

财通财通宝货币市场基金 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 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:2021 年 08 月 28 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。本中期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2021年8月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年6月30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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 债券回购融资情况	42
7.3 基金投资组合平均剩余期限	43
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 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	45
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	45
7.8 期末按摊余成本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	46

7.9 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	48
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.4 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 .....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	52
10.9 其他重大事件.....	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	54
11.1 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.....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
§12 备查文件目录.....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## §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	7,942,399,553.71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	88,985,361.16份	7,853,414,192.55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	本基金为货币市场证券

	<p>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。</p>	<p>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。</p>
--	--	--

### 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	谷澍

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于2021年2月9日变更为谷澍。

### 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ctfund.com">http://www.ctfund.com</a>
基金中期报告备置地点	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
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4 1/43楼

### §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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年01月01日-2021年06月30日)	
	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B
本期已实现收益	902,524.87	99,312,993.00
本期利润	902,524.87	99,312,993.00
本期净值收益率	1.0586%	1.1790%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年06月30日)	
期末基金资产净值	88,985,361.16	7,853,414,192.55
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年06月30日)	
累计净值收益率	13.6640%	15.0181%

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。

#### 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

财通财通宝货币A

阶段	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
过去一个月	0.1700%	0.0006%	0.0292%	0.0000%	0.140 8%	0.000 6%

过去三个月	0.5040%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.415 5%	0.000 5%
过去六个月	1.0586%	0.0006%	0.1761%	0.0000%	0.882 5%	0.000 6%
过去一年	2.0257%	0.0009%	0.3555%	0.0000%	1.670 2%	0.000 9%
过去三年	6.8781%	0.0015%	1.0712%	0.0000%	5.806 9%	0.001 5%
自基金合同 生效起至今	13.6640%	0.0027%	1.7654%	0.0000%	11.898 6%	0.002 7%

## 财通财通宝货币B

阶段	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
过去一个月	0.1897%	0.0006%	0.0292%	0.0000%	0.160 5%	0.000 6%
过去三个月	0.5642%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.475 7%	0.000 5%
过去六个月	1.1790%	0.0006%	0.1761%	0.0000%	1.002 9%	0.000 6%
过去一年	2.2705%	0.0009%	0.3555%	0.0000%	1.915 0%	0.000 9%
过去三年	7.6515%	0.0015%	1.0712%	0.0000%	6.580 3%	0.001 5%
自基金合同 生效起至今	15.0181%	0.0027%	1.7654%	0.0000%	13.252 7%	0.002 7%

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





注：(1)本基金合同生效日为 2016 年 7 月 27 日；

(2)本基金建仓期为自合同生效起 6 个月，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。

## §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173人，管理人员和主要业务骨干的证券、基金从业平均年限在7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		
张婉玉	本基金的基金经理	2020-05-12	-	7年	上海财经大学硕士。历任交银施罗德基金投研助理、国利货币助理债券经纪人、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，曾担任固定收益部基金经理助理，现任固定收益部基金经理。
罗晓倩	本基金的基金经理	2017-07-19	-	8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。2016年5月加入

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

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 公平交易制度的执行情况

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。

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。

#### 4.3.2 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

今年二季度债市整体震荡，在结构性“资产荒”的压力下，叠加资金面平稳宽松格局，债券走出了慢牛行情。10年国债收益率从3.19%下行至3.07%，10年国开收益率从3.57%下行至3.49%，国债和国开分别下行12bp和8bp，季内利率波动不大，平稳下行。

国内经济持续复苏，5月经济数据表现依旧积极。生产端，工业增加值同比小幅回落至8.8%，季调环比增长0.52%，与四月持平，表现较为平稳。需求端，出口金额（美元计）同比增长27.8%，两年复合增长11.1%，虽较4月的16.8%有所回落，但继续维持高韧性；地产投资，或因居民中长期贷款走弱的缘故导致边际回落，但仍维持高位；制造业投资，延续改善，在广义下游需求及企业盈利向好的格局下，制造业投资增速的反弹在二季度持续；基建投资，虽小幅加快，或因专项债共计提速带动，但仍弱于今年3月份开工旺季的增速，仍处于低位徘徊。整体二季度经济动能强于一季度，生产保持平稳，消费持续恢复，出口、制造业投资及地产投资对经济存在一定的支撑。

货币政策方面，后疫情时代，我国疫情控制和经济复苏都领先于全球，央行虽然较早喊出了货币政策正常化，但结构性冲击仍在，内生增长动力不强，结构性政策十分必要，因此疫情而出的宽松政策很难完全退出。整体二季度流动性表现宽松平稳，5月中下旬后流动性变化受到地方债供给、年中考核等因素干扰，资金利率中枢有所抬升，但央行表明“维稳”态度明显，流动性相对平稳跨过年中。

在上半年中，组合整体保持中性策略，在严控信用风险和流动性风险的前提下，同时平衡流动性和收益率，配置上关注短久期、高等级品种，适当增加杠杆增厚组合收益。

#### 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1.0586%，同期业绩比较基准收益率为0.1761%；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1.1790%，同期业绩比较基准收益率为0.1761%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计出口和地产存在高位回落的压力，但经济回落斜率较缓，财政节奏后移将对经济带来一定的支撑。随着通胀高企、经济的持续恢复以及疫苗接种加速，后续货币政策或将边际发生变化。假定央行继续无为而治，蓄水池的水保持既有水量，但是配置资产的方向较上半年将会有所增加。一是地方债供给增加，二是各地政府努力修复信用环境，信用分层可能会有所好转。此外，下半年起有大量MLF到期，央行操作比去年下半年更加宽松可能性不大；而且下半年海外货币政策或开启整体转向，资金面上的压力预期也会略大于上半年。债市震荡格局不改，货币政策或将边际收紧。

本基金将根据期限利差调整组合杠杆率，合理配置各类资产，根据市场的变化调整组合久期，保持组合组合收益率稳定提高。同时在缴税及季末等时点抓住阶段性交易机会。竭力为持有人服务。

#### 4.6 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》，与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》，与申万宏源证券有限公司于2019年9月签订了《运营服务合同》，于2020年5月签订了《基金运营服务合同》。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。

#### 4.7 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902,524.87元，向财通财通宝货币B类份额持有人分配利润99,312,993.00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

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《中华人民共和国证券投资基金法》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2021年1月1日至2021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,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《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期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《公开募集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中期报告中的财务指标、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 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 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：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,601,826,500.22	2,103,218,383.95
结算备付金		-	-
存出保证金		8,303.67	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,932,065,437.97	3,555,991,491.09
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,932,065,437.97	3,555,991,491.09
资产支持证券投资		-	-
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	2,903,975,715.98	2,751,049,686.58
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	20,967,314.59	25,246,743.17
应收股利		-	-
应收申购款		300,945.59	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,459,144,218.02	8,435,506,304.79
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020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		512,887,143.55	664,228,713.65
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,230,431.09	1,899,095.19
应付托管费		675,888.20	575,483.40
应付销售服务费		83,442.18	72,115.47
应付交易费用	6.4.7.7	109,983.28	122,623.42
应交税费		73,154.30	26,204.13
应付利息		52,502.76	43,965.62
应付利润		524,087.97	664,647.93
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	108,030.98	199,000.00
负债合计		516,744,664.31	667,831,848.81
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	7,942,399,553.71	7,767,674,455.98
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		7,942,399,553.71	7,767,674,455.98
负债和所有者权益总计		8,459,144,218.02	8,435,506,304.79

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2021年6月30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7,942,399,553.71份；其中A类基金份额总额88,985,361.16份，B类基金份额总额7,853,414,192.55份。



## 6.2 利润表

会计主体：财通财通宝货币市场基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		121,775,717.68	89,802,115.93
1.利息收入		121,397,222.49	88,109,702.90
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,295,518.74	29,453,904.30
债券利息收入		59,696,838.42	36,834,362.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		34,404,865.33	21,821,436.30
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		378,495.19	1,692,413.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	378,495.19	1,692,413.03
资产支持证券投资	6.4.7.14.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-

<b>减：二、费用</b>		21,560,199.81	18,440,801.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	14,026,145.03	11,420,747.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,250,347.01	3,460,832.64
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	527,280.80	441,254.26
4. 交易费用	6.4.7.20	1,050.00	-
5. 利息支出		2,555,298.72	2,949,103.00
其中：卖出回购金融资产支出		2,555,298.72	2,949,103.00
6. 税金及附加		41,404.31	10,136.21
7. 其他费用	6.4.7.21	158,673.94	158,727.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		100,215,517.87	71,361,314.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		100,215,517.87	71,361,314.88

注：后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 6.3 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：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06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)	7,767,674,455.98	-	7,767,674,455.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	100,215,517.87	100,215,517.87
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以	174,725,097.73	-	174,725,097.73

“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	14,458,764,733.66	-	14,458,764,733.66
2.基金赎回款	-14,284,039,635.93	-	-14,284,039,635.93
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）	-	-100,215,517.87	-100,215,517.87
五、期末所有者权益（基金净值）	7,942,399,553.71	-	7,942,399,553.71
项目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06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）	7,266,578,518.43	-	7,266,578,518.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	71,361,314.88	71,361,314.88
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）	-1,360,617,458.87	-	-1,360,617,458.87
其中：1.基金申购款	11,447,121,845.90	-	11,447,121,845.90
2.基金赎回款	-12,807,739,304.77	-	-12,807,739,304.77
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）	-	-71,361,314.88	-71,361,314.88
五、期末所有者权益（基金净值）	5,905,961,059.56	-	5,905,961,059.56

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:

王家俊

刘为臻

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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)。

### 6.4.2 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》、《公开募集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3号《半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<年度报告和中期报告>》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。

#### 6.4.3 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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至2021年6月30日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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、其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 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。

### 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 2021年06月30日
活期存款	1,826,500.22
定期存款	1,600,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	1,600,000,000.00
其他存款	-
合计	1,601,826,500.22

注：定期存款的存款期限为定期存款的票面存期。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2021年06月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	83,828,457.58	83,854,397.80	25,940.22	0.0003
	银行间市场	3,848,236,980.39	3,850,278,700.00	2,041,719.61	0.0257
	合计	3,932,065,437.97	3,934,133,097.80	2,067,659.83	0.0260
资产支持证券		-	-	-	-
合计		3,932,065,437.97	3,934,133,097.80	2,067,659.83	0.0260

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产或负债。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末2021年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	2,903,975,715.98	-
合计	2,903,975,715.98	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	535.02
应收定期存款利息	10,349,610.87
应收其他存款利息	-

应收结算备付金利息	-
应收债券利息	9,301,653.27
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,315,511.73
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3.70
合计	20,967,314.59

注：其他为结算保证金利息。

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06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	109,983.28
合计	109,983.28

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	108,030.98
合计	108,030.98

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 财通财通宝货币A

金额单位：人民币元



项目 (财通财通宝货币A)	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	95,269,239.56	95,269,239.56
本期申购	248,888,009.41	248,888,009.41
本期赎回(以“-”号填列)	-255,171,887.81	-255,171,887.81
本期末	88,985,361.16	88,985,361.16

#### 6.4.7.9.2 财通财通宝货币B

金额单位：人民币元

项目 (财通财通宝货币B)	本期2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,672,405,216.42	7,672,405,216.42
本期申购	14,209,876,724.25	14,209,876,724.25
本期赎回(以“-”号填列)	-14,028,867,748.12	-14,028,867,748.12
本期末	7,853,414,192.55	7,853,414,192.55

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。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 财通财通宝货币A

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	902,524.87	-	902,524.87
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	-902,524.87	-	-902,524.87
本期末	-	-	-

##### 6.4.7.10.2 财通财通宝货币B

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	99,312,993.00	-	99,312,993.00
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	-99,312,993.00	-	-99,312,993.00
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	16,268.06
定期存款利息收入	27,278,111.86
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,090.22
其他	48.60
合计	27,295,518.74

注：本基金本期其他存款利息收入为结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期末投资股票，股票投资收益为零。

#### 6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期末投资基金，基金投资收益为零。

#### 6.4.7.14 债券投资收益

##### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期

	2021年01月01日至2021年06月30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	378,495.19
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	378,495.19

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	5,366,702,916.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	5,336,476,256.99
减：应收利息总额	29,848,164.52
买卖债券差价收入	378,495.19

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未有资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

##### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--买卖贵金属差价收入。

#### 6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益--申购差价收入。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

##### 6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

##### 6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未投资衍生工具，衍生工具收益为零。

#### 6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期未有股利收益。

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期未有公允价值变动收益。

#### 6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期未有其他收入。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	1,050.00
合计	1,050.00

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
汇划手续费	42,842.96
帐户维护费	16,652.03
合计	158,673.94

#### 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2021年6月30日止，本基金未发生需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 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。

#### 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

本基金本报告期不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。

##### 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
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
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。

#### 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

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

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交易。

#### 6.4.10.1.4 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。

#### 6.4.10.1.5 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。

### 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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,026,145.03	11,420,747.62
其中：支付销售机构的客户维护费	488,976.66	426,285.54

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,250,347.01	3,460,832.64

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。

### 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 2021年01月01日至2021年06月30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	73.55	16.44	89.99
财通基金	98,163.60	379,172.61	477,336.21
中国农业银行	2,104.28	0.00	2,104.28
合计	100,341.43	379,189.05	479,530.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30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	40.68	0.00	40.68
财通基金	84,522.85	307,773.06	392,295.91
中国农业银行	3,353.70	0.00	3,353.70
合计	87,917.23	307,773.06	395,690.29

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。

### 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。

### 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

财通财通宝货币A

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

财通财通宝货币B

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	954,851,004.49	392,724,454.26
报告期间申购/买入总份额	272,203,958.90	355,272,623.10
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	300,000,000.00	250,000,000.00
报告期末持有的基金份额	927,054,963.39	497,997,077.36
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	11.80%	8.54%

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。

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

份额单位：份

财通财通宝货币B

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份	持有的基金份额	持有的基金份



		额占基金总份 额的比例		额占基金总份 额的比例
上海财通 资产管理 有限公司	65,556,151.40	0.83%	70,764,663.78	0.92%

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30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	1,826,500.22	16,268.06	3,149,864.32	31,426.68

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 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。

##### 6.4.10.7.2 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。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金

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
904,774.14	-	-2,249.27	902,524.87	-

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
99,451,303.69	-	-138,310.69	99,312,993.00	-

**6.4.12 期末（2021年06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**

本基金本报告期末未持有因新发/增发而于期末流通受限的证券。

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告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2021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人民币512,887,143.55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
112008147	20中信银行CD 147	2021-07-01	99.81	222,000	22,157,959.06
112010421	20兴业银行CD 421	2021-07-01	99.89	2,000,000	199,785,422.93
160309	16进出09	2021-07-01	100.08	1,000,000	100,082,121.36
170206	17国开06	2021-07-01	101.13	50,000	5,056,627.99
190403	19农发03	2021-07-01	100.44	500,000	50,221,447.19
200406	20农发06	2021-07-01	100.00	400,000	40,001,292.08
210206	21国开06	2021-07-01	99.95	57,000	5,697,276.89
210301	21进出01	2021-07-01	100.07	300,000	30,020,717.23
2103673	21进出673	2021-07-01	99.90	200,000	19,980,160.15
210401	21农发01	2021-07-01	100.30	200,000	20,059,757.49
219926	21贴现国债26	2021-07-01	99.66	600,000	59,796,037.20
合计				5,529,000	552,858,819.57

### 6.4.12.3.2 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。

## 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。

### 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。

### 6.4.13.3 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。

#### 6.4.13.3.1 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、组合在短期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。

### 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。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末2021年06月30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	1,826,500.22	1,000,000,000.00	600,000,000.00	-	-	-	1,601,826,500.22
存出保证金	8,303.67	-	-	-	-	-	8,303.67
交易性金融资产	1,483,273,554.15	1,185,287,442.92	1,263,504,440.90	-	-	-	3,932,065,437.97
买入返售金融资产	2,903,975,715.98	-	-	-	-	-	2,903,975,715.98
应收利息	-	-	-	-	-	20,967,314.59	20,967,314.59
应收申购款	-	-	-	-	-	300,945.59	300,945.59
资产总计	4,389,084,074.02	2,185,287,442.92	1,863,504,440.90	-	-	21,268,260.18	8,459,144,218.02
负债							
卖出回购	512,887,143.55	-	-	-	-	-	512,887,143.55

金融资产款							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,230,431.09	2,230,431.09
应付托管费	-	-	-	-	-	675,888.20	675,888.20
应付销售服务费	-	-	-	-	-	83,442.18	83,442.18
应付交易费用	-	-	-	-	-	109,983.28	109,983.28
应交税费	-	-	-	-	-	73,154.30	73,154.30
应付利息	-	-	-	-	-	52,502.76	52,502.76
应付利润	-	-	-	-	-	524,087.97	524,087.97
其他负债	-	-	-	-	-	108,030.98	108,030.98
负债总计	512,887,143.55	-	-	-	-	3,857,520.76	516,744,664.31
利率敏感度缺口	3,876,196,930.47	2,185,287,442.92	1,863,504,440.90	-	-	17,410,739.42	7,942,399,553.71
上年度末 2020 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	203,218,383.95	1,200,000,000.00	700,000,000.00	-	-	-	2,103,218,383.95

存款							
交易性金融资产	818,893,431.46	1,542,959,312.14	1,194,138,747.49	-	-	-	3,555,991,491.09
买入返售金融资产	2,751,049,686.58	-	-	-	-	-	2,751,049,686.58
应收利息	-	-	-	-	-	25,246,743.17	25,246,743.17
资产总计	3,773,161,501.99	2,742,959,312.14	1,894,138,747.49	-	-	25,246,743.17	8,435,506,304.79
负债							
卖出回购金融资产款	664,228,713.65	-	-	-	-	-	664,228,713.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,899,095.19	1,899,095.19
应付托管费	-	-	-	-	-	575,483.40	575,483.40
应付销售服务费	-	-	-	-	-	72,115.47	72,115.47
应付交易费用	-	-	-	-	-	122,623.42	122,623.42
应交税费	-	-	-	-	-	26,204.13	26,204.13
应付利息	-	-	-	-	-	43,965.62	43,965.62
应付利润	-	-	-	-	-	664,647.93	664,647.93
其他	-	-	-	-	-	199,000.00	199,000.00

负债							
负债总计	664,228,713.65	-	-	-	-	3,603,135.16	667,831,848.81
利率敏感度缺口	3,108,932,788.34	2,742,959,312.14	1,894,138,747.49	-	-	21,643,608.01	7,767,674,455.98

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予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	市场利率下降25个基点	1,953,743.99	1,878,102.80
	市场利率上升25个基点	-1,953,743.99	-1,878,102.80

#### 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

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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口



金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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	3,932,065,437.97	49.51	3,555,991,491.09	45.78
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,932,065,437.97	49.51	3,555,991,491.09	45.78

#### 6.4.13.4.3.2 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、可转换债券及可交换债券，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

#### 6.4.14 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2021年6月30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3,932,065,437.97元，无属于第一层次和第三层次的余额。

于2020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3,555,991,491.09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。

## §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	固定收益投资	3,932,065,437.97	46.48
	其中：债券	3,932,065,437.97	46.48
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,903,975,715.98	34.33
	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	1,601,826,500.22	18.94
4	其他各项资产	21,276,563.85	0.25
5	合计	8,459,144,218.02	100.00

### 7.2 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	2.81	
	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	512,887,143.55	6.46
	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资金余额未超过资产净值的20%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	79
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

### 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。

### 7.3.2 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	55.26	6.46
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	4.15	-
	其中：剩余存续期超过397天	-	-

	的浮动利率债		
3	60天（含）—90天	18.34	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	12.31	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	16.18	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.24	6.46

#### 7.4 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。

#### 7.5 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	143,624,494.78	1.81
2	央行票据	-	-
3	金融债券	292,407,222.88	3.68
	其中：政策性金融债	292,407,222.88	3.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	700,103,485.86	8.81
6	中期票据	-	-
7	同业存单	2,795,930,234.45	35.20
8	其他	-	-
9	合计	3,932,065,437.97	49.51
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	112119088	21恒丰银行CD088	4,000,000	397,520,137.30	5.01
2	112015469	20民生银行CD469	2,500,000	249,673,194.46	3.14
3	112116012	21上海银行CD012	2,000,000	199,795,862.38	2.52
4	112010421	20兴业银行CD421	2,000,000	199,785,422.93	2.52
5	112198556	21青岛农商行CD079	1,800,000	178,439,198.95	2.25
6	112116011	21上海银行CD011	1,500,000	149,845,769.95	1.89
7	160309	16进出09	1,000,000	100,082,121.36	1.26
8	012101630	21远东租赁SCP007	1,000,000	100,004,033.29	1.26
9	012100834	21大唐租赁SCP001	1,000,000	99,976,925.11	1.26
10	112008251	20中信银行CD251	1,000,000	99,899,859.47	1.26

7.7 “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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0510%
报告期内偏离度的最低值	-0.0613%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0275%

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。

### 7.8 期末按摊余成本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。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

**7.9.2 本报告期内，**本基金投资的前十名证券中20兴业银行CD421（证券代码：112010421.IB）的发行主体兴业银行在报告编制前一年内受到福建银保监局的行政处罚；20民生银行CD469（证券代码：112015469.IB）的发行主体民生银行在报告编制前一年内受到银保监会的行政处罚；21上海银行CD011（证券代码：112116011.IB）、21上海银行CD012（证券代码：112116012.IB）的发行主体上海银行在报告编制前一年内受到上海

银保监会的行政处罚。除上述情形外，本基金投资的其他证券的发行主体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、处罚的情形。

本基金投资上述标的的投资决策程序为：

- 1、投资决策委员会确定每个产品的基本投资逻辑；
- 2、投资研究体系中的研究平台是一个共享平台，为投资决策全流程提供研究支持；
- 3、基金经理拟订所管理产品的投资计划与方案；
- 4、金融工程小组对基金经理/投资经理的投资计划进行风险评价，并向投资决策委员会提交评估报告；
- 5、投资决策委员会对基金经理/投资经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；6、根据决策纪要，基金经理/投资经理对计划方案进行具体实施；
- 7、中央交易室按有关交易规则执行基金经理/投资经理下达的交易指令，并将有关信息进行反馈；
- 8、基金经理/投资经理定期检讨投资组合的运作成效；
- 9、金融工程小组定期为投资决策委员会、投资总监、基金经理/投资经理出具绩效与风险评估报告。

### 7.9.3 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	8,303.67
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	20,967,314.59
4	应收申购款	300,945.59
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	21,276,563.85

### 7.9.4 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。

## §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
财通财通宝货币A	2,661	33,440.57	85,978,397.38	96.62%	3,006,963.78	3.38%
财通财通宝货币B	109	72,049,671.49	7,853,414,192.55	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,770	2,867,292.26	7,939,392,589.93	99.96%	3,006,963.78	0.04%

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。

## 8.2 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	927,054,963.39	11.67%
2	银行类机构	400,204,664.59	5.04%
3	券商类机构	315,503,861.98	3.97%
4	保险类机构	303,314,312.89	3.82%
5	保险类机构	303,226,932.01	3.82%
6	基金类机构	300,917,780.85	3.79%
7	实业类机构	276,362,997.89	3.48%
8	基金类机构	252,446,791.74	3.18%
9	保险类机构	200,013,873.78	2.52%
10	银行类机构	200,013,873.78	2.52%



**8.3 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	95,545.07	0.1074%
	财通财通宝货币B	0.00	0.00%
	合计	95,545.07	0.0012%

**8.4 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

**§9 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	95,269,239.56	7,672,405,216.42
本报告期基金总申购份额	248,888,009.41	14,209,876,724.25
减：本报告期基金总赎回份额	255,171,887.81	14,028,867,748.12
本报告期期末基金份额总额	88,985,361.16	7,853,414,192.55

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。

**§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

- 1、基金管理人于2021年8月6日聘任吴林惠先生担任公司第四届董事会董事职务，原董事夏理芬先生于2021年8月6日离任；
- 2、2021年5月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 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)。

## 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。

## 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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-

方正 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
高华 证券	2	-	-	-	-	-
海通 证券	2	-	-	-	-	-
华泰 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-
中信 建投 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。

**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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成	成交金额	占当期债券回	成交金	占当期权证成	成交金	占当期基金成

		交总 额的比例		购成 交总 额的比例	额	交总 额的比例	额	交总 额的比例
安信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	19,432,473.50	15.2 3%	-	-	-	-	-	-
高华 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	108,183,490.10	84.7 7%	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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。

### 10.9 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部分基金参加平安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	2021-01-08
2	《财通财通宝货币市场基金2020	中国证监会指定报刊	2021-01-21

	年第4季度报告》	及网站	
3	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司基金费率优惠活动的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-01-26
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	2021-02-03
5	《财通财通宝货币市场基金2020年年度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-03-27
6	《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	2021-03-30
7	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海国金理益财富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	2021-04-02
8	《财通财通宝货币市场基金2021年第一季度报告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-04-21
9	《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	2021-04-24
10	《财通基金管理有限公司关于旗下投资组合调整停牌股票估值方法的公告》	中国证监会指定报刊及网站	2021-05-12
11	《财通基金管理有限公司关于旗下部分基金参加光大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	2021-05-14
12	《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	2021-06-09
13	《财通基金管理有限公司关于旗	中国证监会指定报刊	2021-06-18

	下部分基金增加东方财富证券股份有限公司为代销机构并参加基金申购费率优惠活动的公告》	及网站	
14	《财通财通宝货币市场基金更新招募说明书（2021年6月26日公告）》	中国证监会指定报刊及网站	2021-06-26

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

### 11.2 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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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。

### 12.2 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。

### 12.3 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  
二〇二一年八月二十八日