# 融通月月添利定期开放债券型证券投资基金 2018年年度报告摘要

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:2019年3月27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2019年3月25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2018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 | 526,831,277.02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 | 522,688,460.28份 | 4,142,816.74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 | 徐卫东 | 贺倩 |
| | 联系电话 | (0755)26948666 | (010)66060069 |
| | 电子邮箱 | service@mail.rtfund.com | tgxxpl@abchina.com |
| 客户服务电话 | | 400-883-8088、(0755)26948088 | 95599 |
| 传真 | | (0755)26935005 | (010)68121816 |

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 | 2018年 | | 2017年 | | 2016年 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 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 | 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 | 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 |
| 本期已实现收益 | 23,287,537.78 | 237,358.18 | -38,190,321.84 | -2,959,418.78 | 53,941,453.33 | 841,021.06 |
| 本期利润 | 39,283,572.21 | 426,356.48 | -27,113,729.18 | -2,010,387.22 | -14,425,947.16 | -3,221,999.09 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0687 | 0.0645 | -0.0247 | -0.0303 | -0.0136 | -0.1477 |
| 本期基金份额净值增长率 | 7.12% | 6.85% | -2.29% | -2.59% | -0.56% | -0.86% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018年末 | | 2017年末 | | 2016年末 | |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0107 | 0.0066 | -0.0224 | -0.0256 | 0.0116 | 0.0108 |
| 期末基金资产净值 | 546,163,783.02 | 4,310,877.37 | 571,135,715.26 | 7,026,248.54 | 1,265,629,153.31 | 84,972,903.49 |
| 期末基金份额净值 | 1.045 | 1.041 | 0.983 | 0.979 | 1.012 | 1.011 |

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

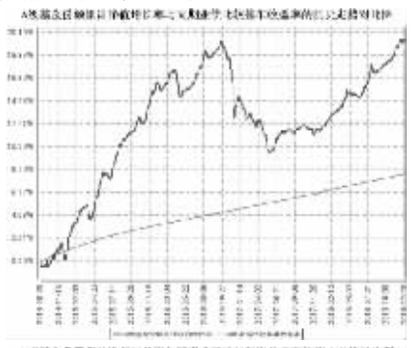
融通月月添利定期开放债券A

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.94% | 0.07% | 0.38% | 0.00% | 1.56% | 0.07% |
| 过去六个月 | 4.16% | 0.08% | 0.76% | 0.00% | 3.40% | 0.08% |
| 过去一年 | 7.12% | 0.08% | 1.50% | 0.00% | 5.62% | 0.08% |
| 过去三年 | 4.09% | 0.11% | 4.50% | 0.00% | -0.41% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 19.80% | 0.12% | 7.62% | 0.00% | 12.18% | 0.12% |

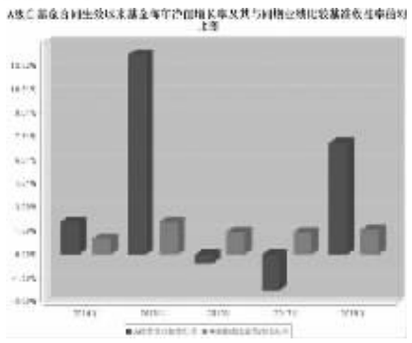
融通月月添利定期开放债券B

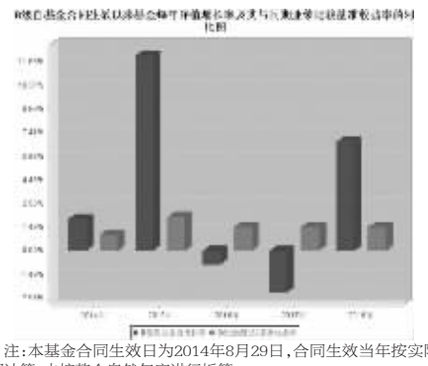
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 1.85% | 0.07% | 0.38% | 0.00% | 1.47% | 0.07% |
| 过去六个月 | 3.98% | 0.08% | 0.76% | 0.00% | 3.22% | 0.08% |
| 过去一年 | 6.85% | 0.07% | 1.50% | 0.00% | 5.35% | 0.07% |
| 过去三年 | 3.19% | 0.11% | 4.50% | 0.00% | -1.31% | 0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 18.12% | 0.12% | 7.62% | 0.00% | 10.50% | 0.12% |

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





注:本基金合同生效日为2014年8月29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

单位:人民币元

| 融通月月添利定期开放债券A | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 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 |
| 2018 | 0.0800 | 282,758.06 | 3,869,044.84 | 4,151,802.90 | |
| 2017 | 0.0600 | 6,259,569.32 | 1,247,108.64 | 7,506,677.96 | |
| 2016 | 0.5030 | 47,679,005.16 | 5,792,386.30 | 53,471,391.46 | |
| 合计 | 0.6430 | 54,221,332.54 | 10,908,539.78 | 65,129,872.32 | |

单位:人民币元

| 融通月月添利定期开放债券B | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 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 |
| 2018 | 0.0500 | 20,047.99 | 662.84 | 20,710.83 | |
| 2017 | 0.0600 | 122,886.60 | 381,520.38 | 504,406.98 | |
| 2016 | 0.4620 | 744,430.80 | 410,475.49 | 1,154,906.29 | |
| 合计 | 0.5720 | 887,365.39 | 792,658.71 | 1,680,024.10 | |

§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:新时代证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司(Nikko AssetManagement Co.,Ltd.)40%。

截至2018年12月31日,公司共管理六十五只开放式基金:即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证100指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金(LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金(LOF)、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通中证军工指数分级证券投资基金、融通中证全指证券公司指数分级证券投资基金、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通成长30灵活配置混合型证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风1号灵活配置混合型证券投资基金、融通通盈保本混合型证券投资基金、融通增利债券型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通增祥债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通国企改革新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金(LOF)、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金(LOF)、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金(QDII)、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通嫦娥债券型证券投资基金、融通通臻债券型证券投资基金、融通通利债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金、融通通祥债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通丰利四分法证券投资基金(QDII)。其中,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 | | |
| 朱浩然 | 本基金的基金经理 | 2017年9月8日 | - | 6 | 朱浩然先生,中央财经大学经济学硕士,经济学学士。6年证券投资从业经历,具有基金从业资格。现任融通基金管理有限公司固定收益部基金经理。历任华夏基金管理有限公司机构投资部信用研究员、交易管理部交易员、机构债券投资部基金研究员、上海华朴资产管理有限公司投资经理。2017年2月加入融通基金管理有限公司,历任固定收益部专户投资经理,现任融通通福债券(LOF)、融通月月添利定期开放债券、融通通源短融债券、融通通泰保本混合型证券投资基金、融通通祺债券、融通通瑞债券、融通通悦债券、融通通捷债券、融通增辉定期开放债券发起式基金的基金经理。 |
| 张一格 | 本基金的基金经理、固定收益投资总监 | 2016年8月24日 | 2018年3月24日 | 12 | 张一格先生,中国人民银行研究生部经济学硕士,南开大学经济学学士,英国特许金融分析师(CIFA)。12年证券投资从业经历,具有基金从业资格。现任融通基金管理有限公司固定收益投资总监。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券等基金的基金经理。2015年6月加入融通基金管理有限公司,现任融通通盈保本混合、融通通裕定期开放债券发起式、融通收益增强债券、融通通昊定期开放债券发起式、融通通源短融债券基金的基金经理。 |

注:任职日期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

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

2018年年初以来,随着前期金融监管、地方政府债务监管带来的信用收缩逐步影响实体经济,以及中美贸易战不断发酵,央行货币政策转向明显,实施了多次降准、MLF放量续作、大量投放OMO等措施,整体流动性维持宽松态势,上半年长端利率也走出了较大幅度的行情,利率债呈现牛陡形态。三季度在通胀、地方债供给及基建发力的担忧下,收益率陷入震荡,四季度收益率在宽信用不及预期的背景下重新选择下行。

组合在春节之后即开始逐步提高久期,并逐步减持转债,保持了组合的高杠杆操作,适当辅以长久期利率债的波段操作。组合整体在2018年实现了净值增长。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通月月添利定期开放债券A基金份额净值为1.045元,本报告期基金份额净值增长率为7.12%;截至本报告期末融通月月添利定期开放债券B基金份额净值为1.041元,本报告期基金份额净值增长率为6.85%;同期业绩比较基准收益率为1.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2019年,我们认为债市收益率仍有下行空间。

第一,经济基本面角度,整体我们认为国内经济面临持续的压力,最新的官方、财新PMI全面走弱。社融余额增速仍在下滑趋势中,数据主要体现在非标上,今年1-11月委托贷款+信托贷款收缩4.77万亿,收缩趋势仍在。银行表内信贷结构仍差,表内票据今年1-11月新增加1.55万亿,而去年同期净减少1.72万亿,表内企业中长期贷款今年1-11月新增金额比去年同期减少7700亿。

地产商、地方政府、家庭作为加杠杆的主体,目前均面临压力。地产商和地方政府加快周转带来投资高企,但土地流拍增加,土地购置分项的领先指标显示土地购置费对地产投资的支撑已经开始见顶回落,高投资可持续性不强。《资管新规》和对地方政府融资行为、问责等各方面限制了地方政府加杠杆的能力和意愿,比如湖南、新疆、广西等。居民部门方面,再分配过程对居民消费不利,可支配收入增速低于名义GDP增长,低于企业利润增长,低于税收增速,目前居民新增贷款占可支配收入已经达到09年以后新高。2008-2017年住户部门债务收入比从43%上升到112%,房贷收入比从22.6%上升到60.5%。

第二,整体政策方向角度,最近民企疏困等方面的政策较为密集,但目前融资走弱的限制因素包括商业银行风险偏好走低、坏账压力、地方政府隐形债务的监管,依靠政策来推动宽信用存在较大的难度。只要没有运动式的放松地产、放松地方政府监管和强压商业银行扩大信贷,我们认为融资反弹的可能性不大,进而对经济的预期尚难以改善。

第三,资金面与流动性角度,2018年年初以来,货币政策对流动性的表述从"合理稳定"逐渐转向"合理充裕",操作行为上定向降准、降准置换MLF等释放呵护信号,短端资金利率和中端NCD利率中枢下行明显,市场对货币政策的认知也从"怀疑其可持续性"逐渐到"确认、相信和定价"转变。3季度的国常会与政治局会议进一步确认流动性合理充裕的信号,信用收缩和贸易摩擦背景下,央行有必要维持适度宽松的流动性,整体我们认为债券收益率波动中枢仍有下行空间。

但是,从性价比来看,我们认为2019年利率品不如中等久期信用债加杠杆套息更优,因此在组合久期中,信用债贡献比例会增大,利率债贡献比例会适当减小,会更加积极地挖掘转债的投资机会。在2019年,我们将继续努力为持有人提供相对稳定的净值增长。

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、参考独立第三方估值服务机构的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与基金托管人核对,同时负责对外进行信息披露。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。

截至本报告期末,本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议,由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

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2018年12月19日实施2018年第一次利润分配,以2018年11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0.08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0.05元。

本基金于2019年1月14日实施2018年第二次利润分配,以2018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0.06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

本报告期内,本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§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 2018 年 1 月 1 日至 2018年12月31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 审计报告

本基金2018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(2019)第21141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:融通月月添利定期开放债券型证券投资基金

报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 563,880.03 | 465,533.93 |
| 结算备付金 | 1,707,806.42 | 4,577,226.66 |
| 存出保证金 | 49,265.43 | 57,253.52 |
| 交易性金融资产 | 819,419,470.47 | 723,413,801.70 |
| 其中:股票投资 | - | - |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 775,419,470.47 | 723,413,801.70 |
| 资产支持证券投资 | 44,000,000.00 | - |
| 贵金属投资 | - | - |
| 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 | 13,355,593.29 | 13,925,959.05 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | - | - |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 835,096,015.64 | 742,439,774.86 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2018年12月31日 | 上年度末 2017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 | 283,582,262.38 | 163,500,000.00 |
| 应付证券清算款 | - | - |
| 应付赎回款 | - | - |
| 应付管理人报酬 | 326,742.50 | 343,271.97 |
| 应付托管费 | 93,354.99 | 98,077.69 |
| 应付销售服务费 | 1,283.11 | 2,086.16 |
| 应付交易费用 | 30,550.42 | 11,797.20 |
| 应交税费 | 89,627.09 | - |
| 应付利息 | 437,534.76 | 222,578.04 |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 60,000.00 | 100,000.00 |
| 负债合计 | 284,621,355.25 | 164,277,811.06 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 526,831,277.02 | 588,338,807.32 |
| 未分配利润 | 23,643,383.37 | -10,176,843.52 |
| 所有者权益合计 | 550,474,660.39 | 578,161,963.80 |
| 负债和所有者权益总计 | 835,096,015.64 | 742,439,774.86 |

注:报告截止日2018年12月31日,融通月月添利定期开放债券A基金份额净值1.045元,基金份额总额522,688,460.28份;融通月月添利定期开放债券B基金份额净值1.041元,基金份额总额4,142,816.74份。融通月月添利定期开放债券份额总额合计为526,831,277.02份。

7.2 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | 52,882,215.29 | -4,231,617.33 |
| 1.利息收入 | 37,377,285.64 | 69,799,714.61 |
| 其中:存款利息收入 | 160,273.02 | 4,392,996.90 |
| 债券利息收入 | 36,253,656.10 | 63,199,078.67 |
| 资产支持证券利息收入 | 199,385.38 | - |
| 买入返售金融资产收入 | 763,971.14 | 2,207,636.04 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益 | -680,103.08 | -86,056,956.16 |
| 其中:股票投资收益 | - | - |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -680,103.08 | -86,056,956.16 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 贵金属投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | - | - |
| 3.公允价值变动收益 | 16,185,032.73 | 12,025,624.22 |
| 4.汇兑收益 | - | - |
| 5.其他收入 | - | - |
| 减:二、费用 | 13,172,286.60 | 24,892,499.07 |
| 1. 管理人报酬 | 4,136,297.49 | 8,070,599.89 |
| 2. 托管费 | 1,181,799.29 | 2,305,885.64 |
| 3. 销售服务费 | 23,460.50 | 231,641.79 |
| 4. 交易费用 | 41,705.65 | 19,236.63 |
| 5. 利息支出 | 7,249,694.55 | 13,771,117.92 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 7,249,694.55 | 13,771,117.92 |
| 6. 税金及附加 | 109,922.55 | - |
| 7. 其他费用 | 429,406.57 | 494,117.20 |
| 三、利润总额 | 39,709,928.69 | -29,124,116.40 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润 | 39,709,928.69 | -29,124,116.40 |

7.3 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:2018年1月1日至2018年12月31日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018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) | 588,338,807.32 | -10,176,843.52 | 578,161,963.80 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 39,709,928.69 | 39,709,928.69 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -61,507,530.30 | -1,717,188.07 | -63,224,718.37 |
| 其中:1.基金申购款 | 485,419,689.23 | 18,460,793.14 | 503,880,482.37 |
| 2.基金赎回款 | -546,927,219.53 | -20,177,981.21 | -567,105,200.74 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | -4,172,513.73 | -4,172,513.73 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 526,831,277.02 | 23,643,383.37 | 550,474,660.39 |
| 项目 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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) | 1,335,180,826.10 | 15,421,230.70 | 1,350,602,056.80 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -29,124,116.40 | -29,124,116.40 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -746,842,018.78 | 11,537,127.12 | -735,304,891.66 |
| 其中:1.基金申购款 | 1,621,965.60 | 9,288.63 | 1,631,254.23 |
| 2.基金赎回款 | -748,463,984.38 | 11,527,838.49 | -736,936,145.89 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | -8,011,084.94 | -8,011,084.94 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 588,338,807.32 | -10,176,843.52 | 578,161,963.80 |

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:

_____张帆_____ _____颜锡廉_____

_____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 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

7.4.1.1 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。

7.4.1.2 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。

7.4.1.3 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。

7.4.2 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("融通基金") | 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、基金销售机构 |
| 新时代证券股份有限公司("新时代证券") | 基金管理人的股东、基金销售机构 |
| 日兴资产管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 深圳市融通资本管理股份有限公司 | 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:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 4,136,297.49 | 8,070,599.89 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 294,184.58 | 838,962.74 |

注:1、支付基金管理人融通基金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。

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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31日 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,181,799.29 | 2,305,885.64 |

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。

7.4.3.2.3 销售服务费

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 2018年1月1日至2018年12月31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 | - | 247.65 | 247.65 |
| 中国农业银行 | - | 17,870.12 | 17,870.12 |
| 合计 | - | 18,117.77 | 18,117.77 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31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 | - | 170,051.28 | 170,051.28 |
| 中国农业银行 | - | 42,140.48 | 42,140.48 |
| 合计 | - | 212,191.76 | 212,191.76 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日B类基金份额基金资产净值的0.35%计提,逐日累计至每月月底,按月支付给融通基金,再由融通基金计算并支付给各基金销售机构,其计算公式为:日销售服务费=前一日B类基金资产净值 X 0.35%/ 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.3.4.2 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

无。

7.4.3.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日 | | 上年度可比期间 2017年1月1日至2017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 |
| 中国农业银行 | 563,880.03 | 83,809.87 | 465,533.93 | 155,241.44 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.4 期末(2018年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 110049 | 海尔转债 | 2018-12-20 | 2019-1-18 | 新债未上市 | 100 | 100 | 3,140 | 313,996.87 | 313,996.87 | - |
| 7.4.12.1.2 受限证券类别:资产支持证券 | | | | | | | | | | |
| 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 |
| 139358 | 绿城7优1 | 2018-12-13 | 2019-1-9 | 资产支持证券上市 | 100 | 100 | 40,000 | 4,000,000.00 | 4,000,000.00 | - |

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018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145,082,262.38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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 011801400 | 18宛