

融通易支付货币市场证券投资基金 2011 年年度报告

2011 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 26 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》规定，于 2012 年 3 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。

本报告中的财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司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 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	6
§ 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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	9
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 审计报告	11
§ 7 年度财务报表	12
7.1 资产负债表.....	12
7.2 利润表	13
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
7.4 报表附注	15
§ 8 投资组合报告	30
8.1 期末基金资产组合情况	31
8.2 债券回购融资情况	32
8.3 基金投资组合平均剩余期限	32
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	33
8.5 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	33
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	33
8.7 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	33
8.8 投资组合报告附注	34
§ 9 基金份额持有人信息	34
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	34

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	34
§ 10 开放式基金份额变动.....	35
§ 11 重大事件揭示.....	35
11.1 基金份额持有人大会决议	35
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	35
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	35
11.4 基金投资策略的改变	35
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	36
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	36
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	37
11.9 其他重大事件	37
§ 12 备查文件目录.....	37

§ 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
交易代码	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	1,957,134,048.03 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	银行一年期定期存款税后利率。
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有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 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 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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	10,162,975.50	3,985,457.72	8,808,695.64
本期利润	10,162,975.50	3,985,457.72	8,808,695.64
本期净值收益率	3.6992%	1.8616%	1.6362%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末基金资产净值	1,957,134,048.03	207,567,690.85	779,958,226.26
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
累计净值收益率	16.6658%	12.5042%	10.4482%

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；

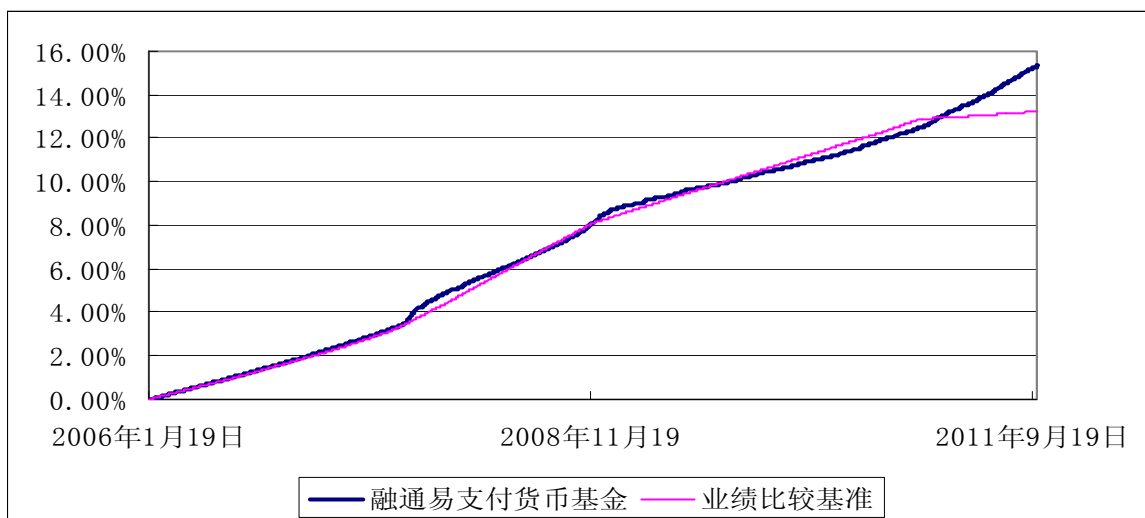
2. 本基金利润分配原则：“每日分配收益，按月结转份额”。

3.2 基金净值表现

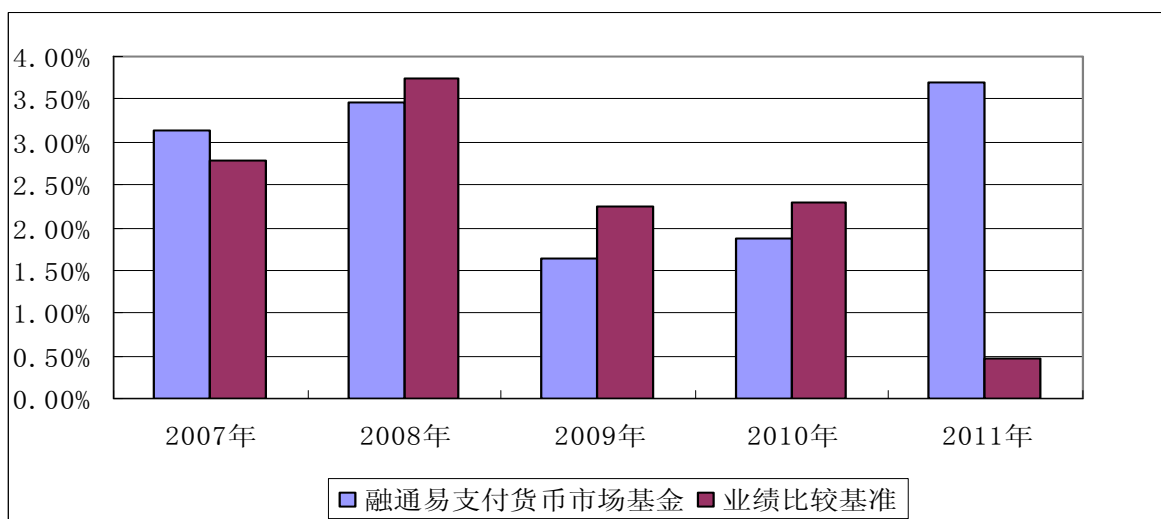
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	1.1574%	0.0068%	0.1260%	0.0000%	1.0314%	0.0068%
过去六个月	2.0905%	0.0050%	0.2521%	0.0000%	1.8384%	0.0050%
过去一年	3.6992%	0.0044%	0.4697%	0.0001%	3.2295%	0.0043%
过去三年	7.3577%	0.0057%	5.0208%	0.0023%	2.3369%	0.0034%
过去五年	14.5596%	0.0062%	11.5679%	0.0031%	2.9917%	0.0031%
自基金合同 生效起至今	16.6658%	0.0060%	13.3590%	0.0029%	3.3068%	0.0031%

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

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
2011	5,588,854.35	1,823,616.34	2,750,504.81	10,162,975.50	-
2010	3,124,411.98	954,715.95	-93,670.21	3,985,457.72	-
2009	6,845,394.44	2,321,357.71	-358,056.51	8,808,695.64	-
合计	15,558,660.77	5,099,690.00	2,298,778.09	22,957,128.86	-

§ 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 12 月 31 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		
蔡奕奕	本基金的基金经理	2011 年 10 月 13 日	-	6	管理科学硕士，具有证券从业资格。2006 年 3 月至 2006 年 11 月，就职于万家基金管理有限公司，担任交易员职务，从事股票债券交易工作；2006 年 12 月至 2008 年 8 月，就职于银河基金管理有限公司，担任交易员职务，从事债券交易工作；2008 年 9 月至今，就职于融通基金管理有限公司，历任交易员、行业研究员职务。
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	2011 年 11 月 3 日	8	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。

注：任职日期和离任日期均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合规守信情况的说明

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

为实现控制通胀、调控房地产的目标，2011 年央行始终坚持从紧的货币政策：央行通过 6 次上调法定存款准备金率和 2 次加息等一系列紧缩性货币政策，使得全年流动性始终处于偏紧的状态，货币市场资金利率处于高位，融资较为困难。另一方面，政府通过限购等政策对房地产市场进行了严厉打压，使得房地产投资增速大幅下降，经济增长放缓预期加重。前三季度，由于通胀不断走高、资金面持续超预期紧张，再加上期间城投债等信用危机事件爆发，令债券市场经历了大幅下跌。进入四季度，随着通胀见顶回落、宏观经济减速，央行货币政策从紧转松，并在 11 月末下调准备金率，因此债市自 10 月份开始大幅上涨，其中中长期利率债和高等级信用债涨幅居前。

2011 年前三季度本基金始终坚持防御的投资策略，组合内保证足额现金和一定比例的逆回购，在资金利率大幅飙升之际相应加大逆回购比例和期限，待资金面出现好转迹象时买入部分债券超调品种，博取小段修复行情。四季度本基金开始采取积极配置策略，逐步提高了短融仓位；同时由于 10 月份证监会放开了货币基金协议存款的投资比例，本基金提高了协议存款的配置比例。

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 3.6992%，同期业绩比较基准收益率为 0.4697%。

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 2012 年，在通胀回落、经济减速的大背景下，货币政策有望转向逐步放松，信贷环境也将有所改善，但放松程度和方式仍取决于经济回落的程度，此外欧美经济的复苏情况、欧债问题等也会影响货币政策的决策。我们判断流动性环比的改善是比较确定的，这将有助于资金利率水平下行，使得融资利率走低，债券市场的整体收益率水平将呈现下行的态势，因此我们在策略上将采取年初积极配置的策略：一方面，在保证基金流动性的前提下，将重点关注中等级短融，充分利用信用分析挖掘优质短融，提高组合收益率水平。另一方面，进一步提高对协议存款的投资比例并相应拉长存款期限。

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，特别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。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

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及其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。

4.8 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。根据上述原则，本基金 2011 年度利润分配符合约定，2011 年年度利润分配合计 10,162,975.50 元。

§ 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货币基金）。

本报告期，在对融通易支付货币基金的托管过程中，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，对融通易支付货币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，对融通易支付货币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。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 10,162,975.50 元。

5.3 托管人对本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 审计报告

普华永道中天审字(2012)第 20442 号

融通易支付货币市场证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的融通易支付货币市场证券投资基金(以下简称“融通易支付货币市场基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是融通易支付货币市场基金的基金管理人融通基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)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，并使其实现公允反映；

(2) 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。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

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。

三、审计意见

我们认为，上述融通易支付货币市场基金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监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

了融通易支付货币市场基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司
注册会计师
注册会计师
薛 竞
王 灵

中国 · 上海市
2012 年 3 月 22 日

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	854,557,589.05	799,882.52
结算备付金		-	131,818.18
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	318,414,510.73	119,784,663.40
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		318,414,510.73	119,784,663.40
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	690,583,035.87	30,000,165.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	5,270,597.55	595,055.33
应收股利		-	-
应收申购款		101,982,534.37	56,752,148.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,970,808,267.57	208,063,732.60
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债	7.4.7.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		9,999,865.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		253,704.01	47,350.25
应付托管费		76,880.04	14,348.57
应付销售服务费		192,200.00	35,871.40
应付交易费用	7.4.7.7	15,423.27	7,006.40
应交税费		124,200.00	124,200.00
应付利息		3,177.28	-
应付利润		2,923,269.94	172,765.13
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	85,500.00	94,500.00
负债合计		13,674,219.54	496,041.75
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,957,134,048.03	207,567,690.85
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,957,134,048.03	207,567,690.85
负债和所有者权益总计		1,970,808,267.57	208,063,732.60

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 1,957,134,048.03 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		12,136,802.71	5,946,959.05
1. 利息收入		11,161,996.05	5,198,520.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,924,958.22	200,124.05
债券利息收入		5,134,713.26	4,020,552.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,102,324.57	977,844.20
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		974,806.66	748,438.38
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	974,806.66	748,438.38

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	7.4.7.13	-	-
减：二、费用		1,973,827.21	1,961,501.33
1. 管理人报酬		823,519.98	774,441.72
2. 托管费		249,551.56	234,679.24
3. 销售服务费		623,878.83	586,698.39
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		63,824.88	145,640.10
其中：卖出回购金融资产支出		63,824.88	145,640.10
6. 其他费用	7.4.7.15	213,051.96	220,041.88
三、利润总额		10,162,975.50	3,985,457.72
减：所得税费用		-	-
四、净利润		10,162,975.50	3,985,457.72

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 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）	-	10,162,975.50	10,162,975.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	1,749,566,357.18	-	1,749,566,357.18
其中：1. 基金申购款	3,703,571,717.52	-	3,703,571,717.52
2. 基金赎回款	-1,954,005,360.34	-	-1,954,005,360.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-10,162,975.50	-10,162,975.50
五、期末所有者权益（基金净值）	1,957,134,048.03	-	1,957,134,048.03
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 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）	-	3,985,457.72	3,985,457.72
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-572,390,535.41	-	-572,390,535.41
其中：1. 基金申购款	2,694,876,701.94	-	2,694,876,701.94
2. 基金赎回款	-3,267,267,237.35	-	-3,267,267,237.35
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-3,985,457.72	-3,985,457.72
五、期末所有者权益（基金净值）	207,567,690.85	-	207,567,690.85

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：

<u>奚星华</u>	<u>颜锡廉</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

7.4 报表附注

7.4.1 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）。

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、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《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>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011年度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2011年12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和基金净值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

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单

独确认为应收项目。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。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本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。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本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债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(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，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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。当本基金依法有权抵销债权债务且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

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本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。

其他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

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，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

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，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。

本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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。

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需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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
活期存款	2,557,589.05	799,882.52
定期存款	852,000,000.00	-
其中：存款期限1个月以内	442,000,000.00	-
存款期限1-3个月	360,000,000.00	-
存款期限3个月以上	50,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计：	854,557,589.05	799,882.52

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011 年 12 月 31 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	318,414,510.73	318,642,000.00	227,489.27	0.0116%
	合计	318,414,510.73	318,642,000.00	227,489.27	0.0116%
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 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	119,784,663.40	119,696,000.00	-88,663.40	-0.0427%
	合计	119,784,663.40	119,696,000.00	-88,663.40	-0.0427%

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

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 2011 年 12 月 31 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间		690,583,035.87	-
合计		690,583,035.87	-
项目		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
		账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券-银行间		30,000,165.00	-
合计		30,000,165.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,812.75	1,005.29
应收定期存款利息	1,761,214.95	-

应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	46.10
应收债券利息	2,015,150.42	558,591.38
应收买入返售证券利息	1,489,419.43	35,412.56
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	5,270,597.55	595,055.33

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	15,423.27	7,006.40
合计	15,423.27	7,006.40

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	85,500.00	94,500.00
合计	85,500.00	94,500.00

7.4.7.9 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12月31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	3,703,571,717.52	3,703,571,717.52
本期赎回	-1,954,005,360.34	-1,954,005,360.34
本期末	1,957,134,048.03	1,957,134,048.03

注：本年申购包含红利再投资和基金转入的份额及金额；本年赎回包含基金转出的份额及金额。

7.4.7.10 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	10,162,975.50	-	10,162,975.50
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	-10,162,975.50	-	-10,162,975.50
本期末	-	-	-

注：本基金以份额面值 1.000 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 1.000 元转为基金份额。

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
活期存款利息收入	43,976.06	50,438.81
定期存款利息收入	1,761,214.95	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	93,064.42	145,261.24
其他	26,702.79	4,424.00
合计	1,924,958.22	200,124.05

注：“其他”为申购款利息收入。

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	643,859,417.05	715,659,066.03
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	638,456,388.37	710,923,570.71
减：应收利息总额	4,428,222.02	3,987,056.94
债券投资收益	974,806.66	748,438.38

7.4.7.13 其他收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无其他收入。

7.4.7.14 交易费用

本基金本报告期及上年度可比期间均无交易费用。

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
审计费用	78,000.00	90,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行费用	14,051.96	12,041.88
债券托管帐户维护费	21,000.00	18,000.00
合计	213,051.96	220,041.88

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，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2011年度	分配收益所属期间
第一次收益支付	2011年12月15日-2012年01月15日
第二次收益支付	2012年01月16日-2012年02月14日
第三次收益支付	2012年02月15日-2012年03月14日

注：根据融通基金管理有限公司 2011 年 12 月 15 日的《融通易支付货币市场证券投资基金收益支付公告》，本基金投资者的累计收益于每月 15 日(如遇节假日顺延)集中支付并按 1 元面值自动转为基金份额，累计收益的计算期间为上次收益支付计算截止日的次日至当月登记日。自 2012 年 1 月起，如无特殊情况将不再进行每月例行收益支付公告。

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	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
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

注：于 2011 度，并无与本基金存在控制关系或其他重大影响关系的关联方发生变化的情况。以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

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。

7.4.10.1.1 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无应支付关联方的交易佣金。

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 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	823,519.98	774,441.72
其中：支付销售机构的客户维护费	187,007.87	240,432.67

注：支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33% 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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.33\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	249,551.56	234,679.24

注：支付基金托管人中国民生银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 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12月31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	194,500.44
中国民生银行	78,713.98
新时代证券	18.23
合计	273,232.65
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12月31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	50,706.62
中国民生银行	89,248.10
新时代证券	250.04
合计	140,204.76

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，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。其计算公

式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 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

本期 2011年1月1日至2011年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行	19,989,384.62	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国民生银行	-	-	-	-	-	-

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

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

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。

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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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
中国民生银行	307,557,589.05	885,916.32	799,882.52	50,438.81

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。(2010年12月31日：同)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及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、本基金本报告期及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）在承销期内承销的证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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
5,588,854.35	1,823,616.34	2,750,504.81	10,162,975.50	-

注：本基金在本年度累计分配收益 10,162,975.50 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 5,588,854.35 元(附注 7.4.7.9)，计入应付收益科目 2,750,504.81 元。

7.4.12 期末（2011 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

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。

7.4.12.2 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。

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 2011 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 9,999,865.00 元，是以如下债券作为抵押：

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
110242	11 国开 42	2012 年 1 月 4 日	100.07	100,000	10,007,433.88
合计				100,000	10,007,433.88

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

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。

基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；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第一责任人，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；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，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。

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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国民生银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。其他定期存款存放在具有托管资格的中国民生银行、深圳发展银行和兴业银行，与该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，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 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。

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 9.71%(2010 年 12 月 31 日：28.91%)。

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 2011 年 12 月 31 日	本期末 2010 年 12 月 31 日
A-1	190,006,205.81	60,011,636.55
A-1 以下		-

未评级	98,525,693.28	19,795,503.07
合计	288,531,899.09	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。

7.4.13.2.2 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 12 月 31 日	本期末 2010 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AA+	-	-
未评级	29,882,611.64	39,977,523.78
合计	29,882,611.64	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。

7.4.13.3 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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。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 180 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。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%。

除卖出回购金融资产款余额中有 9,999,865.00 元将在 1 至 3 个月内到期外，本基金所持有的其他金融负债的合约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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	444,557,589.05	360,000,000.00	50,000,000.00	-	-	854,557,589.05
交易性金融资产	-	29,882,611.64	288,531,899.09	-	-	318,414,510.73
买入返售金融资产	690,583,035.87	-	-	-	-	690,583,035.87
应收利息	-	-	-	-	5,270,597.55	5,270,597.55
应收申购款	-	-	-	-	101,982,534.37	101,982,534.37
其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,135,140,624.92	389,882,611.64	338,531,899.09	-	107,253,131.92	1,970,808,267.57
负债						
卖出回购金融资产款	9,999,865.00	-	-	-	-	9,999,865.00
应付管理人报酬	-	-	-	-	253,704.01	253,704.01
应付托管费	-	-	-	-	76,880.04	76,880.04
应付销售服务费	-	-	-	-	192,200.00	192,200.00
应付交易费用	-	-	-	-	15,423.27	15,423.27
应付利息	-	-	-	-	3,177.28	3,177.28
应付利润	-	-	-	-	2,923,269.94	2,923,269.94
应交税费	-	-	-	-	124,000.00	124,000.00
其他负债	-	-	-	-	85,700.00	85,700.00
负债总计	9,999,865.00	-	-	-	3,674,354.54	13,674,219.54
利率敏感度缺口	1,125,140,759.92	389,882,611.64	338,531,899.09	-	103,578,777.38	1,957,134,048.03
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 年以上	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	-	39,977,523.78	79,807,139.62	-	-	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	-	-	-	-	56,752,148.17	56,752,148.17

其他资产	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,931,865.70	39,977,523.78	79,807,139.62	-	57,347,203.50	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
应交税费	-	-	-	-	124,200.00	124,200.00
其他负债	-	-	-	-	94,500.00	94,500.00
负债总计	-	-	-	-	496,041.75	496,041.75
利率敏感度缺口	30,931,865.70	39,977,523.78	79,807,139.62	-	56,851,161.75	207,567,690.85

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值。为便于同本报告期数据进行比较，对 2010 年 12 月 31 日的交易性金融资产已按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以重分类。

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 (2011 年 12 月 31 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)
	1. 利率下降 25 个基点	809,061.08	359,800.55
2. 利率上升 25 个基点	-808,151.89	-359,754.06	

7.4.13.4.2 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 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 318,414,510.73 元，无属于第一或第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第二层级 119,784,663.40 元，无属于第一或第三层级的余额)。

(iii)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级未发生重大变动。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 比较期间财务报表

本公司 2010 年度财务报表由另一家会计师事务所审计，并出具无保留意见审计报告。比较期间财务报表的部分项目已按本年度财务报表的披露方式进行了重分类。

(3) 除公允价值和比较期间财务报表外，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	318,414,510.73	16.16
	其中：债券	318,414,510.73	16.16
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	690,583,035.87	35.04
	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	854,557,589.05	43.36
4	其他各项资产	107,253,131.92	5.44
5	合计	1,970,808,267.57	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	1.1518	
	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	9,999,865.00	0.51
	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%。

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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	154
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

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 180 天。

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	48.73	0.51
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.50	-
2	30 天(含)—60 天	24.08	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.02	-
3	60 天(含)—90 天	5.11	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	2.55	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	14.74	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		95.21	0.51

8.4 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	48,420,834.14	2.47
3	金融债券	79,987,470.78	4.09
	其中：政策性金融债	79,987,470.78	4.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	190,006,205.81	9.71
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	318,414,510.73	16.27
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	29,882,611.64	1.53

8.5 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	1101094	11 央行票据 94	500,000	48,420,834.14	2.47
2	110414	11 农发 14	300,000	30,089,991.38	1.54
3	110242	11 国开 42	200,000	20,014,867.76	1.02
4	041160016	11 苏国信 CP002	200,000	20,001,746.10	1.02
5	041161014	11 中公用 CP002	200,000	20,001,010.80	1.02
6	041151014	11 京热电 CP001	200,000	20,000,945.74	1.02
7	041162012	11 山钢 CP002	200,000	19,983,944.60	1.02
8	041161002	11 渝化医 CP001	100,000	10,064,860.60	0.51
9	100230	10 国开 30	100,000	10,021,505.58	0.51
10	041151012	11 桂旅游 CP002	100,000	10,001,327.52	0.51

8.6 “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	44
报告期内偏离度的最高值	0.3123%
报告期内偏离度的最低值	-0.3599%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1541%

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 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。

8.8.2 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

8.8.3 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。

8.8.4 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	5,270,597.55
4	应收申购款	101,982,534.37
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	107,253,131.92

§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

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
6,302	310,557.61	1,131,792,042.62	57.83%	825,342,005.41	42.17%

9.2 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	3,632,146.24	0.1856%

§ 10 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	3,703,571,717.52
减：本报告期基金总赎回份额	1,954,005,360.34
本报告期末基金份额总额	1,957,134,048.03

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期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) 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。

(2) 自 2011 年 10 月 13 日起，增聘蔡奕奕女士担任本基金的基金经理，与乔羽夫先生共同管理本基金。

具体内容请参阅 2011 年 10 月 15 日在《上海证券报》上刊登的相关公告。

(3) 经公司董事会审议通过并报中国证监会备案，同意刘模林先生辞去公司副总经理职务。具体内容请参阅 2011 年 10 月 22 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

(4) 自 2011 年 11 月 3 日起，乔羽夫先生不再担任本基金的基金经理，蔡奕奕女士继续担任本基金的基金经理，管理本基金。

具体内容请参阅 2011 年 11 月 5 日在《上海证券报》上刊登的相关公告。

11.2.1 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。

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、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人于本期将为本基金提供审计服务的原安永华明会计师事务所更换为普华永道中天会计师事务所有限公司，上述事项已经托管人同意，并报中国证监会备案，公告日期 2011 年 10 月 20 日。

本基金本报告期应支付的审计费用为人民币 78,000.00 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

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。

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	
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。

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
长江证券	-	-	224,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	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
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收益支付公告	上海证券报、管理人网站	2011-2-15
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	2011-3-15
6	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
7	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
8	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
9	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	2011-4-14
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
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	2011-7-14
16	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	2011-8-12

17	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	2011-9-15
18	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	2011-9-23
19	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	2011-9-23
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	2011-10-14
21	融通易支付货币市场证券投资基金基金经理增聘公告	上海证券报、 管理人网站	2011-10-15
22	2011 年度融通基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	上海证券报、 管理人网站	2011-10-20
23	融通易支付货币市场证券投资基金基金经理变更公告	上海证券报、 管理人网站	2011-11-5
24	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	2011-11-14
25	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	2011-12-15

§ 12 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。