

**财通财通宝货币市场基金 2018 年年度报告**

**2018 年 12 月 31 日**

**基金管理人:财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 03 月 29 日**

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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本基金合同规定，于2019年3月27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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	23
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	24
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	24
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	25
4.9 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	25
§5 托管人报告	25
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	25
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	25
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	26
§6 审计报告	26
6.1 审计报告基本信息	26
6.2 审计报告的基本内容	26
§7 年度财务报表	29
7.1 资产负债表	29
7.2 利润表	31
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	32
7.4 报表附注	34
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 债券回购融资情况	60
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明	60
8.3 基金投资组合平均剩余期限	60
8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况	60
8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例	60
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	62
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	62
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	63

8.9 投资组合报告附注.....	63
8.9.1 基金计价方法说明.....	63
8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期内没有出现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、处罚的情形。.....	64
8.9.3 期末其他各项资产构成.....	64
8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分.....	64
§9 基金份额持有人信息.....	64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
9.4 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情况.....	65
§10 开放式基金份额变动.....	66
§11 重大事件揭示.....	66
11.1 基金份额持有人大会决议.....	66
11.2 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.....	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
11.4 基金投资策略的改变.....	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	68
11.9 其他重大事件.....	68
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
§13 备查文件目录.....	75
13.1 备查文件目录.....	75
13.2 存放地点.....	75
13.3 查阅方式.....	75

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通财通宝货币市场基金	
基金简称	财通财通宝货币	
场内简称	-	
基金主代码	002957	
交易代码	-	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年07月27日	
基金管理人	财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	8,868,290,525.16份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B
下属分级基金的场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	002957	002958
报告期末下属分级基金的份额总额	164,196,672.45份	8,704,093,852.71份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将综合宏观经济运行状况，货币政策、财政政策等政府宏观经济状况及政策，分析资本市场资金供给状况的变动趋势，预测市场利率水平变动趋势。在此基础上，综合各类投资品种的流动性、收益性以及信用风险状况，力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	人民币活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

下属分级基金的风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
---------------	---	---

### 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	财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	武祎
	联系电话	021-20537888
	电子邮箱	service@ctfund.com
客户服务电话	400-820-9888	95599
传真	021-20537999	010-68121816
注册地址	上海市虹口区吴淞路619号505室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼	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	200120	100031
法定代表人	夏理芬	周慕冰

### 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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市银城中路68号时代金融中心41/43楼

### §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	财通财通宝货币A		
	2018年	2017年	2016年7月27日 (基金合同生效日)-2016年 12月31日
本期已实现收益	6,271,483.49	11,226,072.90	4,085,216.56
本期利润	6,271,483.49	11,226,072.90	4,085,216.56
本期净值收益率	3.2971%	3.5170%	0.8836%
3.1.2 期末数据和指标	2018年	2017年	2016年
期末基金资产净值	164,196,672.45	262,981,365.20	336,504,088.87
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
累计净值收益率	7.8749%	4.4317%	0.8836%

3.1.1 期间数据和指标	财通财通宝货币B		
	2018年	2017年	2016年7月27日 (基金合同生效日)-2016年 12月31日
本期已实现收益	175,951,866.54	173,554,344.29	51,314,522.91
本期利润	175,951,866.54	173,554,344.29	51,314,522.91
本期净值收益率	3.5457%	3.7659%	0.9884%

<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2018年	2017年	2016年
期末基金资产净值	8,704,093,852.71	2,620,444,175.72	3,933,068,225.51
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2018年末	2017年末	2016年末
累计净值收益率	8.5072%	4.7915%	0.9884%

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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等；

(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)本基金利润分配按日结转份额；

(4)本基金的《基金合同》生效日为2016年7月27日，因此主要会计数据和财务指标上上年度可比期间数据只列示从基金合同生效日至2016年12月31日的数据。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段（财通财通宝货币A）	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.6558%	0.0010%	0.0895%	0.0000%	0.5663%	0.0010%
过去六个月	1.4346%	0.0020%	0.1790%	0.0000%	1.2556%	0.0020%
过去一年	3.2971%	0.0034%	0.3555%	0.0000%	2.9416%	0.0034%
自基金合同生效起至今	7.8749%	0.0031%	0.8671%	0.0000%	7.0078%	0.0031%

注：(1)上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)本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）；



(3)本基金收益分配是按日结转份额。

阶段（财通财通宝货币 B）	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.7169%	0.0010%	0.0895%	0.0000%	0.6274%	0.0010%
过去六个月	1.5575%	0.0020%	0.1790%	0.0000%	1.3785%	0.0020%
过去一年	3.5457%	0.0034%	0.3555%	0.0000%	3.1902%	0.0034%
自基金合同生效起至今	8.5072%	0.0031%	0.8671%	0.0000%	7.6401%	0.0031%

注：(1)上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) 本基金的业绩比较基准为：人民币活期存款利率（税后）；

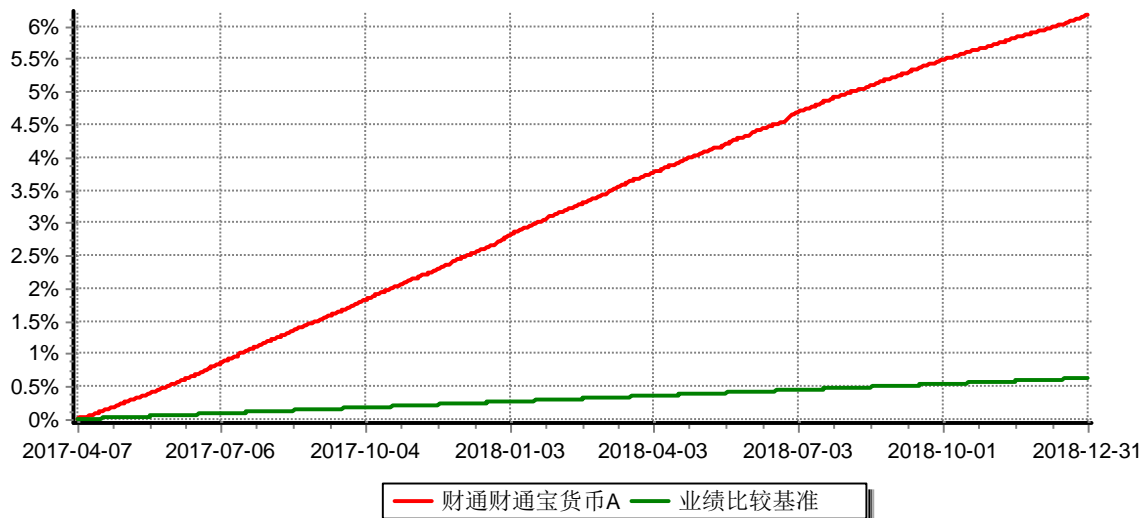
(3)本基金收益分配是按日结转份额。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

财通财通宝货币A

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

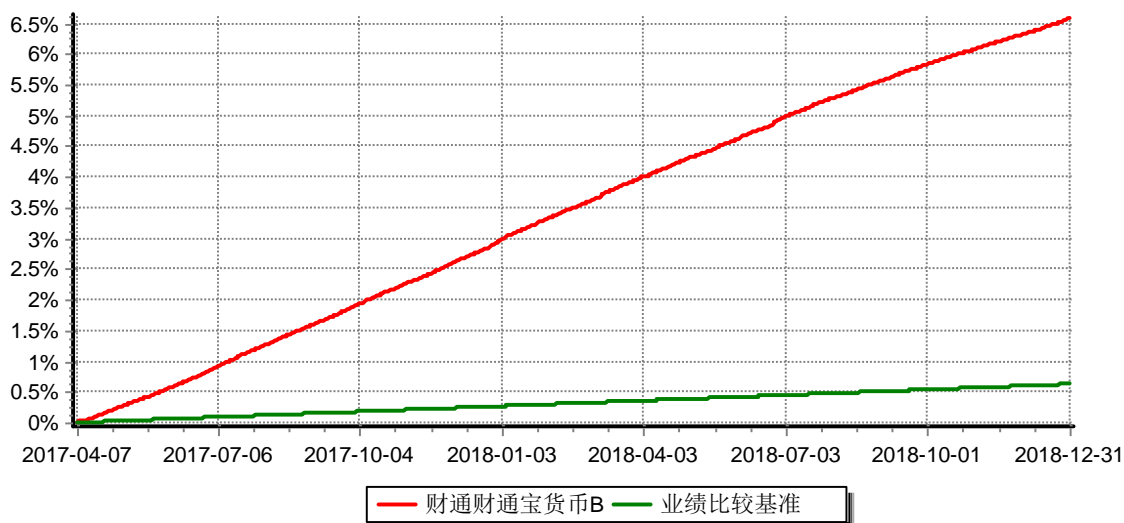
(2016年07月27日-2018年12月31日)



注：(1)本基金合同生效日为2016年7月27日；

(2)本基金建仓期为2016年7月27日至2017年1月17日，截至报告期末及建仓期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

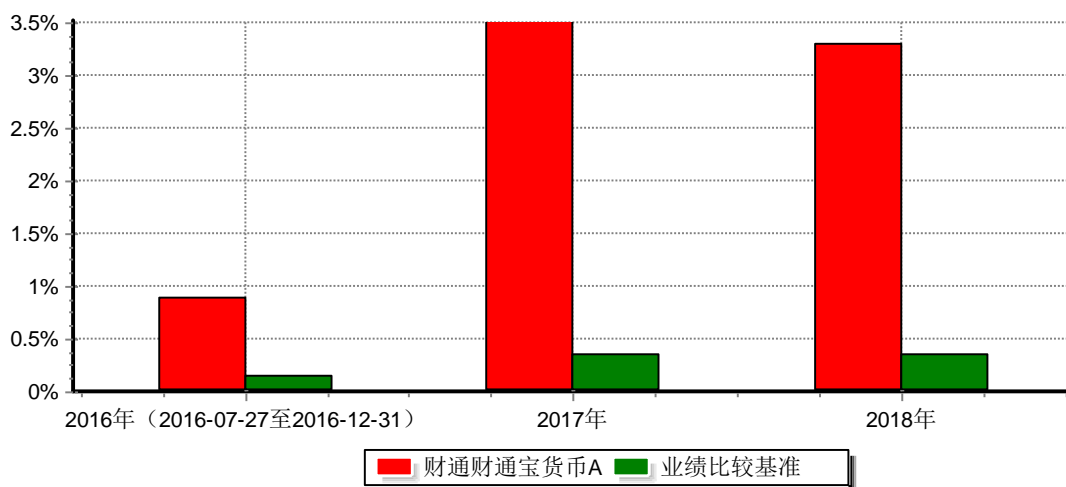
财通财通宝货币B  
 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2016年07月27日-2018年12月31日)



注：(1)本基金合同生效日为2016年7月27日；

(2)本基金建仓期为2016年7月27日至2017年1月17日，截至报告期末及建仓期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

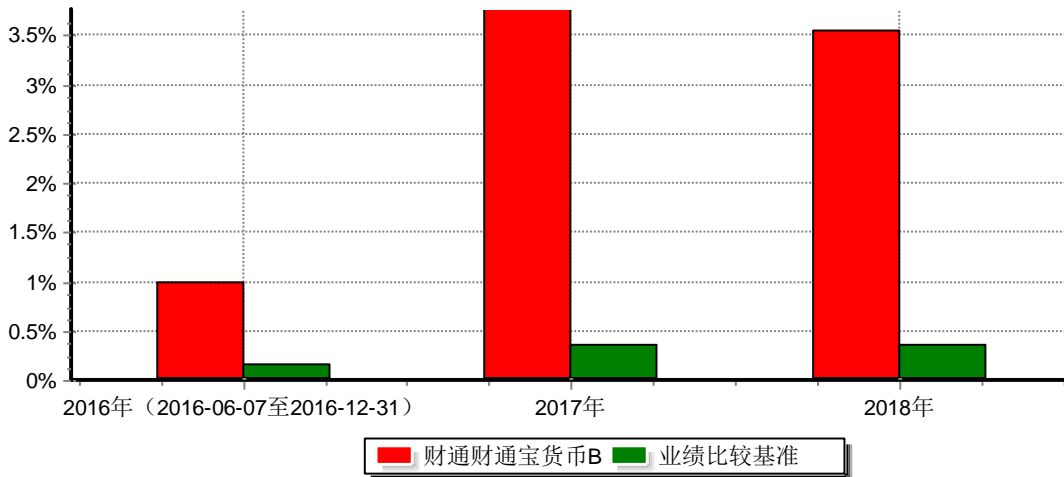
### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：(1) 本基金合同生效日为2016年7月27日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算；

(2)本基金建仓期是2016年7月27日至2017年1月17日，截至报告期末及建仓期末，基金的资产配置符

合基金契约的相关要求。



注：(1) 本基金合同生效日为2016年7月27日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算；

(2) 本基金建仓期是2016年7月27日至2017年1月17日，截至报告期末及建仓期末，基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

财通财通宝货币A

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应 付赎回款转 出金额	应付利润本 年变动	年度利润分配 合计	备注
2018年	6,333,031.53	-	-61,548.04	6,271,483.49	-
2017年	11,149,475.81	-	76,597.09	11,226,072.90	-
2016年	4,033,745.44	-	51,471.12	4,085,216.56	-
合计	21,516,252.78	-	66,520.17	21,582,772.95	-

财通财通宝货币B

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应 付赎回款转 出金额	应付利润本 年变动	年度利润分配合 计	备注
2018年	173,525,998.07	-	2,425,868.47	175,951,866.54	-

2017年	172,880,614.29	-	673,730.00	173,554,344.29	-
2016年	50,660,445.58	-	654,077.33	51,314,522.91	-
合计	397,067,057.94	-	3,753,675.80	400,820,733.74	-

## §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

财通基金管理有限公司成立于2011年6月，由财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江瀚叶股份有限公司共同发起设立，财通证券股份有限公司为第一大股东，出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币，注册地上海，经营范围为基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

财通基金始终秉承“持有人利益至上”的核心价值观，致力于为客户提供专业优质的资产管理服务。在公募业务方面，公司坚持以客户利益为出发点设计产品，逐步建立起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线，获得一定市场口碑；公司将特定客户资产管理业务作为重要发展战略之一，形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌，产品具有追求绝对收益、标的丰富、方案灵活等特点，为机构客户、高端个人客户提供个性化的理财选择。

公司现有员工184人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在10年以上。通过提供多维度、人性化的客户服务，财通基金始终与持有人保持信息透明；通过建立完备的风险控制体系，财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的投资能力、规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价值。

#### 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		
张亦博	本基金的基金经理	2016年07月27日	2018年9月26日	7年	澳大利亚莫纳什大学风险管理学硕士，特许金融分析师（CFA）。历任德邦证券有限责任公司研究所研究员，东吴证券股份有限公司资产管理总部债券研究员、债券投资经理助理，华宝证券有限责任公司资产管

					理部固定收益投资经理。2015年8月加入财通基金管理有限公司，任固定收益部基金经理。
罗晓倩	本基金的基金经理	2017年07月19日	-	6年	复旦大学投资学硕士，历任友邦保险、国华人寿、汇添富基金、华福基金、东吴证券资产管理总部投资经理。2016年5月加入财通基金管理有限公司，曾任固定收益部基金经理助理，现任固定收益部基金经理。
林洪钧	本基金的基金经理、固定收益投资总监兼固定收益部总监	2018年9月14日	-	14年	复旦大学工商管理硕士、力学与工程科学本科。历任国泰君安证券股份有限公司上海分公司机构客户部客户经理，华安基金管理有限公司债券交易员，加拿大Financial Engineering Source Inc.金融研究员，交银施罗德基金管理有限公司固定收益部债券研究员、专户投资部投资经理、固定收益部助理总经理/基金经理，光大保德信基金管理有限公司固定收益部固定收益投资总监，兴证证券资产管理有限公司固定收益投资三部固收总监，2018年8月加入财通基金管理有限公司，现任固定收益投资总监兼固定收益部总监。
张婉玉	本基金的基金经理助理	2018年8月24日		5年	上海第二工业大学学士，上海财经大学硕士在读。历任交银施罗德基金投研助理，国利货币债券经纪人，兴证资管债券交易员。2018年8月加入财通基

					金管理有限公司，现任固定收益部基金经理助理。
--	--	--	--	--	------------------------

注：(1)基金的首任基金经理，其"任职日期"为基金合同生效日，其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期；

(2)非首任基金经理，其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

(3)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

本公司现行公平交易制度主要内容附录如下：

第一条 为了进一步规范和完善财通基金管理有限公司(以下简称"公司")有关授权、

研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等业务管理，保证公司管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益，特制订本制度。

第二条 本制度根据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规以及公司管理制度制订。

第三条 本制度所称投资组合包括封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等。

第四条 公司应严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

第五条 本制度以保证公司旗下管理的不同投资组合之间不存在利益输送并得到公平对待，以及保护投资者合法权益为基本原则而制订。

第六条 本制度规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动，同时包括授权、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。

第七条 公司应合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

第八条 公司应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、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，应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。

第九条 公司研究员负责各行业上市公司的调研及研究报告的撰写，采用客观的研究方法，任何投资分析和建议均应有充分的事实和数据支持，避免主观臆断，严禁利用内幕信息作为投资依据。

公司内部建立信息公开、资源共享的公平投资管理环境。内部研究报告由行业研究员上传公司研究平台，各投资组合经理可以在同一时间接收到同样的研究信息及个股评估，对自身管理的组合做出适当的投资决定，不存在个别组合获得信息落后或不全面的情况。

第十条 公司建立健全公司适用的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，投资组合经理在此基础上根据投资授权构建具体的投资组合。

第十一条 公司执行健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组

合经理等各投资决策主体的职责和权限划分。

第十二条 公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息应相互隔离。

第十三条 公司建立系统的交易方法,即投资组合经理应根据投资组合的投资风格和投资策略,制定客观、完整的交易决策规则,并按照这些规则进行交易决策,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。

第十四条 公司要求投资组合经理承诺并落实严格遵守基金合同、特定资产管理合同及公司有关投资管理制度的规定,审慎勤勉,充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权,维护公平的投资管理环境,维护所管理投资组合的合法利益,并按照规则进行交易决策,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性,坚持投资者利益优先的原则。

第十五条 集中交易部与投资、研究部门严格实行物理隔离,以充分保障集中交易部的独立性与保密性,实行集中交易制度,同时建立和完善公平的交易分配制度,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

第十六条 投资交易系统支持公平交易功能,不同投资组合同向买卖同一证券的交易分配原则为"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"。

第十七条 严格控制同一投资组合或不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的交易行为。确因投资组合的投资策略或流动性等原因需要而发生的同日反向交易,相关投资组合经理需要事先提供决策依据,填写《特殊交易需求申请审批表》,并存档备查。但完全按照有关指数构成比例进行证券投资的投资组合可以不受此规定的限制。

第十八条 所有投资对象的投资指令必须经由集中交易部负责人或其授权人审核分配至交易员执行。进行投资指令分配的人员必须保证投资指令得到公平对待,应保证不同投资组合在同一时点就同一投资对象下达的相同方向的投资指令分配给同一交易员完成。

第十九条 对于交易所公开竞价交易,公司在投资交易系统设置强制公平交易模式,系统遇到该类两个或两个以上不同投资组合发出同向买卖指令情形时,会自动提示交易员进入公平交易模式。该模式下,在两个或两个以上投资组合的指令有效价格范围内,系统能最大限度保证参加公平交易的各投资组合所买入或卖出投资对象的价格接近。各投资组合参加公平交易委托数量按照各投资组合中尚未执行指令部分的委托数量占公平交易委托总量的比例进行分配。各投资组合指令在无交易员人为干预的情况下,各自在交易所完成交易指令。

第二十条 公司要求同一投资组合经理对其名下管理的各投资组合进行绝对公平交易执行。即同一投资组合经理如需下达同一只投资对象的买卖交易指令时,其所管理投



投资组合的所有有关指令必须在15分钟内批量下达，且指令价格必须相同，但数量可以按投资组合的规模而有所不同。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而无法进行绝对公平交易执行的，相关投资组合经理需要事先提供决策依据，填写《特殊交易需求申请审批表》，并存档备查。

第二十一条 公司要求不同投资组合经理对其名下管理的各投资组合进行相对公平交易执行。即不同的投资组合经理基于平等的信息知晓权和所管理投资组合的个别情况，分别独立做出对某一投资对象的投资决策，故下达指令的时间、限价都会有所不同。但由于是共同享有同一信息来源，不同投资组合经理在同一天就同一投资对象下达的买卖交易指令应为同向交易，限价范围比较接近但可以不同，指令的数量也可按组合的规模而有所不同。

第二十二条 投资组合经理不得为了影响股票交易价格在交易日14:50-15:00间下达交易所投资指令，如因为申购、赎回或合规控制的要求需在交易日14:50-15:00间下达交易所投资指令，投资经理必须使用录音电话通知集中交易部相关情况，并于当日收盘后及时提交书面情况说明，由集中交易部、监察稽核部和投资相关部门备案。

第二十三条 对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。公司在获配额度确定后，严格按照价格优先的原则在各投资组合间进行分配，申购价格相同的投资组合则根据投资指令的数量按比例进行分配。集中交易部必须严格独立接收各投资组合的投资指令，在申购结果产生前，不得以任何形式向任何人泄露各投资指令的内容，包括指令价格与数量等要素。

第二十四条 对于各投资组合以独立账户名义进行申购的交易，申购获配的证券数量由投资交易系统接收各类证券登记结算机构发送的数据进行分配。

第二十五条 对于由于特殊原因不能参与公平交易程序的交易指令，按照公司已建立的相应控制制度和流程执行。

第二十六条 为确保公司管理的不同投资组合获得公平对待，确保投资管理和交易管理业务的合法合规和公平诚信，公司建立异常交易的监控和报告制度。

第二十七条 根据监管机关和证券交易所的相关规定，主要的异常交易类型包括：涉嫌内幕交易的投资交易行为、涉嫌市场操纵的投资交易行为、涉嫌利益输送的投资交易行为等。

(一) 涉嫌内幕交易的投资交易行为是指根据能够影响股价和投资者投资行为的重大非公开信息进行投资的行为；

(二) 涉嫌市场操纵的投资交易行为是指公司管理的投资组合的交易行为致使证券交易价格发生异常或形成虚拟的价格水平，或者致使证券交易量发生异常或形成虚拟的交易量水平。其主要的类型包括：

1、连续交易操纵。即公司管理的投资组合单独或者通过合谋，集中资金优势、持股优势或者利用信息优势，联合或者连续进行买卖，操纵证券交易价格或证券交易量的行为；

2、约定交易操纵。即公司管理的投资组合相互串通，或与他人串通，以事先约定的时间、价格和方式相互进行证券交易，操纵证券交易价格或证券交易量的行为；

3、虚假申报操纵。即公司管理的投资组合进行不以成交为目的的频繁申报和撤销申报，误导其他投资者，操纵证券交易价格或交易量的行为；

4、特定时间价格操纵。即公司管理的投资组合在计算相关证券的参考价格或结算价格或参考价值的特定时间，通过拉抬、打压或锁定手段，操纵相关证券的参考价格或结算价格或参考价值的行为；

5、尾市交易操纵。即公司管理的投资组合在即将收市时，通过拉抬、打压或锁定手段，操纵证券收市价格的行为。

(三) 涉嫌利益输送的投资交易行为是指公司管理的同一投资组合的同向与反向交易、不同投资组合的同向与反向交易等存在利益输送和不符合公平交易原则的行为。

第二十八条 涉嫌内幕交易的投资交易行为的界定标准主要为：

(一) 投资组合经理或者研究人员获得的是涉及上市公司的经营、财务或者对该证券的市场价格和投资者行为有重大影响的而又尚未公开的信息；

(二) 投资组合经理的投资行为主要依据该信息，无其他充足、深入的研究支持。

第二十九条 连续交易操纵的界定标准主要为：

(一) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在同一个交易日内就同一证券大笔下单、连续下单或者密集下单（如多个组合同时下单），造成证券交易价格波动达到一定幅度；

(二) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合进行巨额交易量的申报，且申报价格明显偏离申报时的成交价格达到一定幅度；

(三) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在一段时期内进行大量且连续的交易，造成证券交易价格发生明显波动达到一定幅度；

(四) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在可进行T+0交易的市场中在同一价位或者相近价位大量或者频繁进行回转交易；

(五) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在大宗交易中进行涉嫌虚假申报或其他扰乱市场秩序的申报；

(六) 公司管理的单个投资组合或多个投资组合在银行间债券交易等议价交易中的成交价格明显偏离同期市场平均成交价格。

第三十条 约定交易操纵的界定标准主要为：公司管理的投资组合之间互为对手方。

第三十一条 虚假申报操纵的界定标准主要为：公司管理的投资组合在一个交易日内

频繁申报或撤销申报，以影响证券交易价格或其他投资者的投资行为。

频繁申报和撤销申报，是指某投资组合在同一交易日内，在同一证券的有效竞价范围内，按照同一买卖方向，连续、交替进行三次以上的申报和撤销申报。

第三十二条 特定时间价格操纵和尾市价格操纵的界定标准主要为：在计算相关证券的参考价格或结算价格或参考价值的特定时间，如证券交易所收市前的十分钟时间，公司管理的投资组合以高于市价的价格发出买入申报致使证券交易价格发生异常上涨，或者以低于市价的价格发出卖出申报致使证券交易价格发生异常下跌，或者通过发出买入或者卖出申报致使证券交易价格发生异常波动。

第三十三条 涉嫌利益输送的投资交易行为的界定标准主要为：

（一）公司管理的不同投资组合之间存在以对方为交易对手的交易，或者在银行间债券交易市场等议价市场上通过第三方进行利益输送的行为。

（二）公司同一投资组合经理所管理的不同投资组合在同一交易日内存在就同一证券的无合理理由的反向交易行为。

第三十四条 本制度界定的可能影响证券交易价格或者证券交易量的异常交易行为具体包括：

（一）各交易所交易规则中规定的、公司可能参与的异常交易行为：

- 1、可能对证券交易价格产生重大影响的信息披露前，大量买入或者卖出相关证券；
- 2、公司管理的投资组合之间大量或者频繁进行互为对手方的交易；
- 3、两个或两个以上固定的或涉嫌关联的证券账户之间大量或者频繁进行互为对手方的交易；
- 4、大笔申报、连续申报或者密集申报，以影响证券交易价格；
- 5、频繁申报或频繁撤销申报，以影响证券交易价格或其他投资者的投资行为；
- 6、在同一价位或者相近价位大量或者频繁进行回转交易；
- 7、大量或者频繁进行高买低卖交易；
- 8、进行与自身公开发布的投资分析、预测或建议相背离的证券交易；
- 9、在大宗交易中进行虚假或其他扰乱市场秩序的申报；
- 10、其他经交易所或托管银行电话、书面提示的交易异常行为。

（二）银行间询价交易包括的异常交易行为：

1、交易对手异常：指交易对手超出交易对手库范围、与信用级别较低的交易对手进行大额交易、与丙类账户进行交易；

2、交易价格异常：指回购利率异常和现券交易价格异常。回购利率异常指回购利率偏离同期公允回购利率（可参考中债登网站提供的回购利率数据）30bp

以上，现券交易价格异常指根据交易价格推算出的收益率偏离同期公允收益率（根

据影子定价标准确定) 30bp 以上(一年期以上债券为50bp)；

3、同日反向交易：指当天买卖同一债券品种且价格相同(或造成亏损)的交易、当天进行利率相同(或造成亏损)的正逆回购交易等。

(三) 其他涉嫌进行利益输送的交易行为：

- 1、关联交易行为；
- 2、投资于禁止或者限制的投资对象；
- 3、与受限或禁止的交易对手进行交易；
- 4、采用可能显著影响市价的交易方式；
- 5、可能违反公平交易原则的交易；
- 6、与投资组合的投资风格或公司内部的投资分析明显不符的交易行为。

(四) 公司规定的其他异常交易行为。

第三十五条 异常交易监控体系包括事前监控、事中监控、事后监控三个环节。

第三十六条 事前监控是指在投资交易系统中进行风险监控参数设置及风险监控参数调整，此项工作由风险管理部负责。

第三十七条 在新投资组合成立并开始运作前，根据法律法规、基金合同、资产管理合同、公司规章制度及公司相关决定，风险管理部应及时编制《风险控制参数设置表》，经督察长批准后进行设置。

第三十八条 《风险控制参数设置表》应包括政策性指标、契约性指标、内部监控指标三个方面。政策性指标、契约性指标必须与法律法规、监管政策和各类资产管理合同的相关规定严格一致。非因法律法规、监管政策和资产管理合同发生调整 and 变化，风险管理部不得接受任何关于取消、放宽政策性指标、契约性指标的要求。对于内部监控指标，公司规章制度已明确规定放开监控、放宽监控程序的，风险管理部应在严格审核程序完整性、有效性的前提下执行放开、放宽监控的操作。

第三十九条 风险管理部应对日常交易中系统自动触发的限制性投资交易行为予以监控和报告。

第四十条 事中监控是指投资交易过程中对异常交易的实时监控，包括指令时间、价格、数量等方面。集中交易部负有对系统无法识别和限制的异常交易进行监控和报告的职责。

第四十一条 事后监控包括公平交易分析、交易情况稽核两项内容，分别由风险管理部、监察稽核部负责。

第四十二条 集中交易部在收到下述情形之一的投资指令时启动异常交易识别流程和报告制度。启动异常交易识别流程后，涉及异常交易的投资指令暂停执行：

- (一) 交易所投资指令当日累计数量已达到所投资股票当日成交量的50%的；
- (二) 交易所投资指令下达时间距离收市10分钟以内的；

(三) 短时间内针对同一证券频繁下达指令或者频繁撤销指令的;

(四) 同一投资组合经理投资某一证券,对其管理的投资风格相似各投资组合下达投资指令时,存在不合理时间或价格差异;

(五) 议价交易的交易对手方为公司股东、投资组合托管人或其重大利益关联方、议价交易对手库以外的交易对象;

(六) 参与开盘集合竞价时,投资指令价格偏离前一交易日收盘价格5% (含) 以上的;

(七) 其他可能影响到公平交易或可能发生利益输送的。

第四十三条 涉及异常交易的投资指令,由集中交易部要求指令下达人填写《特殊交易需求申请审批表》,指令下达人做出合理性解释,经由相关部门审核通过并报集中交易部、风险管理部备案。审核流程中任一人员认为有必要的,应当要求其他相关人员提供意见。

第四十四条 风险管理部对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则的要求。

第四十五条 风险管理部应根据市场公认的第三方信息,对投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查。相关投资组合经理应对交易价格异常情况进行合理性解释。

第四十六条 风险管理部对不同投资组合,尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控,同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

第四十七条 风险管理部应对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控,对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析。相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

第四十八条 公司建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度,并健全相关业务记录,确保投资交易公平性的可稽核性。

第四十九条 投资交易行为稽核工作应包括如下内容:

- (一) 投资交易系统风险控制参数的健全性、完整性、有效性;
- (二) 投资指令、指令分配、交易执行的合法合规性;
- (三) 公平交易分析及专项报告的合法合规性。

第五十条 监察稽核部对投资交易行为的稽核工作应反映在季度监察稽核项目表中以及相关专项稽核报告中。

第五十一条 督察长负责对整个投资交易业务领域事前、事中、事后的监控情况实施检查和监督。

第五十二条 在监控过程中集中交易部、风险管理部、监察稽核部一旦发现异常交易，应立即向公司督察长、分管副总经理及总经理报告，并及时采取相关的控制和改进措施。

第五十三条 经报告的异常交易行为，由监察稽核部负责进行专项稽核。监察稽核部应查明该事项的发生过程、发生原因、责任人、处理建议，形成报告后报送督察长、分管副总经理、总经理审批。

第五十四条 风险管理部负责交易价差分析。交易价差是指不同投资组合在相同的时间段内同买或者同卖一只股票时两者买卖均价存在差异。

第五十五条 交易价差分析应遵循如下原则：

（一）分别计算各个投资合同期、同方向交易的某只股票的交易均价，然后比较各自均价差异，再将发生的所有差异进行汇总分析；

（二）模拟计算各投资组合之间溢价金额大小，分析利益输送的可能性。

第五十六条 风险管理部建立分析交易价差的信息系统，应对不同投资组合和不同类别投资组合之间的交易价差进行分析，尤其是对于那些与其他投资组合收益率存在明显差异的投资组合重点进行交易价差分析。

第五十七条 风险管理部应分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行分析，对连续四个季度期间内、不同时间窗内（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资合同向交易的交易价差进行分析，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存分析报告备查。如果在上述分析期间内，公司管理的所有投资合同向交易价差出现异常情况，应重新核查公司投资决策和交易执行环节的内部控制，针对潜在问题完善公平交易制度，并在向中国证监会报送的监察稽核季度报告和年度报告中对此做专项说明。

第五十八条 在各投资组合的定期报告中，至少应披露以下事项：公司整体公平交易制度执行情况；对异常交易行为做专项说明，其中，如果报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%，应说明该类交易的次数及原因。

在投资组合的年度报告中，还应披露公平交易制度和控制方法，并在公司整体公平交易制度执行情况中，对当年度同向交易价差做专项分析。

第五十九条 公司应参考交易所和托管银行的提示进行信息披露。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易制度》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合及短期国债回购交易除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易（短期国债回购交易除外）的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

#### 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

本报告期内基本面仍显羸弱，经济继续处于下行通道。数据上看，投资弱、消费弱，出口和房地产强。投资方面，主要是基建投资持续萎靡，制造业投资有所反弹，房地产投资维持高位；消费方面，受汽车需求腰斩和消费升级难，消费增速下滑；出口方面，贸易战影响不大，出口整体处于高位；房地产：整体投资较高，建安投资一般，新开工投资强劲，销售结构性走弱。

货币政策层面，继续维持宽松，财政政策更有直接作用，需发力，存在预算约束，多渠道筹措财政资金。监管去杠杆进入平稳期，不会新增去杠杆举措。货币政策以内部环境为主，优先考虑稳增长，通胀、汇率不是主要矛盾，2018年降准贯穿四个季度，但货币政策在去杠杆和长期方向迷失的背景下，广义紧、狭义松；货币宽，信用紧。

本报告期内，本基金采用稳健策略，在资金面持续宽松的环境下抓住收益相对高点择时进行配置，适当拉长组合久期，并适时适度小幅增加杠杆。组合配置上，增配存单和短融，在提升组合静态收益的同时以保持组合更优的流动性。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通财通宝货币A基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为3.2971%，同期业绩比较基准收益率为0.3555%；截至报告期末财通财通宝货币B基金份额净值为1.000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为3.5457%，同期业绩比较基准收益率为0.3555%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

利率债策略上经济下行压力较大，PMI数据创26个月新低，基本面需求较弱。债市机会仍在。

通胀压力有所缓解。国际油价连跌十日，之前比较担忧的油价，以及房租价格、因为灾害导致价格飙涨的蔬菜鲜果价格，以及猪瘟可能导致猪周期提前的通胀干扰。目前仅剩猪瘟干扰尚未消除，央行货币政策报告予以关注，并提出长期可控。在需求较弱，居民杠杆过高的前提下，通胀压力料将进一步缓解。与此同时，由于工业制造景气度走低，基数效应和供给侧改革效果消退，PPI继续回落。货币政策大概率将保持实际宽松，资金面依旧充裕。

展望2019年，我们认为货币市场仍将保持较为充沛的流动性，短端收益率在央行较为独立的货币政策指引下，上行压力不大。组合操作层面，我们将保持组合较为稳定的久期，适度调整各类属配置，在严控信用风险及保证流动性的同时，适度增加高评级短融以及资产支持证券以提升收益率。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入推进监察稽核各项工作。公司监察稽核部门在权限范围内，对公司各部门执行公司内控制度及各项规章制度情况进行监察，对公司各项业务活动与相关制度等的合法性、合规性、合理性进行监督稽核、评价、报告和建议。通过各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，建立健全风险管理体系，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证券监督管理委员会《关于证券投资基金估值业务的指导意见》和中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》等法律法规的有关规定，本基金管理人设立估值委员会并制定估值委员会制度。

估值委员会成员由总经理、督察长、基金投资部、专户投资部、固定收益部、研究部、风险管理部、监察稽核部、基金清算部等部门负责人、基金清算部相关业务人员、涉及的相关基金经理或投资经理或实际履行前述部门相当职责的部门负责人或人员组成。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力，且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理如果认



为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业务外包协议》。

根据中国证券投资基金业协会《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》（中基协发〔2017〕6号），基金管理人与中证指数有限公司签订了《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》，委托中证指数有限公司计算并提供流通受限股票流动性折扣。

基金管理人与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金行政外包协议》，截至报告期末，基金管理人对旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行外包。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，且每日进行支付，收益支付方式为红利再投资，免收再投资的费用。报告期内本基金向财通财通宝货币A类份额持有人分配利润6,271,483.49元，向财通财通宝货币B类份额持有人分配利润175,951,866.54元。

#### 4.9 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

报告期内，本基金未有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。

### §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—财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,财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,财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

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2019)审字第 60951782_B05 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	财通财通宝货币市场基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了财通财通宝货币市场基金的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财通财通宝货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了财通财通宝货币市场基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准

	<p>则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于财通财通宝货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>财通财通宝货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估财通财通宝货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督财通财通宝货币市场基金的财务报告过程。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对财通财通宝货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致财通财通宝货币市场基金不能持续经营。</p> <p>评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于</p>

	舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蒋燕华、骆文慧
会计师事务所的地址	上海市世纪大道100号环球金融中心50楼
审计报告日期	2019-03-28

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：财通财通宝货币市场基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,930,822,197.47	475,650,405.42
结算备付金		-	-
存出保证金		-	1,108.35
交易性金融资产	7.4.7.2	4,331,709,560.22	1,282,380,126.51
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,331,709,560.22	1,276,667,650.70
资产支持证券投资		-	5,712,475.81
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	1,619,219,908.81	1,108,709,615.67
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	33,911,910.80	19,811,426.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,915,663,577.30	2,886,552,682.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年12月31日</b>	<b>上年度末 2017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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		39,999,820.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,368,933.60	1,040,051.08
应付托管费		717,858.67	315,166.98
应付销售服务费		106,749.07	90,075.15
应付交易费用	7.4.7.7	97,651.39	56,972.88
应交税费		21,918.68	-
应付利息		20,924.76	-
应付利润		3,820,195.97	1,455,875.54
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	219,000.00	169,000.00
负债合计		47,373,052.14	3,127,141.63
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	8,868,290,525.16	2,883,425,540.92
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		8,868,290,525.16	2,883,425,540.92
负债和所有者权益总计		8,915,663,577.30	2,886,552,682.55

注：(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分；

(2)报告截止日2018年12月31日，基金份额净值1.0000元，其中A类基金份额净值1.0000元，B类基金份额净值1.0000元。基金份额总额8,868,290,525.16份；其中A类基金份额总额164,196,672.45份，B类基金份额总额8,704,093,852.71份。

## 7.2 利润表

会计主体：财通财通宝货币市场基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入		209,514,324.40	209,053,977.31
1.利息收入		204,888,608.18	200,877,561.57
其中：存款利息收入	7.4.7.11	71,858,712.55	72,504,061.22
债券利息收入		90,694,066.69	76,437,165.85
资产支持证券利息收入		42,363.17	22,821.25
买入返售金融资产收入		42,293,465.77	51,913,513.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,625,716.22	8,176,415.74
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	4,615,190.94	8,164,451.21
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	10,525.28	11,964.53
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	-

<b>减：二、费用</b>		27,290,974.37	24,273,560.12
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	18,071,980.87	16,585,451.83
2. 托管费	7.4.10.2.2	5,476,357.84	5,025,894.46
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,005,812.36	1,274,196.78
4. 交易费用	7.4.7.19	-	675.00
5. 利息支出		2,229,535.19	1,032,658.45
其中：卖出回购金融资产支出		2,229,535.19	1,032,658.45
6. 税金及附加		110,819.32	-
7. 其他费用	7.4.7.20	396,468.79	354,683.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		182,223,350.03	184,780,417.19
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		182,223,350.03	184,780,417.19

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通财通宝货币市场基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01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）	2,883,425,540.92	-	2,883,425,540.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	182,223,350.03	182,223,350.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值	5,984,864,984.24	-	5,984,864,984.24



变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	38,039,618,663.15	-	38,039,618,663.15
2.基金赎回款	-32,054,753,678.91	-	-32,054,753,678.91
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)	-	-182,223,350.03	-182,223,350.03
五、期末所有者权益(基金净值)	8,868,290,525.16	-	8,868,290,525.16
项目	上年度可比期间 2017年01月01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)	4,269,572,314.38	-	4,269,572,314.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	184,780,417.19	184,780,417.19
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)	-1,386,146,773.46	-	-1,386,146,773.46
其中: 1.基金申购款	32,948,262,531.63	-	32,948,262,531.63
2.基金赎回款	-34,334,409,305.09	-	-34,334,409,305.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-184,780,417.19	-184,780,417.19
五、期末所有者权益	2,883,425,540.92	-	2,883,425,540.92

(基金净值)			
--------	--	--	--

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:

王家俊	王家俊	刘为臻
_____	_____	_____
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

财通财通宝货币市场基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监[2016]1213号《关于准予财通财通宝货币市场基金注册的批复》的核准,由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2016年7月27日生效。首次募集规模为7,840,714,131.15份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为财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。

本基金分设两类基金份额:A类基金份额和B类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码,收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。若A类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过500万份时,本基金自动将其在该基金账户持有的A类基金份额升级为B类基金份额。若B类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于500万份时,本基金自动将其在该基金账户持有的B类基金份额降级为A类基金份额。

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括:(一)现金;(二)期限在1年以内(含1年)的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单;(三)剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券;(四)中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如果法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(税后)。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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编报规则》第5号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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2018年12月31日的财务状况以及2018年1月1日至2018年12月31日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系2018年1月1日至2018年12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

本基金的金融资产于初始确认时分类为交易性金融资产及贷款和应收款项。本基金持有的交易性金融资产主要包括债券投资等。

本基金的金融负债于初始确认时分类为其他金融负债。

##### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产。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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券于成交日确认为债券投资。债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；卖出银行间同业市场交易的债券于成交日确认债券投资收益。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

#### (2) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以使用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金估值采用摊余成本法，其相当于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金持有的金融工具的估值方法具体如下：

#### (1) 银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息；

#### (2) 债券投资

本基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

#### (3) 回购协议

1) 本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；

2) 本基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提。回购期间对涉及的金融资产根据其资产的性质进行相应的估值。回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

#### (4) 其他

1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

2) 为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值；

3) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

### 7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第120号《货币市场基金监督管理办

法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用自有资金予以弥补；

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(6)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率逐日计提；

(3)基金A类份额销售服务费按前一日A类资产净值的0.25%年费率逐日计提，B类份额销售服务费按前一日B类资产净值的0.01%年费率逐日计提；

(4)卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1) 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2)本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3)"每日分配、按日支付"。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，当日所得收益结转为基金份额参与下一日收益分配；若当日已实现收益大于零时，则增加投资人基金份额；若当日已实现收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；若当日净收益小于零时，不缩减投资人基金份额，待其后累计净收益大于零时，即增加投资人基金份额；投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

(4)本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5)本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金已实现收益小于零，若当日已实现收益小于零时，不缩减投资人基金份额，待其后累计收益大于零时，即增加投资人基金份额；若投资人赎回基金份额，其收益将结清，收益为负值的，则从投资人赎回基金款中扣除；

(6)当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

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

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入

免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

## 2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

## 3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。

## 4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明



### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	3,822,197.47	2,650,405.42
定期存款	2,927,000,000.00	473,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-	--
存款期限1-3个月	967,000,000.00	273,000,000.00
存款期限3个月以上	1,960,000,000.00	200,000,000.00
其他存款	-	-
合计	2,930,822,197.47	475,650,405.42

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2018年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,331,709,560.22	4,335,165,000.00	3,455,439.78	0.0390
	合计	4,331,709,560.22	4,335,165,000.00	3,455,439.78	0.0390
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,331,709,560.22	4,335,165,000.00	3,455,439.78	0.0390
项目		上年度末2017年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	1,276,667,650.70	1,276,642,000.00	-25,650.70	-0.0009
	合计	1,276,667,650.70	1,276,642,000.00	-25,650.70	-0.0009
资产支持证券		5,712,475.81	5,724,000.00	11,524.19	0.0004
合计		1,282,380,126.51	1,282,366,000.00	-14,126.51	-0.0005

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产或负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,619,219,908.81	-
合计	1,619,219,908.81	-
项目	上年度末2017年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	191,600,000.00	-
银行间市场	917,109,615.67	-
合计	1,108,709,615.67	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	5,813.07	1,026.92
应收定期存款利息	19,353,635.95	3,567,742.40
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	12,085,374.80	14,740,953.40
应收资产支持证券利息	-	3,077.64
应收买入返售证券利息	2,348,512.63	1,473,086.42
应收申购款利息	118,574.35	25,539.27
应收黄金合约拆借孳息	-	-

其他	-	0.55
合计	33,911,910.80	19,811,426.60

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	97,651.39	56,972.88
合计	97,651.39	56,972.88

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	219,000.00	169,000.00
合计	219,000.00	169,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (财通财通宝货币A)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	262,981,365.20	262,981,365.20
本期申购	1,847,963,251.72	1,847,963,251.72
本期赎回(以“-”号填列)	-1,946,747,944.47	-1,946,747,944.47
本期末	164,196,672.45	164,196,672.45

金额单位：人民币元

项目 (财通财通宝货币B)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,620,444,175.72	2,620,444,175.72
本期申购	36,191,655,411.43	36,191,655,411.43
本期赎回(以“-”号填列)	-30,108,005,734.44	-30,108,005,734.44
本期末	8,704,093,852.71	8,704,093,852.71

注：申购含红利再投、转换入份额和A类基金份额与B类基金份额之间自动升降级而增加的基金份额，赎回含转换出份额及A类基金份额与B类基金份额之间自动升降级而减少的基金份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (财通财通宝货币A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	6,271,483.49	-	6,271,483.49
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-6,271,483.49	-	-6,271,483.49
本期末	-	-	-

单位：人民币元

项目 (财通财通宝货币B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	175,951,866.54	-	175,951,866.54
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-175,951,866.54	-	-175,951,866.54
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
活期存款利息收入	100,138.06	68,915.11
定期存款利息收入	70,145,381.91	71,272,217.83
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,834.61	331.17
其他	1,610,357.97	1,162,597.11
合计	71,858,712.55	72,504,061.22

注：本基金本期其他存款利息收入包括结算保证金利息收入和应收申购款利息收入，分别为1.64元和1,610,356.33元。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资股票，股票投资收益为零。

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资股票，股票投资收益为零。

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资基金，基金投资收益为零。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日

债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	4,615,190.94	8,164,451.21
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	4,615,190.94	8,164,451.21

**7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	9,492,455,181.62	8,793,808,386.35
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,379,629,646.05	8,727,607,491.07
减：应收利息总额	108,210,344.63	58,036,444.07
买卖债券差价收入	4,615,190.94	8,164,451.21

**7.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券赎回差价收入。

**7.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间均未有债券申购差价收入。

**7.4.7.14.5 资产支持证券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
卖出资产支持证券成交总额	5,762,932.20	2,724,000.00

减：卖出资产支持证券成本总额	5,725,474.72	2,712,035.47
减：应收利息总额	26,932.20	—
资产支持证券投资收益	10,525.28	11,964.53

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

#### 7.4.7.16 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本基金本报告期及上年度可比期间均未有公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均未有其他收入。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	-	675.00
交易基金产生的费用		
其中：申购费		
赎回费		
合计	-	675.00

#### 7.4.7.19.1 持有基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间未有持有基金产生的费用。

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	150,000.00	100,000.00
汇划手续费	149,268.79	157,483.60
帐户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	396,468.79	354,683.60

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至2018年12月31日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
财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
财通证券股份有限公司("财通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
杭州市实业投资集团有限公司	基金管理人的股东
浙江瀚叶股份有限公司	基金管理人的股东
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
上海财通资产管理有限公司	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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易



#### 7.4.10.1.1 股票交易

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股票交易。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
财通证券	0.00	0.00%	82,940,093.19	83.42%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均未有应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,071,980.87	16,585,451.83
其中：支付销售机构的客户维护费	75,169.12	76,063.05

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数；

(3)客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,476,357.84	5,025,894.46

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日计提，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 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 2018年01月01日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B	合计
财通证券	1,117.82	35.15	1,152.97
财通基金	418,990.04	524,983.86	943,973.90
中国农业 银行	27,135.27	0.00	27,135.27
合计	447,243.13	525,019.01	972,262.14
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B	合计
财通证券	1,400.92	0.00	1,400.92
财通基金	721,410.04	468,007.88	1,189,417.92
中国农业 银行	61,397.10	19.18	61,416.28
合计	784,208.06	468,027.06	1,252,235.12

注：(1)支付基金销售机构的销售服务费A类份额按前一日A类基金资产净值0.25%的年费率计提，B类份额按前一日B类基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付；

(2)A类份额销售服务费计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。B类份额销售服务费计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值×0.01%/当年天数。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

项目	本期 2018年01月01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	
	财通财通宝货 币A	财通财通宝 货币B	财通财通宝货 币A	财通财通宝 货币B
基金合同生效日持有的基金份额	—	—	—	—
期初持有的基金份额	—	—	—	330,144,707.54
期间申购/买入总份额	—	55,291,150.31	—	152,266,034.14
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	55,291,150.31	—	482,410,741.68
期末持有的基金份额	—	0.00	—	0.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	0%	—	0%

注：期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

### 7.4.10.5 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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2018年01月01日至2018年12月31日		2017年01月01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
中国农业银行股份有限公司	3,822,197.47	100,138.06	2,650,405.42	68,915.11

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项的说明。

##### 7.4.10.7.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

本基金本报告期及上年度可比期间无其他当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

#### 7.4.11 利润分配情况

财通财通宝货币A

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
6,333,031.53	-	-61,548.04	6,271,483.49	-

财通财通宝货币B

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润 分配合计	备注
173,525,998.07	-	2,425,868.47	175,951,866.54	-

#### 7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因新股/新债而于期末流通受限的证券。

#### 7.4.12.2 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股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 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人民币39,999,820.00元，是以如下债券作为质押：

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
120411	12农发11	2019-01-04	100.20	400,000	40,079,095.24
合计				400,000	40,079,095.24

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险防范和控制，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。总经理负责公司日常经营管理中的风险控制工作，公司下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的监察稽核部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

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。

#### 7.4.13.2 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建立了信用风险管理流程，通过对各类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，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司，按银行同业利率计息，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、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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。本基金投资组合的平均剩余期限不超过120天，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资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款，结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	853,822,197.47	1,367,000,000.00	710,000,000.00	-	-	-	2,930,822,197.47
交易性金融资产	289,694,939.93	2,127,336,089.30	1,914,678,530.99	-	-	-	4,331,709,560.22
买入返售金融资产	1,619,219,908.81	-	-	-	-	-	1,619,219,908.81
应收利息	-	-	-	-	-	33,911,910.	33,911,910.8

						80	0
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,762,737,046.21	3,494,336,089.30	2,624,678,530.99	-	-	33,911,910.80	8,915,663,577.30
负债							
卖出回购金融资产款	39,999,820.00	-	-	-	-	-	39,999,820.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,368,933.60	2,368,933.60
应付托管费	-	-	-	-	-	717,858.67	717,858.67
应付销售服务费	-	-	-	-	-	106,749.07	106,749.07
应付交易费用	-	-	-	-	-	97,651.39	97,651.39
应交税费	-	-	-	-	-	21,918.68	21,918.68
应付利息	-	-	-	-	-	20,924.76	20,924.76
应付利润	-	-	-	-	-	3,820,195.97	3,820,195.97
其他负债	-	-	-	-	-	219,000.00	219,000.00
负债总计	39,999,820.00	-	-	-	-	7,373,232.14	47,373,052.14
利率敏感度缺口	2,722,737,226.21	3,494,336,089.30	2,624,678,530.99	-	-	26,538,678.66	8,868,290,525.16
上年度末2017年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	52,650,405.42	273,000,000.00	150,000,000.00	-	-	-	475,650,405.42
存出保证金	1,108.35	-	-	-	-	-	1,108.35
交易性金融资产	389,621,259.26	394,625,703.44	498,133,163.81	-	-	-	1,282,380,126.51
买入返售金融资产	1,108,709,615.67	-	-	-	-	-	1,108,709,615.67
应收利息	-	-	-	-	-	19,811,426.	19,811,426.6



						60	0
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,550,982,388.70	667,625,703.44	648,133,163.81	—	—	19,811,426.60	2,886,552,682.55
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,040,051.08	1,040,051.08
应付托管费	-	-	-	-	-	315,166.98	315,166.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	90,075.15	90,075.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	56,972.88	56,972.88
应付利润	-	-	-	-	-	1,455,875.54	1,455,875.54
其他负债	-	-	-	-	-	169,000.00	169,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,127,141.63	3,127,141.63
利率敏感度缺口	1,550,982,388.70	667,625,703.44	648,133,163.81	—	—	16,684,284.97	2,883,425,540.92

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1.市场利率变化主要对基金组合债券类资产的估值产生影响，对其他会计科目的影响可忽略。		
假设	2.基金组合对利率的风险暴露，根据报告期末各只债券的修正久期加权计算得到，债券凸性对组合净值的影响可忽略。		
假设	3.市场即期利率曲线平行变动。		
假设	4.基金组合构成和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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	市场利率下降25个基点	3,350,233.96	737,368.57
	市场利率上升25个基点	-3,350,233.96	-737,368.57

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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。本基金为货币型基金，主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，并不持有其他权益类投资，因此其他的市场因素对本基金资产净值无重大影响。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	4,331,709,560.22	48.84	1,276,667,650.70	44.28
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	5,712,475.81	0.20
合计	4,331,709,560.22	48.84	1,282,380,126.51	44.48

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末均未持有交易性权益类投资，因此其他价格风险因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

##### 1)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负债，其因剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

##### 2)以公允价值计量的金融工具

##### (1)各层次金融工具公允价值

于2018年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币4,331,709,560.22元，无属于第一层次和第三层次的余额。

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为人民币1,282,380,126.51元，无属于第一层次和第三层次的余额。

##### (2)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### (3)第三层次公允价值本期变动金额

本基金本期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

##### 2、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 3、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	固定收益投资	4,331,709,560.22	48.59
	其中：债券	4,331,709,560.22	48.59
	资产支持证券	-	-

2	买入返售金融资产	1,619,219,908.81	18.16
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,930,822,197.47	32.87
4	其他各项资产	33,911,910.80	0.38
5	合计	8,915,663,577.30	100.00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.42	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	39,999,820.00	0.4510
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	32

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

根据本货币市场基金基金合同约定，本基金投资组合的平均剩余期限不得超过120天，本报告期内本货币市场基金平均剩余期限未有超过120天的情况。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	31.15	0.45
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	11.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	27.63	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.07	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	23.52	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.15	0.45

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

根据本货币市场基金基金合同约定，本基金投资组合的平均存续期不得超过240天，本报告期内本货币市场基金平均存续期未有超过240天的情况。

#### 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	39,952,258.38	0.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	410,201,175.44	4.63
	其中：政策性金融债	410,201,175.44	4.63
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	230,002,681.73	2.59

6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,651,553,444.67	41.18
8	其他	-	-
9	合计	4,331,709,560.22	48.84
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

### 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111815459	18民生银行C D459	2,500,000	246,168,299.9 4	2.78
2	111820227	18广发银行C D227	2,000,000	198,989,519.4 3	2.24
3	111814270	18江苏银行C D270	2,000,000	198,980,196.5 4	2.24
4	111821372	18渤海银行C D372	2,000,000	198,850,394.4 2	2.24
5	111872850	18广州银行C D088	2,000,000	198,271,816.2 0	2.24
6	111804040	18中国银行C D040	2,000,000	197,072,470.5 0	2.22
7	111884273	18锦州银行C D194	1,500,000	149,101,763.7 0	1.68
8	111882133	18南京银行C D100	1,300,000	127,353,355.2 7	1.44
9	160415	16农发15	1,100,000	109,945,715.2 2	1.24
10	111821336	18渤海银行C D336	1,000,000	99,755,810.51	1.12

### 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.2212%
报告期内偏离度的最低值	-0.0211%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0797%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内负偏离度的绝对值未有达到0.25%的情况。

### 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内正偏离度的绝对值未有达到0.5%的情况。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与“摊余成本法”计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者自有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

**8.9.2** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期内没有出现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、处罚的情形。

**8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	33,911,910.80
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	33,911,910.80

**8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§9 基金份额持有人信息**

**9.1 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
财通财通宝货币A	2,803	58,578.91	152,559,723.00	92.91%	11,636,949.45	7.09%
财通财通宝货币B	138	63,073,143.86	8,694,092,777.12	99.89%	10,001,075.59	0.11%
合计	2,941	3,015,399.70	8,846,652,500.12	99.76%	21,638,025.04	0.24%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用期末基金份额总额，特此说明。



### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	基金类机构	666,465,332.88	7.52%
2	银行自有资金	401,470,027.04	4.53%
3	银行自有资金	400,083,802.64	4.51%
4	保险自有资金	350,991,797.91	3.96%
5	基金类机构	333,636,566.96	3.76%
6	券商类机构	302,362,315.68	3.41%
7	银行自有资金	302,072,054.38	3.41%
8	基金类机构	280,594,449.13	3.16%
9	信托类机构	272,143,499.03	3.07%
10	银行自有资金	250,546,137.14	2.83%

### 9.3 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	财通财通宝货币A	164,740.39	0.0019%
	财通财通宝货币B	0.00	0.00%
	合计	164,740.39	0.0019%

### 9.4 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 研究部门负责人持有本开放式 基金	财通财通宝货币A	0
	财通财通宝货币B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	财通财通宝货币A	0
	财通财通宝货币B	0
	合计	0

注：(1)本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；

(2)本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B
基金合同生效日(2016年07月27日)基金份额总额	1,186,753,840.53	6,653,960,290.62
本报告期期初基金份额总额	262,981,365.20	2,620,444,175.72
本报告期基金总申购份额	1,847,963,251.72	36,191,655,411.43
减：本报告期基金总赎回份额	1,946,747,944.47	30,108,005,734.44
本报告期期末基金份额总额	164,196,672.45	8,704,093,852.71

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 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

1、本报告期内，基金管理人于2018年6月29日聘任武伟先生担任公司督察长职务，原督察长黄惠女士于2018年6月29日离任；于2019年1月18日聘任夏理芬先生担任公司董事长职务，原董事长刘未先生于2019年1月18日离任；

2、本报告期基金托管人总行聘任刘琳同志、李智同志为本行托管业务部高级专家。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金进行审计的机构未发生变化，为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)。报告期内应支付给会计师事务所的基金审计费用为六万元，目前该事务所已为本基金提供审计服务的年限不满三年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
方正证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

#### 11.7.2 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		基金交易	
	成交金	占当	成交金额	占当	成	占当	成	占当

	额	期债 券成 交总 额比 例		期债 券回 购成 交总 额比 例	交 金 额	期权 证成 交总 额比 例	交 金 额	期基 金成 交总 额比 例
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	4,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《财通基金管理有限公司关于旗下基金2017年年度资产净值的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-01
2	《财通基金管理有限公司销售网点及销售人员资格信息一览表》	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-12
3	《财通财通宝货币市场基金2017年第4季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-01-20
4	《财通财通宝货币市场基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-02-10
5	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中原银行股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-02-13
6	《宁夏银星能源股份有限公司简	中国证监会指定报刊及网	2018-02-27

	式权益变动报告书》	站	
7	《财通财通宝货币市场基金更新招募说明书（2018年第1号）》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-10
8	《财通财通宝货币市场基金更新招募说明书摘要（2018年第1号）》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-10
9	《关于财通财通宝货币市场基金增加上海朝阳永续基金销售有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-16
10	《财通财通宝货币市场基金基金合同（201803更新）》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-24
11	《财通财通宝货币市场基金托管协议（201803更新）》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-24
12	《财通基金管理有限公司关于修改旗下部分基金<基金合同>、<托管协议>的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-24
13	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国光大银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-24
14	《财通财通宝货币市场基金2017年年度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-31
15	《财通财通宝货币市场基金2017年年度报告摘要》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-31
16	《财通财通宝货币市场基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-03-31
17	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-03
18	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-12

	公告》		
19	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-17
20	《财通基金管理有限公司关于旗下基金增加代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-17
21	《财通财通宝货币市场基金2018年第1季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-20
22	《财通财通宝货币市场基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-04-25
23	《北京首旅酒店(集团)股份有限公司简式权益变动报告书》	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-18
24	《际华集团股份有限公司简式权益变动报告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-22
25	《债券投资交易人员公示债券投资交易人员公示》	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-22
26	《关于旗下部分基金增加北京恒宇天泽基金销售有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-05-31
27	《财通财通宝货币市场基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-06-13
28	《上海龙宇燃油股份有限公司简式权益变动报告书》	中国证监会指定报刊及网站	2018-06-23
29	《财通财通宝货币市场基金限制大额申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-06-27
30	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加扬州国信嘉利基金销售有限公司为代销机构的公	中国证监会指定报刊及网站	2018-06-27

	告》		
31	《财通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-06-30
32	《财通基金管理有限公司关于旗下基金2018年半年度资产净值的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-02
33	《财通基金管理有限公司关于旗下基金2018年半年度资产净值的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-02
34	《关于财通基金管理有限公司旗下基金增加联储证券有限责任公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-04
35	《关于财通财通宝货币市场基金增加海通证券股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-06
36	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加扬州国信嘉利基金销售有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-07
37	《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合所持中国中铁(601390)估值调整的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-07
38	《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合所持棕榈股份(002431)估值调整的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-07
39	《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合所持奥马电器(002668)估值调整的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-07
40	《关于北京懒猫金融信息服务有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-11
41	《关于财通财通宝货币市场基金增加蚂蚁(杭州)基金销售有限	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-11

	公司为代销机构的公告》		
42	《财通基金管理有限公司销售网点及销售人员资格信息一览表》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-12
43	《债券投资交易人员公示》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-12
44	《财通基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-13
45	《财通基金管理有限公司关于高级管理人员在子公司兼任职务及领薪情况的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-13
46	《财通财通宝货币市场基金2018年第2季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-07-20
47	《关于旗下部分基金增加南京途牛金融信息服务有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-08-07
48	《关于旗下部分基金增加深圳盈信基金销售有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-08-07
49	《财通基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在第一创业证券股份有限公司费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-08-15
50	《关于浙江民泰商业银行股份有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-08-18
51	《财通财通宝货币市场基金2018年半年度报告》及其摘要	中国证监会指定报刊及网站	2018-08-29
52	《债券投资交易人员公示》	中国证监会指定报刊及网站	2018-09-05
53	《财通财通宝货币市场基金更新	中国证监会指定报刊及网	2018-09-08



	招募说明书（2018年第2号）及其摘要	站	
54	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加东海证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-09-08
55	《财通财通宝货币市场基金基金经理变更公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-09-15
56	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通定期定额投资业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-09-18
57	《财通财通宝货币市场基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-09-19
58	《财通基金管理有限公司关于代为履行基金经理职责情况的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-09-21
59	《财通财通宝货币市场基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-09-26
60	《财通财通宝货币市场基金基金经理变更公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-09-27
61	《财通基金管理有限公司关于广州分公司办公地址变更的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-10-13
62	《关于旗下基金增加沈阳麟龙投资顾问有限公司为代销机构并参加基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-10-19
63	《财通财通宝货币市场基金2018年第3季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-10-25
64	《财通基金管理有限公司债券交易相关人员信息公示表1031》	中国证监会指定报刊及网站	2018-10-31
65	《关于财通基金管理有限公司旗	中国证监会指定报刊及网	2018-11-06

	下基金增加济安财富(北京)基金销售有限公司为代销机构的公告》	站	
66	《吉林化纤股份有限公司简式权益变动报告书》	中国证监会指定报刊及网站	2018-11-13
67	《关于财通财通宝货币市场基金增加华泰证券股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-11-17
68	《财通基金管理有限公司债券交易相关人员信息公示表》	中国证监会指定报刊及网站	2018-11-22
69	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加江海证券有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-11-23
70	《财通基金管理有限公司关于基金经理恢复履行基金职责的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-12-01
71	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加中山证券有限责任公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-12-07
72	《深圳市证通电子股份有限公司简式权益变动报告书》	中国证监会指定报刊及网站	2018-12-07
73	《财通基金管理有限公司债券交易相关人员信息公示表1219》	中国证监会指定报刊及网站	2018-12-20
74	《关于财通基金管理有限公司旗下部分基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-12-21
75	《财通财通宝货币市场基金暂停申购（转换转入、定期定额投资）业务的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-12-26
76	《关于财通财通宝货币市场基金增加英大证券有限责任公司为代销机构的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-12-26

77	《关于财通基金管理有限公司旗下部分开放式基金参与中国农业银行申购费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2018-12-29
----	--	--------------	------------

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、关于财通财通宝货币市场基金基金合同；
- 3、关于财通财通宝货币市场基金基金托管协议；
- 4、关于财通财通宝货币市场基金招募说明书及其更新；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心41楼。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人、基金托管人的办公场所或基金管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：<http://www.ctfund.com>

财通基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十九日