

融通易支付货币市场证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：融通基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2011 年 8 月 25 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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据融通易支付货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)基金合同规定，于 2011 年 8 月 18 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 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
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	7
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	8
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	9
§ 5 托管人报告	9
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	9
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	9
5.3 托管人对半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	9
§ 6 半年度财务报表(未经审计)	9
6.1 资产负债表	9
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	12
6.4 报表附注	13
§ 7 投资组合报告	25
7.1 期末基金资产组合情况	25
7.2 债券回购融资情况	25
7.3 基金投资组合平均剩余期限	25
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	26
7.5 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	26
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	27
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	27
7.8 投资组合报告附注	27
§ 8 基金份额持有人信息	28
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	28
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	28
§ 9 开放式基金份额变动	28
§ 10 重大事件揭示	28

10.1 基金份额持有人大会决议	28
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	28
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	28
10.4 基金投资策略的改变	29
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	29
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	29
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	29
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	30
10.9 其他重大事件	30
§ 11 备查文件目录	31

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通易支付货币市场证券投资基金
基金简称	融通易支付货币
基金主代码	161608
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 1 月 19 日
基金管理人	融通基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	162,938,564.77 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在强调本金安全性、资产充分流动性的前提下，追求稳定的当期收益。
投资策略	1、根据宏观经济指标，重点关注利率变化趋势，决定基金投资组合的平均剩余期限； 2、根据各大类属资产的收益水平、平均剩余期限、流动性特征，决定基金投资组合中各类属资产的配置比例； 3、根据收益率、流动性、风险匹配原则以及债券的估值原则构建投资组合，并根据投资环境的变化相机调整； 4、在短期债券的单个债券选择上利用收益率利差策略、收益率曲线策略以及含权债券价值变动策略选择收益率高或价值被低估的短期债券，进行投资决策。
业绩比较基准	银行活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率低于股票、债券和混合性基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	关悦
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 58560666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	guanyue2@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95568
传真		(0755) 26935005	(010) 58560794
注册地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地址		深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区复兴门内大街 2 号
邮政编码		518053	100031
法定代表人		田德军	董文标

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》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金半年度报告报告备置地点	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
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 层

§ 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(2011年1月1日至2011年6月30日)
本期已实现收益	3,186,418.36
本期利润	3,186,418.36
本期净值收益率	1.5759%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末基金资产净值	162,938,564.77
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
累计净值收益率	14.2771%

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；

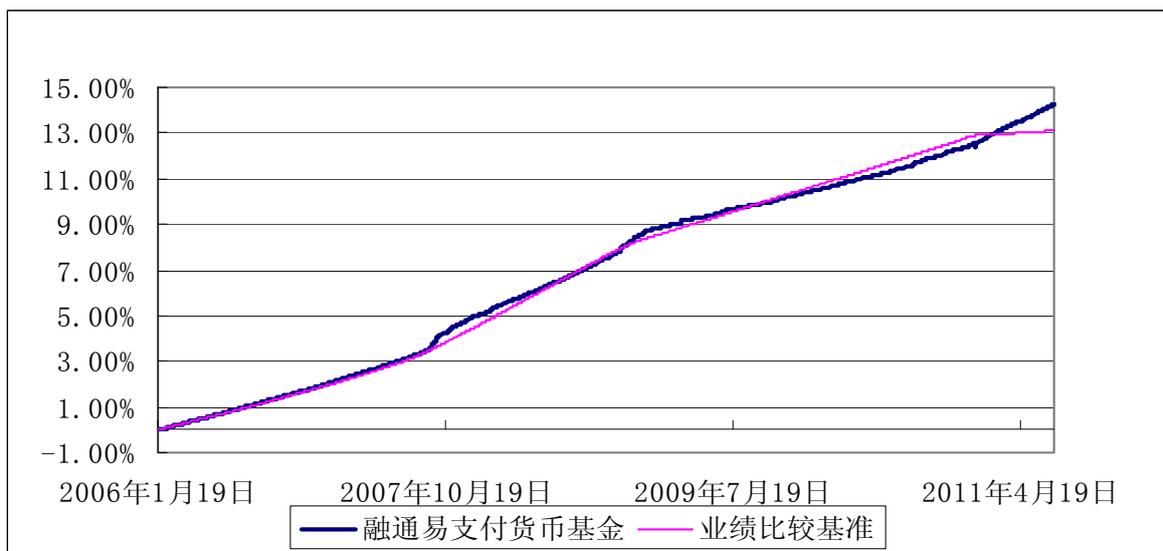
2. 本基金利润分配原则：“每日分配收益，按月结转份额”。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	0.2889%	0.0019%	0.0411%	0.0000%	0.2478%	0.0019%
过去三个月	0.7960%	0.0026%	0.1233%	0.0001%	0.6727%	0.0025%
过去六个月	1.5759%	0.0031%	0.2176%	0.0002%	1.3583%	0.0029%
过去一年	2.6803%	0.0048%	1.4060%	0.0026%	1.2743%	0.0022%
过去三年	7.2472%	0.0065%	6.5751%	0.0026%	0.6721%	0.0039%
自基金合同 生效起至今	14.2771%	0.0059%	13.1070%	0.0026%	1.1701%	0.0033%

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



注：本基金业绩比较基准项目分段计算，其中 2010 年 12 月 31 日之前（含此日）采用“银行一年期定期存款税后利率。”，2011 年 1 月 1 日起使用新基准即“银行活期存款利率(税后)（即银行活期存款利率×（1-利息税率））”。

§ 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：新时代证券有限责任公司 60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至 2011 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有十二只：一只封闭式基金，既融通通乾封闭基金；十一只开放式基金，既融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证 100 指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮 100 指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金和融通深证成份指数基金。其中融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

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		
乔羽夫	本基金的基金经理、融通债券基金的基金经理	2008 年 3 月 31 日	-	7	经济学硕士，具有证券从业资格。2000 年 9 月至 2001 年 10 月，就职于深圳远永盛投资

					<p>有限责任公司,从事证券交易工作;2004年9月至今,就职于融通基金管理有限公司,先后从事债券交易、债券研究以及债券投资等工作。2005年通过基金从业人员资格考试,2006年获得全国银行间同业拆借中心交易员资格、债券托管结算业务资格。</p>
--	--	--	--	--	---

注:任职日期指公司董事会作出决定之日,证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》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,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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,并制定了相应的制度和流程,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的基金。

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

上半年央行始终坚持从紧的货币政策,包括连续6次上调法定准备金、两次加息、上调央票发行利率以及重启三年期央票发行等货币政策,对货币市场资金利率和整体收益率水平造成明显

的上行压力。

出于对全年物价水平始终在高位以及货币政策难以放松的判断，本基金整体策略以防御为主，投资策略上主动降低组合债券持仓、缩短久期，以规避利率风险，将组合剩余期限控制在 130 天以内；同时加大逆回购投资比例，保证足额现金以应对流动性冲击。

上半年本基金在配置上主要有几个方面：一是把握资金利率大幅飙升时逆回购时机和期限；二是重点配置因信用利差较高而具备投资价值的短期融资券，以提高组合整体收益水平；三是择机买入受资金面影响的超跌品种，博取小段修复行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值收益率为 1.5759%，同期业绩比较基准收益率为 0.2176%。

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，工业增加值和 PMI 数据的持续低位徘徊显示了经济增长速度的放缓；而由于 CPI 翘尾因素的回落和猪肉价格已经处于历史高位，因此我们预计通胀有缓慢回落的可能。因此，我们判断下半年货币政策的紧缩力度较上半年将有所减弱。

基于以上分析，以及考虑到金融债和信用债券等品种收益率已经接近上轮通胀和加息周期的高位，我们认为下半年债券收益率继续上升空间有限，债券市场较上半年更具投资机会。而通胀形势的反复和资金面的紧张程度仍是我们应密切关注的主要风险所在。

4.6 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证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构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。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验，估值委员会成员不包含基金经理。

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。其中研究部负责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，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值

方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金的利润分配方式为每日结转收益，按月结转份额。投资者的累计收益定于每月 15 日集中支付并按 1.00 元面值自动转为基金份额。若该日为非工作日，则顺延到下一工作日。

§ 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

中国民生银行股份有限公司根据《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》和《融通易支付货币市场证券投资基金托管协议》，托管融通易支付货币市场证券投资基金（以下简称融通易支付基金）。

本报告期，在对融通易支付基金的托管过程中，中国民生银行股份有限公司严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同、托管协议的规定，安全保管了基金的全部资产，对融通易支付基金的投资运作进行了全面的会计核算和应有的监督，我行遵循笃守诚信、勤勉尽责、严格自律、追求卓越的工作精神，履行了托管人的义务，未发生损害基金份额持有人利益的行为。

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，中国民生银行股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规、基金合同、托管协议的规定，对融通易支付基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值、基金每万份基金收益和七日年化收益率、基金收益分配、基金费用开支等进行了认真的复核，未发现基金管理人在投资运作中有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对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

经中国民生银行股份有限公司资产托管部复核，由融通基金管理有限公司编制的本半年度报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：融通易支付货币市场证券投资基金

报告截止日： 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	843,597.98	799,882.52
结算备付金		71,428.57	131,818.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	90,040,192.21	119,784,663.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		90,040,192.21	119,784,663.40
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	97,900,586.85	30,000,165.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	999,259.23	595,055.33
应收股利		-	-
应收申购款		1,622,992.56	56,752,148.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		191,478,057.40	208,063,732.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
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		27,899,786.05	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		67,615.86	47,350.25
应付托管费		20,489.65	14,348.57
应付销售服务费		51,224.09	35,871.40
应付交易费用	6.4.7.7	8,795.81	7,006.40
应交税费		124,200.00	124,200.00
应付利息		4,035.87	-
应付利润		264,625.75	172,765.13
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,719.55	94,500.00
负债合计		28,539,492.63	496,041.75
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	162,938,564.77	207,567,690.85

未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		162,938,564.77	207,567,690.85
负债和所有者权益总计		191,478,057.40	208,063,732.60

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 162,938,564.77 份。

6.2 利润表

会计主体：融通易支付货币市场证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		4,011,931.15	3,074,388.58
1. 利息收入		3,838,687.93	2,732,419.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	93,763.56	142,047.17
债券利息收入		2,394,067.73	2,137,367.23
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,350,856.64	453,005.51
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		173,243.22	341,968.67
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	173,243.22	341,968.67
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益		-	-
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	6.4.7.13	-	-
减：二、费用		825,512.79	1,108,139.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	335,155.50	457,146.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	101,562.33	138,529.09
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	253,905.73	346,322.95
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		25,920.56	56,427.33
其中：卖出回购金融资产支出		25,920.56	56,427.33
6. 其他费用	6.4.7.15	108,968.67	109,714.06
三、利润总额		3,186,418.36	1,966,249.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润		3,186,418.36	1,966,249.01

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通易支付货币市场证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 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）	207,567,690.85	-	207,567,690.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,186,418.36	3,186,418.36
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-44,629,126.08	-	-44,629,126.08
其中：1. 基金申购款	935,770,835.83	-	935,770,835.83
2. 基金赎回款	-980,399,961.91	-	-980,399,961.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-3,186,418.36	-3,186,418.36
五、期末所有者权益（基金净值）	162,938,564.77	-	162,938,564.77
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 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）	779,958,226.26	-	779,958,226.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,966,249.01	1,966,249.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-613,337,060.77	-	-613,337,060.77
其中：1. 基金申购款	1,754,532,302.74	-	1,754,532,302.74
2. 基金赎回款	-2,367,869,363.51	-	-2,367,869,363.51
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-1,966,249.01	-1,966,249.01
五、期末所有者权益（基金净值）	166,621,165.49	-	166,621,165.49

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：

<u>奚星华</u>	<u>奚星华</u>	<u>刘美丽</u>
基金管理公司负责人	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

融通易支付货币市场证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2005]195 号文件《关于同意融通易支付货币市场证券投资基金募集的批复》批准，向社会公开募集。本基金基金合同于 2006 年 1 月 19 日正式生效，首次设立募集规模为 2,823,218,174.33 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为融通基金管理有限公司，本基金的注册登记人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国民生银行股份有限公司（简称“中国民生银行”）。

本基金主要投资于货币市场工具，包括：现金、一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单、剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券、期限在一年以内(含一年)的债券回购、期限在一年以内(含一年)的中央银行票据，以及经中国证监会、中国人民银行认可的并允许货币市场基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：“银行活期存款利率(税后)”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《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》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》和《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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于 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日期间的经营成果和净值变动情况。

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一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 营业税、企业所得税

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、债券的差价收入，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。

6.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，对基金取得的股票的股息、红利及债券的利息等收入，由上市公司、债券发行企业等在向基金派发时代扣代缴 20% 的个人所得税。

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 2011 年 6 月 30 日
活期存款	843,597.98
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	843,597.98

注：本基金本报告期末投资于定期存款或其他存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 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	-	-	-	-
	银行间市场	90,040,192.21	89,839,000.00	-201,192.21	-0.1235%
	合计	90,040,192.21	89,839,000.00	-201,192.21	-0.1235%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；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和衍生金融负债。

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 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	97,900,586.85	-
合计	97,900,586.85	-

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 2011年6月30日
应收活期存款利息	639.10
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,828.89
应收债券利息	768,948.32
应收买入返售证券利息	227,842.92
应收申购款利息	-
其他	-
合计	999,259.23

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	8,795.81
合计	8,795.81

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
预提审计费	44,630.98
预提信息披露费	49,588.57
预提银行间帐户维护费	4,500.00
合计	98,719.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	207,567,690.85	207,567,690.85
本期申购	935,770,835.83	935,770,835.83
本期赎回	-980,399,961.91	-980,399,961.91
本期末	162,938,564.77	162,938,564.77

注：“本期申购”含基金转换入；“本期赎回”含基金转换出。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	3,186,418.36	-	3,186,418.36
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	-3,186,418.36	-	-3,186,418.36
本期末	-	-	-

注：本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每月以红利再投资方式集中支付累积收益，即按份额面值 1.00 元转为基金份额。

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	19,257.61
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	68,465.95
其他	6,040.00
合计	93,763.56

注：“其他”为申购款利息收入。

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	411,251,720.67
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	408,790,282.99
减：应收利息总额	2,288,194.46
债券投资收益	173,243.22

6.4.7.13 其他收入

无余额。

6.4.7.14 交易费用

无余额。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	49,588.57
银行费用	5,749.12
债券托管帐户维护费	9,000.00
合计	108,968.67

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需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

本报告期与本基金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
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中国民生银行	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司（新时代证券）	基金管理人股东、基金代销机构

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

本基金为货币基金，不从事股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金为货币基金，不从事权证交易。

6.4.10.1.3 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租用关联方的交易单元。

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 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	335,155.50	457,146.14
其中：支付销售机构的客户维护费	78,725.74	141,727.14

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金的管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	101,562.33	138,529.09

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费 各关联方名称	本期
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
融通基金管理有限公司	56,970.90
中国民生银行	40,532.21
新时代证券	10.25
合计	97,513.36
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日 当期发生的基金应支付的销售服务费
融通基金管理有限公司	22,578.20
中国民生银行	44,001.04
新时代证券	97.75
合计	66,676.99

注：基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行	843,597.98	19,257.61	2,142,200.99	29,018.40

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“民生银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示，此部分资金于2011年上半年的利息收入为68,465.95元，2010年同期的利息收入为108,628.77元。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期和上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的股票。

6.4.10.6 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

金额单位：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
2,255,669.93	838,887.81	91,860.62	3,186,418.36	-

6.4.12 期末（2011年6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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金为货币基金，不从事股票交易。

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2011年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形式的卖出回购证券余额27,899,786.05元，是以如下债券作为质押：

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
100230	10 国开 30	2011 年 7 月 1 日	100.22	100,000	10,021,786.02
110203	11 国开 06	2011 年 7 月 1 日	99.93	100,000	9,993,088.92
110221	11 国开 21	2011 年 7 月 1 日	99.83	100,000	9,983,342.31
合计	-	-	-	300,000	29,998,217.25

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立风险控制与审计委员会，主要负责公司运行合规性的监督、核查以及公司内外部审计的沟通、监督和核查工作。委员会对董事会负责；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；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，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的直接责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由总经理办公会决定的投资专业人员和金融工程人员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部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，确保既定的风险控制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。

本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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，并建立交易对手库，以控制相应的信用风险。

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 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
A-1	60,041,974.96	60,011,636.55
A-以下	-	-
未评级	-	19,795,503.07
合计	60,041,974.96	79,807,139.62

注：未评级债券为政策性金融债和央票。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 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 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	29,998,217.25	39,977,523.78
合计	29,998,217.25	39,977,523.78

注：未评级债券为政策性金融债和央票。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，均可在证券交易所或在银行间同业市场交易。于 2011 年 6 月 30 日本基金未持有流通受限证券，因此均能及时变现。此外，本基金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，债券正回购的资金余额在每个交易日一般均不超过基金资产净值的 20%。于资产负债表日，本基金所持有

的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	不计息	合计
资产						
银行存款	843,597.98	-	-	-	-	843,597.98
结算备付金	71,428.57	-	-	-	-	71,428.57
交易性金融资产	-	-	60,041,974.96	29,998,217.25	-	90,040,192.21
买入返售金融资产	97,900,586.85	-	-	-	-	97,900,586.85
应收利息	-	-	-	-	999,259.23	999,259.23
应收申购款	-	-	-	-	1,622,992.56	1,622,992.56
资产总计	98,815,613.40	-	60,041,974.96	29,998,217.25	2,622,251.79	191,478,057.40
负债						
卖出回购金融资产款	27,899,786.05	-	-	-	-	27,899,786.05
应付管理人报酬	-	-	-	-	67,615.86	67,615.86
应付托管费	-	-	-	-	20,489.65	20,489.65
应付销售服务费	-	-	-	-	51,224.09	51,224.09
应付交易费用	-	-	-	-	8,795.81	8,795.81
应付利息	-	-	-	-	4,035.87	4,035.87

应付利润	-	-	-	-	264,625.75	264,625.75
其他负债	-	-	-	-	222,919.55	222,919.55
负债总计	27,899,786.05	-	-	-	639,706.58	28,539,492.63
利率敏感度缺口	70,915,827.35	-	60,041,974.96	29,998,217.25		
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产						
银行存款	799,882.52	-	-	-	-	799,882.52
结算备付金	131,818.18	-	-	-	-	131,818.18
交易性金融资产	-	-	99,813,092.93	19,971,570.47	-	119,784,663.40
买入返售金融资产	30,000,165.00	-	-	-	-	30,000,165.00
应收利息	-	-	-	-	595,055.33	595,055.33
应收申购款	822,761.26	-	-	-	55,929,386.91	56,752,148.17
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	31,754,626.96	-	99,813,092.93	19,971,570.47	56,524,442.24	208,063,732.60
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	47,350.25	47,350.25
应付托管费	-	-	-	-	14,348.57	14,348.57
应付销售服务费	-	-	-	-	35,871.40	35,871.40
应付交易费用	-	-	-	-	7,006.40	7,006.40
应付利润	-	-	-	-	172,765.13	172,765.13
其他负债	-	-	-	-	218,700.00	218,700.00
负债总计	-	-	-	-	496,041.75	496,041.75
利率敏感度缺口	31,754,626.96	-	99,813,092.93	19,971,570.47		

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 (2011 年 6 月 30 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)
	1. 利率上升 25 个基点	-368,913.29	-359,754.06
2. 利率下降 25 个基点	368,975.53	359,800.55	

上表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，对为交易而持有的债券公允价值产生的影响。正数表示可能增加基金资产公允价值，负数表示可能减少基金资产公允价值。

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，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其它价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	90,040,192.21	47.02
	其中:债券	90,040,192.21	47.02
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	97,900,586.85	51.13
	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	915,026.55	0.48
4	其他各项资产	2,622,251.79	1.37
5	合计	191,478,057.40	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.29	
	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	27,899,786.05	17.12
	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

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	113
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	150
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

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%。

7.3.2 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	49.65	17.12
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	6.13	-
2	30 天(含)—60 天	12.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	12.28	-
3	60 天(含)—90 天	17.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	36.85	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		115.91	17.12

7.4 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	29,998,217.25	18.41
	其中：政策性金融债	29,998,217.25	18.41
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	60,041,974.96	36.85
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	90,040,192.21	55.26
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	29,998,217.25	18.41

7.5 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	100230	10 国开 30	100,000	10,021,786.02	6.15
2	1181240	11 皖山鹰 CP01	100,000	10,020,424.49	6.15
3	1181202	11 丰原 CP01	100,000	10,020,314.20	6.15
4	1181099	11 兵建工 CP01	100,000	10,000,878.15	6.14
5	1181159	11 大国际 CP01	100,000	10,000,358.12	6.14

6	1181069	11 昆钢集 CP01	100,000	10,000,000.00	6.14
7	1181234	11 山煤 CP01	100,000	10,000,000.00	6.14
8	110206	11 国开 06	100,000	9,993,088.92	6.13
9	110221	11 国开 21	100,000	9,983,342.31	6.13

7.6 “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	3
报告期内偏离度的最高值	0.2738%
报告期内偏离度的最低值	-0.1257%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1392%

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 本报告期内本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况:

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2011 年 2 月 15 日	20.72	巨额赎回	2011 年 2 月 16 日、 2011 年 2 月 17 日

7.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

7.8.4 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	应收证券清算款	-
3	应收利息	999,259.23
4	应收申购款	1,622,992.56
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,622,251.79

§ 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

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
3,245	50,212.19	61,975,968.38	38.04%	100,962,596.39	61.96%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	88,496.95	0.0543%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年1月19日)基金份额总额	2,823,218,174.33
本报告期期初基金份额总额	207,567,690.85
本报告期基金总申购份额	935,770,835.83
减：本报告期基金总赎回份额	980,399,961.91
本报告期末基金份额总额	162,938,564.77

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

10.2.1 基金管理人的重大变动

经公司董事会审议并经中国证监会核准,奚星华先生担任公司总经理职务,颜锡廉先生(Allen Yan)担任公司副总经理职务,涂卫东先生担任公司督察长职务。经公司董事会审议并报中国证监会备案,吴冶平先生辞去公司督察长职务。

具体内容请参阅 2011 年 3 月 26 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

10.2.2 本报告期基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期末未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未改聘为其审计的会计师事务所，仍为安永华明会计师事务所。

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，基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

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

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	
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准和程序：

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六个方面：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

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) 券商服务评价；(2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；(3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；(4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、本基金本报告期内无变更交易单元的情况。

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	
	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
长江证券	-	-	165,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期末出现偏离度绝对值超过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	融通易支付货币市场证券投资基金收益支付公告	上海证券报、管理人网站	2011-1-14
2	融通易支付货币市场证券投资基金2010年第4季度报告	上海证券报、管理人网站	2011-1-21
3	融通易支付货币市场证券投资基金恢复申购（含转换转入、定期定额投资）公告	上海证券报、管理人网站	2011-1-26
4	融通易支付货币市场证券投资基金暂停申购（含转换转入、定期定额投资）公告	上海证券报、管理人网站	2011-1-26
5	融通易支付货币市场证券投资基金收益支付公告	上海证券报、管理人网站	2011-2-15
6	融通易支付货币市场证券投资基金更新招募说明书（2011年第1号）及其摘要	上海证券报、管理人网站	2011-3-3
7	融通易支付货币市场证券投资基金收益支付公告	上海证券报、管理人网站	2011-3-15
8	融通易支付货币市场证券投资基金恢复申购（含转换转入、定期定额投资）公告	上海证券报、管理人网站	2011-3-25
9	融通易支付货币市场证券投资基金暂停申购（含转换转入、定期定额投资）公告	上海证券报、管理人网站	2011-3-25
10	融通基金管理有限公司高级管理人员任职公告	证券时报、管理人网站	2011-3-26
11	关于中信证券股份有限公司新增代销融通旗下开放式基金及开通定投业务的公告	上海证券报、管理人网站	2011-3-28
12	融通易支付货币市场证券投资基金2010年年度报告及其摘要	上海证券报、管理人网站	2011-3-29
13	融通易支付货币市场证券投资基金收	上海证券报、管理人网站	2011-4-14

	益支付公告		
14	融通易支付货币市场证券投资基金 2011 年第 1 季度报告	上海证券报、管理人网站	2011-4-22
15	融通易支付货币市场证券投资基金收益支付公告	上海证券报、管理人网站	2011-5-13
16	关于新增恒泰长财证券有限责任公司代理融通旗下开放式基金销售业务的公告	上海证券报、管理人网站	2011-5-16
17	融通易支付货币市场证券投资基金限制大额申购的公告	上海证券报、管理人网站	2011-5-17
18	关于融通旗下开放式基金在天相投资顾问有限公司开通定期定额投资业务的公告	上海证券报、管理人网站	2011-5-31
19	融通易支付货币市场证券投资基金收益支付公告	上海证券报、管理人网站	2011-6-14
20	融通易支付货币市场证券投资基金收益支付公告	上海证券报、管理人网站	2011-7-14

§ 11 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通易支付货币市场证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通易支付货币市场证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通易支付货币市场证券投资基金招募说明书》及其定期更新
- (五) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》
- (六) 融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- (七) 中国民生银行业务资格批件和营业执照

存放地点:基金管理人、基金托管人处

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,或登录本基金管理人网站<http://www.rtfund.com>查阅。