申购	49.01	49.01

本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	800,809,410.65	800,809,410.65

金额单位：人民币元

融通月月添利定期开放债券 B		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	229,438.38	229,438.38
本期申购	420.69	420.69
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	229,859.07	229,859.07

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

融通月月添利定期开放债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,431,761.62	3,593,980.59	17,025,742.21
本期利润	24,983,380.10	16,607,459.38	41,590,839.48
本期基金份额交易产生的变动数	0.40	0.39	0.79
其中：基金申购款	0.40	0.39	0.79
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-8,008,093.49	-	-8,008,093.49
本期末	30,407,048.63	20,201,440.36	50,608,488.99

单位：人民币元

融通月月添利定期开放债券 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,572.29	1,027.33	4,599.62
本期利润	6,740.21	4,758.06	11,498.27
本期基金份额交易产生的变动数	2.93	3.38	6.31
其中：基金申购款	2.93	3.38	6.31
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,294.31	-	-2,294.31
本期末	8,021.12	5,788.77	13,809.89

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	292,492.42
其他	178.16
合计	331,998.19

#### 6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,274,695.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,415,000.00
减：应收利息总额	12,353.07
买卖债券差价收入	3,847,342.03

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属差价收入。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益/损失。

#### 6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年1月1日至2015年6月30日
1. 交易性金融资产	16,612,217.44
——股票投资	-
——债券投资	16,566,217.44
——资产支持证券投资	46,000.00
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	16,612,217.44

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	45.01
银行间市场交易费用	1,350.00
合计	1,395.01

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	10,450.71
债券帐户维护费	15,000.00
合计	213,889.81

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 本基金于 2015 年 7 月 14 日实施 2015 年第 2 次利润分配，以 2015 年 6 月 30 日的可分配收益为基准，融通月月添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.18 元，融通月月添利定期开放债券 B 每 10 份基金份额派发红利 0.18 元。

2. 本基金于 2015 年 8 月 10 日实施 2015 年第 3 次利润分配，以 2015 年 7 月 31 日的可分配收益为基准，融通月月添利定期开放债券 A 每 10 份基金份额派发红利 0.15 元，融通月月添利定期开放债券 B 每 10 份基金份额派发红利 0.13 元。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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”)	基金管理人的股东

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,893,945.67
其中：支付销售机构的客户维护费	1,346.86

注：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 0.70%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 × 0.70% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	826,841.57

注：支付基金托管人中国农业银行的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

###### 6.4.10.2.3 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		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	融通月月添利定期 开放债券 A	融通月月添利定期 开放债券 B	合计
融通基金管理有限公司	-	219.80	219.80

中国农业银行	-	183.01	183.01
合计	-	402.81	402.81

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 B 类基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	2,876,850.90	39,327.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按同业利率计息。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

融通月月添利定期开放债券 A

金额单位：人民币元



序号	权益 登记日	除息日	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	本期利润分配 合计	备注
1	2015 年 1 月 9 日	2015 年 1 月 9 日	0.1000	8,008,043.69	49.80	8,008,093.49	-
合计	-	-	0.1000	8,008,043.69	49.80	8,008,093.49	-

## 融通月月添利定期开放债券 B

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	本期利润分配 合计	备注
1	2015 年 1 月 9 日	2015 年 1 月 9 日	0.1000	1,867.31	427.00	2,294.31	-
合计	-	-	0.1000	1,867.31	427.00	2,294.31	-

## 6.4.12 期末（2015 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 99,999,750.00 元，是以如下债券作为抵押：

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
101464033	14 连云发 MTN001	2015-07-01	105.44	200,000	21,088,000.00
101462033	14 南昌工业 MTN001	2015-07-01	101.64	400,000	40,656,000.00
101464039	14 郑州建投 MTN001	2015-07-01	101.62	400,000	40,648,000.00
合计				1,000,000	102,392,000.00

## 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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款余额 528,999,979.40 元，于 2015 年 7 月 1 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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是债券型基金，主要投资于固定收益类金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进

行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未投资短期信用评级债券。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

长期信用评级	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	438,982,898.70	290,009,756.98
AAA 以下	920,035,200.00	813,056,602.70
未评级	-	-
合计	1,359,018,098.70	1,103,066,359.68

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的

10%。本基金所持证券在证券交易所上市或在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2015 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款 99,999,750.00 元将在一个月以内到期且计息外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,876,850.90	-	-	-	2,876,850.90
结算备付金	46,851,869.80	-	-	-	46,851,869.80
存出保证金	3,635.12	-	-	-	3,635.12
交易性金融资产	493,058,398.70	493,865,700.00	372,094,000.00	35,876,000.00	1,394,894,098.70
应收证券清算款	-	-	-	9,506,528.24	9,506,528.24
应收利息	-	-	-	37,444,790.68	37,444,790.68
资产总计	542,790,754.52	493,865,700.00	372,094,000.00	82,827,318.92	1,491,577,773.44
负债					
卖出回购金融资产款	628,999,729.40	-	-	-	628,999,729.40
应付证券清算款	-	-	-	10,001,898.94	10,001,898.94

应付管理人报酬	-	-	-	491,300.56	491,300.56
应付托管费	-	-	-	140,371.61	140,371.61
应付销售服务费	-	-	-	70.34	70.34
应付交易费用	-	-	-	10,994.21	10,994.21
应付利息	-	-	-	3,400.68	3,400.68
其他负债	-	-	-	268,439.10	268,439.10
负债总计	628,999,729.40	-	-	10,916,475.44	639,916,204.84
利率敏感度缺口	-86,208,974.88	493,865,700.00	372,094,000.00	71,910,843.48	851,661,568.60
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,960,851.51	-	-	-	2,960,851.51
结算备付金	29,390,999.77	-	-	-	29,390,999.77
存出保证金	44,656.46	-	-	-	44,656.46
交易性金融资产	19,816,000.00	1,103,676,670.68	15,403,689.00	-	1,138,896,359.68
应收利息	-	-	-	16,715,697.21	16,715,697.21
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	52,212,507.74	1,103,676,670.68	15,403,689.00	16,715,697.21	1,188,008,564.63
负债					
卖出回购金融资产款	369,000,000.00	-	-	-	369,000,000.00
应付证券清算款	-	-	-	237,536.07	237,536.07
应付管理人报酬	-	-	-	480,062.42	480,062.42
应付托管费	-	-	-	137,160.68	137,160.68
应付销售服务费	-	-	-	68.66	68.66
应付交易费用	-	-	-	4,594.95	4,594.95
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	369,000,000.00	-	-	939,422.78	369,939,422.78
利率敏感度缺口	-316,787,492.26	1,103,676,670.68	15,403,689.00	15,776,274.43	818,069,141.85

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2015 年 6 月 30 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	市场利率下降 25 个基点	9,312,947.04	8,539,514.51
	市场利率上升 25 个基点	-9,209,995.38	-8,441,713.15

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 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	1,394,894,098.70	93.52
	其中：债券	1,359,018,098.70	91.11
	资产支持证券	35,876,000.00	2.41
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	49,728,720.70	3.33
7	其他各项资产	46,954,954.04	3.15
8	合计	1,491,577,773.44	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	861,119,900.00	101.11

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	497,641,000.00	58.43
7	可转债	257,198.70	0.03
8	其他	-	-
9	合计	1,359,018,098.70	159.57

### 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	122041	09 招金债	800,000	81,000,000.00	9.51
2	124367	13 锡城发	700,000	73,297,000.00	8.61
3	124149	13 镇水投	700,000	70,224,000.00	8.25
4	124979	14 陂城投	600,000	61,632,000.00	7.24
5	101456071	14 石国投 MTN005	600,000	61,140,000.00	7.18

### 7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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	119128	14 长热 04	100,000	10,000,000.00	1.17
2	1489162	14 上银 1B	100,000	9,876,000.00	1.16
3	119127	14 长热 03	60,000	6,000,000.00	0.70
4	119125	14 长热 01	50,000	5,000,000.00	0.59
5	119126	11 长热 02	50,000	5,000,000.00	0.59

### 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

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 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

本基金本报告期末投资国债期货。

### 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	3,635.12
2	应收证券清算款	9,506,528.24
3	应收股利	-
4	应收利息	37,444,790.68
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,954,954.04

#### 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	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
融通月月添利定期开放债券 A	195	4,106,714.93	800,041,222.22	99.90%	768,188.43	0.10%
融通月月添利定期开放债券 B	274	838.90	0.00	0.00%	229,859.07	100.00%



合计	469	1,707,792.86	800,041,222.22	99.88%	998,047.50	0.12%
----	-----	--------------	----------------	--------	------------	-------

### 8.2 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
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通月月添利定期开放债券 A	14,295.55	0.0018%
	融通月月添利定期开放债券 B	27,497.43	11.9627%
	合计	41,792.98	0.0052%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	融通月月添利定期开放债券 A 类	0
	融通月月添利定期开放债券 B 类	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	融通月月添利定期开放债券 A 类	0
	融通月月添利定期开放债券 B 类	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通月月添利定期开放债券 A	融通月月添利定期开放债券 B
基金合同生效日（2014 年 8 月 29 日）基金份额总额	800,809,361.64	229,438.38
本报告期期初基金份额总额	800,809,361.64	229,438.38
本报告期基金总申购份额	49.01	420.69
减：本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	800,809,410.65	229,859.07

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人的重大人事变动：

2015 年 3 月 14 日，本基金管理人发布公告，蔡奕奕不再担任本基金基金经理，具体内容请参阅 2015 年 3 月 14 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的相关公告。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的  
需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询  
服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据  
基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步  
骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、本报告期内基金租用交易单元无变更，原申银万国证券吸收合并宏源证券后变更为申万宏  
源证券。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例	成交金额	占当期债 券回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例
申万宏源	-	-	2,222,000,000.00	4.69%	-	-
中信证券	43,687,114.00	100.00%	45,126,900,000.00	95.31%	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	披露日期
1	融通月月添利定期开放债券型证 券投资基金第一次分红公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、管理人网站	2015-1-7
2	融通月月添利定期开放债券型证 券投资基金基金经理离任公告	中国证券报、证券时报、 上海证券报、管理人网站	2015-3-14
3	融通基金关于新时代证券新增代	中国证券报、证券时报、	2015-4-1

	销公司旗下部分基金的公告	上海证券报、管理人网站	
4	关于融通旗下部分开放式基金参加银河证券基金申购（含定投）费率优惠的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2015-4-20
5	关于融通旗下部分开放式基金新增渤海银行为代销机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2015-5-11
6	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加农业银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2015-5-30
7	融通基金关于新增国金证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2015-6-15
8	融通基金关于新增中国国际金融股份有限公司为销售机构的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、管理人网站	2015-6-26

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》，经与托管银行、会计师事务所协商一致，自 2015 年 3 月 27 日起本基金对持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

具体内容请参阅 2015 年 3 月 28 日刊登在指定信息披露媒体上刊登的《融通基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告》。

2、本基金的基金管理人融通基金管理有限公司 2015 年 7 月 25 日刊登高管人员变更公告，田德军先生因个人原因辞去公司董事长职务，由高峰先生担任公司董事长职务。

具体内容请参阅 2015 年 7 月 25 日刊登在指定信息披露媒体上刊登的《融通基金管理有限公司关于高管人员变更的公告》。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- （一）中国证监会批准融通月月添利定期开放债券型证券投资基金设立的文件
- （二）《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金基金合同》
- （三）《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金托管协议》
- （四）《融通月月添利定期开放债券型证券投资基金招募说明书》及其更新

(五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件和营业执照

(七) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。