

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:2018年7月19日

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

基金托管人承诺以诚实信用、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2018年4月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称:融通现金宝货币

交易代码:002788

申购赎回方式:契约型开放式

基金合同生效日:2016年11月10日

报告期末基金份额总额:2,827,756,916份

投资目标:在严格控制基金资产净值波动和保持基金资产较高流动性的基础上,力争实现基金资产的稳定增值。

投资策略:根据对未来利率变化的预测,确定和调整基金投资组合的平均期限,对各项投资品种进行定性分析和定量分析,确定和调整参与的投品种类和各种投资品种的配置比例,在严格控制风险和保持资产流动性的前提下,追求基金资产的稳定增值。

风险收益特征:本基金为货币市场基金,是货币市场基金中的低风险品种,其长期平均预期收益率要低于股票基金、混合型基金和债券型基金。

基金管理人:融通基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

下属二级基金的基金简称:融通现金宝货币A 融通现金宝货币B

下属二级基金的交易代码:002788 004398

报告期末下属分级基金的份额:630,185,156份 2,207,570,763份

总资产:630,185,156份 2,207,570,763份

负债:630,185,156份 2,207,570,763份

净资产:630,185,156份 2,207,570,763份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2018年4月1日 - 2018年6月30日)

融通现金宝货币A 融通现金宝货币B

1.本期利润 6,008,980.72 27,316,826.02

2.本期利润 6,008,980.72 27,316,826.02

3.期末基金资产净值 630,185,156.00 2,207,570,763.15

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;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之日起,利润分配是“每日分配收益,按日结转份额”。
(3)基金净值表现

3.2.1 本报告期基金净值增长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 净值增长率① 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

过去三个月 0.0041% 0.0073% 0.0000% 0.0032% 0.0041%

融通现金宝货币B

阶段 净值收益率① 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

过去三个月 1.0013% 0.0041% 0.0073% 0.0000% 0.0041%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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业务相关的工作时间计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

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 公公平交易专项说明

4.3.1 平公正交易制度的执行情况

本基金基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。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 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度4月份资金面较一季度出现了超预期的紧张,6月份资金明显宽松,相应地,单周利率先上后下,一季度末资金面宽松推升3个月回购利率单周大幅下行并突破4%,而4月份央行降准后货币市场资金面不宽松,导致单周利率一路上行,3个月到期利率一度上行60bp至4.5%;一级市场一二级市场资金面不宽松,需求也逐渐提升,并导致资金面持续紧张,而资金面紧张的情况下,资金面也出现了一定的缓解,资金面缓和后,资金面又再度趋紧,资金面缓和后,资金面又再度趋紧。

展望三季度,资金面有可能继续延续6月份宽松的局面,但需特别关注个别月份社融可能会出现结构性的反弹,从而对资金面形成扰动;总体来看因为社融年初以来持续回暖,融资需求的回落大概率的会导致实体经济总需求下降从而导致经济增速下降。

投资方面,本基金在二季度降低了组合剩余期限,从而降低组合剩余期限,同时适当增加长久期的配置,从而对资金面形成扰动;总体来看因为社融年初以来持续回暖,融资需求的回落大概率的会导致实体经济总需求下降从而导致经济增速下降。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末本基金的基金份额净值为1.278元;本报告期基金份额净值增长率为-3.11%,业绩比较基准收益率为1.62%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值变动情况

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金资产的比例(%)

1 权益投资 1,204,591,072.00 36.63

其中:债券 1,204,591,072.00 36.63

贵金属投资 - -

2 固定收益投资 100,000,676.00 3.04

其中:债券(可赎回债券)的买入返售金融资产 - -

3 衍生工具及权证投资 1,941,800,136.00 90.00

4 其他资产 42,560,520.01 1.29

5 合计 3,288,967,403.60 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 制造业 409,239,130.88 16.24

其中:食品饮料 100,000,676.00 3.96

2 信息传输、软件和信息技术服务业 1,941,800,136.00 90.00

3 金融业 42,560,520.01 1.29

5.3 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 项目 金额(元) 占基金资产净值的比例(%)

1 国债 99,349,701.00 3.58

2 中票 100,020,822.00 3.54

3 企业债 100,020,822.00 3.54

4 企业短期融资券 60,000,070.00 1.77

5 合计 964,706,804.00 34.12

5.4 报告期内按行业分类的资产支持证券投资情况

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 债券名称 面值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国债 债券 89,363,701.00 3.18

2 中票 债券 100,020,822.00 3.54

3 企业债 债券 100,020,822.00 3.54

4 企业短期融资券 债券 60,000,070.00 1.77

5 合计 1,204,591,072.00 36.63

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 数量(手) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 1310901306 100国开行债(C)0326 1,000,000.00 99,549,509.11 3.19

2 1310010120 100国债(C)0128 1,000,000.00 99,200,567.10 3.51

3 1310001431 100国债(C)0141 1,000,000.00 99,200,526.07 3.51

4 1310211444 100国债(C)0144 1,000,000.00 97,682,079.00 3.46

5 1310060606 100国开行债(C)0204 1,000,000.00 97,682,079.00 3.46

6 1310011132 100国债(C)0132 1,000,000.00 79,500,465.22 2.81

7 1310211443 100国债(C)0143 1,000,000.00 77,194,109.26 2.73

8 008910 100国债(C)0140 1,000,000.00 50,000,744.20 1.73

9 01006051 100国债(C)0202 500,000.00 50,000,070.00 1.77

10 111000147 100渤海银行CD147 500,000.00 49,696,220.00 1.76

§ 6 开放式基金份额变动

序号 代码 名称 金额(元)

1 002788 002788 16,204,28

2 002788 002788 201,300,000.00 4,206,769,963.21

3 002788 002788 440,462,829.02 4,750,006,891.71

4 002788 002788 530,186,156.00 2,207,570,763.15

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 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

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.itfund.com查询。

融通基金管理有限公司 2018年7月19日

§ 9 投资组合报告附注

5.11 本基金报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.1 本基金报告期末前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

序号 代码 名称 金额(元)

1 002788 002788 74,119,115.07

2 002788 002788 3,977,012.18

3 002788 002788 6,223,690.00