2.1 基金基本情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况 本基金管理人以价值投资为理念,致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策 、营造公平交易的执行环境,公司通过严格的内控制度和授权体系,确保投资,研 交易等各个环节的独立性。公司将投资管理财能和交易执行职能相隔离,实行集中 3. 并建立了公平的交易分配制度,确保在场内、场外各类交易中,各投资组合都享

6 边库、在此外でしまります。 ・ 本の ・ 本の ・ 本の ・ 本の ・ 本の ・ 本の ・ 大の ・ 大の

公司建立了专门的公平交易制度,并在交易系统中适当启用公平交易模块,保证 公平交易的严格执行,对异常交易的监控包括事前,事中和事后等环节,特殊情况会经

过严格的报告和审批程序,会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价

主动型投资组合未发生过同日反向交易(短期国被回购交易除外)的情况,也未发生影响市场价格的施江日间向或反向交易。 经过事前制度均束,事中严密监控,以及事后的统计排查,本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明,本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响,亦未发现本基金存在异常交易行为。
44 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
441 报告期内基金符及策略和业绩表现的说明
441 报告期内基金资产的分析
本报告期内签资流能仍偏弱,经济继续处于下行通道,生产需求双弱格局未改。房地产下产走势明确且当前限产对生产不利,基建将反弹但预计反弹斜率较缓缓行政效展质。包商事件引发的实体融资压力尚未得到缓解。当前不具备货币政策收案的前进,在经济数据持续偏弱的大背景下,货币政策在趋势上难以收案,海外方面,美俄收基本要包销帐,对国内债产市场,放着依利好国内债券市场。

本报告期内,财通宝继续采用灵活的策略,保持较高组合久期,同时抓住交易机会

进行配置。组合配置上,选择高评级存单及债券,在保持充沛流动性的基础上力求提升

442 报告明内基金的业绩表现 截至报告用末对邮财通空货币人基金份额净值为1,000元,本报告期内,该类基金 份额净值收益率为1,2054%,同期业绩比较基准收益率为0,1761%,截至报告期末财通 财通宝货币日基金份额净值为1,0000元,本报告期内,该类基金份额净值收益率为 1,3262%,同期业绩比较基据收益率为0,1761%。 45 管理人对宏观经济。证券市场及行业走势的简要展望 2019年将面临经济增长环境内外同时放缓的局面,从经济增长和社融的领先滞后 关系来看, 在杠杆对签济的负面影响还未结束,2019年国内经济增长将持续下行;同时 发达国家的经济增长保间作出现见顶回溶的风险,尤其是近几年相对表现强创的美国 经济。自2017年起新能储务产价格来打碎的现象。 及时全国日本相继用规辑表演会

新的证券价格需经估值委员会和托管行同意后才能采纳,否则不改变用来

「证券10161717月771行。 估值委员会职责,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

基金管理人与中国工商银行股份有限公司于2013年9月签订了《基金估值核算业

已於反》。 根据中国证券投资基金业协会《关于发布 〈证券投资基金投资流通受限股票估值

估值政策、估值方法和估值程序,确保公司各基金产品净值计算的公允性,以维护广大

指引(试行))的通知》(中基协发(2017)6号),基金管理人与中证指数有限公司签订了《流通受限股票流动性折扣委托计算协议》,委托中证指数有限公司计算并提供

流通受限股票流动性折扣。 基金管理人与中国工商银行股份有限公司上海市分行于2018年6月签订了《基金

行政外包协议》,与中信中证投资服务有限责任公司于2019年7月签订了《行政管理服务协议》。截至报告期末,基金管理人对旗下部分特定客户资产管理计划估值业务实行

外包。
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洞1,602,526.0元。向财通财通宝货币B类价额持有人分配利润1,602,526.0元。向财通财通宝货币B类价额持有人分配利润112,500,085.20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报告期人对基金全有连续20个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情况出现。
\$ 5. 托管人报告
5.1 报告期内本基金长管允遵职合情情况声明
大年餐本基金的证据中本基金经验人。由图水则组长职私会和国人司票核建定有证

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信恃况声明 在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证 势投资基金法 相关法律法规的规定以及基金合同,托管协议的约定、对本基金基金管 理人一财通基金管理有限公司2019年1月1日至2019年6月30日基金的投资运作,进行

"认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何

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

本托管人认为,财通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计

等心的人似分,则是越近自建市积公司位本建立的汉风运行。基立员广宁值的计算,基金份额申购赎回价格的计算。基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为,在报告期内,严格遵守了(证券投资基金法)等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

现,任令直要疗面的这样严格按照基金管间的规定进行。 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 本托管人认为、财通基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息 披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年

度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息

26,772,786.

1,899,200,488

本期末 2019年06月30日

129.199.735

132,915,206.5

40,955,664

2,124,282

3,485,165.

166,808.4

114.102.611.

知成部分

E:(1)后附会计报表附注为本会计报表的组成部分; 2)报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.0000元,其中A类基金份额净值

1.0000元, B类基金份额净值1.0000元。基金份额总额4.896.578.379.75份;其中A类基

金份额总额109.430.658.31份,B类基金份额总额4.787.147.721.44份。

6.2 利何农 会计主体:财通财通宝货币市场基金 本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

上年度末 2018年12月31日

上年度末 2018年12月31日

39.999.82

47,373,052.1

28,088,400

3,366,326

3,355,801

751.684.8

81.991.460

真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。 §6 半年度财务会计报告(未经审计)

会计主体:财通财通宝货币市场基金 报告截止日:2019年06月30日

1:股票投资

产支持证券投资

负债和所有者权益

生金融负债

付证券清算款

计管理人报酬

交税费

分配利消

产支持证券利息收入

投资收益(损失以

中:股票投资收益

生工具收益

利息支出

、利润总额(亏损总额 -"号填列)

· 后附会计报表附注为木会计报表

允价值变动收益(指 -"号填列)

生金融资产

开. 资源共享的公平投资管理环境。

差的专项统计分析,以排查异常交易。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

交易执行机会。 ,公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手 ,公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手

财通财通宝货币市场基金 2019年半年度报告摘要

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:2019年08月27日 《1 重要提示

y 1 = 5,000,00
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的法律责任。本半年度报告已
经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019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
阅读本其会的招募说明其及甘田新

本基金的伯券院明节及具更新。 本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告 《2 基金简介

左即李枫郑时为前,以孙且并而义勿。
报告期内,本基金参与上市公司定向增发项目,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制度》
的规定,未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投
资的投资组合及短期国债回购交易除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交
易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批
并留痕备查。
本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他

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		4,896,578,379.75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
下属分级基金的场内简称		-	-
下属分级基金的交易代码		002957	002958
报告期末下属分级基金的份额总额		109,430,658.31份	4,787,147,721.44份
2.2 基金产品说明			
投资目标	在河现	严格控制风险和保持资产 超越业绩比较基准的投资	流动性的前提下,力争实 回报。
	本	基金将综合宏观经济运行	· 大况,货币政策、财政政

投资策略	策等政府宏观经济状况及i 给状况的变动趋势,预测市 此基础上,综合各类投资品	行状品,货币收策、财政政 政策,分析资本市场资金供 1场利率水平变动趋势。在 品种的流动性、收益性以及 2安全性、流动性需要的基
业绩比较基准	人民币活期存款利率(税后	i).
风险收益特征		资基金,是证券投资基金中 與期风险和预期收益低于股 学型基金。
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。	
2.3 基金管理人和基金托管人	•	

份有限公司 f 60069 hina.com
60069 hina.com
hina.com
0
19
21816
-

0.4.4	期间数据和指标	报告期(2019年01月01	日-2019年06月30日)	
3.1.1	别问奴婚和伯尔	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B	
本期已	实现收益	1,602,526.04	112,500,085.20	
本期利	润	1,602,526.04	112,500,085.20	
本期净	值收益率	1.2054%	1.3262%	
3.1.2	期末数据和指标	报告期末(2019	年06月30日)	
期末基	金资产净值	109,430,658.31	4,787,147,721.44	
期末基	金份额净值	1.0000	1.0000	
			收益、其他收入(不含公允)	
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	直变

受动收益, 开原性大致用后的求购, 不明利的分外则已实现收益加工本明公元的重要 动收益,由于货币市场基金用雕余成本法核算, 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, 以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, 计人费用后实际收益,不更低于所列数字; (3)本基金利润分配按日结转份额。

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	收益率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	准收益率标 准差④	1)-(3)	2-4	
过去一个月	0.1582%	0.0008%	0.0292%	0.0000%	0.1290%	0.0008%	
过去三个月	0.5405%	0.0007%	0.0885%	0.0000%	0.4520%	0.0007%	
过去六个月	1.2054%	0.0013%	0.1761%	0.0000%	1.0293%	0.0013%	
过去一年	2.6573%	0.0018%	0.3555%	0.0000%	2.3018%	0.0018%	
自基金合同生 效起至今	9.1752%	0.0029%	1.0447%	0.0000%	8.1305%	0.0029%	
注:(1)上述基	金业绩指标	示不包括持	有人认购或	交易基金的	各项费用	月,计入费	₩.

が以並が、半安成丁州列級子; (2) 本基金的业绩比较基准为:人民币活期存款利率(税后); (3)本基金收益分配是按日结转份额。

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	基准收益率标准差	①-③	2-4	
	过去一个月	0.1780%	0.0008%	0.0292%	0.0000%	0.1488%	0.0008%	
	过去三个月	0.6007%	0.0007%	0.0885%	0.0000%	0.5122%	0.0007%	
	过去六个月	1.3262%	0.0013%	0.1761%	0.0000%	1.1501%	0.0013%	
	过去一年	2.9044%	0.0018%	0.3555%	0.0000%	2.5489%	0.0018%	
	自基金合同生 效起至今	9.9462%	0.0029%	1.0447%	0.0000%	8.9015%	0.0029%	
	注:(1)上述基	金业绩指标	示不包括持有	「人认购 」	艾易基金	的各项费用	月,计入费	用后
岃	收益水平要低	于所列数	字;					
	(2) 木其全的	川が新したなかま	(2) (1) (2) (2) (2) (3) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4) (4	五年田内書	かまけるな (社)	⊟).		

(3)本基金收益分配是按日结转份额

3.2. 白基金合同生效以来基金份额累计净值收益案变动及其与同期业绩比较基

财通财通宝货币A 份额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-2019年6月30日) THE REAL AND REAL PROPERTY OF THE SHEET REAL 注: (1)本基金合同生效日为2016年7月27日.

2)本基金建仓期为2016年7月27日至2017年1月17日,截至报告期末及建仓期末,

		校基准收益率历史走	- 势对比图
	(2016年07月27日-	-2019年6月30日)	
9%			-
**		-	-
		and the same of th	
		and the same of th	
1.7	5492	at the same of the	
24			
***	and the state of t		
***	and the second		
4%	100		
18			
11.0			
		or or orderly or or an error or	
Adventure	the transfer of the same of th		

注:(1)本基金是6周至XX6为2016年7月27日; (2)本基金建仓期为2016年7月27日至2017年1月17日,截至报告期末及建仓期末,

(2) 本藝並建位期外2016年/月27日主2017年1月 基金的资产配置符合基金契约的相关要求。 § 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

4.1. 基金管理人及其管理基金的经验 財通基金管理有限公司成立于2011年6月,由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瀚叶股份有限公司大阳发起设立、财通证券股份有限公司为 第一大股东、出资比例40%。公司注册资本2亿元人民币、注册地上海、经营范围为基金 募集、基金销售、资产管理和中国证监会产市的财立它业务。 财通基金岭终秉海、特有人利益至上"的核心价值观。效力于为客户提供专业优质 的资产管理服务。在公募业务方面、公司坚持以客户利益为出发点设计产品、逐步建立 起覆盖各种投资标的、各种风险收益特征的产品线、获得一定市场口碗,公司将特定客 户资产管理业务作为重要发展战略之一,形成玉泉系列、富春系列等多个子品牌、产品 具有追求检对收益、标的丰富、方案灵活等特点、为机构客户、高端个人客户提供个性 化的理财选择。

化的理财选择。 公司现有员工165人,管理人员和主要业务骨干的证券,基金从业平均年限在10年 以上。通过提供多维度,人性化的客户服务,财通基金龄终与持有,保持信息透明;通 过建立完备的风险控制体系,财通基金最大限度地保证客户的利益。公司将以专业的 投资能力,规范的公司治理、诚信至上的服务、力求创新的精神为广大投资者创造价 使

姓名	职务		基金经理(助 期限	证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期	AE-PPX	
林洪钧	本基金的、基金型收益监 投资固定收益监收 超点 定收益 監收 超级 电总型 超级 电电弧 超级 电电弧 电电弧 电电弧 电电弧 电电弧 电电弧 电电弧 电电弧 电电弧 电电	2018年9月 14日	-	14年	吳旦大学工商管理側上、 学与工程科学来,历历社 奉春校证券股份有限公 公司债券交易,加拿 戶戶型,加拿 戶戶型, 是有一个 是一个 是一个 是一个 是一个 是一个 是一个 是一个 是
罗晓倩	本基金的 基金经理	2017年7月 19日	-	6年	复旦大学投资学研究生。 后就职于友邦保险、国华。 寿、汇添富基金、华福基金。 2015年5月加入东吴证券 任资产管理总部投资经理 理有限公司,担任固定收力 部基金全型助理。2017年 月起任基金经理。
张婉玉	本基金的基金经理助理	2018年8月 24日	-	5 年	上海第二工业大学学士, 海财经大学硕士在读。历时 交租施罗德基全投时到 国利货币债券经纪人,兴 资管债券交易员。2018年 月加入财通基金管理有目 公司,现任固定收益部基: 经理助理。 同生效日,其"离职日其

据公司决议确定的解聘日期; (2)非盲任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任 日期系解聘日期; (3)证券人业的含义遵从行业协会(证券业人业人员资格管理办法)的相关规定。 42 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 未报告期内。本基金管理人严格遵守(中华人民共和国证券投资基金法)、《证券 投资基金销户管理办法》、《公开募集证券投资基金产管理办法》、《公开募集开放 式证券投资基金流力性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相 失规定、依照读定信用、勤励尽责、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 和建物产方。

项目	20194	01月01日至2019年0	6月30日			
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计			
·、期初所有者权益 基金净值)	8,868,290,525.16	-	8,868,290,525.16			
、本期经营活动产 的基金净值变动数 x期利润)	-	114,102,611.24	114,102,611.24			
、本期基金份额交 产生的基金净值变)数 (净值减少以 –"号填列)	-3,971,712,145.41	l	-3,971,712,145.41			
中:1.基金申购款	21,898,742,117.12	I	21,898,742,117.12			
基金赎回款	-25,870,454, 262.53	-	-25,870,454,262.53			
、本期向基金份额 有人分配利润产生 基金净值变动(净 減少以"-"号填)	-	-114,102,611.24	-114,102,611.24			
、期末所有者权益 基金净值)	4,896,578,379.75	ı	4,896,578,379.75			
项目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日					
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计			
·、期初所有者权益 基金净值)	2,883,425,540.92	-	2,883,425,540.92			
、本期经营活动产的基金净值变动数 以期利润)	-	81,991,460.65	81,991,460.65			
、本期基金份额交 产生的基金净值变)数 (净值减少以 _"号填列)	845,916,542.52	_	845,916,542.52			
中:1.基金申购款	15,511,052,201.39	-	15,511,052,201.39			
基金赎回款	-14,665,135, 658.87		-14,665,135,658.87			
、本期向基金份额 有人分配利润产生 基金净值变动(净 減少以"-"号填)		-81,991,460.65	-81,991,460.65			
、期末所有者权益 基金净值)	3,729,342,083.44	-	3,729,342,083.44			
表附注为财务报	表的组成部分_					

11304.000	工26/160	メリンリ王榮
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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 观型则通过及IIII加速通过及下间的"本金量",现在于间域企业自己建立及宏(及 下简称"中国证监会")证监[2016]1213号《关于准予财通财通宝货币市场基金注册的 批复》的核准,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。首次募集规模为7,840,714,131.15份基金份额。本基金为契约型

的基金代码,收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金已实现收益和7日年化收 記念並一次。 起本。若A类基金分额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到成超过500万份时, 本基金自动将其在该基金账户持有的A类基金份额升级为B类基金份额。若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,本基金自动将其在该基金 账户持有的B类基金份额隆级为A类基金份额。

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)。

Assa 近19建筑记长88年12月、入宅11日19年78年3年、代出了。 6.42 会计报关的编制基础 亦以务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修 订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则") 编制,同时、对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会 修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》。中国证监会制定的《中国证券监督 即以开发们的以此为权政据查案目核原业为相当》。《计图证超录的是的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格 式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证 国证券投资基金业协会颁布的相关规定

本别为报表权公本施立行9%55日/36邮207180 643 遗籍企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2019年6月30 本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于2019年6月30 日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日止期间的经营成果和净值变动情

6.4.4 本場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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改增值税试

点的通知》的规定、经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改证增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金(封闭式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的转 让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值 税,存款利息收入不征收增值税,

试点金融业有关政策的通知》的规定,金融机构开展的质押式买人返售金融商品业务 及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据的效应。国家税务总局财税2017日今支《关于金融机构同业往来等增值税 政策的补充通知》的规定,金融机构开展的实断式买人返售金融商品业务、同业存款、 同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入; 根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育

使想到成都。国家秘劳运局则他从16月40亏义《天丁明朝贡献、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定,本基金运营过程中发生的增值税应税行为,以本基金的基金管理人为增值税纳税人, 表 可塞亚自星八分自国662965人; 根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的

值税的,已纳税额从本基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。 2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加 4. 州山北宁州山安州、汉西安川市、四月78年回7月 根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例(2011年修订)》、《征收教育费 附加的暂行规定(2011年修订)》及相关地方教育附加的征收规定,凡缴纳消费税、增

值税、营业税的单位和个人,都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加(除按 照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外)及地方教育费附加。

投资基金)管理人运用基金买卖股票。债券的差价收入、继续免征企业 根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通 知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收 人,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款 利息所得哲免征收个人所得税。

本基金本报告期不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。

关联方名称 基金管理人、基金发起人、基金销售机构

中国工商银行股份有限公司("中国工商银 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

64.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易 64.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

648.12 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。 6.4.8.1.3 债券交易

6.4.8.1.5 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未有应支付关联方的佣金。

6.4.8.2.1 基金管理费

日至2019 14,135,564.4 7,043,608 :(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提。

逐日计提,按月支付: (2) 基金管理人报酬计算公式为: 日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 ×

(3) 客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付 (3) 各广地广级亚国邮运自建入三部运用自动的99以上13户以间继运用自动的90以13 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

项目	本期 2019年01月01日至2019 年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年06月30日	
的期发生的基金应支付的托管费	4,283,504.38	2,134,426.89	
:(1)支付基金托管人的基金持 提,按月支付;	托管费按前一日基金资	产净值0.10%的年费率计	·提,

单位:人民币元

(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。 64823 销售服务费

			単位:人民			
获得销售服	2019年01	本期 月01日至2019年06月30日				
务费的各关 联方名称	当期发生的	当期发生的基金应支付的销售服务费				
#K/37LN0	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B	合计			
财通证券	119.04	0.00	119.04			
财通基金	139,573.63	408,970.68	548,544.31			
中国农业银 行	6,259.16	27.40	6,286.56			
合计	145,951.83	408,998.08	554,949.91			
获得销售服	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日					
务费的各关 联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费					
403.010	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B	合计			
财通证券	461.28	0.00	461.28			
财通基金	234,620.17	201,984.47	436,604.64			
中国农业银 行	15,029.07	0.00	15,029.07			
合计	250,110.52	201.984.47	452.094.99			

的年费率计提,B类份额按前一日B类基金资产净值0.01%的年费率计提,逐日累计至 每月月底,按月支付;

6/当年天数。B类份额销售服务费计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产 净值×0.01%/当年天数。

6483 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。 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

		期		可比期间	
项目	2019年1月1日至2019年6月30 日		2018年1月1日至2018年6月30 日		
	财通财通宝货 币A	财通财通宝货 市B	财通财通宝货 币A	财通财通宝货 币B	
基金合同生效日持有的 基金份额	-	600,027, 000.00	-	600,027, 000.00	
用初持有的基金份额	-	0.00	-	0.00	
月间申购/买人总份额	-	190,273, 494.83	-	0.00	
用间因拆分变动份额	-	0.00	-	0.00	
或:期间赎回/卖出总份 顷	-	0.00	-	0.00	
用末持有的基金份额	-	190,273, 494.83	-	0.00	
用末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	3.97%	-	0.00%	
:期间申购/买入总	分额含红利再	投、转换人份額	页。期间赎回/		

出份额。 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方无投资本

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

称	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业 银行活期	3,619,513.77	100,107.42	3,914,481.88	53,788.91

6.4.8.6 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人关联方承销的证券。 6.4.8.7 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无其当期交易及持有基金管理人以及管理人

6.4.8.7.1 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无其他关联交易事项的说明。 6.4.8.7.2 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

关联方所管理基金产生的费用。 6.4.9期末(2019年06月30日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因新股/新债而于期末流通受限的证券 6492 期末持有的新时停憩等流通受阻股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票 6493 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2019年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成

的卖出回购证券款余额人民币129,199,735.40元,是以如下债券作为质押: 金额单位:人民币元

回购到期日 期末估 值单价 债券代码 债券名称 数量(张) 期末估值总额 700.00 1,360,000

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券 6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 1、公允价值

1)不以公允价值计量的金融工具 不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括贷款和应收款项以及其他金融负

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

债,其因剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。 2)以公允价值计量的金融工具 (1)各层次金融工具公允价值

于2019年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产中属于第二层次的余额为人民币1,667,798,974.75元,无属于第一层次和第三层 次的余额。

资产中属于第二层次的余额为人民币4,331,709,560,22元,无属于第一层次和第三层 次的余额。 (2)公允价值所属层次间的重大变动

值所属层次未发生重大变动。 (3)第三层次公允价值本期变动金额

本基金本期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次 · 介价值本期未发生变动。 截至资产负债表日,本基金无需要说明的承诺事项。

本基金本期持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具的公允价

3、其他事项 截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

《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

15-49	坝目	312 (19)	例(%)
1	固定收益投资	1,667,798,974.75	33.16
	其中:债券	1,641,026,188.60	32.63
	资产支持证券	26,772,786.15	0.53
2	买入返售金融资产	1,899,200,488.81	37.76
	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	1,403,619,513.77	27.91
4	其他各项资产	58,874,608.93	1.17
5	合计	5,029,493,586.26	100.00

净值比例(%)	占基金资产	项目	序号
3.40		报告期内债券回购融资余额	1
_		其中:买断式回购融资	
占基金资产净值比例(%)	金額	项目	序号
2.64	129,199,735.40	报告期末债券回购融资余额	2
_	-	其中:买断式回购融资	

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

天数 报告期末投资组合平均剩余期降 报告期内投资组合平均剩余期限最低值

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明 根据本货币市场基金基金合同约定,本基金投资组合的平均剩余期限不得超过

120天,本报告期内本货币市场基金平均剩余期限未有超过120天的情况。 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

平均剩余期限 其中:剩余存绿 內浮动利率债 其中:剩余存续期超过3 的浮动利率债

其中:剩余存续期超过39% 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 根据本货币市场基金基金合同约定,本基金投资组合的平均存续期不得超过240

天,本报告期内本货币市场基金平均存续期未有超过240天的情况。 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	250,166,498.78	5.11
	其中:政策性金融债	250,166,498.78	5.11
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,000,066.89	0.61
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,360,859,622.93	27.79
8	其他	_	_
9	合计	1,641,026,188.60	33.51
10	剩余存续期超过397天的浮动 利率债券	-	-

金额单位:人民币元 债券代码 债券名称 债券数量(张) 摊余成本 4,300,000 427,001,959.0 2,500,000 248.266.217. 9 錦州银 1994446 2.500.000 248,245,962 3南京银 129,546,954. ,300,000 华融湘江镇 ,000,000 99,364,860. 600.000 59.667.646.1 500 000 49 467 637 4 7.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说 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

本基金本报告期内正偏塞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

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

				金智	页单位:人民
序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
1	1989094	19上和2A1	500,000	26,462,781.41	0.54
2	1989013	19上和1A1	500,000	310,004.74	0.01

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买人成本列示,按照票面利率或协议 利率并考虑其买人时的溢价与折价,在剩余存续期内按实际利率法摊销,每日计提损

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

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。

单位:人民币元

立收证券清算款 50,540,253. - 排井田

7.9.2 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调

79.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四舍五人的原因,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

杏 或在损失编制口前一年内受到公耳遗毒 处照的情形

7.9.3 期末其他各项资产构成

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

				持有人	結构	
份额级别	持有人户数	户均持有 的基金份	机构投	资者	个人投資	6者
571000000	(户)	100	持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
财 通 財 通 宝货币A	2,754	39,735.17	102,092, 393.67	93.29%	7,338, 264.64	6.71%
财 通 財 通 宝货币B	114	41,992, 523.87	4,767,120, 930.12	99.58%	20,026, 791.32	0.42%
合计	2,868	1,707, 314.64	4,869,213, 323.79	99.44%	27,365, 055.96	0.56%

的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用期末基金份额总额,特此说

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 序号 持有人类別 持有份额(份)

基金管理人所有从业人员持有

1	银行类机构	455,137,317.60	9.30%
2	券商类机构	401,347,550.56	8.20%
3	实业类机构	356,285,348.46	7.28%
4	券商类机构	301,914,262.12	6.17%
5	券商类机构	202,135,294.22	4.13%
6	基金类机构	200,644,748.77	4.10%
7	基金类机构	190,273,494.83	3.89%
8	券商类机构	101,444,314.39	2.07%
9	保险类机构	101,404,404.20	2.07%
10	券商类机构	100,145,109.46	2.05%

	合计	th 224,218.94		0.0046%
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	份額級	·别		预总量的数量区间 万份)
本公司高级管理人员、基金投资	F和 财通财通宝1	労币A		0
研究部门负责人持有本开放式		労币B		0
金	合计			0

§ 9 开放式基金份额变动

		单位
	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B
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	164, 196, 672.45	8,704,093,852.71
本报告期基金总申购份额	426,000,110.01	21,472,742,007.11
减:本报告期基金总赎回份额	480,766,124.15	25,389,688,138.38
本报告期期末基金份额总额	109,430,658.31	4,787,147,721.44

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

10.1 基金份额持有人大会决议 本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人,基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 1、本报告期内,基金管理人于2019年1月18日聘任夏理芬先生担任公司董事长职 务,原董事长刘未先生于2019年1月18日离任;

2、本报告期内,于2019年1月中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总

裁职务;于2019年4月中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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 本报告期内,为本基金进行审计的机构未发生变化,为安永华明会计师事务所(特

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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

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

佣金 成交金额 财通证券

(1)经营行为稳健规范,内控制度健全的证券经营机构 (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易

(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,能积极为公司投资业务的开展,投资 信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下: (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向,根据公司对券商交易单元的选择标 准,确定选用交易单元的所属券商以及(主)交易单元,报投资总监与总经理审核批

(2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议,经相关业务部门确认后,报公司领

(3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理 交易单元手续及账户开户手续。 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

导审批;

本基金本报告期内偏离度绝对值不存在超过0.5%的情况。 § 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金价额比例达到或超过20%的情况 报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息 本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

财通其全管理有限公司 二〇一九年八月二十七日

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署

开放式,存线期限不定。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。 本基金分设两类基金份额:A类基金份额和类基金份额。两类基金份额分设不同

本基金投资于法律法规及监管制场介许投资的金融工具。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)

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《关于进一步明确全面推开营改增

通知》的规定,自2018年1月1日起,本基金的基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为,暂通用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对本基金在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增

3 企业所得税 根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通 知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄

64.7.1 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 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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。

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。 本基金本报告期及上年良可比期间均未把过大联万义参半几批行取券义易。 648.14 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。

单位:人民币元

销售服	2019年01月01日至2019年06月30日		
的各关 方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
-3-LN3-	财通财通宝货币A	财通财通宝货币B	合计
证券	119.04	0.00	119.04
基金	139,573.63	408,970.68	548,544.31
农业银	6,259.16	27.40	6,286.56
合计	145,951.83	408,998.08	554,949.91
销售服	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日		
的各关 方名称	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	合计
证券	461.28	0.00	461.28
基金	234,620.17	201,984.47	436,604.64
农业银	15,029.07	0.00	15,029.07