

# 财通资管鑫管家货币市场基金

## 2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:财通证券资产管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 30 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，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月24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2021年01月01日起至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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
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	16
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	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 债券回购融资情况	45
7.3 基金投资组合平均剩余期限	46
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	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	47
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	48
7.8 期末按摊余成本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
7.9 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§9 开放式基金份额变动	52

§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	55
10.9 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	57
§12 备查文件目录	57
12.1 备查文件目录	57
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通资管鑫管家货币市场基金	
基金简称	财通资管鑫管家货币	
基金主代码	003479	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年10月25日	
基金管理人	财通证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	12,384,478,868.19份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通资管鑫管家货币 A	财通资管鑫管家货币 B
下属分级基金的交易代码	003479	003480
报告期末下属分级基金的份额总额	1,916,394,201.62份	10,468,084,666.57份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在力求保持基金资产安全性与较高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金主要为投资人提供现金管理工具，通过积极的投资组合管理，同时充分把握市场短期失衡带来的套利机会，在安全性、流动性和收益性之间寻求最佳平衡点。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

### 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	财通证券资产管理有限公司	中国银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	刘泉	许俊
	联系电话	021-20568203	010-66594319
	电子邮箱	lq@ctzg.com	fcid@bankofchina.com
客户服务电话	95336	95566	
传真	021-68753502	010-66594942	
注册地址	浙江省杭州市上城区白云路2 6号143室	北京市西城区复兴门内大街1 号	
办公地址	上海市浦东新区栖霞路26弄 富汇大厦B座8、9层	北京市西城区复兴门内大街1 号	
邮政编码	200122	100818	
法定代表人	马晓立	刘连舸	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ctzg.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通证券资产管理有限公司	浙江省杭州市上城区四宜路22号四宜大院B幢

## § 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 (2021年01月01日-2021年06月30日)
---------------	----------------------------------

	财通资管鑫管家货币A	财通资管鑫管家货币B
本期已实现收益	22,313,467.20	157,383,854.99
本期利润	22,313,467.20	157,383,854.99
本期净值收益率	1.1024%	1.2228%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
期末基金资产净值	1,916,394,201.62	10,468,084,666.57
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2021年06月30日)	
累计净值收益率	14.7508%	16.0473%

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。

2、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。

3、本基金收益分配按日结转份额。

## 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

财通资管鑫管家货币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
过去一个月	0.1727%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.0617%	0.0004%
过去三个月	0.5286%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.1920%	0.0004%
过去六个月	1.1024%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	0.4329%	0.0005%
过去一年	1.9740%	0.0011%	1.3481%	0.0000%	0.6259%	0.0011%

					9%	1%
过去三年	7.5925%	0.0021%	4.0500%	0.0000%	3.5425%	0.0021%
自基金合同生效起至今	14.7508%	0.0028%	6.3210%	0.0000%	8.4298%	0.0028%

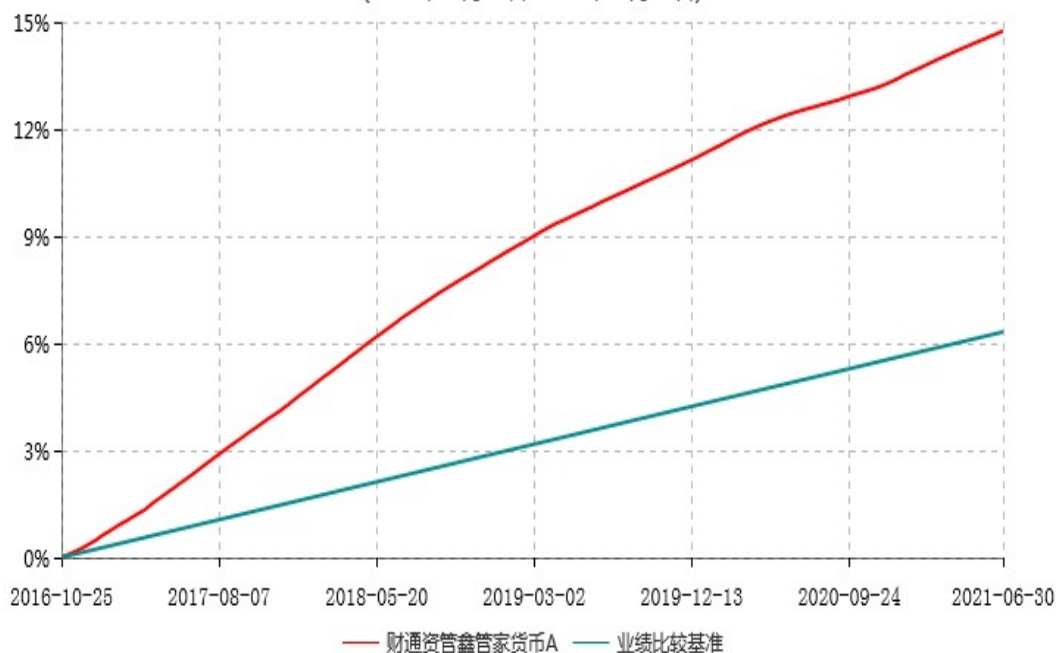
财通资管鑫管家货币B

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
过去一个月	0.1925%	0.0004%	0.1110%	0.0000%	0.0815%	0.0004%
过去三个月	0.5888%	0.0004%	0.3366%	0.0000%	0.2522%	0.0004%
过去六个月	1.2228%	0.0005%	0.6695%	0.0000%	0.5533%	0.0005%
过去一年	2.2190%	0.0011%	1.3481%	0.0000%	0.8709%	0.0011%
过去三年	8.3700%	0.0021%	4.0500%	0.0000%	4.3200%	0.0021%
自基金合同生效起至今	16.0473%	0.0027%	6.3210%	0.0000%	9.7263%	0.0027%

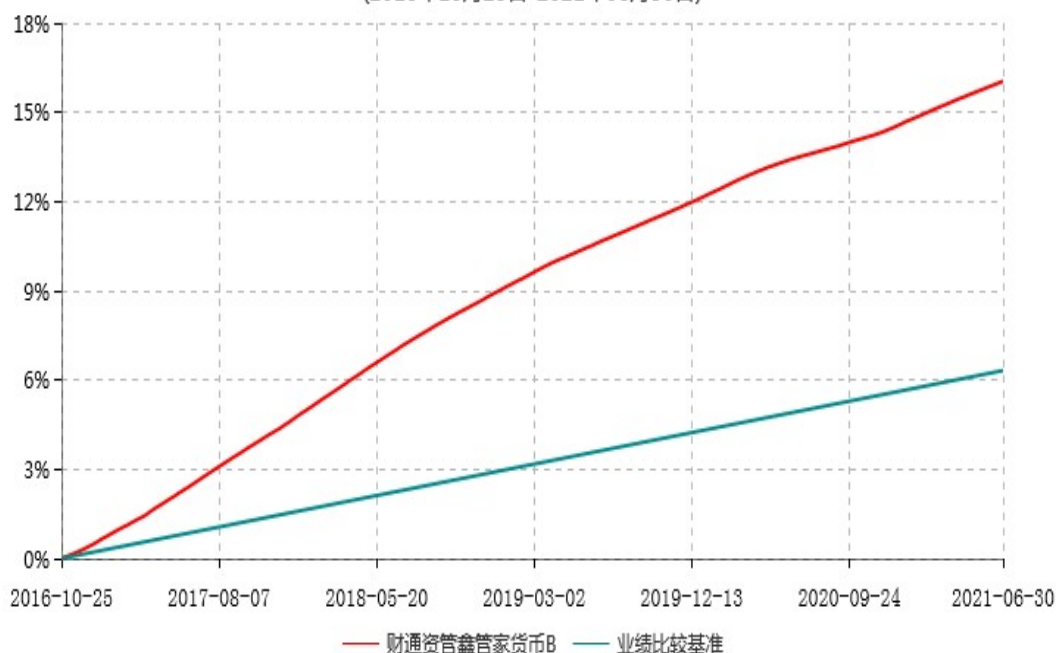
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



财通资管鑫管家货币A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10月25日-2021年06月30日)



财通资管鑫管家货币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10月25日-2021年06月30日)



注：自基金合同生效至报告期末，财通资管鑫管家货币市场基金 A 类基金份额净值收益率为 14.7508%，同期业绩比较基准收益率为 6.3210%；财通资管鑫管家货币市场基金 B 类基金份额净值收益率为 16.0473%，同期业绩比较基准收益率为 6.3210%。

## § 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

财通证券资产管理有限公司系财通证券股份有限公司的全资子公司，注册资本2亿元人民币。2015年12月，公司获准开展公开募集证券投资基金管理业务。截至2021年6月30日，公司共管理29只基金，分别为财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鑫管家货币市场基金、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管消费精选灵活配置混合型证券投资基金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金、财通资管价值成长混合型证券投资基金、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管价值发现混合型证券投资基金、财通资管行业精选混合型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管优选回报一年持有期混合型证券投资基金、财通资管均衡价值一年持有期混合型证券投资基金、财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管宸瑞一年持有期混合型证券投资基金、财通资管智选核心回报6个月持有期混合型发起式证券投资基金、财通资管睿慧1年定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管价值精选一年持有期混合型证券投资基金和财通资管鸿安30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金。

#### 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		
夏金涛	本基金基金经理、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管瑞享12个月定期开放混	2020-10-23	-	5	上海交通大学应用统计硕士。2016年3月起加入财通证券资产管理有限公司，历任固定收益部产品经理

	合型证券投资基金、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金和财通资管睿慧1年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。				助理、固收公募投资部基金经理助理。
陈希希	本基金基金经理、财通资管鸿睿12个月定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金和财通资管鸿安30天滚动持有中短债债券型发起式证券投资基金基金经理。	2021-01-20	-	10	金融学学士，2010年10月至2012年9月担任日信证券股份有限公司固定收益部债券交易员，2012年10月至2014年12月担任财通证券股份有限公司资产管理部高级债券交易员，2014年12月至2015年7月担任财通证券资产管理有限公司固定收益部高级债券交易员，2015年7月至2017年7月期间担任财通证券资产管理有限公司固定收益部投资主办。
王珊	本基金基金经理。	2021-06-04	-	5	上海理工大学国际商务硕士。2016年3月起加入财通证券资产管理有限公司，历任固收公募投资部和固收私募投资部研究员、固收公募投资部基金经理助理。
宫志芳	本基金基金经理、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿运中短	2017-08-18	2021-01-19	10	武汉大学数理金融硕士，中级经济师，2010年7月进入浙江泰隆银行资金运营部先后从事外汇交易和债券交易；2012年3月进入宁

	<p>债债券型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金和财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金基金经理。</p>				<p>波通商银行金融市场部筹备债券业务，主要负责资金、债券投资交易，同时15年初筹备并开展贵金属自营业务；2016年3月加入财通证券资产管理有限公司。</p>
邹舟	<p>本基金基金经理、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金和财通资管新添益6个月持有期混合型发起式证券投资基金基金经理。</p>	2019-05-22	2021-01-20	5	<p>美国本特利大学会计学硕士、工商管理学硕士。2016年4月加入财通证券资产管理有限公司，历任固定收益部交易员，固收公募投资部基金经理助理。</p>
朱红	<p>本基金基金经理助理、财通资管鑫逸回报混合型证券投资基金、财通资管鑫盛6个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管鑫锐回报混合型证券投资基金、财通资管睿智6个月定期开放债券型发起式证券投资基金、财通资管瑞享12个月定期开放混合型证券投资基金、财通资管积极收益债券型发起式证券投资基金、财通资管鸿运中短债债券型证券投资基金财通资管鸿益中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿睿12个月定期开</p>	2020-04-08	-	5	<p>华东理工大学金融学硕士。2016年1月起加入财通证券资产管理有限公司，历任交易部交易助理，现任固收公募投资部基金经理助理。</p>

	放债券型证券投资基金、财通资管鸿利中短债债券型证券投资基金、财通资管鸿达纯债债券型证券投资基金、财通资管鸿福短债债券型证券投资基金、财通资管丰和两年定期开放债券型证券投资基金、财通资管鸿盛12个月定期开放债券型证券投资基金和财通资管丰乾39个月定期开放债券型证券投资基金基金经理助理。				
王珊	本基金基金经理助理。	2020-04-08	2021-06-04	5	上海理工大学国际商务硕士。2016年3月起加入财通证券资产管理有限公司，历任固收公募投资部和固收私募投资部研究员，主要负责产品研究以及信用债分析。

注：1、上述任职日期为根据公司确定的聘任日期，离任日期为根据公司确定的解聘日期；首任基金经理任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的涵义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》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

期末本基金基金经理无同时管理私募资产管理计划的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《财通资管鑫管家货币市场基金基金合同》、《财通资管鑫管家货币市场基金招募说明书》的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。本报告期内，基金运作合法合规，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。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通证券资产管理有限公司公平交易管理办法》等规定。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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，本基金与本公司管理的其他基金在不同时间窗下（如日内、3日内、5日内）同向交易的交易价差未出现异常。

### 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

2021年上半年，全球经济发展总体向好，我国基本管控住了疫情扩散的风险，保障了社会各项经济活动的稳健运行，总体延续了去年以来经济复苏的势头，但节奏放缓。具体来看，制造业PMI持续位于荣枯线以上，但连续4个月下降，生产扩张步伐放缓，需求端稳步修复，进出口景气度下滑，基本面复苏边际走弱；投资方面，投资数据同比边际放缓，1-5月固定资产投资同比增长15.4%，其中，基建投资增速11.8%，房地产投资增速为18.3%，制造业投资增速为20.4%，基建温和修复，地产小幅回落，制造业增速改善，修复仍有空间；消费方面，1-5月社零总额同比增长25.7%，受就业尚未充分恢复、居民消费意愿不足、疫情局部反复等拖累，消费修复偏慢；物价指数方面，上半年CPI同比从-0.3%上行至1.1%，但仍受猪肉价格拖累，目前通胀主因供给侧驱动，并非影响市场的主要因素。金融数据来看，在2021年上半年，随着经济恢复持续，货币金融指标均有明显回落。截至2021年5月，我国累计社融规模14.01万亿元，较去年同期下降了19.34%；M2同比增速下滑至8.3%，与去年增速相比也明显回落。政策方面，货币政策保持稳健，资金面平衡宽松。上半年受基本面、货币政策以及海外政策波动等影响，债券收益率先升后降，整体呈现震荡走势，10年期国债收益率振幅在24BP左右。

报告期内，我们根据对市场趋势以及流动性指标分析，主要配置同业存单、同业存款、回购以及高等级短期融资债券。密切跟踪资金面和市场变化，在关键时点谨慎且合理的使用杠杆和拉长久期，在利率高点踩准时机进行调仓和资产切换，在流动性和安全性第一的前提下，力争为投资者创造较好的回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末财通资管鑫管家货币A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1.1024%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%；截至报告期末财通

资管鑫管家货币B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1.2228%，同期业绩比较基准收益率为0.6695%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球经济可能进入共振复苏阶段，国内经济复苏仍然稳健。货币政策将有望延续中性稳健导向，财政政策对总需求仍会进行保障。债券收益率大概率会维持区间震荡格局。从资产配置的角度看，信用债和利率债仍具有配置价值，同时应着重关注波段操作机会，以票息策略为主，整体对于下半年市场行情持谨慎乐观态度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。

本基金管理人设有估值工作小组，估值工作小组成员由公司分管高管、研究及投资部门、合规稽核部、风险管理部、运营保障部等人员组成。估值小组成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书的有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人，当日收益参与下一日的收益分配，并按日支付且结转为相应的基金份额。

#### 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

报告期内，本基金未出现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 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在财通资管鑫管家货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他

有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

## 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，财通资管鑫管家货币基金A类实施利润分配的金额为：22,313,467.20元。

报告期内，财通资管鑫管家货币基金B类实施利润分配的金额为：157,383,854.99元。

## 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 中期财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：财通资管鑫管家货币市场基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,461,515,830.15	711,964,171.00
结算备付金		1,460,631.78	-
存出保证金		36,344.70	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,585,951,604.58	11,812,667,274.90
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,585,951,604.58	11,812,667,274.90
资产支持证券		-	-



投资			
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	2,201,456,893.65	4,415,591,138.37
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	40,792,034.73	25,056,781.88
应收股利		-	-
应收申购款		7,061,876.99	9,882,372.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		14,298,275,216.58	16,975,161,738.66
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		1,907,056,712.99	408,458,767.89
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,641,839.51	4,169,007.82
应付托管费		971,157.17	1,111,735.46
应付销售服务费		534,593.87	555,015.44
应付交易费用	6.4.7.7	291,525.21	500,051.29
应交税费		111,997.09	48,068.19
应付利息		229,440.55	59,611.06
应付利润		823,629.97	1,218,257.42
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	135,452.03	264,000.00
负债合计		1,913,796,348.39	416,384,514.57
<b>所有者权益:</b>			

实收基金	6.4.7.9	12,384,478,868.19	16,558,777,224.09
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		12,384,478,868.19	16,558,777,224.09
负债和所有者权益总计		14,298,275,216.58	16,975,161,738.66

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额12,384,478,868.19份，其中A类基金份额1,916,394,201.62份，B类基金份额10,468,084,666.57份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通资管鑫管家货币市场基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		216,675,178.15	601,958,115.88
1. 利息收入		220,383,143.03	523,845,310.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	19,234,151.03	21,125,513.73
债券利息收入		146,959,810.88	340,549,478.09
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		54,189,181.12	162,170,318.46
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,707,964.88	78,112,805.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,707,964.88	78,112,805.60
资产支持证券投资		-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		36,977,855.96	136,742,863.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	22,341,158.18	58,902,266.01
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,957,642.17	15,707,270.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,169,343.84	5,298,336.32
4. 交易费用	6.4.7.18	-	-
5. 利息支出		5,306,085.04	56,556,711.37
其中：卖出回购金融资产支出		5,306,085.04	56,556,711.37
6. 税金及附加		60,994.70	130,677.27
7. 其他费用	6.4.7.19	142,632.03	147,601.22
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		179,697,322.19	465,215,252.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		179,697,322.19	465,215,252.77

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：财通资管鑫管家货币市场基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	16,558,777,224.09	-	16,558,777,224.09
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	179,697,322.19	179,697,322.19
三、本期基金份额交 易产生的基金净值 变动数(净值减少以 “-”号填列)	-4,174,298,355.90	-	-4,174,298,355.90
其中：1. 基金申购款	56,180,055,754.98	-	56,180,055,754.98
2. 基金赎回 款	-60,354,354,110.88	-	-60,354,354,110.88
四、本期向基金份额 持有人分配利润产生 的基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)	-	-179,697,322.19	-179,697,322.19
五、期末所有者权益 (基金净值)	12,384,478,868.19	-	12,384,478,868.19
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	22,246,907,185.36	-	22,246,907,185.36
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	465,215,252.77	465,215,252.77
三、本期基金份额交 易产生的基金净值	15,355,348,970.72	-	15,355,348,970.72

变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	107,193,018,491.94	-	107,193,018,491.94
2. 基金赎回款	-91,837,669,521.22	-	-91,837,669,521.22
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-465,215,252.77	-465,215,252.77
五、期末所有者权益(基金净值)	37,602,256,156.08	-	37,602,256,156.08

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:

钱慧

刘博

刘博

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

财通资管鑫管家货币市场基金(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]第2128号《关于准予财通资管鑫管家货币市场基金注册的批复》核准,由财通证券资产管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管鑫管家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12,459,878,642.53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1352号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《财通资管鑫管家货币市场基金基金合同》于2016年10月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为12,460,559,512.66份基金份额,其中认购资金利息折合680,870.13份基金份额。本基金的基金管理人为财通证券资产管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《财通资管鑫管家货币市场基金基金合同》和《财通资管鑫管家货币市场基金招募说明书》的规定,本基金根据基金份额持有人持有本基金的份额数量进行基金份额类别划分。本基金将设A类和B类两类基金份额,两类基金份额按照不同的费率计提销售

服务费用，两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七日年化收益率。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《财通资管鑫管家货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，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金融工具。本基金的业绩比较基准为同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人财通证券资产管理有限公司于2021年8月27日批准报出。

#### 6.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定（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》、《财通资管鑫管家货币市场基金基金合同》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。

本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2021年6月30日的财务状况以及2021年1月1日至6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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、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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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《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)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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	11,515,830.15
定期存款	2,450,000,000.00
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	350,000,000.00
存款期限3个月以上	2,100,000,000.00
其他存款	-
合计	2,461,515,830.15

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	1,000,057.24	1,000,000.00	-57.24	0.0000
	银行间市场	9,584,951,547.34	9,591,152,010.50	6,200,463.16	0.0501
	合计	9,585,951,604.58	9,592,152,010.50	6,200,405.92	0.0501
资产支持证券		-	-	-	-
合计		9,585,951,604.58	9,592,152,010.50	6,200,405.92	0.0501

注：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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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 2021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	2,201,456,893.65	-
合计	2,201,456,893.65	-

##### 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从买断式逆回购交易中取得的债券。



## 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	3,086.95
应收定期存款利息	12,313,847.70
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	657.30
应收债券利息	27,196,141.70
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	1,278,284.68
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	16.40
合计	40,792,034.73

注：其他包括应收保证金利息。

## 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	22,999.63
银行间市场应付交易费用	268,525.58
合计	291,525.21

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021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	-
预提费用	135,452.03
合计	135,452.03

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 财通资管鑫管家货币A

金额单位：人民币元

项目 (财通资管鑫管家货币A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,740,717,462.38	1,740,717,462.38
本期申购	29,402,408,238.69	29,402,408,238.69
本期赎回(以“-”号填列)	-29,226,731,499.45	-29,226,731,499.45
本期末	1,916,394,201.62	1,916,394,201.62

##### 6.4.7.9.2 财通资管鑫管家货币B

金额单位：人民币元

项目 (财通资管鑫管家货币B)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	14,818,059,761.71	14,818,059,761.71
本期申购	26,777,647,516.29	26,777,647,516.29
本期赎回(以“-”号填列)	-31,127,622,611.43	-31,127,622,611.43
本期末	10,468,084,666.57	10,468,084,666.57

注：申购含红利再投、份额转换入、份额升降级等原因导致的份额调增，赎回含份额转换出、份额升降级等原因导致的份额调减。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 6.4.7.10.1 财通资管鑫管家货币A

单位：人民币元

项目 (财通资管鑫管家货币 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	22,313,467.20	-	22,313,467.20
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	-22,313,467.20	-	-22,313,467.20
本期末	-	-	-

## 6.4.7.10.2 财通资管鑫管家货币B

单位：人民币元

项目 (财通资管鑫管家货币 B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	157,383,854.99	-	157,383,854.99
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	-157,383,854.99	-	-157,383,854.99
本期末	-	-	-

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	125,530.35

定期存款利息收入	19,104,389.33
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,181.97
其他	49.38
合计	19,234,151.03

注：其他包括存出保证金利息收入。

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益—买卖股票差价收入。

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益—证券出借差价收入。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-3,707,964.88
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	-3,707,964.88

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	21,181,355,554.33
减：卖出债券（、	21,142,021,051.69

债转股及债券到期 兑付) 成本总额	
减: 应收利息总额	43,042,467.52
买卖债券差价收入	-3,707,964.88

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 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。

##### 6.4.7.14.2 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。

#### 6.4.7.15 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

#### 6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.18 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	66,944.66
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
帐户维护费	15,580.00
银行间查询服务费	600.00

合计	142,632.03
----	------------

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 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

本基金本报告期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
财通证券资产管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
财通证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构

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

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买	成交金额	占当期 债券买

		卖成交 总额的 比例		卖成交 总额的 比例
财通证券 股份有限 公司	225,096,206.85	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30 日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回 购成交总额的 比例
财通证券股 份有限公司	52,000,000.0 0	100.00%	672,050,000.00	98.75%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
财通证券 股份有限 公司	23,599.63	100.00%	22,999.63	100.00%
关联方名 称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总

		量的比 例		额的比例
财通证券 股份有限 公司	-	-	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2021年01月01日至202 1年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,341,158.18	58,902,266.01
其中：支付销售机构的客户维护费	2,868,658.91	6,194,523.68

注：基金管理费按基金前一日的资产净值乘以0.30%的管理费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金管理费=前一日该基金资产净值×年管理费率÷当年天数。基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,957,642.17	15,707,270.92

注：基金托管费按基金前一日的资产净值乘以0.08%的托管费率来计算，具体计算方法如下：每日应计提基金托管费=前一日该基金资产净值×年托管费率÷当年天数。基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

##### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管鑫管家货币A	财通资管鑫管家货币B	合计
财通证券股份有限公司	2,294,350.59	54,358.94	2,348,709.53
财通证券资产管理有限公司	26,495.00	507,227.65	533,722.65
中国银行股份有限公司	8,671.05	735.07	9,406.12
合计	2,329,516.64	562,321.66	2,891,838.30
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通资管鑫管家货币A	财通资管鑫管家货币B	合计
财通证券股份有限公司	3,130,782.85	60,479.12	3,191,261.97
财通证券资产管理有限公司	21,096.30	1,523,379.74	1,544,476.04
中国银行股份有限公司	15,909.33	1,286.51	17,195.84
合计	3,167,788.48	1,585,145.37	4,752,933.85

注：本基金A类基金份额的销售服务费按前一日A类基金份额的基金资产净值的0.25%的年费率计提，具体计算方法如下：每日A类基金份额应计提的基金销售服务费=前一日A类基金份额的基金资产净值×年费率÷当年天数，基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

B类基金份额的销售服务费按前一日B类基金份额的基金资产净值的0.01%的年费率计

提，具体计算方法如下：每日B类基金份额应计提的基金销售服务费=前一日B类基金份额的基金资产净值×年费率÷当年天数，基金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

本基金本报告期内及上年度可比期间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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

##### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 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

财通资管鑫管家货币A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020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	-	-

财通资管鑫管家货币B

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	230,064,051.51	190,287,607.44
报告期间申购/买入总份额	2,814,645.58	52,539,029.38
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	15,000,000.00
报告期末持有的基金份额	232,878,697.09	227,826,636.82
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.88%	0.61%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人在本年度申购本基金的交易委托财通证券资产管理有限公司直销柜台办理，无申购费用。

#### 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

份额单位：份

财通资管鑫管家货币B

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020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
财通证券股份有限公司	993,807,644.24	8.02%	2,272,287,865.23	13.72%

注：本基金本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方无投资财通资管鑫管家货币A的情况。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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

中国银行 股份有限 公司	11,515,830.15	125,530.35	331,419,204.60	20,639,123.01
--------------------	---------------	------------	----------------	---------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

财通资管鑫管家货币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
22,294,588.84	19,882.79	-1,004.43	22,313,467.20	-

财通资管鑫管家货币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
156,427,171.11	1,350,306.90	-393,623.02	157,383,854.99	-

注：本基金在本年度累计分配收益179,697,322.19元，其中以红利再投资方式结转入实收基金178,721,759.95元，包含于赎回款的已分配未支付收益1,370,189.69元，计入应付收益科目-394,627.45元。

#### 6.4.12 期末（2021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

本基金本期末无因认购新发/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2021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1,907,056,712.99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
112003158	20农业银行CD158	2021-07-02	99.59	1,200,000	119,507,158.88
112006136	20交通银行CD136	2021-07-02	99.85	765,000	76,383,206.27
112009517	20浦发银行CD517	2021-07-01	98.68	1,580,000	155,911,234.44
112010288	20兴业银行CD288	2021-07-01	99.80	2,200,000	219,570,504.54
112017271	20光大银行CD271	2021-07-01	99.76	1,240,000	123,697,214.75
112109078	21浦发银行CD078	2021-07-01	98.77	3,500,000	345,707,977.18
112110022	21兴业银行CD022	2021-07-07	99.84	1,111,000	110,922,161.58
160421	16农发21	2021-07-01	100.04	1,806,000	180,676,725.12
180212	18国开12	2021-07-01	100.24	300,000	30,071,388.58
190212	19国开12	2021-07-01	100.04	300,000	30,013,306.71
200010	20付息国债10	2021-07-01	100.01	80,000	8,000,634.18
200010	20付息国债10	2021-07-06	100.01	2,120,000	212,016,805.73
200309	20进出09	2021-07-01	100.01	1,440,000	144,013,645.97
200309	20进出09	2021-07-05	100.01	1,060,000	106,010,044.95
200409	20农发09	2021-07-01	100.00	500,000	49,998,506.66
210206	21国开06	2021-07-01	99.98	700,000	69,987,031.84
217706	21贴现国开06	2021-07-01	99.90	200,000	19,980,317.33

219916	21贴现国债16	2021-07-01	99.97	300,000	29,991,804.79
合计				20,402,000	2,032,459,669.50

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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

本基金为货币市场基金，属于低风险合理稳定收益品种，其预期的风险水平低于股票基金、混合基金和债券基金。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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力求通过主动承担适度信用风险获得持续投资收益，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立规范科学有效的内部风险管理体系结构。董事会是公司风险管理的最高决策机构，授权公司经营管理层建立责任明确、程序清晰的组织结构，制定公司风险管理的具体规章制度，组织实施各类风险的识别与评估工作；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，风险管理部负责拟定公司的风险管理政策、风险管理流程和具体制度，并具体实施，确保公司整体风险得到有效的识别、监控和管理，确保公司各项内部管理制度得到有效执行。基金管理业务合规负责人对董事会负责并报告工作，负责监督检查公募基金业务的合法合规性并对内部控制制度的执行情况进行监察、稽核。

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行中国银行股份有限公司。对于定期银行存款，本基金通过选择具备适当信用水平的银行作为交易对手、平衡信用风险与投资收益率、综合参考内外部信用评级信息评价及调整投资限额，管理相关信用风险并定期评估减值损失。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，不投资于主体评级在AA+级以下的债券，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，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	109,847,792.39	560,010,510.00
A-1以下	-	-
未评级	1,861,054,381.40	1,056,670,791.41
合计	1,970,902,173.79	1,616,681,301.41

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为短期融资券、国债和政策性金融债

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	7,354,879,768.59	9,995,492,159.97

合计	7,354,879,768.59	9,995,492,159.97
----	------------------	------------------

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为同业存单。

#### 6.4.13.2.4 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	7,354,879,768.59	200,493,813.52
合计	7,354,879,768.59	200,493,813.52

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单。

#### 6.4.13.3 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2021年6月30日，除卖出回购金融资产款余额中有1,907,056,712.99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（所有者权益）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。

#### 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%。

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%。

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。

#### 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年0 6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	2,211,515,830.15	250,000,000.00	-	-	-	2,461,515,830.15
结算备付金	1,460,631.78	-	-	-	-	1,460,631.78
存出保证金	36,344.70	-	-	-	-	36,344.70
交易性金融资产	8,891,836,629.83	694,114,974.75	-	-	-	9,585,951,604.58
买入返售金融资产	2,201,456,893.65	-	-	-	-	2,201,456,893.65
应收利息	-	-	-	-	40,792,034.73	40,792,034.73
应收申购款	-	-	-	-	7,061,876.99	7,061,876.99
资产总计	13,306,306,330.11	944,114,974.75	-	-	47,853,911.72	14,298,275,216.58
负债						
卖出回购金融资产款	1,907,056,712.99	-	-	-	-	1,907,056,712.99
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,641,839.51	3,641,839.51
应付托管费	-	-	-	-	971,157.17	971,157.17
应付销售	-	-	-	-	534,593.87	534,593.87

售服务费						
应付交易费用	-	-	-	-	291,525.21	291,525.21
应交税费	-	-	-	-	111,997.09	111,997.09
应付利息	-	-	-	-	229,440.55	229,440.55
应付利润	-	-	-	-	823,629.97	823,629.97
其他负债	-	-	-	-	135,452.03	135,452.03
负债总计	1,907,056,712.99	-	-	-	6,739,635.40	1,913,796,348.39
利率敏感度缺口	11,399,249,617.12	944,114,974.75	-	-	41,114,276.32	12,384,478,868.19
上年度末 2020年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	711,964,171.00	-	-	-	-	711,964,171.00
交易性金融资产	10,404,405,043.33	1,408,262,231.57	-	-	-	11,812,667,274.90
买入返售金融资产	4,415,591,138.37	-	-	-	-	4,415,591,138.37
应收利息	-	-	-	-	25,056,781.88	25,056,781.88
应收申购款	-	-	-	-	9,882,372.51	9,882,372.51
资产总计	15,531,960,352.70	1,408,262,231.57	-	-	34,939,154.39	16,975,161,738.66
负债						
卖出回购金融资产款	408,458,767.89	-	-	-	-	408,458,767.89
应付管理人报酬	-	-	-	-	4,169,007.82	4,169,007.82
应付托管费	-	-	-	-	1,111,735.46	1,111,735.46
应付销售服务费	-	-	-	-	555,015.44	555,015.44
应付交易费用	-	-	-	-	500,051.29	500,051.29
应交税	-	-	-	-	48,068.19	48,068.19

费						
应付利息	-	-	-	-	59,611.06	59,611.06
应付利润	-	-	-	-	1,218,257.42	1,218,257.42
其他负债	-	-	-	-	264,000.00	264,000.00
负债总计	408,458,767.89	-	-	-	7,925,746.68	416,384,514.57
利率敏感度缺口	15,123,501,584.81	1,408,262,231.57	-	-	27,013,407.71	16,558,777,224.09

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	1. 市场利率下降25个基点	4,667,255.34	7,418,210.16
2. 市场利率上升25个基点	-4,659,228.33	-7,402,821.83	

#### 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。

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

#### 6.4.14 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。

## § 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	9,585,951,604.58	67.04
	其中：债券	9,585,951,604.58	67.04
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,201,456,893.65	15.40
	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	2,462,976,461.93	17.23
4	其他各项资产	47,890,256.42	0.33
5	合计	14,298,275,216.58	100.00

注：由于四舍五入的原因，金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 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	2.83	
	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	1,907,056,712.99	15.40
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中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基金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	75
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

#### 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	47.82	15.40
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.48	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.12	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	13.99	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	29.66	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	115.07	15.40

注：由于四舍五入的原因，各期限资产占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 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期限未超过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	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	251,114,310.26	2.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	650,159,208.95	5.25
	其中：政策性金融债	650,159,208.95	5.25
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,329,798,316.78	10.74
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,354,879,768.59	59.39
8	其他	-	-
9	合计	9,585,951,604.58	77.40
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按摊余成本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)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	112109078	21浦发银行CD078	3,500,000	345,707,977.18	2.79
2	112006136	20交通银行CD136	3,000,000	299,541,985.38	2.42
3	112005063	20建设银行CD063	3,000,000	299,425,473.29	2.42

4	112010288	20兴业银行CD288	3,000,000	299,414,324.37	2.42
5	112017271	20光大银行CD271	3,000,000	299,267,455.03	2.42
6	112003158	20农业银行CD158	3,000,000	298,767,897.19	2.41
7	200309	20进出09	2,500,000	250,023,690.92	2.02
8	112009517	20浦发银行CD517	2,500,000	246,694,991.21	1.99
9	200010	20付息国债10	2,201,050	220,122,448.23	1.78
10	160421	16农发21	2,000,000	200,084,966.91	1.62

#### 7.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	0.0652%
报告期内偏离度的最低值	-0.0706%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0397%

注：此处偏离度的最高值及下行的偏离度的最低值均指数学意义上的最高值、最低值。

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到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

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

#### 7.8 期末按摊余成本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

鉴于货币市场基金的特性，本基金采用摊余成本法计算基金资产净值，即本基金按持有债券投资的票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价，以摊余的成本计算基金资产净值。

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或交易市价计算的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，基金管理人采用“影子定价”，即于每一计价日采用市场利率和交易价格对基金持有的计价对象进行重新评估，当基金资产净值与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.0000元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

7.9.2 报告期内本基金投资的前十名证券中21浦发银行CD078（证券代码：112109078）、20浦发银行CD517（证券代码：112009517）、20建设银行CD063（证券代码：112005063）、20兴业银行CD288（证券代码：112010288）、20农业银行CD158（证券代码：112003158）的发行主体在本报告编制日前一年内受到公开处罚。报告期内本基金投资的前十名证券的其他发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日一年以内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券之一21浦发银行CD078（证券代码：112109078）和20浦发银行CD517（证券代码：112009517）的发行主体上海浦东发展银行股份有限公司于2021年4月23日收到处罚决定书（沪银保监罚决字〔2021〕29号），并处人民币760万元的罚款；于2020年8月10日收到处罚决定书（沪银保监银罚决字〔2020〕12号），责令改正，并处罚款合计人民币2100万元。

报告期内本基金投资的前十名证券之一20建设银行CD063（证券代码：112005063）的发行主体中国建设银行股份有限公司于2020年7月13日收到处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕32号），并处人民币3920万元的罚款。

报告期内本基金投资的前十名证券之一20兴业银行CD288（证券代码：112010288）的发行主体兴业银行股份有限公司于2020年9月4日收到中国人民银行福州中心支行处罚决定书（福银罚字〔2020〕35号），没收违法所得人民币1087.51万元，并处人民币1382.44万元的罚款；于2020年8月31日收到处罚决定书（闽银保监罚决字〔2020〕24号），并没收违法所得人民币636.18万元，罚款1596.18万元。

报告期内本基金投资的前十名证券之一的20农业银行CD158(证券代码: 112003158)的发行主体中国农业银行股份有限公司于2021年1月19日收到处罚决定书(银保监罚决字(2021)1号), 并处人民币420万元的罚款; 于2020年12月7日收到处罚决定书(银保监罚决字(2020)66号), 并没收违法所得人民币49.59万元和罚款人民币148.77万元; 于2020年07月13日收到处罚决定书(银保监罚决字(2020)36号), 并没收违法所得人民币55.3万元, 罚款人民币5260.3万元。

本基金管理人对该证券投资决策程序的说明如下: 本基金管理人对证券投资有严格的投资决策流程控制, 本基金对该证券的投资也严格执行投资决策流程。在对该证券的选择上, 本基金严格执行公司个券审核流程。在对该证券的持有过程中, 研究员密切关注证券发行主体动向, 在上述处罚发生时及时分析其对该投资决策的影响。经过分析认为此事件对该证券发行主体的财务状况、经营成果和现金流量未产生重大的实质性影响, 因此不影响对该证券基本面和投资价值的判断。

### 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	36,344.70
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	40,792,034.73
4	应收申购款	7,061,876.99
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	47,890,256.42

### 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, 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	持有	户均持有的	持有人结构
----	----	-------	-------

级别	人户数 (户)	基金份额	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 资管 鑫管 家货 币A	62,9 08	30,463.44	76,307,408.49	3.98%	1,840,086,793. 13	96.02%
财通 资管 鑫管 家货 币B	130	80,523,728. 20	9,968,217,153. 70	95.2 2%	499,867,512.87	4.78%
合计	63,0 38	196,460.53	10,044,524,56 2.19	81.1 1%	2,339,954,306. 00	18.89%

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	机构	1,019,758,306.52	8.23%
2	机构	993,807,644.24	8.02%
3	机构	700,560,155.11	5.66%
4	机构	514,473,168.09	4.15%
5	机构	506,696,936.27	4.09%
6	机构	504,889,783.46	4.08%
7	机构	502,478,256.32	4.06%
8	机构	339,908,380.20	2.74%
9	机构	310,014,258.95	2.50%
10	机构	303,284,349.53	2.45%

### 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	财通资管鑫管家货币A	2,180,920.56	0.11%
	财通资管鑫管家货币B	-	-
	合计	2,180,920.56	0.02%

注：1、本表列示“占基金总份额比例”中，对下属分级基金，为占各自级别份额的比例；对合计数，为占期末基金份额总额的比例。

2、期末本公司基金从业人员未持有本基金的B级份额。

### 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	财通资管鑫管家货 币A	0~10
	财通资管鑫管家货 币B	-
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基 金	财通资管鑫管家货 币A	0~10
	财通资管鑫管家货 币B	-
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通资管鑫管家货币A	财通资管鑫管家货币B
基金合同生效日(2016年10月25 日)基金份额总额	1,873,176,855.71	10,587,382,656.95
本报告期期初基金份额总额	1,740,717,462.38	14,818,059,761.71

本报告期基金总申购份额	29,402,408,238.69	26,777,647,516.29
减：本报告期基金总赎回份额	29,226,731,499.45	31,127,622,611.43
本报告期期末基金份额总额	1,916,394,201.62	10,468,084,666.57

注：申购含红利再投、份额转换入、份额升降级等原因导致的份额调增，赎回含份额转换出、份额升降级等原因导致的份额调减。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 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

本报告期内，无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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，未涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略无改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 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，本基金管理人及其高级管理人员、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 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

券商名称	交易单元数	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	

	量					
华泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	23,599.63	100.00%	-

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

### 10.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	225,096,206.85	100.00%	52,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

注：a. 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1、经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 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的需  
要；
- 3、具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；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。

b. 基金交易单元的选择程序如下：

- 1、本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2、基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

c. 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度的绝对值达到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	财通资管鑫管家货币市场基金风险揭示书	证券时报、管理人网站（www.ctzg.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）	2021-01-06
2	财通资管鑫管家货币市场基金基金经理变更公告	同上	2021-01-20
3	财通资管鑫管家货币市场基金基金经理变更公告	同上	2021-01-21
4	财通资管鑫管家货币市场基金招募说明书（更新）2021年第1号	同上	2021-01-22
5	财通资管鑫管家货币市场基金基金产品资料概要更新	同上	2021-01-22
6	财通资管鑫管家货币市场基金暂停（大额）申购、转换转入、定额定额投资业务公告	同上	2021-02-06
7	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司新增定期定额投资业务和转换业务的公告	同上	2021-02-25
8	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在阳光人寿保险股份有限公司新增定期定额投资业务和转换业务	同上	2021-04-23

	的公告		
9	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在华鑫证券有限责任公司开通定投业务的公告	同上	2021-04-23
10	财通证券资产管理有限公司关于直销渠道暂停快速赎回业务的公告	同上	2021-04-26
11	财通资管鑫管家货币市场基金暂停大额申购、转换转入、定期定额投资业务公告	同上	2021-04-28
12	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在腾安基金销售（深圳）有限公司开通转换业务的公告	同上	2021-04-29
13	财通证券资产管理有限公司关于直销渠道恢复快速赎回业务及变更垫支银行的公告	同上	2021-05-27
14	财通资管鑫管家货币市场基金基金经理变更公告	同上	2021-06-05
15	关于财通证券资产管理有限公司旗下部分基金在蚂蚁（杭州）基金销售有限公司新增定期定额投资业务和转换业务的公告	同上	2021-06-08
16	财通资管鑫管家货币市场基金基金产品资料概要更新	同上	2021-06-09
17	财通资管鑫管家货币市场基金招募说明书（更新）2021 年第2号	同上	2021-06-09

## § 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出现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、财通资管鑫管家货币市场基金相关批准文件
- 2、财通证券资产管理有限公司营业执照、公司章程
- 3、财通资管鑫管家货币市场基金托管协议
- 4、财通资管鑫管家货币市场基金基金合同
- 5、财通资管鑫管家货币市场基金招募说明书
- 6、本报告期内按照规定披露的各项公告

### 12.2 存放地点

上海市浦东新区栖霞路26弄富汇大厦B座8、9层  
浙江省杭州市上城区四宜路四宜大院B幢办公楼

### 12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人财通证券资产管理有限公司。

咨询电话：95336

公司网址：www.ctzg.com

财通证券资产管理有限公司

二〇二一年八月三十日