

融通现金宝货币市场基金

2018年第二季度报告

基金管理人：融通基金管理有限公司
基金托管人：包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。

基金托管人包商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中所列数据未经审计。

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	融通现金宝货币市场基金
交易代码	002080
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月30日
报告期末基金份额总额	2,827,766,916.05份
投资目标	严格控制投资风险,在保持资产安全性和流动性的基础上,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	相对收益投资策略:在严格控制风险的前提下,确定和调整基金投资组合的平均期限,对投资组合进行动态调整,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
业绩比较基准	银行活期存款利率(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,其预期风险和预期收益均低于股票型基金、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	包商银行股份有限公司
下属分属基金的基金简称	融通现金宝货币A 融通现金宝货币B
下属分属基金的基金代码	002080 002081
报告期末下属分属基金的资产总额	530,185,156.05 2,297,620,763.15

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2018年4月1日—2018年6月30日)
1.本期已实现收益	6,008,960.72
2.本期利润	6,008,960.72
3.期末基金资产净值	530,185,156.05

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。

阶段	净收益收益率①	净收益收益率基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	1.0203%	0.0041%	0.0072%	0.0000%	0.0033%

注：(1)本基金自基金合同生效日起,利润分配是“每日分配收益,按结转份额”。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净收益收益率①	净收益收益率基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	1.0203%	0.0041%	0.0072%	0.0000%	0.0033%

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

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中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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中所列数据未经审计。

本报告自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	融通中国风1号灵活配置混合
交易代码	002082
前次交易代码	002085
报告变更日期	2016年5月27日
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年5月27日
报告期末基金份额总额	71,872,428.17份
投资目标	本基金主要投资于新上市公司相关优质上市公司,同时通过合理的资产配置,在注重风险控制的的前提下,追求超越基金业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金的投资策略主要是通过基本面分析,筛选具有成长性的上市公司,并在此基础上,结合定量分析,筛选具有成长性的上市公司,并在此基础上,结合定量分析,筛选具有成长性的上市公司。
业绩比较基准	中证全指主要消费指数收益率×50%+沪深300指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益及预期风险水平的投资品种。
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

主要财务指标	报告期(2018年4月1日—2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,813,736.87
2.本期利润	-2,777,376.82
3.期末基金资产净值	81,873,925.04
4.期末基金资产净值	81,873,925.04
5.期末基金资产净值	81,873,925.04

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。

阶段	净收益收益率①	净收益收益率基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	-4.02%	0.15%	-4.52%	0.07%	0.24%

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。

基金管理人：融通基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：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中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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中所列数据未经审计。

本报告自2018年4月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	融通中国风1号灵活配置混合
交易代码	001852
前次交易代码	001853
报告变更日期	2016年2月3日
基金合同生效日	2016年2月3日
报告期末基金份额总额	32,736,007.04份
投资目标	本基金的投资策略主要是通过基本面分析,筛选具有成长性的上市公司,并在此基础上,结合定量分析,筛选具有成长性的上市公司,并在此基础上,结合定量分析,筛选具有成长性的上市公司。
业绩比较基准	中证全指主要消费指数收益率×50%+沪深300指数收益率×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金,但低于股票型基金,属于中等预期收益及预期风险水平的投资品种。
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

主要财务指标	报告期(2018年4月1日—2018年6月30日)
1.本期已实现收益	-1,206,443.72
2.本期利润	-1,925,093.65
3.期末基金资产净值	38,019,360.97
4.期末基金资产净值	38,019,360.97
5.期末基金资产净值	38,019,360.97

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。

阶段	净收益收益率①	净收益收益率基准差②	业绩比较基准收益率③	①-③	②-④
过去三个月	-4.02%	0.15%	-4.52%	0.07%	0.24%

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。

降,这对资产形成支撑,三季度货币市场利率中枢大概率向下。

4.5 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1.0206%,本报告期融通现金宝货币B的基金份额净值收益率为1.0813%,同期业绩比较基准收益率为0.0673%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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元的情形。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	1,204,591,077.89	36.63
2	权益投资	1,204,591,077.89	36.63
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	89,083,270.00	3.18
2	食品饮料	100,000,000.00	3.64
3	其他	100,000,000.00	3.64
4	其他	100,000,000.00	3.64
5	其他	100,000,000.00	3.64
6	其他	100,000,000.00	3.64
7	其他	100,000,000.00	3.64
8	其他	100,000,000.00	3.64
9	其他	100,000,000.00	3.64
10	其他	100,000,000.00	3.64

5.3 报告期末按基金成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券余额(元)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	11180136	中国建设银行3136	1,000,000	99,546,585.11	35.2
2	11180126	18华夏银行CD26	1,000,000	99,500,567.16	35.1
3	11180141	18交通银行CD41	1,000,000	99,500,525.04	35.1
4	11180144	18招商银行CD44	1,000,000	97,582,079.95	3.46
5	11180660	18广发银行CD60	1,000,000	97,582,079.95	3.46
6	11181132	18平安银行CD32	800,000	79,586,466.23	2.81
7	11182143	18招商银行CD43	800,000	77,194,193.35	2.73
8	1801019	18招商银行CD19	600,000	59,906,744.20	2.12
9	01180461	18招商局CD61	500,000	50,000,070.20	1.77
10	11180147	18建设银行CD47	500,000	49,696,224.88	1.76

5.4 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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300176	普利制药	275,756	3,077,115.30	4.22
2	300639	普利制药	51,600	3,746,160.00	4.08
3	600028	中国石化	567,931	3,620,972.19	5.04
4	000661	格力电器	76,100	3,588,115.00	5.01
5	300144	瑞丰新材	124,500	2,925,760.00	5.18
6	600276	恒瑞医药	38,440	2,912,214.40	5.17
7	600418	广汇能源	104,100	2,886,260.00	5.14
8	600812	华北制药	76,400	2,762,071.00	5.04
9	000012	苏宁云	14,002	2,762,300.00	5.03
10	000538	云南白药	25,200	2,695,302.00	5.00

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

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五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.10 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.11 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.13 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.14 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.15 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.16 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.17 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.18 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.19 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.20 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.21 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计	3,251,162,675.79	100.00

5.22 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	62,226,463.27	68.96
2	固定收益投资	62,226,463.27	68.96
3	其他资产	100,000,000.00	3.04
4	其他负债	42,560,520.01	1.29
5	合计		