

融通汇财宝货币市场基金  
2017 年半年度报告摘要

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据融通汇财宝货币市场基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	融通汇财宝货币		
基金主代码	161622		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2016 年 1 月 18 日		
基金管理人	融通基金管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	13,882,879,029.00 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称:	融通汇财宝货币 A	融通汇财宝货币 B	融通汇财宝货币 E
下属分级基金的交易代码:	161622	161623	004399
报告期末下属分级基金的份额总额	130,748,125.98 份	13,714,476,900.92 份	37,654,002.10 份

注：根据《关于融通汇财宝货币市场基金增设 E 类基金份额并修订基金合同部分条款的公告》，本基金于 2017 年 3 月 13 日实施份额分类，增设 E 类份额。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险和保持资产流动性的前提下，追求稳定的当期收益，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将采用积极管理型的投资策略，在控制利率风险、尽量降低基金资

	产净值波动风险并满足流动性的前提下，提高基金收益。本基金的具体投资策略包括利率策略、骑乘策略、放大策略、信用债投资策略、资产支持证券投资策略和其他金融工具投资策略。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种，其长期平均预期风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

## 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		融通基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	郭明
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 66105799
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95588
传真		(0755) 26935005	(010) 66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

# § 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	融通汇财宝货币 A	融通汇财宝货币 B	融通汇财宝货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)	报告期(2017年3月14日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	1,969,133.20	169,169,283.24	254,587.30
本期利润	1,969,133.20	169,169,283.24	254,587.30
本期净值收益率	1.8722%	1.9769%	1.2306%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)		
期末基金资产净值	130,748,125.98	13,714,476,900.92	37,654,002.10
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)		
累计净值收益率	3.9300%	4.3542%	1.2306%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 本基金自转型之日起至 2016 年 9 月 18 日，利润分配是“每日分配收益，按月结转份额”；自 2016 年 9 月 19 日至今，利润分配是“每日分配收益，按日结转份额”。

3、融通汇财宝货币 E 的数据统计期间为 2017 年 3 月 14 日至 2017 年 6 月 30 日。

### 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

融通汇财宝货币 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	0.3277%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.2989%	0.0003%
过去三个月	0.9621%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.8748%	0.0007%
过去六个月	1.8722%	0.0009%	0.1736%	0.0000%	1.6986%	0.0009%
过去一年	3.0444%	0.0024%	0.3495%	0.0000%	2.6949%	0.0024%
自基金合同 生效起至今	3.9300%	0.0025%	0.5073%	0.0000%	3.4227%	0.0025%

融通汇财宝货币 B

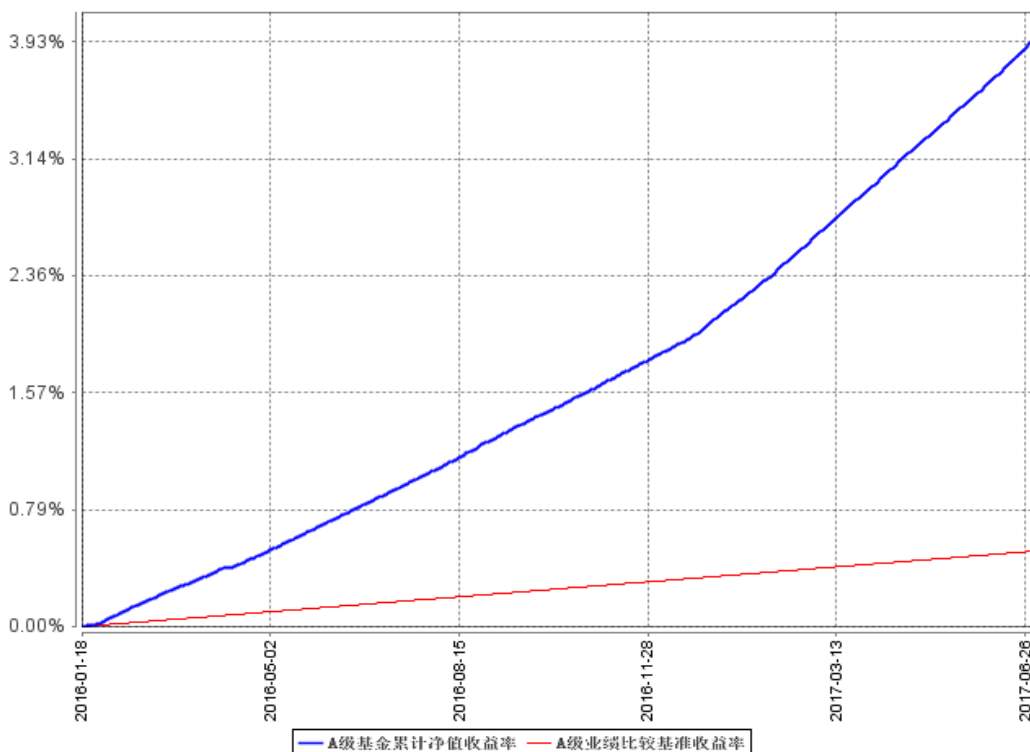
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3551%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.3263%	0.0003%
过去三个月	1.0452%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.9579%	0.0007%
过去六个月	1.9769%	0.0011%	0.1736%	0.0000%	1.8033%	0.0011%
过去一年	3.3105%	0.0023%	0.3495%	0.0000%	2.9610%	0.0023%
自基金合同 生效起至今	4.3542%	0.0024%	0.5073%	0.0000%	3.8469%	0.0024%

融通汇财宝货币 E

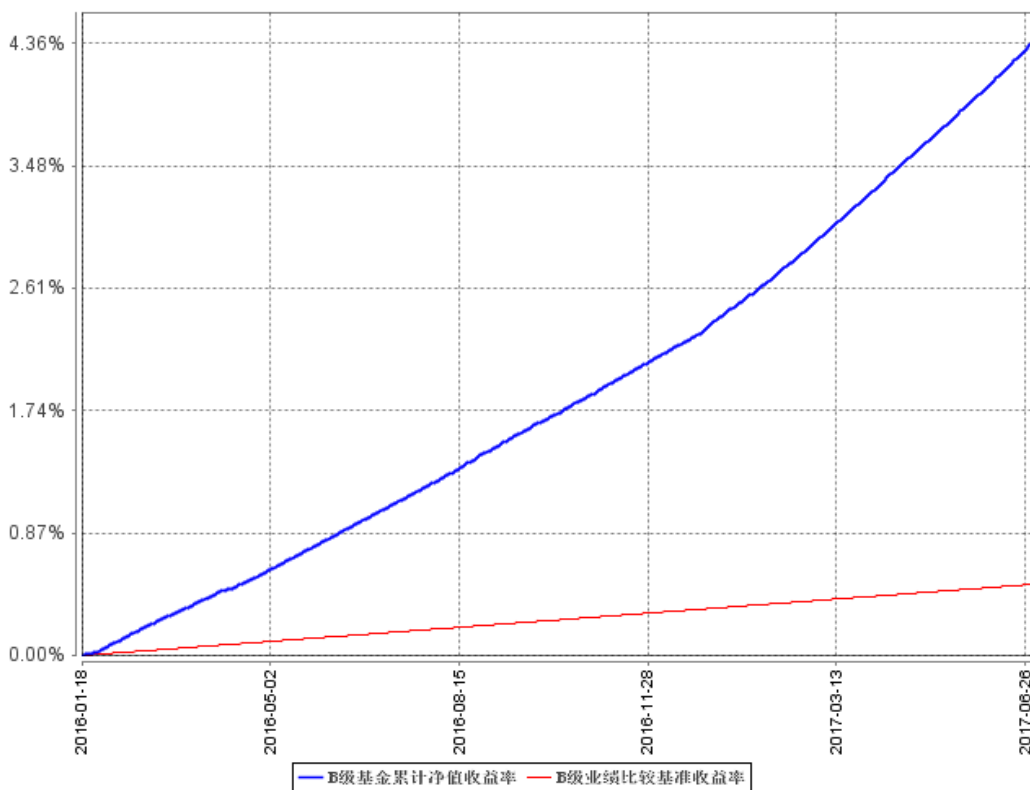
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3510%	0.0003%	0.0288%	0.0000%	0.3222%	0.0003%
过去三个月	1.0328%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.9455%	0.0007%
自 2017 年 3 月 14 日起至 今	1.2306%	0.0007%	0.1045%	0.0000%	1.1261%	0.0007%

### 3.2.2 自基金转型以来基金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

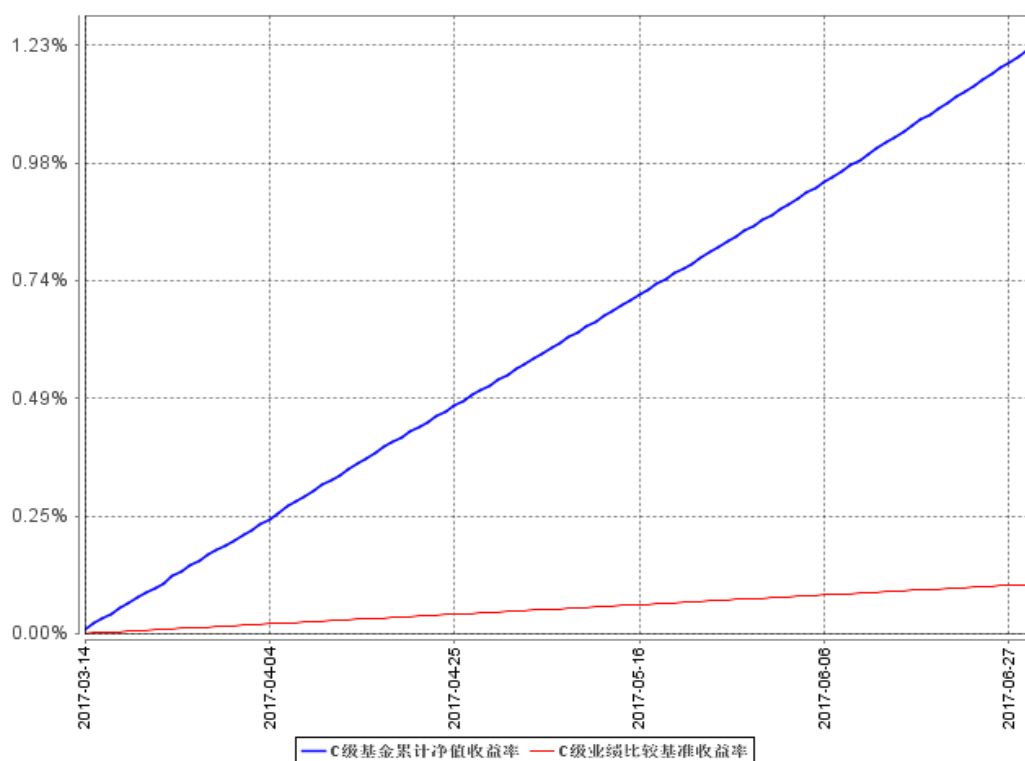
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金的转型日为 2016 年 1 月 18 日。

2、自 2017 年 3 月 13 日，本基金实施基金份额分类，增设 E 类份额。融通汇财宝货币 E 的数据统计期间为 2017 年 3 月 14 日至本报告期末止。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立，公司注册资本 12500 万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券股份有限公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至 2017 年 6 月 30 日，公司共管理六十六只开放式基金：即融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证 100 指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮 100 指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长混合基金（LOF）、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法（QDII-FOF）基金、融通汇财宝货币市场基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽混合基金、融通通福债券基金（LOF）、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利基金、融

通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通中证大农业指数基金（LOF）、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长 30 混合基金、融通中国风 1 号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通增丰债券基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通通景混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通尚混合基金、融通新优选混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金和融通通穗债券基金、融通通弘债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金（LOF）。其中，融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王涛	本基金的基金经理	2015 年 1 月 6 日	-	14	王涛先生，南开大学经济学硕士，14 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任中国工商银行深圳市分行外汇及衍生品交易员、招商银行总行金融市场部交易员、东莞证券固定收益类产品投资经理。2014 年 9 月加入融通基金管理有限公司，现任融通易支付货币、融通汇财宝货币（由原融通七天理财债券转型而来）、融通通源短融债券、融通增利债券、融通通安债券、融通月月添利定期开放债券、融通通福债券（LOF）（由原融通通福分级债券转型而来）、融通通和债券、融通通祺债券、融通通宸债券、融通通玺债券、融通通穗债券、融通通弘债券、融通通颐定期开放债券基金的基金经理。

注：1、任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

2、2017 年 7 月 28 日起，王涛先生不再担任本基金的基金经理，由黄浩荣先生担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2017 年 7 月 28 日在《证券时报》和公司网站上刊登的相关公告。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 上半年美联储加息节奏明显加快，3 月、6 月已经分别加息 25BP，并在 6 月议息会议后明确了缩表计划，美联储对通胀前景并不悲观，美联储货币政策正常化的进程可能已经是长期趋势，全球主要经济体货币政策呈分化趋势。但目前来看，除非美联储的加息及缩表进程超预期，否则其货币政策的外溢效应对中国货币政策尽管会构成一定制约，但影响效果有限，中国货币政策的主要考虑因素仍是国内经济增长和金融防风险的需要。2017 年上半年国内宏观经济总体增长平稳，通货膨胀水平总体不高，在库存周期和外需边际向好的带动下，经济增长相对稳定，市场主要受到货币政策的边际收紧和监管政策的渐次实施影响。本基金在上半年跟随市场变化，适度调整了组合久期和品种结构。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期融通汇财宝货币 A 的基金份额净值收益率为 1.8722%，本报告期融通汇财宝货币 B 的基金份额净值收益率为 1.9769%，本报告期融通汇财宝货币 E 的基金份额净值收益率为 1.2306%，A 类、B 类基金份额同期业绩比较基准收益率为 0.1736%，E 类基金份额同期业绩比较基准收益率为 0.1045%。



#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年“防风险、去杠杆”的基调大概率持续，但伴随债市杠杆水平的渐进去化，若进入监管层的相对合意区间，货币政策可能会出现边际放松和平稳，通过公开市场操作和 MLF 等工具维护资金面的松紧适度，但整体大概率维持上半年的中性偏紧的态势，仍需防范时点冲击。本基金将利用市场波动时机，把握同业存单、短融等品种配置机会，在控制组合久期前提下，择机维持适度的杠杆水平。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及应用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，风险管理部负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金自转型之日起至 2016 年 9 月 18 日，本基金的利润分配方式为每日结转收益，按月结转份额，投资者的累计收益定于每月 15 日集中支付；自 2016 年 9 月 19 日至今，本基金的利润分配方式为每日分配收益，按日结转份额。结转时按 1.00 元面值自动转为基金份额，若该工作日为非工作日，则顺延到下一工作日。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对融通汇财宝货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，融通汇财宝货币市场基金的管理人——融通基金管理有限公司在融通汇财宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对融通基金管理有限公司编制和披露的融通汇财宝货币市场基金 2017 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：融通汇财宝货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7,110,990,485.72	590,870,978.46
结算备付金	49,475,092.39	2,226,033.13
存出保证金	133,269.45	3,779.75
交易性金融资产	6,713,871,561.26	688,044,296.76
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	6,713,871,561.26	688,044,296.76
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	843,920,625.88	1,251,149,891.72
应收证券清算款	52,964,246.60	-

应收利息	47,324,915.60	4,093,636.72
应收股利	-	-
应收申购款	7,561,813.36	39,027,850.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	14,826,242,010.26	2,575,416,466.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2017年6月30日</b>	<b>2016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	-	-
卖出回购金融资产款	887,489,434.56	110,000,000.00
应付证券清算款	50,161,249.67	6,053,224.46
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,764,646.99	124,580.49
应付托管费	1,105,858.79	49,832.20
应付销售服务费	44,938.86	816.60
应付交易费用	51,367.59	7,892.05
应交税费	-	-
应付利息	38,925.23	3,152.98
应付利润	1,627,835.21	501,965.41
递延所得税负债	-	-
其他负债	78,724.36	69,300.00
负债合计	943,362,981.26	116,810,764.19
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	13,882,879,029.00	2,458,605,702.62
未分配利润	-	-
所有者权益合计	13,882,879,029.00	2,458,605,702.62
负债和所有者权益总计	14,826,242,010.26	2,575,416,466.81

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，融通汇财宝货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 130,748,125.98 份；融通汇财宝货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 13,714,476,900.92 份；融通汇财宝货币 E 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 37,654,002.10 份。融通汇财宝货币份额总额合计为 13,882,879,029.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：融通汇财宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年	2016 年 1 月 18 日(基金转型日)

	6 月 30 日	至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	200,814,528.09	3,078,680.84
1. 利息收入	198,416,227.37	3,076,714.13
其中：存款利息收入	126,424,101.12	1,663,040.87
债券利息收入	68,768,340.43	1,339,078.20
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,223,785.82	74,595.06
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	2,398,300.72	1,966.71
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,398,300.72	1,966.71
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益	-	-
4. 汇兑收益	-	-
5. 其他收入	-	-
<b>减：二、费用</b>	29,421,524.35	561,915.92
1. 管理人报酬	10,380,411.49	270,698.62
2. 托管费	4,152,164.55	108,265.25
3. 销售服务费	152,161.50	12,266.12
4. 交易费用	125.00	-
5. 利息支出	14,512,203.98	73,222.75
其中：卖出回购金融资产支出	14,512,203.98	73,222.75
6. 其他费用	224,457.83	97,463.18
<b>三、利润总额</b>	171,393,003.74	2,516,764.92
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	171,393,003.74	2,516,764.92

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通汇财宝货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基	2,458,605,702.62	-	2,458,605,702.62

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	171,393,003.74	171,393,003.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	11,424,273,326.38	-	11,424,273,326.38
其中: 1. 基金申购款	18,018,960,813.08	-	18,018,960,813.08
2. 基金赎回款	-6,594,687,486.70	-	-6,594,687,486.70
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-171,393,003.74	-171,393,003.74
五、期末所有者权益(基金净值)	13,882,879,029.00	-	13,882,879,029.00
项目	上年度可比期间 2016年1月18日(基金转型日)至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	18,562,363.21	-	18,562,363.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,516,764.92	2,516,764.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	325,953,230.75	-	325,953,230.75
其中: 1. 基金申购款	382,451,121.54	-	382,451,121.54
2. 基金赎回款	-56,497,890.79	-	-56,497,890.79
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-2,516,764.92	-2,516,764.92
五、期末所有者权益(基金净值)	344,515,593.96	-	344,515,593.96

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:

张帆	颜锡廉	刘美丽
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告一致。

## 6.4.2 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

## 6.4.3 关联方关系

### 6.4.3.1 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

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.3.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间无通过关联方交易单元的交易。

### 6.4.4.2 关联方报酬

#### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至 2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月18日(基金转型日)至 2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	10,380,411.49	270,698.62
其中：支付销售机构的客户维护费	131,365.98	3,348.45

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.27% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.27% / 当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 18 日(基金转型日)至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4, 152, 164. 55	108, 265. 25

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.08%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.08\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.4.2.3 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	融通汇财宝货币 A	融通汇财宝货币 B	融通汇财宝货币 E	合计
中国工商银行	137, 882. 26	-	-	137, 882. 26
融通基金管理有限公司	3, 534. 03	-	3, 021. 60	6, 555. 63
合计	141, 416. 29	-	3, 021. 60	144, 437. 89
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 18 日(基金转型日)至 2016 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	融通汇财宝货币 A	融通汇财宝货币 B	融通汇财宝货币 E	合计
中国工商银行	4, 472. 21	-	-	4, 472. 21
融通基金管理有限公司	4, 572. 12	-	-	4, 572. 12
合计	9, 044. 33	-	-	9, 044. 33

注：1、基金 A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额按照不同的费率计提销售服务费，A 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.33%年费率计提，B 类基金份额不收取销售服务费，E 类基金份额的销售服务费按照前一日基金净值的 0.05%年费率计提。

本基金销售服务费计提的计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为各级基金份额每日应计提的销售服务费

E 为前一日该级基金份额的基金资产净值

R 为该级基金份额的销售服务费率

2、根据《融通基金管理有限公司关于融通汇财宝货币市场基金 A 类份额销售服务费优惠的公告》，自 2016 年 12 月 26 日起至 2017 年 3 月 31 日，销售服务费率调整为 0.05%，调整后，本基

金的销售服务费按前一日 A 类基金资产净值的 0.05% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 A 类基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

3、基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送上月基金销售服务费划付指令，基金托管人复核后于次日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人指定的基金销售机构，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	121,992,252.88	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016 年 1 月 18 日(基金转型日)至 2016 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-

#### 6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	融通汇财宝货币 A	融通汇财宝货币 B	融通汇财宝货币 E
基金转型日（2016 年 1 月 18 日）持有的基金份额	3,016,072.95	-	-
期初持有的基金份额	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	-	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-	-



项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 18 日(基金转型日)至 2016 年 6 月 30 日		
	融通汇财宝货币 A	融通汇财宝货币 B	融通汇财宝货币 E
基金转型日(2016 年 1 月 18 日)持有的基金份额	3,016,072.95	-	-
期初持有的基金份额	3,016,072.95	-	-
期间申购/买入总份额	23,351.48	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-	-
期末持有的基金份额	3,039,424.43	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.88%	-	-

注: 1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 基金管理人融通基金申购/买入总份额均为红利再投份额。

3. 基金管理人融通基金赎回本基金的交易通过融通基金直销柜台办理, 适用赎回费率为零。

#### 6.4.4.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末, 基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

#### 6.4.4.5 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		2016 年 1 月 18 日(基金转型日)至 2016 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	8,990,485.72	103,828.08	264,842.89	9,340.97

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管, 按银行同业利率计息。

#### 6.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券;

2、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期内承销的证券。

#### 6.4.4.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项的说明。

#### 6.4.5 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.5.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金为货币基金，不从事股票交易。

##### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 189,489,434.56 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
111713041	17 浙商银行 CD041	2017 年 7 月 3 日	98.01	400,000	39,204,000.00
170408	17 农发 08	2017 年 7 月 6 日	99.75	310,000	30,922,500.00
150207	15 国开 07	2017 年 7 月 6 日	100.25	1,200,000	120,300,000.00
合计				1,910,000	190,426,500.00

###### 6.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 698,000,000.00 元，于 2017 年 7 月 3 日、2017 年 7 月 4 日、2017 年 7 月 5 日先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

## § 7 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	6,713,871,561.26	45.28
	其中：债券	6,713,871,561.26	45.28
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	843,920,625.88	5.69
	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	7,160,465,578.11	48.30
4	其他各项资产	107,984,245.01	0.73

5	合计	14,826,242,010.26	100.00
---	----	-------------------	--------

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	8.77	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	887,489,434.56	6.39
	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基金资产净值的 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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	24

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

### 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	25.69	1.73
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	31.32	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	31.56	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	0.14	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天(含)—397 天(含)	17.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		106.40	1.73

#### 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

报告期内投资组合平均剩余存续期限未出现超过 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	562,697,986.60	4.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	485,943,506.34	3.50
	其中：政策性金融债	485,943,506.34	3.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	149,976,927.13	1.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,515,253,141.19	39.73
8	其他	-	-
9	合计	6,713,871,561.26	48.36
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序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	019557	17 国债 03	4,634,620	463,153,622.54	3.34
2	108601	国开 1703	3,159,034	315,644,421.25	2.27
3	111716087	17 上海银行 CD087	3,000,000	299,538,057.32	2.16
4	111711171	17 平安银行 CD171	3,000,000	299,281,567.76	2.16
5	111795405	17 上海农商银行 CD101	2,000,000	199,760,356.87	1.44
6	111712097	17 北京银行 CD097	2,000,000	199,060,164.03	1.43
7	111797831	17 广州农村商业商行 CD088	2,000,000	198,801,757.12	1.43
8	111710251	17 兴业银行 CD251	2,000,000	198,673,557.58	1.43
9	111720087	17 广发银行 CD087	2,000,000	198,647,668.46	1.43
10	111711209	17 平安银行 CD209	2,000,000	198,633,425.42	1.43

#### 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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0205%

报告期内偏离度的最低值	-0.0391%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0123%

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期末未出现偏离度绝对值达到 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

本基金本报告期末未出现偏离度绝对值达到 0.5%的情况。

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

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 本基金采用摊余成本法计价,即计价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和折价,在其剩余期限内按照实际利率法每日计提收益。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.9.3 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	133,269.45
2	应收证券清算款	52,964,246.60
3	应收利息	47,324,915.60
4	应收申购款	7,561,813.36
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	107,984,245.01

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
融通汇财宝货币 A	1,920	68,097.98	7,034,249.18	5.38%	123,713,876.80	94.62%
融通汇	40	342,861,922.52	13,617,104,114.92	99.29%	97,372,786.00	0.71%

财宝货币 B						
融通汇财宝货币 E	3,003	12,538.80	1,043,015.86	2.77%	36,610,986.24	97.23%
合计	4,963	2,797,275.65	13,625,181,379.96	98.14%	257,697,649.04	1.86%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	融通汇财宝货币 A	391,501.26	0.2994%
	融通汇财宝货币 B	0.00	0.0000%
	融通汇财宝货币 E	14,626,795.78	38.8453%
	合计	15,018,297.04	0.1082%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通汇财宝货币 A	0
	融通汇财宝货币 B	0
	融通汇财宝货币 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	融通汇财宝货币 A	0
	融通汇财宝货币 B	0
	融通汇财宝货币 E	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	融通汇财宝货币 A	融通汇财宝货币 B	融通汇财宝货币 E
基金转型日（2016 年 1 月 18 日）基金份额总额	8,543,203.86	10,019,159.35	-
本报告期期初基金份额总额	5,787,158.54	2,452,818,544.08	-
本报告期基金总申购份额	475,715,861.25	17,486,071,479.37	57,173,472.46
减：本报告期基金总赎回份额	350,754,893.81	6,224,413,122.53	19,519,470.36
本报告期末基金份额总额	130,748,125.98	13,714,476,900.92	37,654,002.10

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大变动

2017 年 3 月 4 日,本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》,经本基金管理人第五届董事会第十七次临时会议审议并通过,同意孟朝霞女士辞去公司总经理职务,并决定由公司董事长高峰先生代为履行公司总经理职务。

2017 年 6 月 3 日,本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》,经本基金管理人第五届董事会第十八次临时会议决议审议并通过,决定由张帆先生担任公司总经理职务,公司董事长高峰先生不再代为履行公司总经理职务。

2017 年 7 月 28 日起,王涛先生不再担任本基金的基金经理,由黄浩荣先生担任本基金的基金经理。具体内容请参阅 2017 年 7 月 28 日在《证券时报》和公司网站上刊登的相关公告。

#### 10.2.2 本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期内基金托管人无重大人事变更。

#### 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,无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内,本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 基金专用交易单元的选择标准和程序：

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

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

2. 选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤：(1) 券商服务评价；(2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；(3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；(4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3. 本基金本报告期内新增东北证券交易单元 1 个、东兴证券席位 1 个。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-



浙商证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	1,419,487,246.80	84.24%	29,342,900,000.00	81.24%	-	-
中信证券	265,636,438.57	15.76%	6,774,827,000.00	18.76%	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170303-20170630	0.00	5,572,130,770.04	0.00	5,572,130,770.04	40.14%
	2	20170307-20170630	0.00	4,051,232,024.71	0.00	4,051,232,024.71	29.18%
	3	20170123-20170302	289,521,745.84	2,120,944,829.65	1,620,933,465.21	789,533,110.28	5.69%
	4	20170101-20170306	2,000,580,128.99	9,239,379.55	2,009,819,508.54	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为给投资者提供更好的理财服务,经与本基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,并报中国证监会备案,融通基金管理有限公司决定于2017年7月3日起降低A类基金份额的销售服务费率至0.22%/年,并对基金合同部分条款进行修订。详见本基金管理人于2017年7月3日在《证券时报》及公司官方网站发布的《关于融通汇财宝货币市场基金降低销售服务费率并修订基金合同部分条款的公告》。

融通基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十八日