

融通现金宝货币市场基金

2021 年中期报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国建设股份有限公司根据融通现金宝货币市场证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2021 年 8 月 23 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 1 月 1 日起至 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..... | 5 |
| 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 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 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..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 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..... | 12 |
| 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..... | 13 |
| 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..... | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 13 |
| 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真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| § 6 中期财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表..... | 14 |
| 6.2 利润表..... | 15 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 16 |
| 6.4 报表附注..... | 17 |
| § 7 投资组合报告 | 34 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 34 |
| 7.2 债券回购融资情况..... | 35 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 35 |
| 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..... | 36 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 36 |
| 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..... | 36 |

| | |
|--|-----------|
| 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 | 37 |
| 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 | 37 |
| 7.9 投资组合报告附注 | 37 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 39 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 39 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 | 40 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 40 |
| 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 | 40 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 40 |
| § 10 重大事件揭示 | 41 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 41 |
| 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 | 41 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 41 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 41 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 41 |
| 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 | 41 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 41 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 | 43 |
| 10.9 其他重大事件 | 43 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 44 |
| 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 | 44 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 44 |
| § 12 备查文件目录 | 44 |
| 12.1 备查文件目录 | 44 |
| 12.2 存放地点 | 45 |
| 12.3 查阅方式 | 45 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|--------------------|--------------------|
| 基金名称 | 融通现金宝货币市场基金 | |
| 基金简称 | 融通现金宝货币 | |
| 基金主代码 | 002788 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2016 年 11 月 10 日 | |
| 基金管理人 | 融通基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 1,761,236,596.81 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 融通现金宝货币 A | 融通现金宝货币 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 002788 | 004398 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 259,579,803.52 份 | 1,501,656,793.29 份 |

注：融通现金宝货币市场基金于 2016 年 11 月 10 日成立，后经《关于准许融通现金宝货币市场基金变更注册的批复》（证监许可【2021】1287 号）变更注册，并经持有人大会表决于 2021 年 5 月 24 日通过了《关于融通现金宝货币市场基金更换基金托管人并修改法律文件等有关事项的议案》，修订后的《融通现金宝货币市场基金基金合同》自 2021 年 5 月 25 日起生效。

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在严格控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上，力争获得超越业绩比较基准的稳定回报。 |
| 投资策略 | 根据对未来短期利率变动的预测，确定和调整基金投资组合的平均剩余期限。对各类投资品种进行定性分析和定量分析，确定和调整参与的投资品种和各类投资品种的配置比例。在严格控制投资风险和保持资产流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。 |
| 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 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 涂卫东 |
| | 联系电话 | (0755) 26948666 |
| | 电子邮箱 | service@mail.rtfund.com |
| 客户服务电话 | 400-883-8088、(0755) 26948088 | lishen.zh@ccb.com |

| | | |
|-------|-----------------------------|--------------------------|
| 传真 | (0755) 26935005 | (021) 60635778 |
| 注册地址 | 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层 | 北京市西城区金融大街 25 号 |
| 办公地址 | 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层 | 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 |
| 邮政编码 | 518053 | 100033 |
| 法定代表人 | 高峰 | 田国立 |

注：经基金份额持有人大会表决于 2021 年 5 月 24 日通过了《关于融通现金宝货币市场基金更换基金托管人并修改法律文件等有关事项的议案》，融通现金宝货币市场基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.rtfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人处、基金托管人处 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|------------|-----------------------------|
| 注册登记机构 | 融通基金管理有限公司 | 深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14、15 层 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日) | |
|---------------|-------------------------------------|------------------|
| | 融通现金宝货币 A | 融通现金宝货币 B |
| 本期已实现收益 | 2,918,872.00 | 14,784,943.06 |
| 本期利润 | 2,918,872.00 | 14,784,943.06 |
| 本期净值收益率 | 1.0133% | 1.1342% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021 年 6 月 30 日) | |
| | 期末基金资产净值 | 1,501,656,793.29 |
| 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 6 月 30 日) | |

| | | |
|---------|----------|----------|
| 累计净值收益率 | 14.2460% | 14.4510% |
|---------|----------|----------|

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、本基金自基金合同生效日起，利润分配是“每日分配收益，按日结转份额”。

3、修订后的《融通现金宝货币市场基金基金合同》生效日为 2021 年 5 月 25 日，本报告中的财务指标、图表、净值表现、投资组合报告等内容，不受该合同生效日变更影响，仍保持历史数据的延续性，以 2016 年 11 月 10 日（初始成立日）为起始日进行编制。

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

融通现金宝货币 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 | 0.1553% | 0.0005% | 0.0288% | 0.0000% | 0.1265% | 0.0005% |
| 过去三个月 | 0.4676% | 0.0005% | 0.0873% | 0.0000% | 0.3803% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 1.0133% | 0.0017% | 0.1736% | 0.0000% | 0.8397% | 0.0017% |
| 过去一年 | 2.0544% | 0.0016% | 0.3495% | 0.0000% | 1.7049% | 0.0016% |
| 过去三年 | 7.3232% | 0.0019% | 1.0500% | 0.0000% | 6.2732% | 0.0019% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.2460% | 0.0032% | 1.6233% | 0.0000% | 12.6227% | 0.0032% |

融通现金宝货币 B

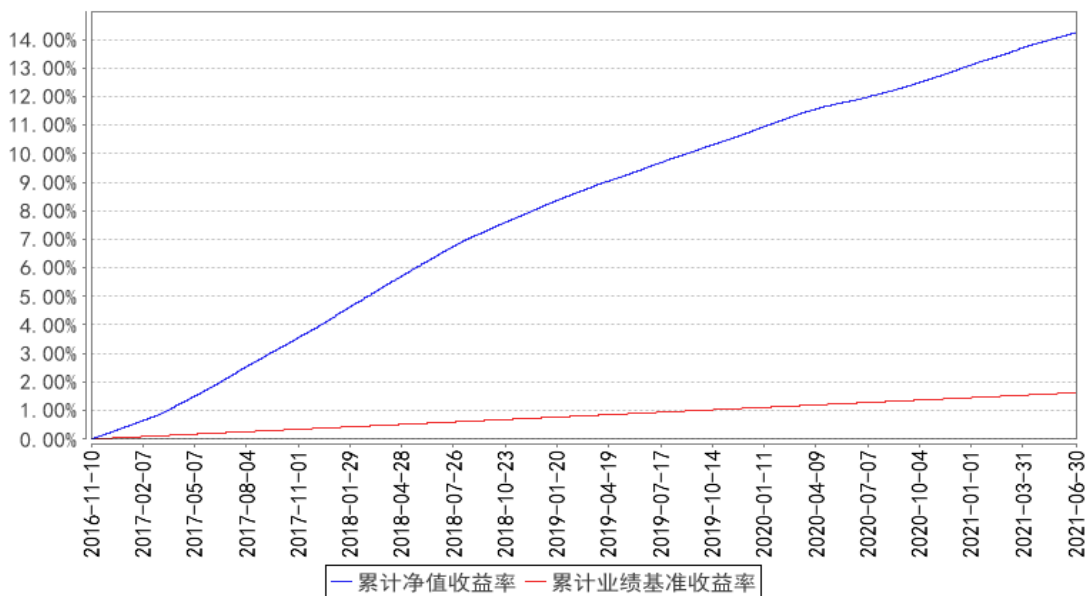
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

| | | 准差② | | ④ | | |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去一个月 | 0.1750% | 0.0005% | 0.0288% | 0.0000% | 0.1462% | 0.0005% |
| 过去三个月 | 0.5278% | 0.0005% | 0.0873% | 0.0000% | 0.4405% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 1.1342% | 0.0017% | 0.1736% | 0.0000% | 0.9606% | 0.0017% |
| 过去一年 | 2.2995% | 0.0016% | 0.3495% | 0.0000% | 1.9500% | 0.0016% |
| 过去三年 | 8.0993% | 0.0019% | 1.0500% | 0.0000% | 7.0493% | 0.0019% |
| 自基金合同生效起至今 | 14.4510% | 0.0033% | 1.5093% | 0.0000% | 12.9417% | 0.0033% |

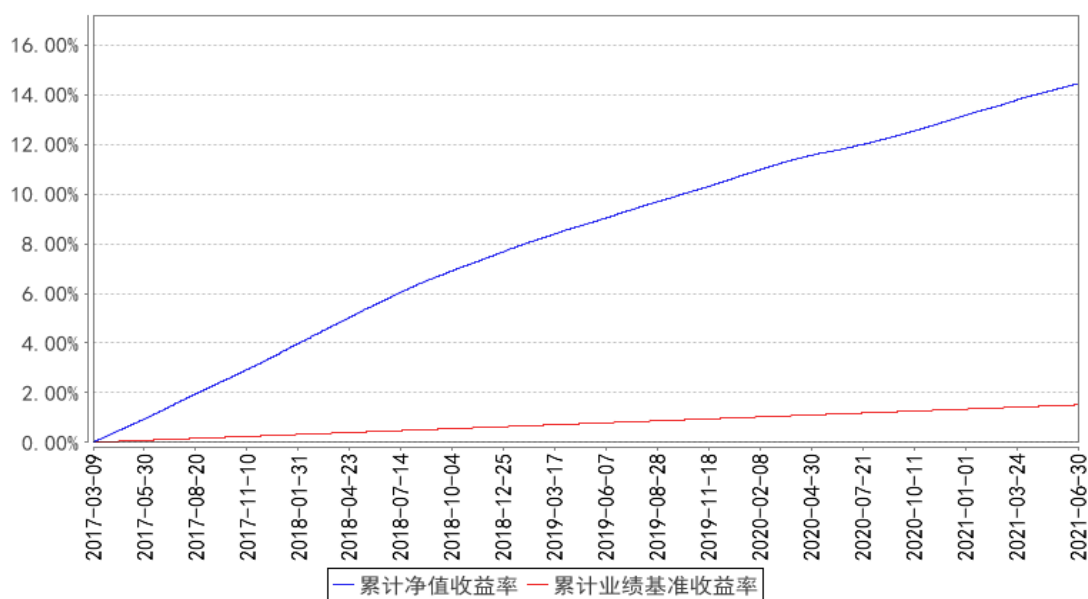
注：为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 11 月 10 日（初始成立日）为起始日进行编制。

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

融通现金宝货币A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



融通现金宝货币B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、本基金于 2017 年 2 月 24 日增加 B 类份额，该类份额首次确认日为 2017 年 3 月 9 日，故本基金 B 类份额的统计期间为 2017 年 3 月 9 日至本报告期末。

2、为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 11 月 10 日（初始成立日）为起始日进行编制。

§ 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金字[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（NikkoAssetManagementCo., Ltd.）40%。

截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理七十六只开放式基金：即融通新蓝筹证券投资基金、融通债券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF)、融通易支付货币市场证券投资基金、融通动力先锋混合型证券投资基金、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF)、融通内需驱动混合型证券投资基金、融通深证成份指数证券投资基金、融通四季添利债券型证券投资基金 (LOF)、融通创业板指数增强型证券投资基金、融通医疗保健行业混合型证券投资基金、融通岁岁添利定期开放债券型证券投资基金、融通通源短融债券型证券投资基金、融通通瑞债券型证券投资基金、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金、融通转型三动力灵活配置混合型证券投资基金、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金、融通

通鑫灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源灵活配置混合型证券投资基金、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金、融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金、融通成长 30 灵活配置混合型证券投资基金、融通汇财宝货币市场基金、融通中国风 1 号灵活配置混合型证券投资基金、融通增鑫债券型证券投资基金、融通增益债券型证券投资基金、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金、融通通安债券型证券投资基金、融通通优债券型证券投资基金、融通通乾研究精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新趋势灵活配置混合型证券投资基金、融通通和债券型证券投资基金、融通沪港深智慧生活灵活配置混合型证券投资基金、融通现金宝货币市场基金、融通通祺债券型证券投资基金、融通可转债债券型证券投资基金、融通通福债券型证券投资基金 (LOF)、融通通宸债券型证券投资基金、融通通玺债券型证券投资基金、融通通润债券型证券投资基金、融通中证人工智能主题指数证券投资基金 (LOF)、融通收益增强债券型证券投资基金、融通中国概念债券型证券投资基金 (QDII)、融通逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通裕定期开放债券型发起式证券投资基金、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通新能源汽车主题精选灵活配置混合型证券投资基金、融通增辉定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增悦债券型证券投资基金、融通研究优选混合型证券投资基金、融通核心价值混合型证券投资基金 (QDII)、融通通盈灵活配置混合型证券投资基金、融通通慧混合型证券投资基金、融通增祥三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增强收益债券型证券投资基金、融通消费升级混合型证券投资基金、融通量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增润三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、融通增享纯债债券型证券投资基金、融通产业趋势股票型证券投资基金、融通中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、融通产业趋势先锋股票型证券投资基金、融通通益混合型证券投资基金、融通创业板交易型开放式指数证券投资基金、融通通恒 63 个月定期开放债券型证券投资基金、融通产业趋势臻选股票型证券投资基金、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金、融通中证云计算与大数据主题指数证券投资基金 (LOF)、融通产业趋势精选 2 年封闭运作混合型证券投资基金、融通价值趋势混合型证券投资基金、融通核心趋势混合型证券投资基金。其中，融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年 | 说明 |
|----|----|-----------------|------|-------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | 限 | |
|-----|----------|-------------|---|---|---|
| 黄浩荣 | 本基金的基金经理 | 2018年11月7日 | - | 7 | 黄浩荣先生，厦门大学管理学硕士，7年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2014年6月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部固定收益研究员、融通通安债券型证券投资基金基金经理、融通通和债券型证券投资基金基金经理、融通通弘债券型证券投资基金基金经理、融通通祺债券型证券投资基金基金经理、融通通宸债券型证券投资基金基金经理、融通通福债券型证券投资基金(LOF)基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通通玺债券型证券投资基金基金经理、融通通穗债券型证券投资基金基金经理、融通通颐定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通昊定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通增利债券型证券投资基金基金经理，现任融通汇财宝货币市场基金基金经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通现金宝货币市场基金基金经理、融通通慧混合型证券投资基金基金经理、融通通昊三个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金的基金经理、融通通益混合型证券投资基金基金经理、融通通远三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通安债券型证券投资基金基金经理。 |
| 刘明 | 本基金的基金经理 | 2018年11月20日 | - | 9 | 刘明先生，北京大学经济学硕士，9年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2012年8月至2017年7月就职于中国建设银行总行金融市场部，从事债券投资交易工作。2017年7月加入融通基金管理有限公司，曾任专户投资经理，现任融通新机遇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通现金宝货币市场基金基金经理、融通通和债券型证券投资基金基金经理、融通通润债券型证券投资基金基金经理、融通易支付货币市场证券投资基金基金经理、融通汇财宝货币市场基金基金经理。 |

注：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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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

回顾 2021 年上半年，虽然金融数据有所弱化，但经济基本面维持较高景气，资金面只有在 1 月下旬演绎了多年来少见的紧张，其他大部分时间都持续维持宽松，且波动性减弱，债市收益率跟随资金面的变化，在春节前后达到高位，之后震荡下行，表现强于市场预期。春节后流动性持续宽松主要是因为央行维稳明显、地方政府债发行偏慢和非银机构加杠杆行为谨慎等原因。此外，大宗商品价格大幅波动和 PPI 的高企并未引发政策对长期通胀的担忧；地方政府和房地产企业举债受到明显制约，宏观杠杆率的控制初见成效。

本基金在 2021 年上半年根据负债端的变化，动态调整了不同资产占比，有效管理了组合利率风险和流动性风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期融通现金宝货币 A 的基金份额净值收益率为 1.0133%，本报告期融通现金宝货币 B 的基金份额净值收益率为 1.1342%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

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，MLF 到期量的增加和地方债发行会自然吸收银行间流动性，但央行会通过降准等手段进行对冲，资金面的表现主要取决于央行对冲的力度和时点，债市在财政后置、融资收缩

趋于平缓、市场机构操作热情恢复等背景下，不确定性和波动性会有所增加。

组合后续仍将密切关注经济基本面和市场流动性的动态变化，根据负债端的变化进行及时调整，在保证流动性和安全性的前提下追求相对收益的提升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金基金 A 级实施利润分配的金额为 2,918,872.00 元。

报告期内，本基金基金 B 级实施利润分配的金额为 14,784,943.06 元。

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

本托管人复核审查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。

§6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：融通现金宝货币市场基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 203,288,988.55 | 170,058,328.53 |
| 结算备付金 | | 115.57 | 33,558.71 |
| 存出保证金 | | 4,925.56 | 4,310.55 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 901,571,474.55 | 1,233,039,185.08 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 901,571,474.55 | 1,193,039,185.08 |
| 资产支持证券投资 | | - | 40,000,000.00 |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 638,904,918.35 | 526,035,629.04 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 5,736,905.48 | 7,958,102.62 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 15,288,516.86 | 16,173,724.76 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 1,764,795,844.92 | 1,953,302,839.29 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 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 | | - | 46,919,856.54 |
| 应付证券清算款 | | 2,688,652.88 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 437,631.24 | 581,294.17 |
| 应付托管费 | | 72,938.56 | 96,882.38 |
| 应付销售服务费 | | 65,220.21 | 118,259.00 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 51,196.00 | 54,161.07 |
| 应交税费 | | 4,796.10 | 25,195.78 |
| 应付利息 | | - | 1,835.54 |
| 应付利润 | | 106,297.06 | 131,755.53 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 132,516.06 | 249,300.00 |
| 负债合计 | | 3,559,248.11 | 48,178,540.01 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 1,761,236,596.81 | 1,905,124,299.28 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 1,761,236,596.81 | 1,905,124,299.28 |
| 负债和所有者权益总计 | | 1,764,795,844.92 | 1,953,302,839.29 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,761,236,596.81 份，其中融通现金宝货币 A 基金份额总额为 259,579,803.52 份，基金份额净值 1 元；融通现金宝货币 B 基金份额总额为 1,501,656,793.29 份，基金份额净值 1 元。

6.2 利润表

会计主体：融通现金宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |
| 一、收入 | | 21,969,884.50 | 20,398,047.78 |
| 1. 利息收入 | | 21,899,854.56 | 20,397,840.91 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 1,687,059.19 | 3,091,860.01 |
| 债券利息收入 | | 13,354,629.51 | 10,191,946.62 |
| 资产支持证券利息收入 | | 298,192.42 | 904,689.03 |
| 买入返售金融资产收入 | | 6,559,973.44 | 6,209,345.25 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |

| | | | |
|-------------------|------------|---------------|---------------|
| 2. 投资收益 | | 70,029.94 | 206.87 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 70,029.94 | 206.87 |
| 资产支持证券投资收 益 | 6.4.7.13.1 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 3. 公允价值变动收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 4. 汇兑收益 | | - | - |
| 5. 其他收入 | 6.4.7.18 | - | - |
| 减：二、费用 | | 4,266,069.44 | 4,096,636.22 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 2,405,281.64 | 2,290,795.14 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 400,880.23 | 381,799.26 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 422,885.42 | 364,319.20 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | - | - |
| 5. 利息支出 | | 850,391.78 | 914,729.19 |
| 其中：卖出回购金融资产支 出 | | 850,391.78 | 914,729.19 |
| 6. 税金及附加 | | 5,774.31 | 7,048.75 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 180,856.06 | 137,944.68 |
| 三、利润总额 | | 17,703,815.06 | 16,301,411.56 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润 | | 17,703,815.06 | 16,301,411.56 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通现金宝货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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） | 1,905,124,299.28 | - | 1,905,124,299.28 |
| 二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润） | - | 17,703,815.06 | 17,703,815.06 |
| 三、本期基金份 额交易产生的基 金净值变动数 | -143,887,702.47 | - | -143,887,702.47 |

| | | | |
|---------------------------|---------------------------------|----------------|-------------------|
| 其中：1. 基金申购款 | 3,831,734,792.09 | - | 3,831,734,792.09 |
| 2. 基金赎回款 | -3,975,622,494.56 | - | -3,975,622,494.56 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | -17,703,815.06 | -17,703,815.06 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,761,236,596.81 | - | 1,761,236,596.81 |
| 项目 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020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) | 1,553,474,296.85 | - | 1,553,474,296.85 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 16,301,411.56 | 16,301,411.56 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | 52,037,499.78 | - | 52,037,499.78 |
| 其中：1. 基金申购款 | 2,644,998,572.08 | - | 2,644,998,572.08 |
| 2. 基金赎回款 | -2,592,961,072.30 | - | -2,592,961,072.30 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 | - | -16,301,411.56 | -16,301,411.56 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 1,605,511,796.63 | - | 1,605,511,796.63 |

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 基金基本情况

融通现金宝货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中

国证监会”)证监许可[2016]889号《关于准予融通现金宝货币市场基金注册的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通现金宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 200,695,266.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2016)第 1450 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《融通现金宝货币市场基金基金合同》于 2016 年 11 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 200,695,659.44 份基金份额,其中认购资金利息折合 393.44 份基金份额。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人自基金合同生效日起为包商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《北京市第一中级人民法院民事裁定书》(2020)京 01 破 270 号之一及中国证监会指定,中国建设银行股份有限公司自包商银行股份有限公司被依法宣告破产之日起担任融通现金宝货币市场基金基金临时基金托管人。

后经召开基金份额持有人大会于 2021 年 5 月 24 日表决通过了《关于融通现金宝货币市场基金更换基金托管人并修改法律文件等有关事项的议案》,融通现金宝货币市场基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司。自 2021 年 5 月 25 日起,原《融通现金宝货币市场基金基金合同》失效,更换基金托管人后的《融通现金宝货币市场基金基金合同》生效。

根据《关于融通现金宝货币市场基金增设 B 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 2 月 24 日起在现有基金份额的基础上增设 B 类基金份额,原基金份额转为 A 类基金份额。基金份额分类后,本基金根据投资者持有的基金份额类别按照不同的费率计提销售服务费用。A 类和 B 类基金份额分别设置基金代码,并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。本基金不同基金份额类别之间不得互相转换,本基金暂不开通 A 类和 B 类基金份额之间的自动升降级业务。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通现金宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于固定收益类金融工具,包括:现金,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,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、资产支持证券以及中国证监会、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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投

资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通现金宝货币市场基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年中期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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%

的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 7,288,988.55 |
| 定期存款 | 196,000,000.00 |
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | 166,000,000.00 |
| 存款期限3个月以上 | 30,000,000.00 |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 203,288,988.55 |

注：定期存款的存款期限指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6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 | 33,431,087.72 | 33,341,006.00 | -90,081.72 | -0.0051 |
| | 银行间市场 | 868,140,386.83 | 868,413,000.00 | 272,613.17 | 0.0155 |
| | 合计 | 901,571,474.55 | 901,754,006.00 | 182,531.45 | 0.0104 |
| 资产支持证券 | - | - | - | - | |
| 合计 | 901,571,474.55 | 901,754,006.00 | 182,531.45 | 0.0104 | |

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

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6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 | 638,904,918.35 | - |
| 合计 | 638,904,918.35 | - |

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 75.52 |
| 应收定期存款利息 | 749,720.28 |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 0.10 |
| 应收债券利息 | 4,647,736.79 |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | 339,370.59 |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 应收出借证券利息 | - |
| 其他 | 2.20 |
| 合计 | 5,736,905.48 |

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | - |
| 银行间市场应付交易费用 | 51,196.00 |
| 合计 | 51,196.00 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 132,516.06 |
| 合计 | 132,516.06 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

融通现金宝货币 A

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|----------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 491,099,397.03 | 491,099,397.03 |
| 本期申购 | 1,069,008,682.70 | 1,069,008,682.70 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -1,300,528,276.21 | -1,300,528,276.21 |
| 本期末 | 259,579,803.52 | 259,579,803.52 |

融通现金宝货币 B

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|----------------|---------------------------------------|-------------------|
| | 基金份额 (份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,414,024,902.25 | 1,414,024,902.25 |
| 本期申购 | 2,762,726,109.39 | 2,762,726,109.39 |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -2,675,094,218.35 | -2,675,094,218.35 |
| 本期末 | 1,501,656,793.29 | 1,501,656,793.29 |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

融通现金宝货币 A

| 项目 | 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 | 2,918,872.00 | - | 2,918,872.00 |
| 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 | -2,918,872.00 | - | -2,918,872.00 |
| 本期末 | - | - | - |

融通现金宝货币 B

| 项目 | 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 | 14,784,943.06 | - | 14,784,943.06 |
| 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 | -14,784,943.06 | | -14,784,943.06 |
| 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1月1日至2021年6月30日 | |
| 活期存款利息收入 | | 1,782.44 |
| 定期存款利息收入 | | 1,684,975.85 |
| 其他存款利息收入 | | - |
| 结算备付金利息收入 | | 259.09 |
| 其他 | | 41.81 |
| 合计 | | 1,687,059.19 |

6.4.7.12 股票投资收益

无。

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|-------------------------|----------------------|------------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | | 1,976,493,305.15 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | | 1,966,332,597.08 |
| 减：应收利息总额 | | 10,090,678.13 |
| 买卖债券差价收入 | | 70,029.94 |

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | |
|----------------|----------------------|---------------|
| | 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
| 卖出资产支持证券成交总额 | | 40,490,126.03 |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | | 40,000,000.00 |
| 减：应收利息总额 | | 490,126.03 |
| 资产支持证券投资收益 | | - |

6.4.7.14 贵金属投资收益

无。

6.4.7.15 衍生工具收益

无。

6.4.7.16 股利收益

无。

6.4.7.17 公允价值变动收益

无。

6.4.7.18 其他收入

无。

6.4.7.19 交易费用

无。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 59,507.37 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 16,841.32 |
| 其他 | 45,000.00 |
| 合计 | 180,856.06 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要作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**

2021 年 2 月 7 日由中国证监会指定中国建设银行股份有限公司为本基金临时基金托管人。后召开基金份额持有人大会于 2021 年 5 月 24 日通过了《关于融通现金宝货币市场基金更换基金托管人并修改法律文件等有关事项的议案》，融通现金宝货币市场基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

本报告期与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的其他关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-------|---------|
|-------|---------|

| | |
|--------------------------|--|
| 融通基金管理有限公司 （“融通基金”） | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 包商银行股份有限公司 （“包商银行”） | 基金托管人、基金销售机构(2021年2月7日前) |
| 中国建设银行股份有限公司 （“建设银行”） | (1) 临时基金托管人（2021年2月7日—2021年5月24日） (2) 基金托管人（自2021年5月25日起） |
| 新时代证券股份有限公司 （“新时代证券”） | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

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

无。

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1月1日至2021年6 月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,405,281.64 | 2,290,795.14 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 497,177.25 | 760,519.79 |

注：1、支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30%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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2021年1月1日至2021年6 月30日 | 上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 400,880.23 | 381,799.26 |

注：1、支付基金托管人包商银行/建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05%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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

2、本期（2021年1月1日至2021年6月30日）应支付的托管费中，2021年1月1日至2021

年 2 月 7 日支付托管人包商银行的托管费为 86,277.31 元, 2021 年 2 月 8 日至 2021 年 6 月 30 日支付托管人建设银行的托管费为 314,602.92 元。上年度可比期间(2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日)应支付的托管费均为应支付给包商银行的金额。

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|----------------|--|-----------|------------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 融通现金宝货币 A | 融通现金宝货币 B | 合计 |
| 包商银行 | 156.14 | 0.00 | 156.14 |
| 直销 | 236,363.70 | 33,846.26 | 270,209.96 |
| 新时代证券 | 30.82 | 93.54 | 124.36 |
| 合计 | 236,550.66 | 33,939.80 | 270,490.46 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 融通现金宝货币 A | 融通现金宝货币 B | 合计 |
| 融通基金 | 46,614.32 | 35,097.22 | 81,711.54 |
| 包商银行 | 1,211.50 | 0.00 | 1,211.50 |
| 新时代证券 | 31.85 | 151.25 | 183.10 |
| 合计 | 47,857.67 | 35,248.47 | 83,106.14 |

注: 支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额和 B 类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付给融通基金, 再由融通基金计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额和 B 类基金份额约定的销售服务费年费率分别为 0.25% 和 0.01%。其计算公式为:

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 A/B 类的基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

无。

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 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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 |
| 包商银行 | 0.00 | 748.58 | 115,741.58 | 2,484.78 |
| 中国建设银行 | 7,288,988.55 | 1,033.86 | - | - |

注：本基金的活期银行存款 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 2 月 19 日由基金托管人包商银行保管，按银行约定利率计息；本基金的活期银行存款 2021 年 2 月 20 日至 2021 年 6 月 30 日由基金托管人建设银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 融通现金宝货币 A | | | | |
|------------------|-------------------|--------------|---------------|----|
| 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 |
| 2,936,241.01 | - | -17,369.01 | 2,918,872.00 | |
| 融通现金宝货币 B | | | | |
| 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 |
| 14,793,032.52 | - | -8,089.46 | 14,784,943.06 | |

注：本基金在本年度累计分配收益 17,703,815.06 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 17,729,273.53 元，应付利润本年变动为-25,458.47 元。

6.4.12 期末(2021 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

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

本基金为货币市场基金，主要投资于货币市场工具。本基金在日常经营活动中涉及的财务风

险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念，高度重视风险管理的组织保障和制度保障，建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程，力争在风险最小化的前提下，确保基金份额持有人利益最大化。

董事会对有效的风险管理承担最终责任，负责确定公司风险管理总体目标，制定公司风险管理战略和风险应对策略；审议重大事件、重大决策的风险评估意见，审批重大风险的解决方案，批准公司基本风险管理制度；审议公司风险管理报告。在董事会下设立风险控制与审计委员会，履行相应风险管理和监督职责。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任，根据董事会的风险管理战略，制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度，并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会，负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作；制定相关风险控制政策，审批风险管理重要流程和风险限额，并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致；识别公司各项业务所涉及各类重大风险，对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估，制定重大风险的解决方案；识别和评估新产品、新业务的新增风险，并制定控制措施；重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件，提出控制措施和解决方案；协调突发性重大风险事件的处理；审定风险事件责任人的责任；根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工，组织实施风险应对方案。

各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，执行风险管理的基本制度流程，定期对本部门的风险进行评估，对其风险管理制度和流程的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人，各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人，基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责，负责执行公司的风险管理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情

况，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和
建议，并报告法规和制度的执行情况。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行
存款存放在本基金的托管行建设银行；本基金的定期存款存放在具有基金托管资格的广发银行股
份有限公司、中国民生银行股份有限公司以及华夏银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信
用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方
式进行限制以控制相应的信用风险；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期
信用评级在 AAA 级以下 的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，
且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具
占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例
合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银
行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021 年 6 月 30 日 | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 119,982,034.03 | 261,671,042.98 |
| 合计 | 119,982,034.03 | 261,671,042.98 |

注：1、未评级债券为超短期融资券、国债和政策性金融债。

2、债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资余额为 0 元（于
2020 年 12 月 31 日，本基金持有按信用评级列示的资产支持证券投资余额为 40,000,000.00 元，

均为短期信用评级 AAA 级的证券)。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 647,938,809.13 | 795,943,210.27 |
| 合计 | 647,938,809.13 | 795,943,210.27 |

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2021年6月30日 | 上年度末 2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA | 33,431,087.72 | 4,914,118.61 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 100,219,543.67 | 130,510,813.22 |
| 合计 | 133,650,631.39 | 135,424,931.83 |

注：1、未评级部分为政策性金融债。

2、债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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。

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，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基

金资产净值的 20%。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不低于 30%，且本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例、投资组合的平均剩余期限及平均剩余存续期皆符合有关法规的要求。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值未超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，

以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2021年6月 30日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|------------------|----------------|---------------|---------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 153,288,988.55 | 20,000,000.00 | 30,000,000.00 | - | 203,288,988.55 |
| 结算备付金 | 115.57 | - | - | - | 115.57 |
| 存出保证金 | 4,925.56 | - | - | - | 4,925.56 |
| 交易性金融资产 | 491,997,462.24 | 379,800,024.80 | 29,773,987.51 | - | 901,571,474.55 |
| 买入返售金融资产 | 638,904,918.35 | - | - | - | 638,904,918.35 |
| 应收利息 | - | - | - | 5,736,905.48 | 5,736,905.48 |
| 应收申购款 | - | - | - | 15,288,516.86 | 15,288,516.86 |
| 资产总计 | 1,284,196,410.27 | 399,800,024.80 | 59,773,987.51 | 21,025,422.34 | 1,764,795,844.92 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 437,631.24 | 437,631.24 |
| 应付托管费 | - | - | - | 72,938.56 | 72,938.56 |

| | | | | | |
|-------------------------|------------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 应付证券清算款 | - | - | - | 2,688,652.88 | 2,688,652.88 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 65,220.21 | 65,220.21 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 51,196.00 | 51,196.00 |
| 应付利润 | - | - | - | 106,297.06 | 106,297.06 |
| 应交税费 | - | - | - | 4,796.10 | 4,796.10 |
| 其他负债 | - | - | - | 132,516.06 | 132,516.06 |
| 负债总计 | - | - | - | 3,559,248.11 | 3,559,248.11 |
| 利率敏感度缺口 | 1,284,196,410.27 | 399,800,024.80 | 59,773,987.51 | 17,466,174.23 | 1,761,236,596.81 |
| 上年度末 2020年12月 31日 | 1个月以内 | 1-3个月 | 3个月-1年 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 120,058,328.53 | 30,000,000.00 | 20,000,000.00 | - | 170,058,328.53 |
| 结算备付金 | 33,558.71 | - | - | - | 33,558.71 |
| 存出保证金 | 4,310.55 | - | - | - | 4,310.55 |
| 交易性金融资产 | 341,702,842.88 | 721,993,738.70 | 169,342,603.50 | - | 1,233,039,185.08 |
| 买入返售金融资产 | 526,035,629.04 | - | - | - | 526,035,629.04 |
| 应收利息 | - | - | - | 7,958,102.62 | 7,958,102.62 |
| 应收申购款 | - | - | - | 16,173,724.76 | 16,173,724.76 |
| 资产总计 | 987,834,669.71 | 751,993,738.70 | 189,342,603.50 | 24,131,827.38 | 1,953,302,839.29 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 581,294.17 | 581,294.17 |
| 应付托管费 | - | - | - | 96,882.38 | 96,882.38 |
| 卖出回购金融资产款 | 46,919,856.54 | - | - | - | 46,919,856.54 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 118,259.00 | 118,259.00 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 54,161.07 | 54,161.07 |
| 应付利息 | - | - | - | 1,835.54 | 1,835.54 |
| 应付利润 | - | - | - | 131,755.53 | 131,755.53 |
| 应交税费 | - | - | - | 25,195.78 | 25,195.78 |
| 其他负债 | - | - | - | 249,300.00 | 249,300.00 |
| 负债总计 | 46,919,856.54 | - | - | 1,258,683.47 | 48,178,540.01 |
| 利率敏感度缺口 | 940,914,813.17 | 751,993,738.70 | 189,342,603.50 | 22,873,143.91 | 1,905,124,299.28 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日

孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|--------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 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6月30日） | 上年度末（2020年12月31日） |
| 分析 | 市场利率上升 25 个基点 | -279,594.89 | -536,293.21 |
| | 市场利率下降 25 个基点 | 279,857.32 | 536,944.07 |

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

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-----------------------|------------------|---------------|
| 1 | 固定收益投资 | 901,571,474.55 | 51.09 |
| | 其中：债券 | 901,571,474.55 | 51.09 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 638,904,918.35 | 36.20 |
| | 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 | 203,289,104.12 | 11.52 |
| 4 | 其他各项资产 | 21,030,347.90 | 1.19 |
| 5 | 合计 | 1,764,795,844.92 | 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 | 5.27 | |
| | 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 | - | - |
| | 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

无。

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 | 29 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 64 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 29 |

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出现超过 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 | 67.25 | 0.15 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 16.47 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 5.69 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 7.91 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 1.69 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.01 | 0.15 |

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

无。

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 | 29,946,522.72 | 1.70 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 133,596,036.70 | 7.59 |
| | 其中：政策性金融债 | 110,235,831.14 | 6.26 |
| 4 | 企业债券 | 10,070,882.16 | 0.57 |
| 5 | 企业短期融资券 | 80,019,223.84 | 4.54 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 647,938,809.13 | 36.79 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 901,571,474.55 | 51.19 |
| 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 | 180212 | 18 国开 12 | 1,000,000 | 100,219,543.67 | 5.69 |
| 2 | 112107053 | 21 招商银行 CD053 | 1,000,000 | 99,328,859.97 | 5.64 |
| 3 | 112111116 | 21 平安银行 CD116 | 500,000 | 49,933,698.56 | 2.84 |
| 4 | 112106123 | 21 交通银行 CD123 | 500,000 | 49,929,809.65 | 2.83 |
| 5 | 112007098 | 20 招商银行 CD098 | 500,000 | 49,922,197.92 | 2.83 |
| 6 | 112018393 | 20 华夏银行 CD393 | 500,000 | 49,904,771.74 | 2.83 |
| 7 | 112113093 | 21 浙商银行 CD093 | 500,000 | 49,902,602.11 | 2.83 |
| 8 | 112004092 | 20 中国银行 CD092 | 500,000 | 49,901,967.00 | 2.83 |
| 9 | 112199101 | 21 宁波银行 | 500,000 | 49,899,911.27 | 2.83 |

| | | | | | |
|----|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| | | CD104 | | | |
| 10 | 112014121 | 20 江苏银行 CD121 | 500,000 | 49,870,951.44 | 2.83 |

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 | 0.0752% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0564% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0296% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

无。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

无。

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

无。

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：

1、本基金投资的前十名证券中的 20 华夏银行 CD393，其发行主体为华夏银行股份有限公司。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会向华夏银行股份有限公司做出了行政处罚决定（银保监罚决字〔2020〕24 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条第（五）项规定和相关审慎经营的规则，就其内控制度执行不到位、审查系统存在重大风险隐患、账务管理工作存在重大错漏、长期未处置风险监控预警信息等违法违规行为，决定罚款 110 万元。

投资决策说明：华夏银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

2、本基金投资的前十名证券中的 18 国开 12，其发行主体为国家开发银行。

2020 年 12 月 25 日，中国银行保险监督管理委员会向国家开发银行做出了行政处罚决定（银保监罚决字〔2020〕67 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，就其为违规的政府购买服务项目提供融资、违规变相发放土地储备贷款、项目资本金管理不到位等二十四项违法违规行为，决定罚款 4880 万元。

投资决策说明：国家开发银行（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利

润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

3、本基金投资的前十名证券中的 21 平安银行 CD116，其发行主体为平安银行股份有限公司。

2021 年 5 月 28 日，中国银保监会云南监管局向平安银行股份有限公司做出了行政处罚决定（云银保监罚决字（2021）34 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，就其利用来源于本行授信的固定资产贷款和黄金租赁融资的资金发放委托贷款，用于承接处置本行其他贷款风险等违法违规行为，决定罚款合计 210 万元。

投资决策说明：平安银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

4、本基金投资的前十名证券中的 20 江苏银行 CD121，其发行主体为江苏银行股份有限公司。

2020 年 12 月 30 日，中国银行保险监督管理委员会江苏监管局向江苏银行股份有限公司做出了行政处罚决定（苏银保监罚决字（2020）88 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项，就其个人贷款资金用途管控不严、发放流动资金贷款偿还银行承兑汇票垫款等违法违规行为，决定罚款 240 万元。

投资决策说明：江苏银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

5、本基金投资的前十名证券中的 20 中国银行 CD092，其发行主体为中国银行股份有限公司。

2020 年 12 月 5 日，中国银行保险监督管理委员会向中国银行股份有限公司做出了行政处罚决定（银保监罚决字（2020）60 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，就产品管理不规范、风险管理不审慎、内控管理不健全、销售管理不合规等违法违规行为，决定罚款合计 5050 万元。

投资决策说明：中国银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

6、本基金投资的前十名证券中的 21 招商银行 CD053、20 招商银行 CD098，其发行主体为招商银行股份有限公司。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会向招商银行股份有限公司做出了行政处罚决定（银保监罚决字（2021）16 号），依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一、四

十五条、四十六条和相关审慎经营规则，就其理财资金池化运作、并表管理不到位等二十七项违法违规行为，决定罚款 7170 万元。

投资决策说明：招商银行股份有限公司（下称“公司”）的上述罚款合计金额在公司 2020 年全年净利润中占比小于 0.1%，对公司整体业务开展以及持续经营无重大不利影响，对公司资金周转和债务偿还影响小。

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 | 4,925.56 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 5,736,905.48 |
| 4 | 应收申购款 | 15,288,516.86 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 21,030,347.90 |

§ 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（%） |
| 融通现金宝货币 A | 420,235 | 617.70 | 1,007,519.09 | 0.39 | 258,572,284.43 | 99.61 |
| 融通现金宝货币 B | 67,960 | 22,096.19 | 918,770,814.69 | 61.18 | 582,885,978.60 | 38.82 |
| 合 | 488,195 | 3,607.65 | 919,778,333.78 | 52.22 | 841,458,263.03 | 47.78 |

| | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|
| 计 | | | | | | |
|---|--|--|--|--|--|--|

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 | 证券类机构 | 201,078,980.62 | 13.39 |
| 2 | 证券类机构 | 201,078,980.62 | 13.39 |
| 3 | 基金类机构 | 101,104,951.86 | 6.73 |
| 4 | 基金类机构 | 100,545,776.09 | 6.70 |
| 5 | 证券类机构 | 100,539,490.30 | 6.70 |
| 6 | 证券类机构 | 100,000,000.00 | 6.66 |
| 7 | 证券类机构 | 50,272,888.10 | 3.35 |
| 8 | 个人 | 40,002,359.10 | 2.66 |
| 9 | 基金类机构 | 25,000,000.00 | 1.66 |
| 10 | 基金类机构 | 25,000,000.00 | 1.66 |

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 | 融通现金宝货币 A | 375,438.87 | 0.14463 |
| | 融通现金宝货币 B | 17,189,711.69 | 1.14472 |
| | 合计 | 17,565,150.56 | 0.99732 |

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 | 融通现金宝货币 A | 0~10 |
| | 融通现金宝货币 B | >=100 |
| | 合计 | >=100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 融通现金宝货币 A | 0~10 |
| | 融通现金宝货币 B | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 融通现金宝货币 A | 融通现金宝货币 B |
|----------------------------|------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2016年11月10日）基金份额总额 | 200,695,659.44 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 491,099,397.03 | 1,414,024,902.25 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,069,008,682.70 | 2,762,726,109.39 |
| 减：本报告期基金总 | 1,300,528,276.21 | 2,675,094,218.35 |

| | | |
|--------------------------|----------------|------------------|
| 赎回份额 | | |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 259,579,803.52 | 1,501,656,793.29 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于 2021 年 5 月 24 日审议通过了《关于融通现金宝货币市场基金更换基金托管人并修改法律文件等有关事项的议案》，融通现金宝货币市场基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。

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) 基金管理人的重大变动

本报告期基金管理人无重大人事变动。

(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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

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)，该事务所自基金合同生效日起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

本报告期内管理人、托管人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 | |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 财达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 2 | - | - | - | - | - |

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

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

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

3、交易单元变更情况

本基金本报告期新增财达证券交易交易单元一个。

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 |
| 财达证券 | 33,653,001.75 | 62.36% | - | - | - | - |
| 海通证券 | 20,311,573.13 | 37.64% | - | - | - | - |

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

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 | 关于融通现金宝货币市场基金由中国建设银行股份有限公司担任临时基金托管人的公告 | 上海证券报 | 2021-2-7 |
| 2 | 融通现金宝货币市场基金 2021 年春节假期前暂停部分销售机构的大额申购、定投及转换转入业务的公告 | 上海证券报 | 2021-2-8 |
| 3 | 融通基金管理有限公司关于融通现金宝货币市场基金修改基金合同等法律文件的公告 | 上海证券报 | 2021-2-19 |
| 4 | 融通关于旗下部分开放式基金新增深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为销售机构并开通转换业务及参加其费率优惠的公告 | 上海证券报 | 2021-3-10 |
| 5 | 融通关于旗下部分开放式基金新增上海联泰基金销售有限公司为销售机构和新增开通基金定期定额投资业务的公告 | 上海证券报 | 2021-3-30 |
| 6 | 融通现金宝货币市场基金 2021 年清算假期前暂停部分销售机构的大额申购、定投及转换转入业务的公告 | 上海证券报 | 2021-3-31 |
| 7 | 融通关于旗下部分开放式基金在上海华夏财富开通定投及参加其申购费率优惠活动的公告 | 上海证券报 | 2021-4-12 |
| 8 | 关于召开融通现金宝货币市场基金基金份额持有人大会的公告 | 上海证券报 | 2021-4-21 |
| 9 | 融通现金宝货币市场基金基金合同修改前后文对照表 | 上海证券报 | 2021-4-21 |
| 10 | 关于召开融通现金宝货币市场基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告 | 上海证券报 | 2021-4-22 |
| 11 | 关于召开融通现金宝货币市场基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告 | 上海证券报 | 2021-4-23 |
| 12 | 融通现金宝货币市场基金 2021 年五一假期前暂停部分销售机构的大额申购、定投及转换转入业务的公告 | 上海证券报 | 2021-4-27 |
| 13 | 关于融通现金宝货币市场基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告 | 上海证券报 | 2021-5-25 |
| 14 | 融通关于旗下部分开放式基金参加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告 | 上海证券报 | 2021-5-31 |
| 15 | 融通旗下部分开放式基金新增上海中正达广为销售机构并开通定投、转换及参与其费率优惠的公告 | 上海证券报 | 2021-6-7 |
| 16 | 关于东方财富证券销售的融通基金旗下部分开放式基金开通定期定额投资业务及参加其费率优惠 | 上海证券报 | 2021-6-8 |

| | | | |
|----|---|-------|-----------|
| | 活动的公告 | | |
| 17 | 融通现金宝货币市场基金 2021 年端午假期前暂停部分销售机构的大额申购、定投及转换转入业务的公告 | 上海证券报 | 2021-6-9 |
| 18 | 关于融通基金管理有限公司旗下部分基金在中泰证券股份有限公司开通转换业务的公告 | 上海证券报 | 2021-6-23 |

§ 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 | - | 20210324-20210329 | 231,322,136.22 | 388,880,538.66 | 620,202,647.91 | 26.97 | 0.00 |
| 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

融通现金宝货币市场基金经中国证监会《关于准予融通现金宝货币市场基金注册的批复》（证监许可【2016】889 号文）准予注册。基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为包商银行股份有限公司，基金合同生效日为 2016 年 11 月 10 日。

2021 年 2 月 7 日由中国证监会指定中国建设银行股份有限公司为本基金临时基金托管人。

2021 年 4 月 26 日至 2021 年 5 月 21 日融通现金宝货币市场基金召开基金份额持有人大会，会议审议通过了《关于融通现金宝货币市场基金更换基金托管人并修改基金合同有关事项的议案》，融通现金宝货币市场基金更换基金托管人为中国建设银行股份有限公司，上述基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效。自 2021 年 5 月 25 日起，原《融通现金宝货币市场基金基金合同》失效，更换基金托管人后的《融通现金宝货币市场基金基金合同》生效。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通现金宝货币市场基金设立的文件
- (二) 《融通现金宝货币市场基金基金合同》
- (三) 《融通现金宝货币市场基金托管协议》

(四)《融通现金宝货币市场基金招募说明书》及其更新

(五)融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照

(六)报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

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

融通基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日