

财通财通宝货币市场基金 2026 年中期报告

2026 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:2026 年 08 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28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2026年01月01日起至2026年06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	7
§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	8
§4 管理人报告	10
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	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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	44
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 债券回购融资情况	44
7.3 基金投资组合平均剩余期限	45
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	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	46
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	47
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	

.....	47
7.9 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
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	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	54
10.9 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
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.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录.....	55
12.1 备查文件目录.....	55
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§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	12,781,654,369.20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	财通财通宝货币C
下属分级基金场内简称	-	-	-
下属分级基金的交易代码	002957	002958	020990
报告期末下属分级基金的份额总额	2,041,122,066.75份	8,176,570,314.07份	2,563,961,988.38份

注：本基金自2024年3月14日起增加收取销售服务费的C类基金份额，取消本基金A类基金份额和B类基金份额的自动升降级业务，取消不同基金份额类别的转换限制。

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	本基金的主要投资策略包括：利率策略、类属配置策略、个券选择策略、相对价值策略、银行存款投资策略、流动性管理策略、资产支持证券投资策略。
业绩比较基准	人民币活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		财通基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	任航
	联系电话	021-20537888	010-66060069
	电子邮箱	service@ctfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-820-9888	95599
传真		021-68888169/021-68888661	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		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45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		吴林惠	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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.ctfund.com
基金中期报告置备地	基金管理人和基金托管人办公地址

点	
---	--

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	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45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 (2026年01月01日-2026年06月30日)		
	财通财通宝 货币A	财通财通宝 货币B	财通财通宝 货币C
本期已实现收益	14,059,122.29	60,212,846.69	1,637,745.43
本期利润	14,059,122.29	60,212,846.69	1,637,745.43
本期净值收益率	0.5078%	0.6279%	0.5599%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)		
	财通财通宝 货币A	财通财通宝 货币B	财通财通宝 货币C
期末基金资产净值	2,041,122,066.75	8,176,570,314.07	2,563,961,988.38
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 (2026年06月30日)		
	财通财通宝 货币A	财通财通宝 货币B	财通财通宝 货币C
累计净值收益率	23.6262%	26.3733%	3.1877%

注：(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本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。

(3)本基金利润分配是按日结转份额。

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
过去三个月	0.2437%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.1552%	0.0004%
过去六个月	0.5078%	0.0004%	0.1761%	0.0000%	0.3317%	0.0004%
过去一年	1.0849%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	0.7294%	0.0005%
过去三年	4.6222%	0.0014%	1.0712%	0.0000%	3.5510%	0.0014%
过去五年	8.7646%	0.0014%	1.7911%	0.0000%	6.9735%	0.0014%
过去七年	13.2366%	0.0014%	2.5171%	0.0000%	10.7195%	0.0014%
自基金合同 生效起至今	23.6262%	0.0025%	3.5881%	0.0000%	20.0381%	0.0025%

财通财通宝货币B

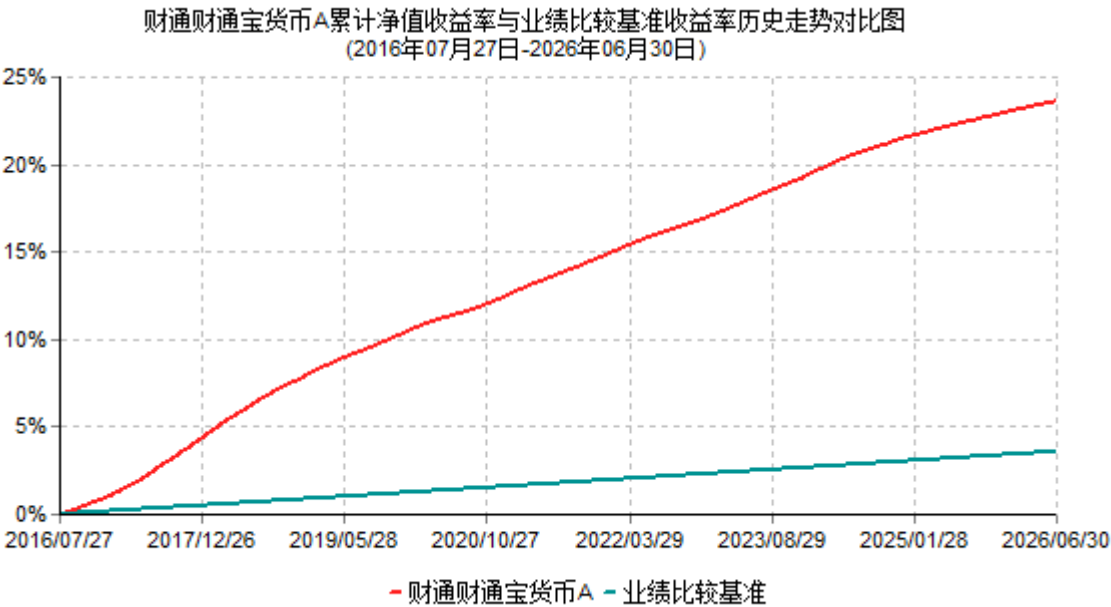
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.3041%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.2156%	0.0004%
过去六个月	0.6279%	0.0004%	0.1761%	0.0000%	0.4518%	0.0004%
过去一年	1.2965%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	0.9410%	0.0005%
过去三年	5.1819%	0.0013%	1.0712%	0.0000%	4.1107%	0.0013%
过去五年	9.8725%	0.0014%	1.7911%	0.0000%	8.0814%	0.0014%
过去七年	14.9411%	0.0013%	2.5171%	0.0000%	12.4240%	0.0013%
自基金合同 生效起至今	26.3733%	0.0025%	3.5881%	0.0000%	22.7852%	0.0025%

财通财通宝货币C

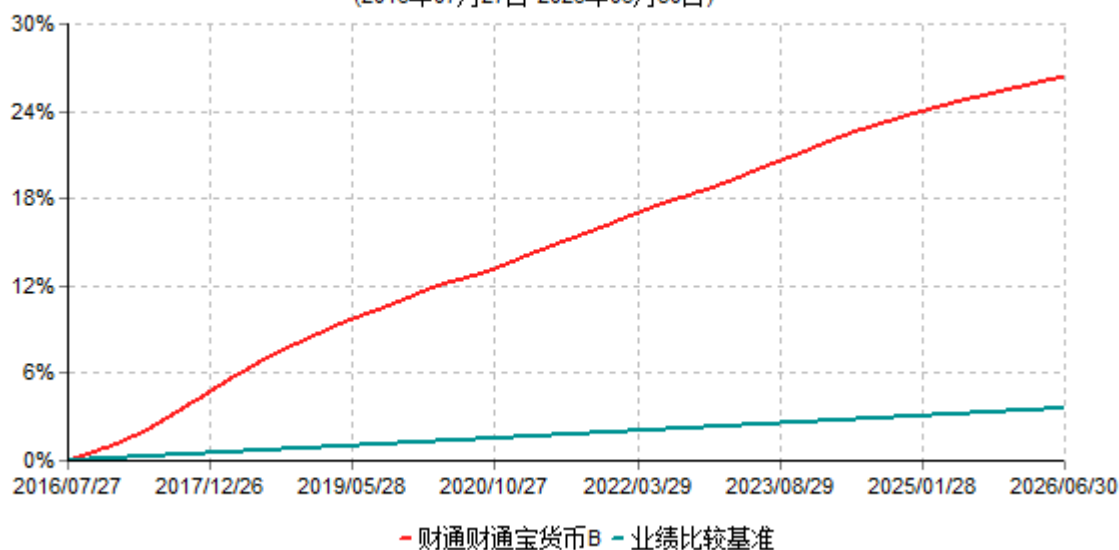
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	0.2710%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.1825%	0.0004%
过去六个月	0.5599%	0.0004%	0.1761%	0.0000%	0.3838%	0.0004%
过去一年	1.1564%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	0.8009%	0.0005%
自增加C类 基金份额起 至今	3.1877%	0.0010%	0.8190%	0.0000%	2.3687%	0.0010%

注：本基金收益分配是按日结转份额。

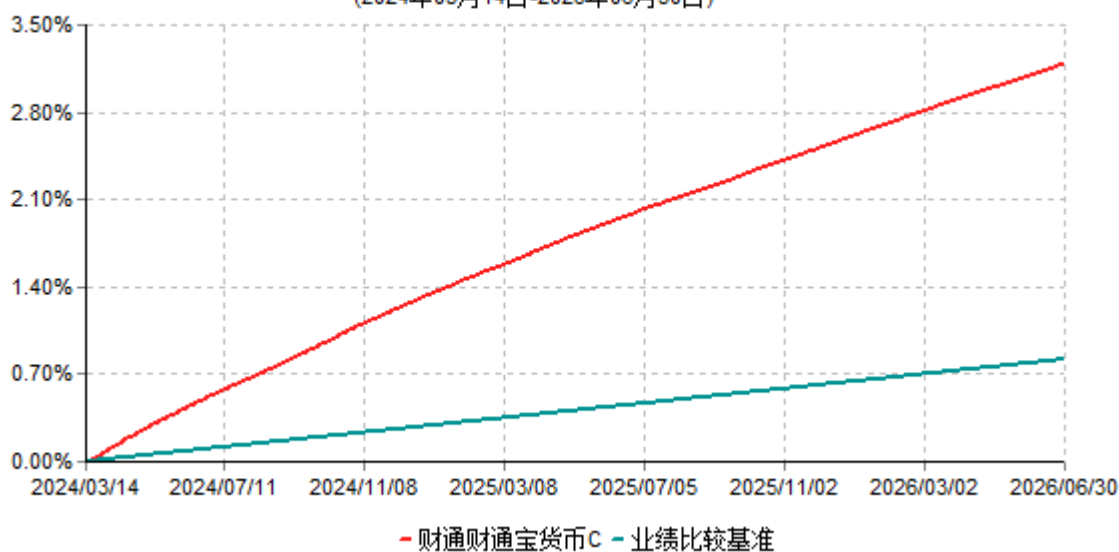
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



财通财通宝货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年07月27日-2026年06月30日)



财通财通宝货币C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年03月14日-2026年06月30日)



- 注：(1)本基金合同生效日为2016年07月27日；
(2)本基金建仓期为自基金合同生效起6个月内，建仓期结束时，本基金各项资产配置比例符合基金合同约定；
(3)本基金自2024年03月14日起增加C类基金份额，相关数据按实际存续期计算。

§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（下称“财通基金”）经中国证监会批准，于2011年6月正式成立。目前公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、QDII、受托管理保险资金投资管理等业务资格。公司股东为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亨通控股股份有限公司，注册资本2亿元人民币，注册地上海。成立15年来，公司收获了“三大报”权威奖项（金牛奖+金基金奖+明星基金奖），先后荣获167项业内权威大奖。

截至2026年6月末，财通基金合计管理规模约2,172.25亿元，其中，公募基金管理规模约1,670.83亿元。公司以打造“特色鲜明、多元发展、客户信赖”的一流资产管理公司为企业愿景，坚持多元化业务布局，旗下公募基金覆盖股票、混合、债券、指数、货币等完整产品线，可满足不同类型客户的多元化需求。同时公司在专户业务中勇于突破，不断探索定增+、固收+、量化+等特色领域，努力以专业创造价值。

财通基金始终恪守“敬畏、感恩、专业、责任”的核心价值观，坚信投研是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为本源，坚守初心、苦练内功，配备了一支资深投研专家团队，纵深一级半、二级市场，持续为投资者创造价值。

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		
罗晓倩	固收多策略投资部 副总经理（主持工 作）、本基金的基金 经理	2017- 07-19	2026- 05-15	13年	复旦大学投资学硕士。历任友邦保险有限公司风控岗，国华人寿保险股份有限公司交易员，汇添富基金管理有限公司债券研究员兼交易员，华福基金管理有限责任公司债券研究员兼交易员，东吴证券股份有限公司投资主办助理。2016年6月加入财通基金管理有限公司，曾任固收投资部基金经理助理、基金经理、副总

					经理，现任固收多策略投资部副总经理（主持工作）、基金经理。
张婉玉	本基金的基金经理	2020-05-12	-	13年	上海财经大学西方经济学硕士。历任交银施罗德基金管理有限公司投研助理，上海国利货币经纪有限公司债券经纪人，兴证证券资产管理有限公司债券交易员。2018年8月加入财通基金管理有限公司，曾任固收投资部基金经理助理，现任固收投资部基金经理。

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

(2)非首任基金经理的“任职日期”和“离任日期”分别为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法律法规及行业协会的相关规定。

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

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》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和本基金合同，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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。本报告期内，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管理办法》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。本报告期内，未发现本基金存在可能导致利益输送的异常交易行为。

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

宏观经济方面，面对外部环境的不确定性，上半年经济顶住压力运行在合理区间。生产端，工业生产较快增长，上半年全国规模以上工业增加值同比增长5.4%，其中装备制造业增加值增长9.3%，高技术制造业增加值增长13.3%，分别快于全部规模以上工业增加值3.9和7.9个百分点。服务业平稳增长，上半年服务业增加值同比增长5.2%，服务业发展向好。需求端，消费市场继续扩容，上半年社会消费品和服务零售总额同比增长2.7%，其中服务零售额同比增长5.3%，商品零售额同比增长1.1%；投资结构持续优化，上半年固定资产投资同比下降5.7%，但高技术产业投资增长4.6%，其中航空航天器及设备制造业投资增长23.3%、信息服务业投资增长15.5%；房地产开发投资同比下降18.0%，仍是主要制约因素。外贸韧性持续彰显，上半年出口增长17.6%、进口增长26.6%。总的来看，上半年经济运行稳中有进，新动能不断成长壮大，但外部不稳定不确定因素较多，国内供强需弱矛盾突出，经济向好基础还需巩固。

宏观政策方面，4月中央政治局会议分析研究当前经济形势和经济工作。会议认为，今年以来我国经济起步有力，主要指标好于预期，同时指出经济持续稳中向好的基础还需进一步巩固。会议强调要用好用足宏观政策，持续优化财政支出结构；增强货币政策前瞻性灵活性针对性，保持流动性充裕。会议部署了深入挖掘内需潜力、加快建设现代化产业体系、有效防范化解重点领域风险等重点任务，提出加强水网、新型电网、算力网、新一代通信网、城市地下管网、物流网等“六张网”建设，全面实施“人工智能+”行动，纵深推进全国统一大市场建设，深入整治内卷式竞争。

产业政策持续加码。6月3日，工业和信息化部印发《“人工智能+信息通信”创新发展实施意见（2026—2028年）》，明确未来三年人工智能与信息通信产业融合发展路径，提出到2028年形成30个以上高价值典型场景、城域算力1毫秒时延圈覆盖率不低于75%等发展目标，部署5G-A规模普及、6G技术研发、网络大模型和智能体创新、算力设施体系优化等重点任务，推动信息通信业与人工智能融合赋能千行百业。制造业景气同步回升，中采咨询数据显示，6月制造业PMI环比回升0.3个百分点至50.3，连续4个月位于荣枯线及以上。位于景气扩张区间的制造业行业主要包括：新科技带动的计算机通信电子、有色、专用设备、金属制品；能源转型影响下的电气机械；受益于“两新”政策和出口共振推动下的汽车；以及涨价因素驱动的石化、纺织、农副食品等。

资金面方面，上半年流动性整体充裕，资金面呈现先松后边际收敛的走势。一季度，央行综合运用MLF、买断式逆回购、国债买卖等工具净投放中长期资金，资金面持续宽松，资金利率低位运行。二季度，央行提出“引导隔夜利率在政策利率水平附近运行”，通过买断式逆回购缩量、MLF加量续作等方式，引导资金利率从超宽松状态向政策利率合理回归。6月末首次启动隔夜逆回购操作，精准呵护跨季流动性，资金面平稳跨季。总体来看，上半年央行流动性管理更加精细化，资金面从超宽松逐步回归均衡偏松格局。

在上半年中，由于资金价格持续走高，本基金保持充足流动性的背景下，加大存单和信用债等波动性资产的比例，拉长组合久期，同时灵活运用杠杆策略，增加波段交易力求提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，财通财通宝货币A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.5078%，同期业绩比较基准收益率为0.1761%；截至本报告期末，财通财通宝货币B基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.6279%，同期业绩比较基准收益率为0.1761%；截至本报告期末，财通财通宝货币C基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.5599%，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

展望后市，随着宏观政策持续发力，新质生产力加快培育壮大，经济有望延续总体平稳、向新向优的发展态势。债市方面，经济运行K型分化、价格温和回升，实体经济融资需求偏弱，基本面对债市仍形成支撑。债市的扰动可能来自于：一是宏观现实与预期的博弈，若PPI未持续下行且财政明显发力，政策和数据的温度变化会影响交易情绪，二是最宽松的资金环境可能已经过去，未来资金可能出现低波动区间下的中枢略升。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会、中国证券投资基金业协会和基金合同关于估值的相关规定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会负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，确定调整/暂停估值方案，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。估值委员会配备投资、研究、会计、风控等岗位资深人员，成员具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。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。估值方法/价格调整需经估值委员会决议通过，并征询基金托管人同意后才能采纳。

基金日常估值由本基金管理人和基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。

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14,059,122.29元，向财通财通宝货币B类份额持有人分配利润60,212,846.69元，向财通财通宝货币C类份额持有人分配利润1,637,745.43元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金未有连续20个工作日出现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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对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、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、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：财通财通宝货币市场基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,524,747,450.37	1,426,186.09
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	6,331,321,843.46	8,399,842,632.35
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,331,321,843.46	8,399,842,632.35
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,440,193,460.82	4,015,307,041.20
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		49,823.74	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		13,296,312,578.39	12,416,575,859.64
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025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		510,019,301.37	100,005,400.44
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,102,238.27	2,135,992.88
应付托管费		1,051,119.13	1,067,996.42
应付销售服务费		743,609.97	604,373.19
应付投资顾问费		-	-
应交税费		83,042.86	53,965.47
应付利润		366,296.01	448,956.66
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	292,601.58	606,458.79
负债合计		514,658,209.19	104,923,143.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,781,654,369.20	12,311,652,715.79
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		12,781,654,369.20	12,311,652,715.79
负债和净资产总计		13,296,312,578.39	12,416,575,859.64

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额总额12,781,654,369.20份。其中A类基金的份额净值1.0000元，份额总额2,041,122,066.75份；B类基金的份额净值1.0000元，份额总额8,176,570,314.07份；C类基金的份额净值1.0000元，份额总额2,563,961,988.38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：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		101,483,327.27	110,489,910.47

1.利息收入		41,434,162.13	48,575,053.32
其中：存款利息收入	6.4.7.9	12,757,603.92	18,395,501.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		28,676,558.21	30,179,552.17
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		60,049,165.14	61,914,857.15
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	60,049,165.14	61,914,857.15
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
减：二、营业总支出		25,573,612.86	22,101,891.61
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	12,587,500.52	12,104,128.00
2.托管费	6.4.10.2.2	6,293,750.26	6,052,064.02
3.销售服务费	6.4.10.2.3	4,135,254.47	1,532,013.36
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		2,356,020.40	2,218,815.81

其中：卖出回购金融资产支出		2,356,020.40	2,218,815.81
6.信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7.税金及附加		40,538.98	36,375.84
8.其他费用	6.4.7.17	160,548.23	158,494.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		75,909,714.41	88,388,018.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		75,909,714.41	88,388,018.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		75,909,714.41	88,388,018.86

6.3 净资产变动表

会计主体：财通财通宝货币市场基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	12,311,652,715.79	-	12,311,652,715.79
二、本期期初净资产	12,311,652,715.79	-	12,311,652,715.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	470,001,653.41	-	470,001,653.41
（一）、综合收益总额	-	75,909,714.41	75,909,714.41
（二）、本期基金份额交易产生的净	470,001,653.41	-	470,001,653.41

资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	38,501,867,378.19	-	38,501,867,378.19
2.基金赎回款	-38,031,865,724.78	-	-38,031,865,724.78
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-75,909,714.41	-75,909,714.41
四、本期期末净资产	12,781,654,369.20	-	12,781,654,369.20
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	15,945,207,694.75	-	15,945,207,694.75
二、本期期初净资产	15,945,207,694.75	-	15,945,207,694.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,975,265,727.12	-	-1,975,265,727.12
（一）、综合收益总额	-	88,388,018.86	88,388,018.86
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,975,265,727.12	-	-1,975,265,727.12
其中：1.基金申购款	27,336,987,629.74	-	27,336,987,629.74
2.基金赎回款	-29,312,253,356.86	-	-29,312,253,356.86

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-88,388,018.86	-88,388,018.86
四、本期期末净资产	13,969,941,967.63	-	13,969,941,967.63

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：

徐春庭

刘为臻

孙金

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”）证监许可[2016]1213号文《关于准予财通财通宝货币市场基金注册的批复》准予注册，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，首次设立募集规模为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。

根据基金管理人财通基金管理有限公司于2024年3月9日发布的《财通基金管理有限公司关于财通财通宝货币市场基金增加C类基金份额、调整基金份额最低交易限额、取消基金份额自动升降级业务及取消基金份额转换限制并修改法律文件的公告》，本基金自2024年3月14日起增加收取销售服务费的C类基金份额，并对本基金的基金合同作相应修改。

本基金对投资者持有的各类基金份额按照不同的费率计提销售服务费用。本基金分设A类、B类和C类三类基金份额，三类基金份额单独设置基金代码，并单独公布每万份基金已实现收益和7日年化收益率。自2024年3月14日起，本基金取消A类和B类基金份额的自动升降级业务，即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，本基金的登记机构将不再把该基金账户持有的A类基金份额自动升级为B类基金份额；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，本基金的登记机构将不再把该基金账户持有的B类基金份额自动降级为A类基金份额。C类基

金份额不进行基金份额升降级。根据基金实际运作情况，在履行适当程序后，基金管理人可调整基金份额升降级的数额限制及规则并公告。

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

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

本基金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

本基金财务报表的编制符合企业会计准则以及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况、自2026年01月01日起至2026年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

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《财政部、国家税务总局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》、财政部、国家税务总局公告2025年第4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令 第826号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告2026年第10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的资管产品运营业务，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027年12月31日前，资管产品管理人运营契约制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。

(2)2027年12月31日前，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债券的转让收入免征增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税；对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在2025年8月8日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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。

(3)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，暂不缴纳企业所得税。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	16,570,478.74
等于：本金	16,447,069.07
加：应计利息	123,409.67
减：坏账准备	-
定期存款	2,508,176,971.63
等于：本金	2,500,000,000.00
加：应计利息	8,176,971.63

减：坏账准备	-
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	2,508,176,971.63
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,524,747,450.37

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		按实际利率计 算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6,331,321,843.46	6,333,267,641.91	1,945,798.45	0.0152
	合计	6,331,321,843.46	6,333,267,641.91	1,945,798.45	0.0152
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,331,321,843.46	6,333,267,641.91	1,945,798.45	0.0152

注：于2026年06月30日，本基金交易性金融资产均为采用摊余成本法摊余的债券投资成本。本基金管理人认为本基金债券投资的公允价值与摊余成本间的差异在合理范围内。

- 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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

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 2026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	4,440,193,460.82	-
合计	4,440,193,460.82	-

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 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06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	-
应付交易费用	200,493.27
其中：交易所市场	-
银行间市场	200,493.27
应付利息	-
预提费用	92,108.31
合计	292,601.58

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 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	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,464,894,170.45	3,464,894,170.45
本期申购	12,048,457,861.87	12,048,457,861.87
本期赎回（以“-”号填列）	-13,472,229,965.57	-13,472,229,965.57
本期末	2,041,122,066.75	2,041,122,066.75

6.4.7.7.2 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	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,845,962,472.79	8,845,962,472.79
本期申购	18,262,686,385.02	18,262,686,385.02
本期赎回（以“-”号填列）	-18,932,078,543.74	-18,932,078,543.74
本期末	8,176,570,314.07	8,176,570,314.07

6.4.7.7.3 财通财通宝货币C

金额单位：人民币元

项目 (财通财通宝货币C)	本期	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	796,072.55	796,072.55
本期申购	8,190,723,131.30	8,190,723,131.30
本期赎回（以“-”号填列）	-5,627,557,215.47	-5,627,557,215.47
本期末	2,563,961,988.38	2,563,961,988.38

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	14,059,122.29	-	14,059,122.29
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	-14,059,122.29	-	-14,059,122.29
本期末	-	-	-

6.4.7.8.2 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	60,212,846.69	-	60,212,846.69
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	-60,212,846.69	-	-60,212,846.69
本期末	-	-	-

6.4.7.8.3 财通财通宝货币C

单位：人民币元

项目 (财通财通宝货币C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-

本期利润	1,637,745.43	-	1,637,745.43
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	-1,637,745.43	-	-1,637,745.43
本期末	-	-	-

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	4,115,774.61
定期存款利息收入	8,176,971.63
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	464,857.68
合计	12,757,603.92

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期无股票投资收益--买卖股票差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	59,844,293.90
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	204,871.24
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	60,049,165.14

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,185,751,404.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,165,307,155.37
减：应计利息总额	20,239,378.08
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	204,871.24

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无债券投资收益--申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益--其他投资收益。

6.4.7.13 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.14 公允价值变动收益

本基金本报告期无公允价值变动收益。

6.4.7.15 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	23,300.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	58,839.92
其他费用	600.00
账户维护费	18,300.00
合计	160,548.23

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 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（"财通基金"）	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 ("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 ("上海财通资产")	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无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 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,587,500.52	12,104,128.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,540,295.25	1,575,418.68
应支付基金管理人的净管理费	10,047,205.27	10,528,709.32

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的0.20%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；
(2)基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,293,750.26	6,052,064.02

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的0.10%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，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 2026年01月01日至2026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	财通财通宝货币C	合计
财通证券	124.84	1,057.98	0.00	1,182.82
财通基金	33,297.41	302,770.21	0.00	336,067.62
农业银行	2,926.01	1.39	0.00	2,927.40
合计	36,348.26	303,829.58	0.00	340,177.84
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025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	财通财通宝货币C	合计
财通证券	256.00	110.30	0.00	366.30
财通基金	37,496.23	359,640.38	0.00	397,136.61
农业银行	4,164.24	237.88	0.00	4,402.12
合计	41,916.47	359,988.56	0.00	401,905.03

注：2023年12月26日前，本基金A类基金份额销售服务费按A类基金份额前一日基金资产净值的0.25%年费率计提；自2023年12月26日起，优惠后的费率为0.01%；自2024年07月24日起，费率恢复为0.25%；自2024年10月21日起，优惠后的费率为0.01%；自2024年11月18日起，费率恢复为0.25%；自2025年07月04日起，优惠后的费率为0.01%；自2025年07月18日起，费率恢复为0.25%；自2025年09月10日起，优惠后的费率为0.01%；自2025年09月23日起，费率恢复为0.25%；自2025年10月24日起，优惠后的费率为0.05%；自2025年11月06日起，费率恢复为0.25%；自2025年12月05日起，优惠后的费率为0.01%；自2025年12月16日起，费率恢复为0.25%。本基金B类基金份额销售服务费按B类基金份额前一日基金资产净值的0.01%年费率计提。本基金C类基金份额销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。

计算方法如下：

$H=E \times \text{销售服务费年费率} / \text{当年天数}$

H为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E为该类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况
无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况
无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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 2026年01月01日至	上年度可比期间 2025年01月01日至
----	--------------------	-------------------------

	2026年06月30日	2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

财通财通宝货币B

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	409,937,723.98	727,049,871.37
报告期间申购/买入总份额	2,014,970,724.93	2,480,029,124.48
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	1,020,000,000.00	2,375,000,000.00
报告期末持有的基金份额	1,404,908,448.91	832,078,995.85
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.18%	6.21%

财通财通宝货币C

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至 2025年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-
---------------------	---	---

注：申购/买入总份额含红利再投、转换入份额；赎回/卖出总份额含转换出份额。

6.4.10.5.2 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

财通财通宝货币B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
财通证券	558,351,267.46	4.3700%	954,710,584.09	7.7500%
上海财通资产	28,890,971.73	0.2300%	0.00	0.0000%

注：除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资财通财通宝货币A和财通财通宝货币C。

6.4.10.6 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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025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
农业银行	16,570,478.74	4,115,774.61	764,532.95	491,818.31

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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均无其他关联交易事项的说明。

6.4.10.8.2 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均无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——固定净值型货币市场基金

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
14,119,634.81	-	-60,512.52	14,059,122.29	-

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
60,302,843.91	-	-89,997.22	60,212,846.69	-

财通财通宝货币C

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
1,569,896.34	-	67,849.09	1,637,745.43	-

6.4.12 期末（2026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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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2026年06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510,019,301.37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
250211	25国开11	2026-07-01	101.23	110,000	11,135,841.22
250431	25农发31	2026-07-01	101.22	4,100,000	415,004,451.16
260401	26农发01	2026-07-01	100.77	1,000,000	100,769,413.02
合计				5,210,000	526,909,705.40

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于2026年06月30日，本基金未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。公司经营管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，经营管理层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，公司设独立的法律合规部和风险管理部，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农业银行，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》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，并对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不超过7个工作日可变现资产的可变现价值，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现

能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资组合的平均剩余期限不超过120天，此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026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							
货币资金	920,332,894.41	-	1,604,414,555.96	-	-	-	2,524,747,450.37
交易性金融资产	350,561,766.26	1,325,558,767.19	4,655,201,310.01	-	-	-	6,331,321,843.46
买入返售	4,440,193,460.82	-	-	-	-	-	4,440,193,460.82

金融 资产							
应收 申购 款	-	-	-	-	-	49,823.74	49,823.74
资产 总计	5,711,088,12 1.49	1,325,558,76 7.19	6,259,615,86 5.97	-	-	49,823.74	13,296,312,57 8.39
负债							
卖出 回购 金融 资产 款	510,019,301. 37	-	-	-	-	-	510,019,301.3 7
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	2,102,238. 27	2,102,238.27
应付 托管 费	-	-	-	-	-	1,051,119. 13	1,051,119.13
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	743,609.9 7	743,609.97
应交 税费	-	-	-	-	-	83,042.86	83,042.86
应付 利润	-	-	-	-	-	366,296.0 1	366,296.01
其他 负债	-	-	-	-	-	292,601.5 8	292,601.58
负债 总计	510,019,301. 37	-	-	-	-	4,638,907. 82	514,658,209.1 9
利率	5,201,068,82	1,325,558,76	6,259,615,86	-	-	-4,589,08	12,781,654,36

敏感 度缺 口	0.12	7.19	5.97			4.08	9.20
上年 度末 2025 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							
货币 资金	1,426,186.09	-	-	-	-	-	1,426,186.09
交易 性金 融资 产	609,150,894. 93	2,935,050,83 8.15	4,855,640,89 9.27	-	-	-	8,399,842,63 2.35
买入 返售 金融 资产	4,015,307,04 1.20	-	-	-	-	-	4,015,307,04 1.20
资产 总计	4,625,884,12 2.22	2,935,050,83 8.15	4,855,640,89 9.27	-	-	-	12,416,575,85 9.64
负债							
卖出 回购 金融 资产 款	100,005,400. 44	-	-	-	-	-	100,005,400.4 4
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	2,135,992. 88	2,135,992.88
应付	-	-	-	-	-	1,067,996.	1,067,996.42

托管费						42	
应付销售服务费	-	-	-	-	-	604,373.19	604,373.19
应交税费	-	-	-	-	-	53,965.47	53,965.47
应付利润	-	-	-	-	-	448,956.66	448,956.66
其他负债	-	-	-	-	-	606,458.79	606,458.79
负债总计	100,005,400.44	-	-	-	-	4,917,743.41	104,923,143.85
利率敏感度缺口	4,525,878,721.78	2,935,050,838.15	4,855,640,899.27	-	-	-4,917,743.41	12,311,652,715.79

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	市场利率下降25个基点	5,984,618.44	7,193,913.32
	市场利率上升25个基点	-5,984,618.44	-7,193,913.32

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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	6,331,321,843.46	8,399,842,632.35
第三层次	-	-
合计	6,331,321,843.46	8,399,842,632.35

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行业等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允

价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2025年12月31日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于2026年06月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	6,331,321,843.46	47.62
	其中：债券	6,331,321,843.46	47.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,440,193,460.82	33.39
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	2,524,747,450.37	18.99
4	其他各项资产	49,823.74	0.00
5	合计	13,296,312,578.39	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	3.11

	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	510,019,301.37	3.99
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的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	89
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	45

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	42.30	3.99
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	4.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	8.52	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-

4	90天(含)—120天	3.17	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	45.74	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		103.87	3.99

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

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

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	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	636,741,600.39	4.98
	其中：政策性金融债	636,741,600.39	4.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,634,137,188.62	12.79
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,060,443,054.45	31.77
8	其他	-	-
9	合计	6,331,321,843.46	49.53
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按公允价值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)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
----	------	------	-------------	------	----------------------

1	112697790	26宁波银行CD214	5,000,000	496,386,283. 27	3.88
2	250431	25农发31	4,100,000	415,004,451. 16	3.25
3	112693438	26宁波银行CD087	3,000,000	298,966,598. 98	2.34
4	112695643	26重庆农村商行CD060	3,000,000	298,325,064. 88	2.33
5	112697070	26广州农村商业银行CD061	3,000,000	297,998,444. 97	2.33
6	112605161	26建设银行CD161	3,000,000	297,941,014. 06	2.33
7	012681211	26厦国贸SCP013	2,500,000	250,467,238. 60	1.96
8	012600501	26厦国贸SCP009	2,000,000	200,843,818. 11	1.57
9	012680885	26象屿SCP004	2,000,000	200,589,226. 04	1.57
10	112695706	26徽商银行CD098	2,000,000	198,879,166. 13	1.56

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0323%
报告期内偏离度的最低值	0.0069%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0203%

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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固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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业发展银行、重庆农村商业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到监管部门处罚。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述情况外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-

4	应收申购款	49,823.74
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	49,823.74

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	91 1,5 65	2,239.14	16,873,108.96	0.83%	2,024,248,957.79	99.17%
财通 财通 宝货 币B	1,0 69	7,648,802.91	8,166,819,750.68	99.8 8%	9,750,563.39	0.12%
财通 财通 宝货 币C	55 6,2 10	4,609.70	0.00	0.00%	2,563,961,988.38	100.00%
合计	1,4 68,	8,701.85	8,183,692,859.64	64.0 3%	4,597,961,509.56	35.97%

	844					
--	-----	--	--	--	--	--

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，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，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	1,404,908,448.91	10.99%
2	券商类机构	558,351,267.46	4.37%
3	基金类机构	322,740,365.60	2.53%
4	银行类机构	310,594,340.88	2.43%
5	券商类机构	288,844,546.37	2.26%
6	银行类机构	270,049,303.54	2.11%
7	基金类机构	205,194,275.43	1.61%
8	其他机构	201,526,323.84	1.58%
9	银行类机构	200,957,154.84	1.57%
10	基金类机构	200,637,583.71	1.57%

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	210,717.95	0.01%
	财通财通宝货币B	454,054.41	0.01%
	财通财通宝货币C	-	-
	合计	664,772.36	0.01%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，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，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	0~10
	财通财通宝货币C	0
	合计	0~10
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	10~50
	财通财通宝货币C	0
	合计	10~50

§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	财通财通宝货币C
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	3,464,894,170.45	8,845,962,472.79	796,072.55
本报告期基金总申购份额	12,048,457,861.87	18,262,686,385.02	8,190,723,131.30
减：本报告期基金总赎回份额	13,472,229,965.57	18,932,078,543.74	5,627,557,215.47
本报告期期末基金份额总额	2,041,122,066.75	8,176,570,314.07	2,563,961,988.38

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

本基金本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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、本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。
- 2、本报告期内，本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

本基金本报告期内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

因内部控制需要，经履行适当程序，本基金管理人于2026年4月2日将本基金会计师事务所由毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）改聘为德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	

财通 证券	2	-	-	-	-	-
东方 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 海通 证券	2	-	-	-	-	-
麦高 证券	2	-	-	-	-	-
申万 宏源	2	-	-	-	-	-
天风 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、选择证券公司参与证券交易的标准

公司结合证券公司的财务状况、经营情况、合规风控能力、交易能力和研究能力完善证券公司的选择标准，证券交易单元所属证券公司需满足以下要求：

- (1)经营行为规范、合规内控制度健全；
- (2)具备高效、安全运作的通讯条件和稳定的交易系统，满足基金投资交易需求；
- (3)具备良好的市场形象和财务状况；
- (4)具备较强的研究及综合服务能力，具有专门的研究机构和专职研究人员；
- (5)被动股票型基金选择合作券商原则上应优先考虑交易服务能力。

公司对券商的服务评价严格遵循法律法规的相关要求，严禁与基金销售规模、保有规模挂钩，严禁以任何形式向证券公司承诺基金证券交易量及佣金或利用交易佣金与证券公司进行利益交换，严禁向第三方转移支付费用。被动股票型基金不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。

2、选择证券公司参与证券交易的程序

- (1)公司建立交易单元管理审议机制，开展证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等审查机制，法律合规部及风险管理部进行前置性审查。
- (2)证券公司交易单元的办理由研究条线发起审批，经审批完成后，由相关部门办理后开通使用。研究条线每季度牵头对券商服务质量开展评价，根据券商服务评价结果，由公司审议当季股票交易量分配计划。

(3)公司建立交易、投研、销售等业务隔离机制，基金销售业务人员不得参与证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配等业务环节。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

本基金本报告期内未租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资。

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	财通财通宝货币市场基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	关于财通财通宝货币市场基金2026年春节前暂停部分代销机构及直销机构申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-06
3	关于财通财通宝货币市场基金2026年清明节前暂停部分代销机构及直销机构申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-27
4	财通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-28
5	财通财通宝货币市场基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
6	财通基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-02
7	财通财通宝货币市场基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22

8	关于财通财通宝货币市场基金2026年劳动节前暂停部分代销机构及直销机构申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-28
9	财通财通宝货币市场基金基金经理变更公告（2026年05月16日公告）	中国证监会规定媒介	2026-05-16
10	财通财通宝货币市场基金更新招募说明书（2026年05月16日公告）	中国证监会规定媒介	2026-05-16
11	财通财通宝货币市场基金基金产品资料概要更新（2026年05月16日公告）	中国证监会规定媒介	2026-05-16
12	关于财通财通宝货币市场基金2026年端午节前暂停部分代销机构及直销机构申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-13

§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

本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、财通财通宝货币市场基金基金合同；
- 3、财通财通宝货币市场基金托管协议；
- 4、财通财通宝货币市场基金招募说明书及其更新；

- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

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43、45楼。

12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：www.ctfund.com

财通基金管理有限公司
二〇二六年八月二十九日