

融通现金宝货币市场基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：2024 年 3 月 28 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通现金宝货币市场基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2024 年 3 月 26 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。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	11
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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20

§ 8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 债券回购融资情况	46
8.3 基金投资组合平均剩余期限	46
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	47
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
8.6 期末按实际利率计算账面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 ...	47
8.7 “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	48
8.8 期末按实际利率计算账面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	48
8.9 投资组合报告附注	48
§ 9 基金份额持有人信息	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
9.4 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
§ 10 开放式基金份额变动	50
§ 11 重大事件揭示	51
11.1 基金份额持有人大会决议	51
11.2 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
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
11.4 基金投资策略的改变	51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	53
11.9 其他重大事件	53
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	54
12.1 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	54
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	54
§ 13 备查文件目录	55
13.1 备查文件目录	55
13.2 存放地点	55
13.3 查阅方式	55

§ 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	897,648,225.10 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	121,433,987.64 份	776,214,237.46 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	王小飞
	联系电话	(0755) 26948666	(021) 60637103
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	wangxiaofei.zh@ccb.com

客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	(021) 60637228
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	张威	田国立

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2023 年		2022 年		2021 年	
	融通现金宝 货币 A	融通现金宝 货币 B	融通现金宝 货币 A	融通现金宝 货币 B	融通现金宝 货币 A	融通现金宝 货币 B
本期已实现收益	3,047,931.24	19,027,681.67	3,382,881.62	13,311,895.37	5,315,880.56	24,639,679.74
本期利润	3,047,931.24	19,027,681.67	3,382,881.62	13,311,895.37	5,315,880.56	24,639,679.74
本期净值收益率	1.7583%	2.0033%	1.6285%	1.8727%	1.9759%	2.2215%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末基金资产净值	121,433,987.64	776,214,237.46	233,401,242.88	1,154,657,588.30	228,045,685.27	545,658,675.96
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
累计净值收益率	19.2737%	20.2087%	17.2128%	17.8479%	15.3347%	15.6815%

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、本基金利润分配是“每日分配收益，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

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
过去三个月	0.4488%	0.0017%	0.0882%	0.0000%	0.3606%	0.0017%
过去六个月	0.9170%	0.0031%	0.1764%	0.0000%	0.7406%	0.0031%
过去一年	1.7583%	0.0025%	0.3500%	0.0000%	1.4083%	0.0025%
过去三年	5.4587%	0.0024%	1.0500%	0.0000%	4.4087%	0.0024%
过去五年	10.2355%	0.0022%	1.7500%	0.0000%	8.4855%	0.0022%
自基金合同生效起至今	19.2737%	0.0033%	2.4997%	0.0000%	16.7740%	0.0033%

融通现金宝货币 B

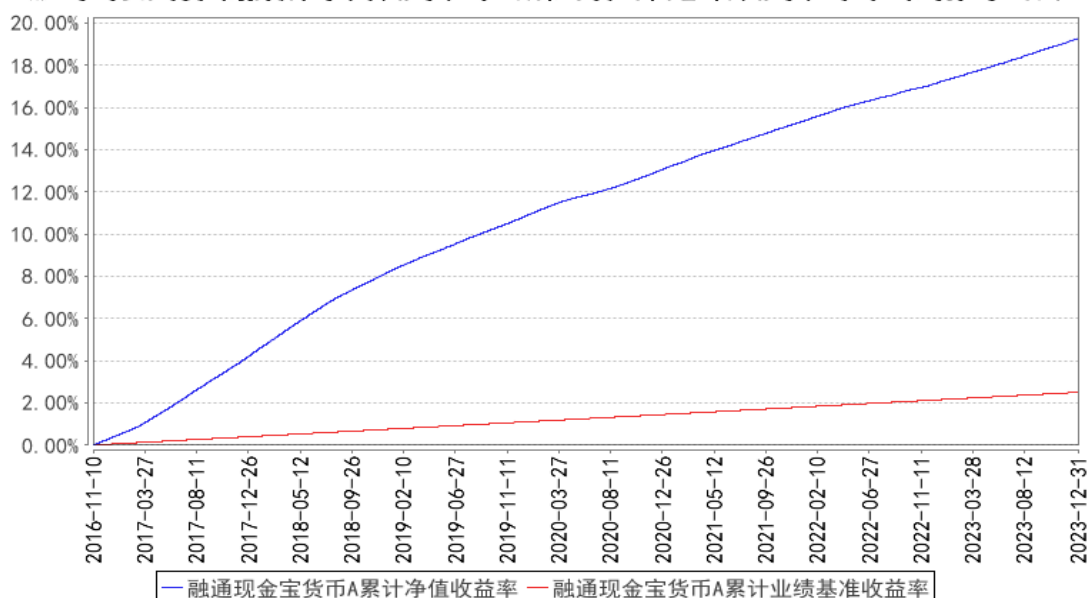
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.5097%	0.0017%	0.0882%	0.0000%	0.4215%	0.0017%
过去六个月	1.0394%	0.0031%	0.1764%	0.0000%	0.8630%	0.0031%
过去一年	2.0033%	0.0025%	0.3500%	0.0000%	1.6533%	0.0025%

过去三年	6.2219%	0.0024%	1.0500%	0.0000%	5.1719%	0.0024%
过去五年	11.5673%	0.0022%	1.7500%	0.0000%	9.8173%	0.0022%
自基金合 同生效起 至今	20.2087%	0.0034%	2.3858%	0.0000%	17.8229%	0.0034%

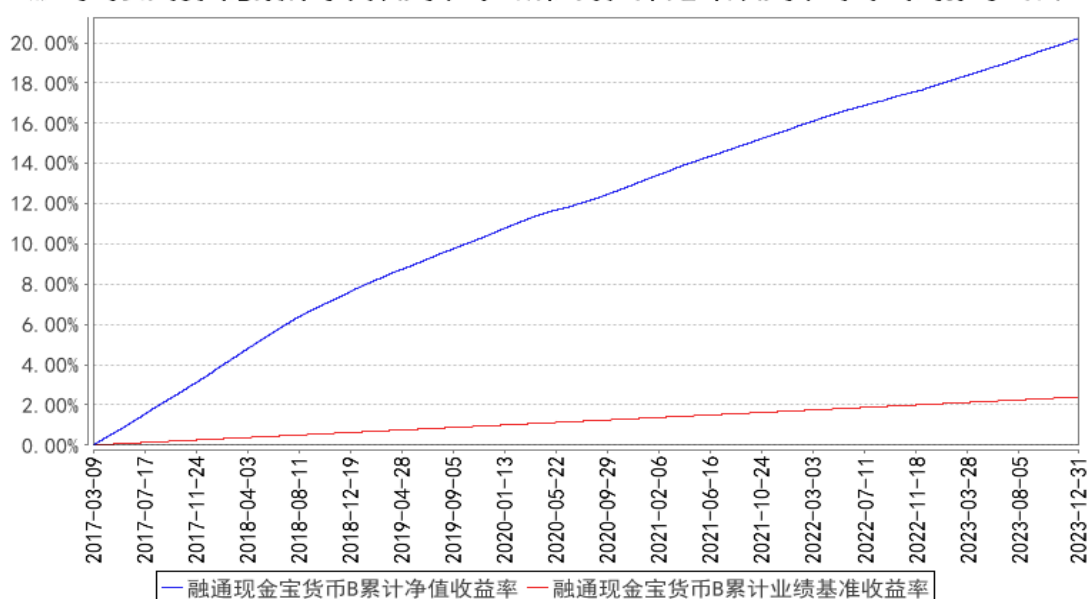
注：为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 11 月 10 日（初始成立日）为起始日进行编制。

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

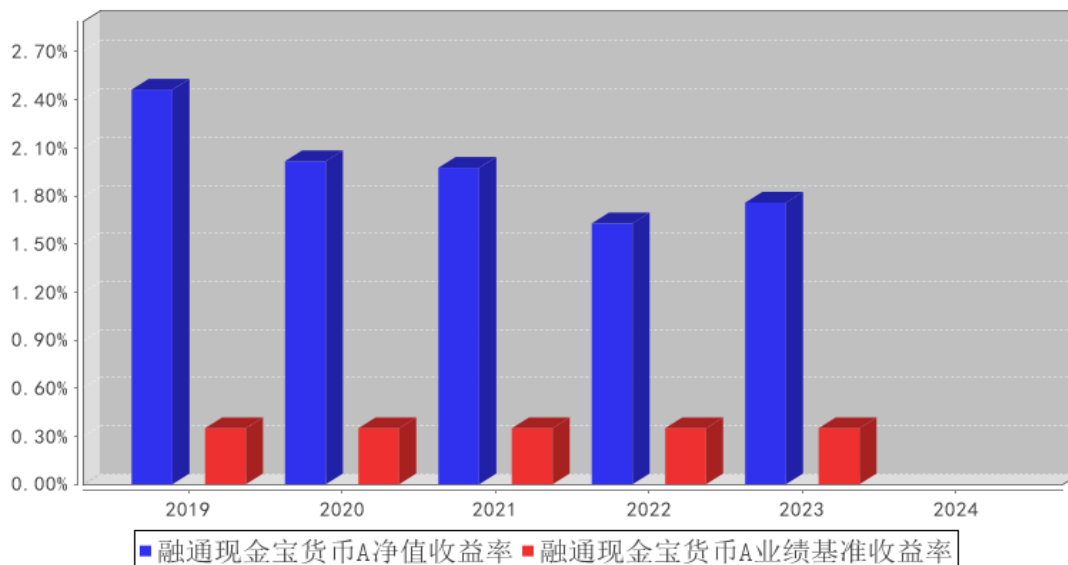


注：1、本基金于 2017 年 2 月 24 日增加 B 类份额，该类份额首次确认日为 2017 年 3 月 9 日，故本基金 B 类份额的统计期间为 2017 年 3 月 9 日至本报告期末。

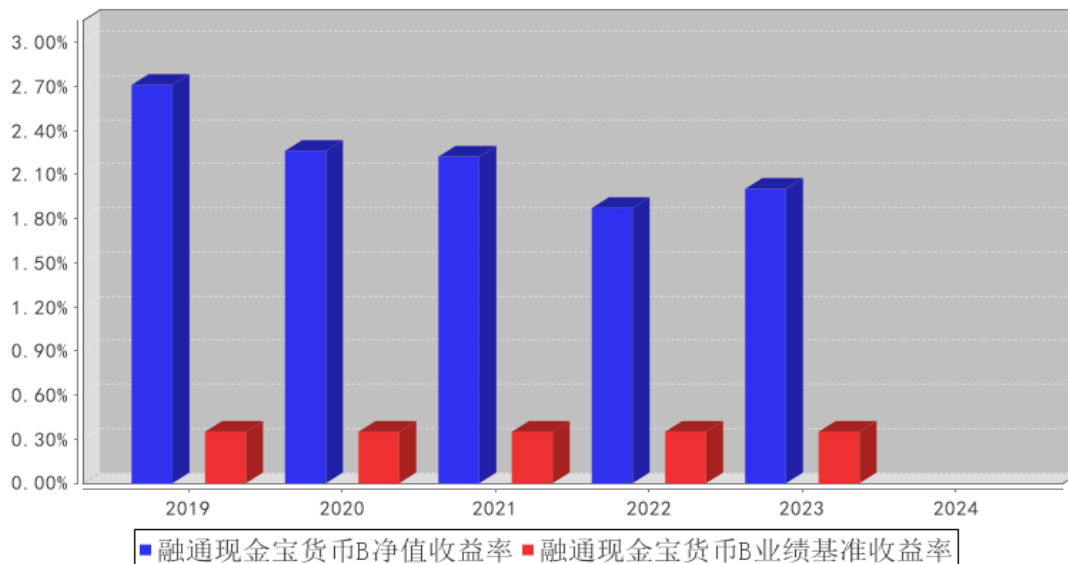
2、为保持历史数据的延续性，本部分所涉自基金合同生效以来相关数据的计算以 2016 年 11 月 10 日（初始成立日）为起始日进行编制。

3.2.3 过去五年基金每年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基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



融通现金宝货币B基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

融通现金宝货币 A

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2023 年	3,062,861.93	-	-14,930.69	3,047,931.24	-
2022 年	3,358,902.04	-	23,979.58	3,382,881.62	-
2021 年	5,336,800.26	-	-20,919.70	5,315,880.56	-
合计	11,758,564.23	-	-11,870.81	11,746,693.42	-

融通现金宝货币 B

年度	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	年度利润 分配合计	备注
2023 年	19,073,001.91	-	-45,320.24	19,027,681.67	-
2022 年	13,154,305.31	-	157,590.06	13,311,895.37	-
2021 年	24,710,780.62	-	-71,100.88	24,639,679.74	-
合计	56,938,087.84	-	41,168.94	56,979,256.78	-

§ 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：诚通证券股份有限公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。本基金管理人拥有公募基金管理资格、特定客户（专户）资产管理资格、合格境内机构投资者资格（QDII）、保险资产受托管理资格、人民币合格境内机构投资者（RQDII）资格、合格境内投资企业（QDIE）资格，产品线完备，涵盖主动权益类基金、被动投资类基金、债券基金、货币基金、混合基金、QDII基金等。

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		
黄浩荣	本基金的基金经理	2018年11月7日	-	9年	黄浩荣先生，厦门大学管理学硕士，9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、融通通远三个月定期开放债券型证券投资基金、融通通益混合型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、融通通安债券型证券投资基金基金经理、融通通华五年定期开放债券型证券投资基金基金经理、融通通跃一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。
时慕蓉	本基金的基金经理	2022年1月4日	-	9年	时慕蓉女士,金融学硕士,9年证券、基金行业从业经历,具有基金从业资格。2014年1月加入融通基金管理有限公司,先后担任股票交易员、债券交易员、投资经理等职务,现任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、融通现金宝货币市场基金基金经理、融通通源短融债券型证券投资基金基金经理、融通通祺债券型证券投资基金基金经理。

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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，本基金管理人通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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、10 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。

4.3.3 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

从 10 年国开收益率走势来看，2023 年债市收益率呈“N”型走势，长端利率中枢整体下行，收益率曲线平坦化特征明显。一季度节前在疫后经济明显修复、稳地产政策持续发力等多重利空下，市场对经济修复预期乐观，风险偏好上移压制债市情绪，债市收益率总体延续去年年底的上行调整行情，直到 5% 的经济增长目标出台，债牛开启。二季度经济弱复苏的反复，市场修正当下过于乐观的预期，收益率持续震荡下行，这一时期债市处于弱现实和弱预期的组合中。7-8 月经济数据持续弱于预期，同时货币政策延续放松、稳增长政策仍未出台落地，市场延续二季度的债牛行情。后随着 8 月下旬系列“宽信用”政策密集出台，市场预期开始转向，叠加资金面持续偏紧，收益率开始转为上行调整态势，11 月底资金面再度收紧、流动性预期转为悲观，引发债市再度快速调整；12 月政策加码预期降温，资金面现实和预期均有所改善，债市收益率整体呈震荡下行态势。

四季度市场融资利率向政策利率收敛，短端收益率上行幅度较大，一年国股 NCD 从季初 2.42%

开始一路上行至高点 2.68%，截止到 12 月中旬 MLF 超额续作，资金面有所缓和，NCD 收益率才开始下行，短端曲线异常平坦，甚至出现倒挂情况。账户利用熊平曲线，主要配置资质较好的存款存单品种，并在 12 月份适度增配长久期资产，锁定较高收益。

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 基金份额净值收益率为 1.7583%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%；

本报告期融通现金宝货币 B 基金份额净值收益率为 2.0033%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济复苏态势有所反复，有效需求不足仍是主要问题，地产销售和投资持续偏弱，地产景气度偏低仍对经济持续构成拖累；同时，M2-M1 增速差持续扩大，经济活性依旧偏低，经济仍处在弱复苏区间中，基本面对债市的压制不强。

政策来看，中央经济工作会议强调经济“稳中求进、以进促稳、先立后破”，推行大的刺激政策的可能性不大；同时，奠定货币政策灵活适度的基调，后续防资金空转对货币政策的约束可能不及前期市场预期，2024 年整体货币政策基调大概率稳中偏松，降准降息预期仍存。

赔率来看，当前收益率曲线较为平坦，收益率曲线未来变陡仍然是赔率较大的策略，目前短端绝对、相对赔率仍然在中高水平，后续随着年底季节性因素消退+非银缺资产，短端利率修复有望持续；长端方面，短端下行或打开长端配置空间，且近期银行负债成本调降存在带动广谱利率整体下行的可能。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核相关部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核相关部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。

4.7 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基金估值业务原则和程序管理细则》进行，公司设立由研究相关部门、风险管理部、登记清算部、稽核审计部和法律合规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、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。

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。

4.8 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，若该工作日为非工作日，则顺延到下一工作日。

4.9 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遵规守信、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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第 22045 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	融通现金宝货币市场基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了融通现金宝货币市场基金(以下简称“融通现金宝货币基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了融通现金宝货币基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于融通现金宝货币基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>融通现金宝货币基金的基金管理人融通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估融通现金宝货币基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算融通现金宝货币基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督融通现金宝货币基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影</p>

	<p>响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对融通现金宝货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致融通现金宝货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	沈兆杰 陈邈迤
会计师事务所的地址	中国.上海市
审计报告日期	2024年3月26日

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	393,514,008.59	51,799,020.43

结算备付金		-	12,510.00
存出保证金		2,773.92	1,497.77
交易性金融资产	7.4.7.2	451,369,105.15	882,594,653.20
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		451,369,105.15	882,594,653.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	104,059,034.18	527,823,331.21
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,463,304.18	10,778,066.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		953,408,226.02	1,473,009,078.91
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		55,009,210.26	84,012,908.78
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		252,521.58	336,033.37
应付托管费		42,086.95	56,005.53
应付销售服务费		34,369.18	59,437.76
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,990.17	15,578.47
应付利润		161,053.66	221,304.59
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	255,769.12	248,979.23
负债合计		55,760,000.92	84,950,247.73
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	897,648,225.10	1,388,058,831.18
其他综合收益	7.4.7.11	-	-

未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		897,648,225.10	1,388,058,831.18
负债和净资产总计		953,408,226.02	1,473,009,078.91

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 897,648,225.10 份，其中融通现金宝货币 A 类基金份额 121,433,987.64 份，融通现金宝货币 B 类基金份额 776,214,237.46 份。

7.2 利润表

会计主体：融通现金宝货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		28,380,513.58	22,080,562.59
1. 利息收入		11,593,006.87	5,426,678.68
其中：存款利息收入	7.4.7.13	5,320,460.07	453,921.80
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		6,272,546.80	4,972,756.88
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		16,787,506.71	16,653,883.91
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	16,787,506.71	16,653,883.91
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		6,304,900.67	5,385,785.60
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,434,353.23	2,799,929.08

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	572,392.39	466,654.89
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	538,617.79	595,017.70
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,489,662.21	1,273,689.61
其中：卖出回购金融资产支出		1,489,662.21	1,273,689.61
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		12,555.05	13,279.47
8. 其他费用	7.4.7.23	257,320.00	237,214.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,075,612.91	16,694,776.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,075,612.91	16,694,776.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22,075,612.91	16,694,776.99

7.3 净资产变动表

会计主体：融通现金宝货币市场基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,388,058,831.18	-	-	1,388,058,831.18
二、本期期初净资产	1,388,058,831.18	-	-	1,388,058,831.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-490,410,606.08	-	-	-490,410,606.08
（一）、综合收益总额	-	-	22,075,612.91	22,075,612.91
（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）	-490,410,606.08	-	-	-490,410,606.08
其中：1. 基金申购款	6,365,459,319.94	-	-	6,365,459,319.94
2. 基金赎回款	-6,855,869,926.02	-	-	-6,855,869,926.02
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资	-	-	-22,075,612.91	-22,075,612.91

产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	897,648,225.10	-	-	897,648,225.10
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	773,704,361.23	-	-	773,704,361.23
二、本期期初净资产	773,704,361.23	-	-	773,704,361.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	614,354,469.95	-	-	614,354,469.95
（一）、综合收益总额	-	-	16,694,776.99	16,694,776.99
（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）	614,354,469.95	-	-	614,354,469.95
其中：1. 基金申购款	5,729,126,720.30	-	-	5,729,126,720.30
2. 基金赎回款	-5,114,772,250.35	-	-	-5,114,772,250.35
（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）	-	-	-16,694,776.99	-16,694,776.99
四、本期期末净资产	1,388,058,831.18	-	-	1,388,058,831.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张帆

高翔

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

7.4 报表附注

7.4.1 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。

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)。

7.4.2 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者

(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格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偏离度绝对值达到或超过 0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以摊余成本计量的金融资产于处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式。

本基金每日计算当日收益并全部分配结转至应付利润科目，并于下一工作日以红利再投资方式结转至实收基金科目。

7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于2024年颁布的修订后的《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〉》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	474,954.31	1,759,820.51
等于：本金	474,899.21	1,757,764.96
加：应计利息	55.10	2,055.55
减：坏账准备	-	-
定期存款	393,039,054.28	50,039,199.92
等于：本金	390,000,000.00	50,000,000.00
加：应计利息	3,039,054.28	39,199.92
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	30,006,000.00
存款期限 3 个月以上	393,039,054.28	20,033,199.92
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	393,514,008.59	51,799,020.43

注：1. 定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

2. 本基金报告期内未提前支取部分定期存款，根据约定，原定期存款利率不变，提前支取未造成利息损失。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 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	451,369,105.15	452,077,901.72	708,796.57	0.0790
	合计	451,369,105.15	452,077,901.72	708,796.57	0.0790
资产支持证券		-	-	-	-
合计		451,369,105.15	452,077,901.72	708,796.57	0.0790
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 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	10,374,344.70	10,344,749.07	-29,595.63	-0.0021
	银行间市场	872,220,308.50	872,424,781.93	204,473.43	0.0147
	合计	882,594,653.20	882,769,531.00	174,877.80	0.0126
资产支持证券		-	-	-	-
合计		882,594,653.20	882,769,531.00	174,877.80	0.0126

注：1. 偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；

2. 偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金净资产。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	104,059,034.18	-

合计	104,059,034.18	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	527,823,331.21	-
合计	527,823,331.21	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	26,469.12	39,679.23
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	26,469.12	39,679.23
应付利息	-	-
预提费用	229,300.00	209,300.00
合计	255,769.12	248,979.23

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

融通现金宝货币 A

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	233,401,242.88	233,401,242.88
本期申购	711,484,047.21	711,484,047.21
本期赎回（以“-”号填列）	-823,451,302.45	-823,451,302.45
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	121,433,987.64	121,433,987.64

融通现金宝货币 B

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,154,657,588.30	1,154,657,588.30
本期申购	5,653,975,272.73	5,653,975,272.73
本期赎回（以“-”号填列）	-6,032,418,623.57	-6,032,418,623.57
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	776,214,237.46	776,214,237.46

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

无。

7.4.7.12 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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	3,047,931.24	-	3,047,931.24
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	-3,047,931.24	-	-3,047,931.24
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	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	19,027,681.67	-	19,027,681.67
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	-19,027,681.67	-	-19,027,681.67
本期末	-	-	-

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	4,004.96	5,017.95
定期存款利息收入	5,315,798.80	435,866.51
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	614.88	13,025.09
其他	41.43	12.25
合计	5,320,460.07	453,921.80

注：此处其他列示的是基金交易保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
债券投资收益——利	16,197,260.53	16,362,566.91

息收入		
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	590,246.18	291,317.00
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	16,787,506.71	16,653,883.91

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,329,426,786.31	2,650,654,145.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,309,100,168.84	2,638,990,016.71
减：应计利息总额	19,736,371.29	11,372,811.35
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	590,246.18	291,317.00

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

无。

7.4.7.20 公允价值变动收益

无。

7.4.7.21 其他收入

无。

7.4.7.22 信用减值损失

无。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	100,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	37,320.00	37,200.00
交易费用	-	14.85
合计	257,320.00	237,214.85

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
诚通证券股份有限公司（“诚通证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本管理股份有限公司（“融通资本”）	本基金管理人能实施重大影响的联营企业
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：1. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2. 融通资本为融通基金持有 52.575% 股权比例的基金管理公司子公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

	月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,434,353.23	2,799,929.08
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,465,370.40	975,634.48
应支付基金管理人的净管理费	1,968,982.83	1,824,294.60

注：1. 支付基金管理人的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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	572,392.39	466,654.89

注：支付基金托管人的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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	1,367.01	10,641.53	12,008.54
诚通证券	32.06	50.19	82.25
合计	1,399.07	10,691.72	12,090.79
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	2,406.75	12,721.74	15,128.49
诚通证券	42.13	38.36	80.49
合计	2,448.88	12,760.10	15,208.98

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，按月支付给基金管理人，再由基金管理人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：

日销售服务费 = 前一日 A/B 类基金份额的基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	474,954.31	4,004.96	1,759,820.51	5,017.95

注：本基金的活期银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 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
3,062,861.93	-	-14,930.69	3,047,931.24	
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
19,073,001.91	-	-45,320.24	19,027,681.67	

注：本基金在本年度累计分配收益 22,075,612.91 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 22,135,863.84 元，应付利润本年变动为-60,250.93 元。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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 55,009,210.26 元，是以如下债券作为抵押：

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
190208	19 国开 08	2024 年 1 月 2 日	102.31	182,000	18,620,969.62
230401	23 农发 01	2024 年 1 月 2 日	102.06	400,000	40,823,548.92
合计				582,000	59,444,518.54

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

监察稽核相关部门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。

7.4.13.2 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人中国建设银行；定期存款主要存放在具有基金托管资格的银行，并实施不同区间的额度管理，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，不投资于信用等级在 AA+级以下的债券与非金融企业债务融资工具，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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	152,022,952.72	180,631,408.31
合计	152,022,952.72	180,631,408.31

注：1. 未评级债券为政策性金融债、金融债、短期融资券。

2. 债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	227,817,929.55	507,128,159.76
合计	227,817,929.55	507,128,159.76

7.4.13.2.4 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	51,065,618.90	30,276,103.76
AAA 以下	-	-
未评级	20,462,603.98	164,558,981.37
合计	71,528,222.88	194,835,085.13

注：1. 未评级债券为国债、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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 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 2023 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 55,009,210.26 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，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(净资产)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。

7.4.13.3.1 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 2023 年 12 月 31 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 2023 年 12 月 31 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%。本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2023 年 12 月 31 日，本基金最后交易日的组合资产中 7 个工作日可变现资产账面金额与净赎回金额符合上述法规要求。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023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	50,822,579.31	171,525,028.02	171,166,401.26	-	-	-	393,514,008.59
存出保证金	2,773.92	-	-	-	-	-	2,773.92
交易性金融资产	-	182,170,499.39	269,198,605.76	-	-	-	451,369,105.15
买入返售金融资产	104,059,034.18	-	-	-	-	-	104,059,034.18
应收申购款	-	-	-	-	-	4,463,304.18	4,463,304.18
资产总计	154,884,387.41	353,695,527.41	440,365,007.02	-	-	4,463,304.18	953,408,226.02
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	252,521.58	252,521.58
应付托管费	-	-	-	-	-	42,086.95	42,086.95
卖出回购金融资产款	55,009,210.26	-	-	-	-	-	55,009,210.26
应付销售服务费	-	-	-	-	-	34,369.18	34,369.18
应付利润	-	-	-	-	-	161,053.66	161,053.66
应交税	-	-	-	-	-	4,990.17	4,990.17

费							
其他负债						255,769.12	255,769.12
负债总计	55,009,210.26					750,790.66	55,760,000.92
利率敏感度缺口	99,875,177.15	353,695,527.41	440,365,007.02			3,712,513.52	897,648,225.10
上年度末 2022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	1,759,820.51	30,006,000.00	20,033,199.92				51,799,020.43
结算备付金	12,510.00						12,510.00
存出保证金	1,497.77						1,497.77
交易性金融资产		592,465,197.65	290,129,455.55				882,594,653.20
买入返售金融资产	527,823,331.21						527,823,331.21
应收申购款						-10,778,066.30	10,778,066.30
资产总计	529,597,159.49	622,471,197.65	310,162,655.47			-10,778,066.30	1,473,009,078.91
负债							
应付管理人报酬						336,033.37	336,033.37
应付托管费						56,005.53	56,005.53
卖出回购金融资产款	84,012,908.78						84,012,908.78
应付销售服务费						59,437.76	59,437.76
应付利润						221,304.59	221,304.59

应交税费						15,578.47	15,578.47
其他负债						248,979.23	248,979.23
负债总计	84,012,908.78					937,338.95	84,950,247.73
利率敏感度缺口	445,584,250.71	622,471,197.65	310,162,655.47			-9,840,727.35	1,388,058,831.18

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。

7.4.13.4.1.2 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		
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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率下降25个基点	377,881.14	527,237.00
	市场利率上升25个基点	-377,163.53	-526,476.44

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	451,369,105.15	882,594,653.20
第三层次	-	-
合计	451,369,105.15	882,594,653.20

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 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资产和负债主要包括货币资金、买入返售金融资产、应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	451,369,105.15	47.34
	其中：债券	451,369,105.15	47.34
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	104,059,034.18	10.91
	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	393,514,008.59	41.27

	付金合计		
4	其他各项资产	4,466,078.10	0.47
5	合计	953,408,226.02	100.00

8.2 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	6.89	
	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	55,009,210.26	6.13
	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。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	105
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	137
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	38

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限 (天数)	原因	调整期
1	2023 年 07 月 28 日	123	基金规模变动	4 个交易日
2	2023 年 07 月 31 日	127	基金规模变动	4 个交易日
3	2023 年 08 月 01 日	131	基金规模变动	4 个交易日
4	2023 年 08 月 02 日	137	基金规模变动	4 个交易日
5	2023 年 08 月 04 日	128	基金规模变动	4 个交易日
6	2023 年 08 月 07 日	129	基金规模变动	4 个交易日

8.3.2 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	17.21	6.13
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天 (含) —60 天	14.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

3	60 天（含）—90 天	24.50	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	4.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	44.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		105.02	6.13

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

无。

8.5 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	112,351,771.80	12.52
	其中：政策性 金融债	61,286,152.90	6.83
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	111,199,403.80	12.39
6	中期票据	-	-
7	同业存单	227,817,929.55	25.38
8	其他	-	-
9	合计	451,369,105.15	50.28
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

8.6 期末按实际利率计算账面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）	按实际利率计 算的账面价值 （元）	占基金资产净值比例（%）
1	112306139	23 交通银行 CD139	500,000	49,479,524.43	5.51
2	230401	23 农发 01	400,000	40,823,548.92	4.55
3	072310061	23 中信建投	300,000	30,582,386.83	3.41

		CP007			
4	2128020	21 招商银行小微债 02	300,000	30,562,638.78	3.40
5	012384410	23 广州地铁 SCP018	300,000	30,020,396.05	3.34
6	2128004	21 招商银行小微债 01	200,000	20,502,980.12	2.28
7	190208	19 国开 08	200,000	20,462,603.98	2.28
8	072310074	23 中信建投 CP009	200,000	20,360,880.49	2.27
9	072310254	23 平安证券 CP015	200,000	20,041,189.88	2.23
10	112321199	23 渤海银行 CD199	200,000	19,920,558.94	2.22

8.7 “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	0.1816%
报告期内偏离度的最低值	-0.0155%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0566%

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。

8.8 期末按实际利率计算账面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

无。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

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。

8.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

1、本基金投资的前十名证券中的 21 招商银行小微债 02、21 招商银行小微债 01,其发行主体为招商银行股份有限公司。根据发布的相关公告,该证券发行主体因未依法履行职责,多次受

到监管机构的处罚。

2、本基金投资的前十名证券中的 23 渤海银行 CD199，其发行主体为渤海银行股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

3、本基金投资的前十名证券中的 23 中信建投 CP007、23 中信建投 CP009，其发行主体为中信建投证券股份有限公司。根据发布的相关公告，该证券发行主体因未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

投资决策说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

8.9.3 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	2,773.92
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	4,463,304.18
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,466,078.10

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	363,917	333.69	10,211.95	0.01	121,423,775.69	99.99
融通现金 宝货币 B	114,537	6,776.97	11,343,438.94	1.46	764,870,798.52	98.54
合计	478,454	1,876.14	11,353,650.89	1.26	886,294,574.21	98.74

9.2 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	7,001,359.08	0.78
2	个人	4,530,147.79	0.50
3	个人	3,687,261.81	0.41
4	个人	3,443,589.30	0.38
5	个人	3,308,861.69	0.37
6	个人	3,082,464.27	0.34
7	个人	2,573,137.75	0.29
8	基金类机构	2,202,929.99	0.25
9	个人	2,200,089.51	0.25
10	基金类机构	2,126,025.86	0.24

9.3 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	10,220.12	0.00842
	融通现金宝货币 B	11,738,979.05	1.51234
	合计	11,749,199.17	1.30889

9.4 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
	融通现金宝货币 B	0~10
	合计	0~10

§ 10 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	233,401,242.88	1,154,657,588.30
本报告期基金总申购份额	711,484,047.21	5,653,975,272.73

减：本报告期基金总赎回份额	823,451,302.45	6,032,418,623.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	121,433,987.64	776,214,237.46

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

11.2.1 基金管理人的重大变动

1、2023 年 1 月 20 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，本公司首席信息官由 Allen Yan（颜锡廉）变更为高翔，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

2、2023 年 3 月 14 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任杜国彦为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

3、2023 年 4 月，经本公司股东会表决通过，由江涛先生担任公司董事，吕秋梅女士不再担任公司董事。

4、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任商小虎为公司副总经理，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

5、2023 年 4 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，新任王智鲲为公司财务负责人，上述变更事项经本公司董事会审议通过。

11.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门根据工作需要，任命牛环起、施伟为资产托管业务部副总经理。

11.3 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，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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），该事务所自本基金合同生效以来为本基金提供审计服务至今。本基金本年度应支付的审计费用为人民币 100,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 12 月 18 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会深圳监管局
受到的具体措施类型	责令改正等相关行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	未严格执行相关法规规定，内部控制机制不健全
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	管理人高度重视，已按法律法规和监管要求对相关问题进行了全面整改，并将整改落实情况报送监管机构。

11.6.2 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，本基金的基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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、本基金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五个方面：

- 1) 实力雄厚，信誉良好；内部管理规范，严格；注册资本符合证监会相关要求；
- 2) 研究实力较强，有稳定的研究机构和专业的研究人员，能及时为本公司提供高质量的研究支持与服务，包括宏观与策略报告、行业与公司分析报告、债券市场分析报告和金融衍生品分析报告等，并能根据基金投资的特定需求，提供专门研究报告；

3) 券商利用其他专业研究咨询机构为本公司提供研究与支持服务的，对该券商研究方面的要求按照上述第 2 点规定执行；

- 4) 严格禁止将席位开设与券商的基金销售挂钩；
- 5) 严格禁止向券商承诺基金在交易单元上的交易量。

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) 评价券商。投资研究相关部门对拟合作券商的研究质量与研究服务进行评价；
- 2) 拟定合作券商。投资研究相关部门根据券商选择标准，拟定备选合作券商；
- 3) 上报批准。投资研究相关部门将备选合作券商上报至研究部，由研究部将备选合作券商的情况上报公司批准；
- 4) 签署协议。在获得批准后，研究部依据公司合同审批流程，与确定的券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内减少中金公司交易单元 1 个。

11.7.2 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	112,935,071.82	100.00	2,000,000.00	100.00	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

11.9 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	融通基金关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 7 日
2	融通管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子冒用“融通基金”名义进行诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 19 日
3	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 1 月 20 日
4	融通基金管理有限公司关于提醒投资者注意防范不法分子诈骗活动的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 2 月 27 日
5	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基	中国证监会指	2023 年 3 月 6 日

	金新增博时财富基金销售有限公司为销售机构并参加其费率优惠活动的公告	定报刊及网站	
6	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 14 日
7	融通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国邮政储蓄银行股份有限公司“邮你同赢”平台为销售平台并开通基金转换业务及参加申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 3 月 23 日
8	融通基金管理有限公司关于公司董事变更情况的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 14 日
9	关于旗下部分开放式基金新增华宝证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 18 日
10	融通现金宝货币市场基金在招商银行股份有限公司开通定期定额投资、转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 19 日
11	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
12	融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 4 月 28 日
13	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加珠海盈米基金销售有限公司转换费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 22 日
14	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增国信证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 5 月 24 日
15	关于旗下部分开放式基金新增东方证券股份有限公司为销售机构并开通定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 6 日
16	关于旗下部分开放式基金新增上海证券有限责任公司为销售机构并开通定期定额投资、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 9 月 27 日
17	融通基金关于网上直销平台费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 12 日
18	融通基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构并开通转换业务及参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023 年 12 月 28 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

13.3 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

2024 年 3 月 28 日