

融通易支付货币市场证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 27 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 2018 年 8 月 22 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§ 7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 债券回购融资情况.....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
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.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细.....	39
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.8 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.....	40
7.9 投资组合报告附注.....	40
§ 8 基金份额持有人信息.....	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	40
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	41
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	41
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.5 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的情况.....	42
§ 9 开放式基金份额变动.....	42
§ 10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	44
10.9 其他重大事件.....	44
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
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.....	45

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	45
§ 12 备查文件目录.....	46
12.1 备查文件目录.....	46
12.2 存放地点.....	46
12.3 查阅方式.....	46

§ 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		
场内简称	融通货币		
基金主代码	161608		
基金运作方式	契约型开放式(ETF)		
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, 117, 309, 514. 16 份		
基金合同存续期	不定期		
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所		
上市日期	2016 年 6 月 20 日		
下属分级基金的基金简称:	融通易支付货币 A	融通易支付货币 B	融通易支付货币 E
下属分级基金场内简称:	-	-	融通货币
下属分级基金的交易代码:	161608	161615	511910
报告期末下属分级基金的份额总额	309, 569, 008. 53 份	708, 955, 343. 35 份	98, 785, 162. 28 份

注：融通易支付货币 E(511910) 份额上市交易，基金份额面值为 100 元，本表所列融通易支付货币 E 的份额面值已折算为 1 元。

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、债券和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东	罗菲菲
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 58560666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn

客户服务电话	400-883-8088、(0755) 26948088	95568
传真	(0755) 26935005	(010) 58560798
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	高峰	洪崎

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
基金半年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处、上海证券交易所

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、15 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

基金级别	融通易支付货币 A	融通易支付货币 B	融通易支付货币 E
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)	报告期(2018 年 1 月 1 日 - 2018 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	4,861,608.60	12,234,474.57	4,238,807.05
本期利润	4,861,608.60	12,234,474.57	4,238,807.05
本期净值收益率	1.8117%	1.9328%	1.7938%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)		
期末基金资产净值	309,569,008.53	708,955,343.35	98,785,162.28
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018 年 6 月 30 日)		
累计净值收益率	47.0725%	25.9622%	6.1234%

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. 本基金自成立起至 2016 年 6 月 14 日，利润分配是按月结转份额；自 2016 年 6 月 15 日起，利润分配方式由按月结转份额变更为按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

融通易支付货币 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	0.2914%	0.0034%	0.0288%	0.0000%	0.2626%	0.0034%
过去三个月	0.8864%	0.0042%	0.0873%	0.0000%	0.7991%	0.0042%
过去六个月	1.8117%	0.0032%	0.1736%	0.0000%	1.6381%	0.0032%
过去一年	3.6461%	0.0025%	0.3500%	0.0000%	3.2961%	0.0025%
过去三年	8.9857%	0.0023%	1.0500%	0.0000%	7.9357%	0.0023%
自基金合同生效起至今	47.0725%	0.0063%	15.7016%	0.0033%	31.3709%	0.0030%

融通易支付货币 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	0.3112%	0.0034%	0.0288%	0.0000%	0.2824%	0.0034%
过去三个月	0.9466%	0.0042%	0.0873%	0.0000%	0.8593%	0.0042%
过去六个月	1.9328%	0.0032%	0.1736%	0.0000%	1.7592%	0.0032%
过去一年	3.8966%	0.0025%	0.3500%	0.0000%	3.5466%	0.0025%
过去三年	9.7733%	0.0023%	1.0500%	0.0000%	8.7233%	0.0023%
自基金合同生效起至今	25.9622%	0.0063%	2.1759%	0.0001%	23.7863%	0.0062%

融通易支付货币 E

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	0.2868%	0.0034%	0.0288%	0.0000%	0.2580%	0.0034%
过去三个月	0.8746%	0.0042%	0.0873%	0.0000%	0.7873%	0.0042%
过去六个月	1.7938%	0.0032%	0.1736%	0.0000%	1.6202%	0.0032%
过去一年	3.5712%	0.0025%	0.3500%	0.0000%	3.2212%	0.0025%
自基金合同生效起至今	6.1234%	0.0025%	0.7081%	0.0000%	5.4153%	0.0025%

注：1、融通易支付货币 A 的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））”。

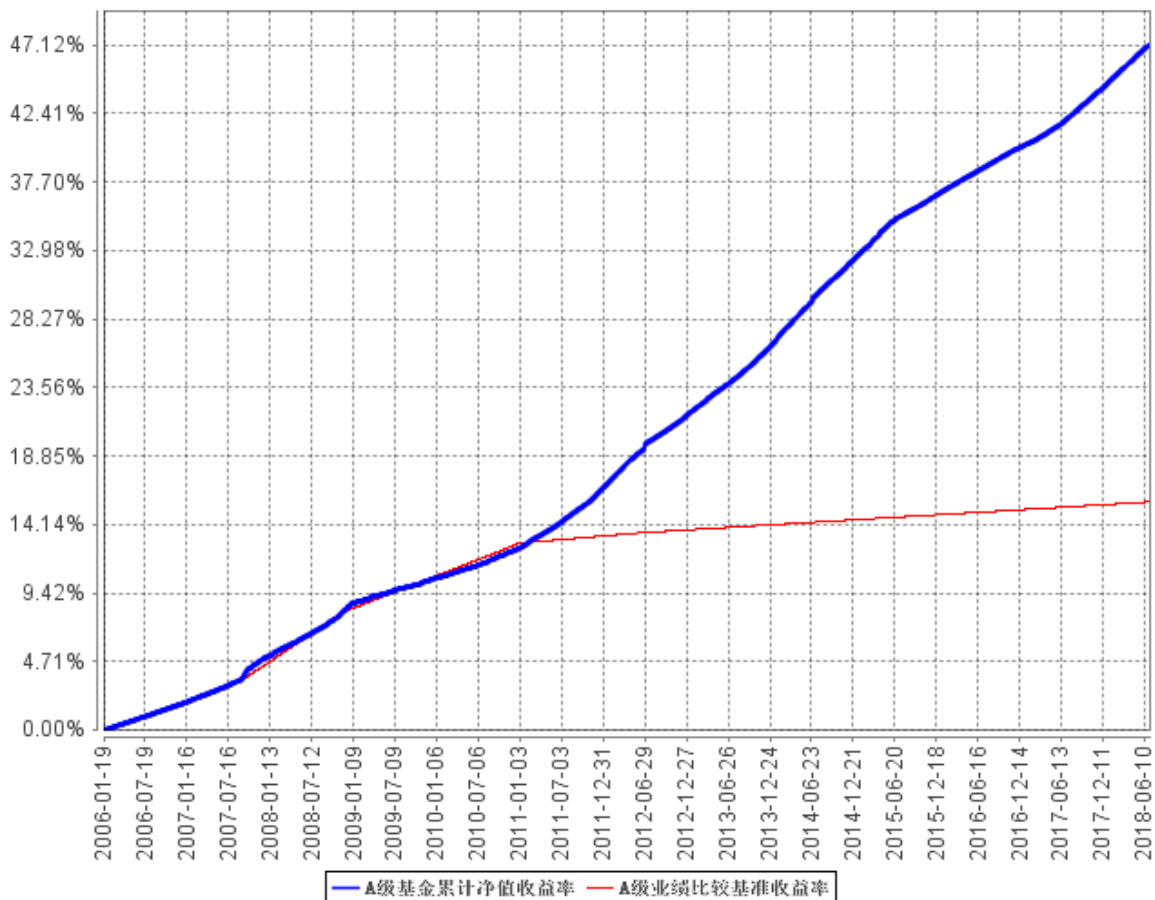
2、自 2012 年 5 月 2 日，本基金实施基金份额分类。新增融通易支付货币 B 类份额，上表中融通易支付货币 B 相关数据的统计起始日为 2012 年 5 月 2 日。

3、自 2016 年 6 月 20 日，增设 E 类份额。融通易支付货币 E 的数据统计期间为 2016 年 6 月

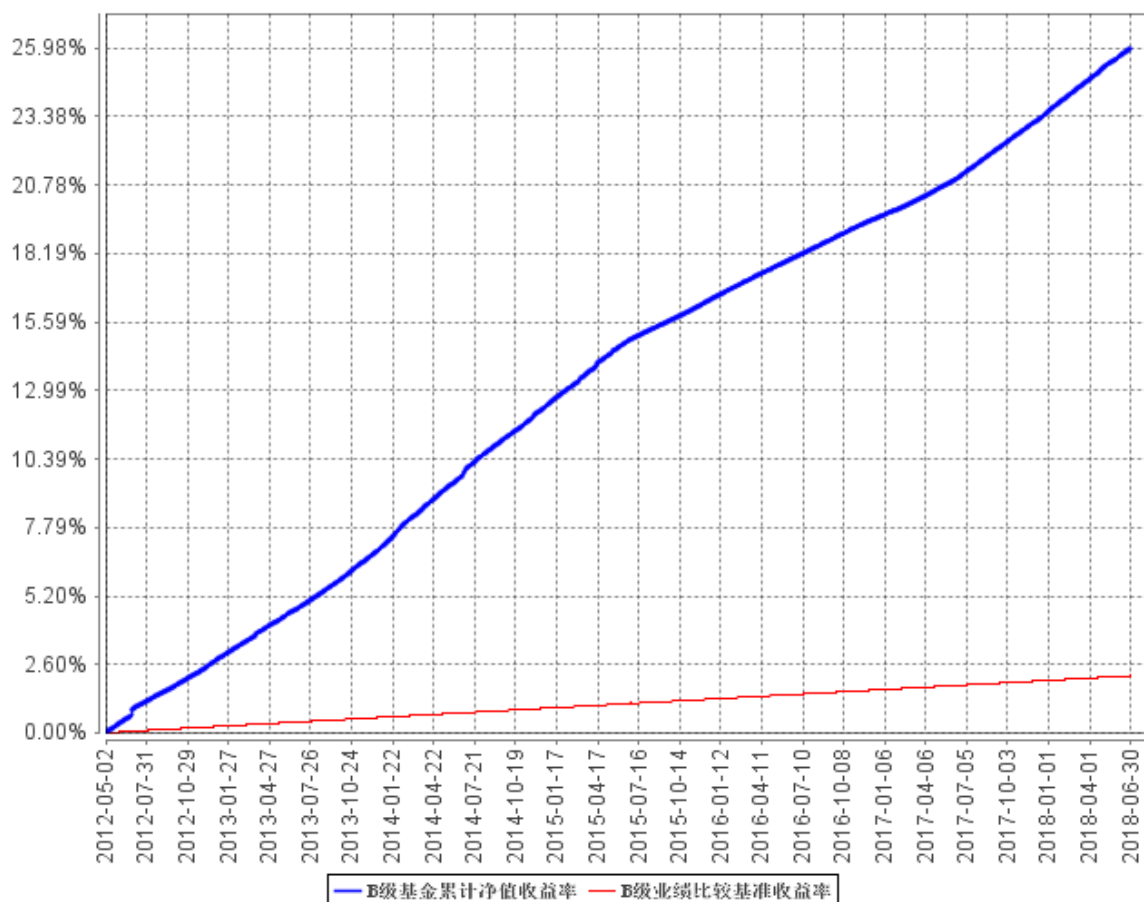
22 日至本报告期末止。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

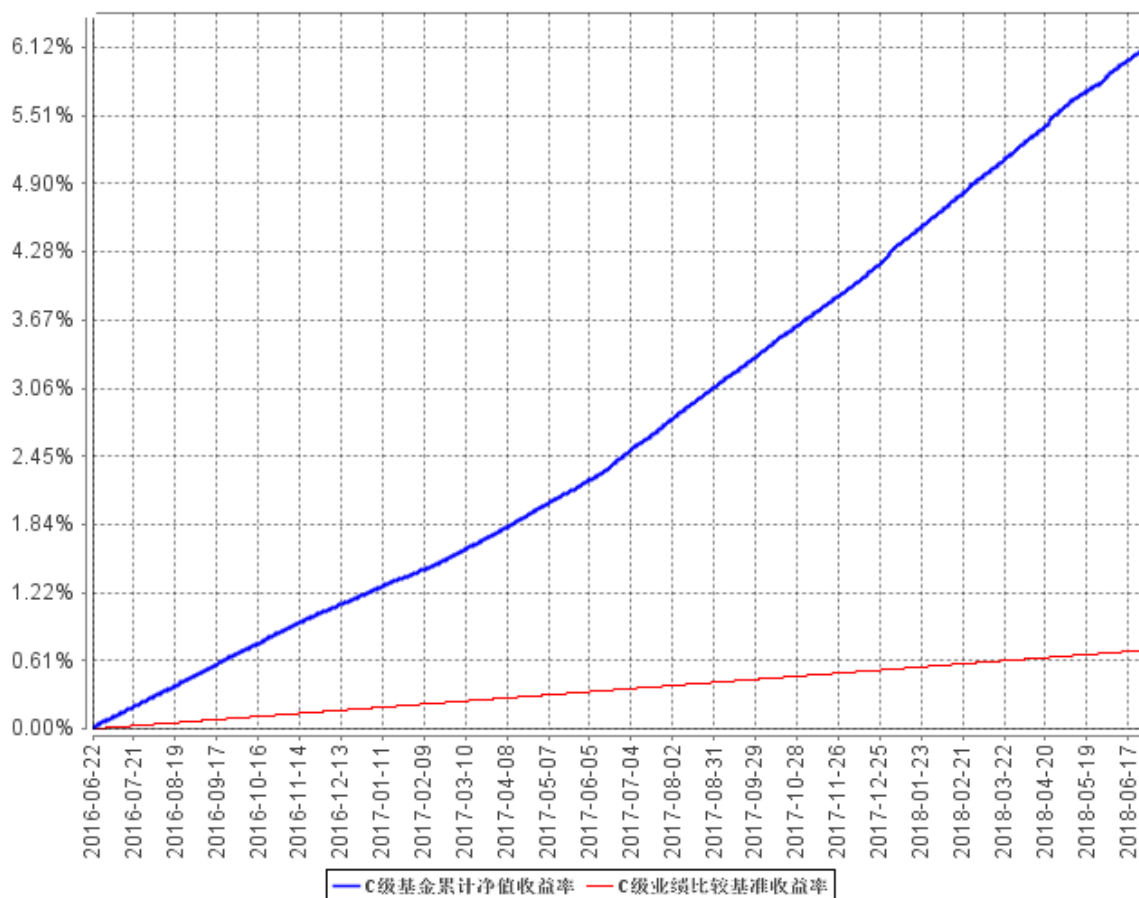
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



E 级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1. 本基金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））”。

2. 自 2012 年 5 月 2 日，本基金实施基金份额分类，增设 B 类份额。融通易支付货币 B 的数据统计期间为 2012 年 5 月 2 日至本报告期末止。

3. 自 2016 年 6 月 20 日增设 E 类份额。融通易支付货币 E 的数据统计期间为 2016 年 6 月 22 日至本报告期末止。

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

截至 2018 年 6 月 30 日，公司共管理六十六只开放式基金：即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、融通动力先锋混合基金、融通领先成长混合基金 (LOF)、融通内需驱动混合基金、融通深证成份指数基金、融通四季添利债券基金、融通创业板指数基金、融通医疗保健混合基金、融通岁岁添利定期开放债券基金、融通丰利四分法 (QDII-FOF) 基金、融通汇财宝货币基金、融通可转债债券基金、融通通泰保本混合基金、融通通福债券基金 (LOF)、融通通源短融债券基金、融通通瑞债券基金、融通月月添利定期开放债券基金、融通健康产业混合基金、融通转型三动力混合基金、融通互联网传媒混合基金、融通新区域新经济混合基金、融通通鑫混合基金、融通新能源混合基金、融通军工分级指数基金、融通证券分级指数基金、融通跨界成长混合基金、融通新机遇混合基金、融通成长 30 混合基金、融通中国风 1 号混合基金、融通通盈保本混合基金、融通增利债券基金、融通增裕债券基金、融通增鑫债券基金、融通增益债券基金、融通增祥债券基金、融通新消费混合基金、融通通安债券基金、融通通优债券基金、融通通乾研究精选混合基金、融通新趋势混合基金、融通国企改革新机遇混合基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币基金、融通通祺债券基金、融通稳利债券基金、融通通宸债券基金、融通通玺债券基金、融通通穗债券基金、融通通润债券基金、融通通颐定期开放债券基金、融通人工智能指数基金 (LOF)、融通新动力混合基金、融通收益增强债券基金、融通中国概念债券基金 (QDII)、融通逆向策略混合基金、融通通裕定期开放债券发起式基金、融通红利机会主题精选混合基金、融通通昊定期开放债券发起式基金、融通新能源汽车主题精选混合基金。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		
黄浩荣	本基金的基金经理	2017 年 7 月 29 日	-	4	黄浩荣先生，厦门大学管理学硕士，4 年证券投资从业经历，具有基金从业资格。2014 年 6 月加入融通基金管理有限公司，历任固定收益部固定收益研究员，现任融通易支付货币、融通汇财宝货币（由原融通七天理财债券转型而来）、融通通源短融债券、融通增利债券、融通通安债券、融通通福债券（LOF）（由原融通通福分级债券转型而来）、融通通和债券、融通通祺债券、融通通宸债券、融通通玺债券、融通通穗债券、融通通润债券、融通通颐定期开放债券、融通通昊定期开放债

					券基金的基金经理。
张一格	本基金的基金经理、固定收益投资总监	2015 年 11 月 17 日	2018 年 3 月 24 日	12	张一格先生，中国人民银行研究生部经济学硕士、南开大学法学学士，美国特许金融分析师（CFA）。12 年证券投资从业经历，具有基金从业资格，现任融通基金管理有限公司固定收益投资总监。历任兴业银行资金营运中心投资经理、国泰基金管理有限公司国泰民安增利债券等基金的基金经理。2015 年 6 月加入融通基金管理有限公司，现任融通通盈保本、融通新机遇灵活配置混合、融通通裕债券、融通收益增强债券、融通通昊定期开放债券发起式基金的基金经理。

注：1、任免日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写；证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

2、2018 年 7 月 12 日，本基金管理人发布了《融通易支付货币市场证券投资基金基金经理变更公告》，自 2018 年 7 月 12 日起，基金管理人增聘王超担任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为，本基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。

本基金管理人对报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，各投资组合的同向交易价差均处于合理范围之内。

报告期内，本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 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

今年上半年经济温和下行，尽管工业增速保持相对稳定，但固定资产投资、社会消费品零售总额和净出口累计同比增速均大幅下滑，经济需求的三驾马车动能呈现走弱趋势。通胀方面，上

半年 CPI 处于较低位置，CPI 在 2 月达到高点后逐步下滑。

货币市场上，央行继续通过灵活的公开市场操作对冲资金面收紧压力，同时于 4 月中旬和 6 月下旬两次宣布进行定向降准，货币政策呈现边际放松，资金面整体维持宽松，虽然 4 月份下旬市场资金出现紧张局面，但 4 月降准带来的流动性释放以及公开市场操作，导致 5、6 月份资金面维持较长时间宽松平稳，季度存单价格高点相比去年下半年均出现较大幅度下降。值得注意的是，在宏观去杠杆背景下，非标、股权等融资渠道收紧，部分企业由于自身经营及流动性管理问题，导致信用事件发生频率增加，信用等级分化明显。由于流动性新规的实行，本基金在上半年中适当降低了组合剩余天数，提高了流动性资产水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期融通易支付货币 A 的基金份额净值收益率为 1.8117%，本报告期融通易支付货币 B 的基金份额净值收益率为 1.9328%，本报告期融通易支付货币 E 的基金份额净值收益率为 1.7938%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

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，随着棚改货币化安置政策收紧以及经济去杠杆继续推进，下半年经济基本面承压明显。通胀方面，预计食品价格同比降幅将趋于收窄，非食品价格增速平稳，预计后期 CPI 同比维持在低位运行。预计下半年经济基本面对债券市场仍趋向利好，通胀水平维持低位，市场流动性相对充裕。本基金将在做好组合流动性管理前提下，适当加大关键时点的资产配置力度和久期。

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、风险管理部、登记清算部、固定收益部、国际业务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，风险管理部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。

截至本报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签订服务协议，由其提供相关债券品种和流通受限股票的估值参考数据。

4.7 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。根据上述原则，本基金 2018 年上半年度利润分配符合基金合同约定，利润分配总额 21,334,890.22 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，融通易支付货币 A 实施利润分配的金额为 4,861,608.60 元，融通易支付货币 B 实施利润分配的金额为 12,234,474.57 元，融通易支付货币 E 实施利润分配的金额为 4,238,807.05 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	197,399,380.61	242,489,306.25
结算备付金		472,229.55	545,454.55
存出保证金		313,563.26	161,583.23
交易性金融资产	6.4.7.2	594,979,658.25	818,812,831.62
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		594,979,658.25	818,812,831.62
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	379,897,689.84	677,189,475.81
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	2,958,567.85	10,071,641.57
应收股利		-	-
应收申购款		458,395.58	145,373,661.66
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,176,479,484.94	1,894,643,954.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 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		56,079,774.96	88,899,666.65
应付证券清算款		2,001,344.66	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		331,530.80	403,066.96
应付托管费		100,463.84	122,141.52
应付销售服务费		96,903.33	87,780.42
应付交易费用	6.4.7.7	36,002.97	33,653.99
应交税费		134,900.17	124,200.00
应付利息		20,957.64	120,801.10

应付利润		215,286.10	803,597.62
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	152,806.31	159,000.00
负债合计		59,169,970.78	90,753,908.26
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,117,309,514.16	1,803,890,046.43
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		1,117,309,514.16	1,803,890,046.43
负债和所有者权益总计		1,176,479,484.94	1,894,643,954.69

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，融通易支付货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 309,569,008.53 份；融通易支付货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 708,955,343.35 份；融通货币基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 98,785,162.28 份。融通易支付货币份额总额合计为 1,117,309,514.16 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		24,847,648.66	182,618,417.86
1. 利息收入		24,598,244.60	185,621,570.58
其中：存款利息收入	6.4.7.11	4,388,643.86	91,530,288.21
债券利息收入		12,582,172.51	75,833,074.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,627,428.23	18,258,207.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		249,404.06	-3,005,076.08
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	249,404.06	-3,005,076.08
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
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	-	1,923.36
减：二、费用		3,512,758.44	52,626,993.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,895,312.55	17,417,169.93

2. 托管费	6.4.10.2.2	574,337.09	5,277,930.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	664,294.84	1,391,452.12
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		190,696.60	28,336,453.46
其中：卖出回购金融资产支出		190,696.60	28,336,453.46
6. 税金及附加		5,148.41	-
7. 其他费用	6.4.7.15	182,968.95	203,987.36
三、利润总额		21,334,890.22	129,991,424.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润		21,334,890.22	129,991,424.81

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	1,803,890,046.43	-	1,803,890,046.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	21,334,890.22	21,334,890.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-686,580,532.27	-	-686,580,532.27
其中：1. 基金申购款	3,209,822,309.19	-	3,209,822,309.19
2. 基金赎回款	-3,896,402,841.46	-	-3,896,402,841.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-21,334,890.22	-21,334,890.22
五、期末所有者权益（基金净值）	1,117,309,514.16	-	1,117,309,514.16
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	32,647,140,386.70	-	32,647,140,386.70
二、本期经营活动产生	-	129,991,424.81	129,991,424.81

的基金净值变动数（本期利润）			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-27,257,459,693.92	-	-27,257,459,693.92
其中：1. 基金申购款	12,566,640,482.37	-	12,566,640,482.37
2. 基金赎回款	-39,824,100,176.29	-	-39,824,100,176.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-129,991,424.81	-129,991,424.81
五、期末所有者权益（基金净值）	5,389,680,692.78	-	5,389,680,692.78

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：

_____ 张帆	_____ 颜锡廉	_____ 刘美丽
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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)。

本基金于2012年5月2日实施分级,基金份额分类后,在基金存续期内的任何一个开放日,若A类基金份额持有人在单个基金帐户保留的基金份额达到或超过500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的A类基金份额升级为B类基金份额,并于升级当日适用B类基金份额的相关费率,若B类基金份额持有人在单个基金帐户保留的基金份额低于500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的B类基金份额降级为A类基金份额,并于降

级当日适用 A 类基金份额的相关费率。两级基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。

根据《关于融通易支付货币市场证券投资基金增设场内基金份额、调整收益分配原则并修订基金合同部分条款的公告》，本基金于 2016 年 6 月 20 日实施基金份额分类，增设 E 类份额。融通易支付货币 E(511910) 份额上市交易，基金份额面值为 100 元，本报告所列融通易支付货币 E 的份额面值已折算为 1 元。

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<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》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

本基金 2018 年上半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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 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

根据财政部、国家税务总局财税[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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	7,399,380.61
定期存款	190,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	120,000,000.00
存款期限 3 个月以上	70,000,000.00
其他存款	-
合计：	197,399,380.61

注：定期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 2018 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	29,862,665.31	29,877,304.60	14,639.29	0.0013%
	银行间市场	565,116,992.94	565,995,000.00	878,007.06	0.0786%
	合计	594,979,658.25	595,872,304.60	892,646.35	0.0779%

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/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 2018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	379,897,689.84	-
合计	379,897,689.84	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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 2018年6月30日
应收活期存款利息	2,088.60
应收定期存款利息	1,031,124.91
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	191.25
应收债券利息	1,792,396.68
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	132,639.42
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	126.99
合计	2,958,567.85

注：其他为应收保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018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	36,002.97
合计	36,002.97

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	152,806.31
合计	152,806.31

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

融通易支付货币 A		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	188,930,012.16	188,930,012.16
本期申购	1,118,372,237.04	1,118,372,237.04
本期赎回	-997,733,240.67	-997,733,240.67
本期末	309,569,008.53	309,569,008.53

金额单位：人民币元

融通易支付货币 B		
项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,049,124,604.12	1,049,124,604.12
本期申购	1,750,798,805.11	1,750,798,805.11
本期赎回	-2,090,968,065.88	-2,090,968,065.88
本期末	708,955,343.35	708,955,343.35

金额单位：人民币元

融通易支付货币 E		
项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	565,835,430.15	565,835,430.15
本期申购	340,651,267.04	340,651,267.04
本期赎回	-807,701,534.91	-807,701,534.91
本期末	98,785,162.28	98,785,162.28

注：1、申购含红利再投及分级份额调增份额；赎回含分级份额调减份额。

2、融通易支付货币 E(511910) 份额上市交易，基金份额面值为 100 元，本表所列融通易支付货币 E 的份额面值已折算为 1 元。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

融通易支付货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	4,861,608.60	-	4,861,608.60
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	-4,861,608.60	-	-4,861,608.60
本期末	-	-	-

单位：人民币元

融通易支付货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	12,234,474.57	-	12,234,474.57
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	-12,234,474.57	-	-12,234,474.57
本期末	-	-	-

单位：人民币元

融通易支付货币 E			
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	4,238,807.05	-	4,238,807.05

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	-4,238,807.05	-	-4,238,807.05
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。本基金自成立起至 2016 年 6 月 14 日，利润分配是按月结转份额，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；自 2016 年 6 月 15 日起，利润分配由按月结转份额变更为按日结转份额，每日以红利再投资方式支付累积收益，即按份额面值 1.000 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	57,412.94
定期存款利息收入	4,309,251.78
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	19,972.57
其他	2,006.57
合计	4,388,643.86

注：其他为保证金利息收入。

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,715,050,138.67
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,705,740,126.47
减：应收利息总额	9,060,608.14
买卖债券差价收入	249,404.06

6.4.7.13 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

6.4.7.14 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	64,464.96
信息披露费	49,588.57
其他	600.00
上市费	29,752.78
银行费用	20,562.64
债券托管帐户维护费	18,000.00
合计	182,968.95

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，本基金无需要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
中国民生银行股份有限公司（“中国民生银行”）	基金托管人、基金销售机构
新时代证券股份有限公司（“新时代证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
深圳市融通资本管理股份有限公司	基金管理人的子公司

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易，无应付关联方的交易佣金。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,895,312.55	17,417,169.93
其中：支付销售机构的客户维护费	144,926.08	197,539.30

注：1、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：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

2、客户维护费是基金管理人与基金销售机构约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的费用，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	574,337.09	5,277,930.18

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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.1.3 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			
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	融通易支付货币 A	融通易支付货币 B	融通易支付货币 E	合计
融通基金管理有限公司	203,035.21	28,801.62	-	231,836.83

中国民生银行	4,998.56	-	-	4,998.56
新时代证券	0.39	-	250,108.58	250,108.97
合计	208,034.16	28,801.62	250,108.58	486,944.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	融通易支付货币 A	融通易支付货币 B	融通易支付货币 E	合计
融通基金管理有限公司	111,305.15	477,037.64	-	588,342.79
中国民生银行	4,767.88	-	-	4,767.88
新时代证券	-	-	193,041.96	193,041.96
合计	116,073.03	477,037.64	193,041.96	786,152.63

注：支付基金销售机构的 A 类基金份额、B 类基金份额和 E 类基金份额的销售服务费分别按前一日该类基金资产净值 0.25%、0.01%和 0.25%的年费率计提。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 约定年费率 / 当年天数。

6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018年1月1日至2018年6月30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	-	-	9,900,000.00	596.71	-	-
上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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	-	111,154,909.59	-	-	130,200,000.00	16,593.87

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固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固有资金投资本基金。

6.4.10.3.2 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

融通易支付货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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
深圳市融通 资本管理股 份有限公司	5,702,299.57	0.51%	10,414,394.66	0.99%

融通易支付货币 E

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金类别份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金类别份 额的比例
新时代证券	-	-	4,265,800.00	0.75%

注：融通易支付货币 E(511910)份额上市交易，基金份额面值为 100 元，本表所列融通易支付货币 E 的份额面值已折算为 1 元。

6.4.10.4 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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 -活期存款	7,399,380.61	57,412.94	55,065,721.03	404,113.54
中国民生银行 -定期存款	50,000,000.00	723,568.84	-	1,612,056.18

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国民生银行保管，按银行同业利率计息，存入中国民生银行的定期存款按协议利率计息。

6.4.10.5 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。

6.4.10.6 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

融通易支付货币A

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
4,886,724.05	-	-25,115.45	4,861,608.60	-

融通易支付货币B

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
12,570,410.65	-	-335,936.08	12,234,474.57	-

融通易支付货币E

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
4,466,067.04	-	-227,259.99	4,238,807.05	-

注：本基金在本年度累计分配收益 21,334,890.22 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 21,923,201.74 元，计入应付收益科目-588,311.52 元。

6.4.12 期末（2018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/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

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
111714332	17 江苏银行 CD332	2018 年 7 月 2 日	98.08	40,000.00	3,923,200.00
111783160	17 广州农村商业银行 CD150	2018 年 7 月 2 日	99.42	300,000.00	29,826,000.00
111898112	18 大连银行 CD086	2018 年 7 月 2 日	98.16	200,000.00	19,632,000.00
合计				540,000.00	53,381,200.00

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,000,000.00 元，于 2018 年 7 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有

的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

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,主要投资于货币市场工具。本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行内控优先和全员风险管理理念,高度重视风险管理的组织保障和制度保障,建立了完备的风险管理组织及相应的制度和流程,力争在风险最小化的前提下,确保基金份额持有人利益最大化。

董事会对有效的风险管理承担最终责任,负责确定公司风险管理总体目标,制定公司风险管理战略和风险应对策略;审议重大事件、重大决策的风险评估意见,审批重大风险的解决方案,批准公司基本风险管理制度;审议公司风险管理报告。在董事会下设立风险控制与审计委员会,履行相应风险管理和监督职责。

公司管理层对有效的风险管理承担直接责任,根据董事会的风险管理战略,制定与公司发展战略、整体风险承受能力相匹配的风险管理制度,并确保风险管理制度得以全面、有效执行。在公司管理层下设立风险管理委员会,负责指导、协调和监督各职能部门和个业务单元开展风险管理工作;制定相关风险控制政策,审批风险管理重要流程和风险限额,并与公司整体业务发展战略和风险承受能力相一致;识别公司各项业务所涉及各类重大风险,对重大风险、重大决策和重要业务流程的风险进行评估,制定重大风险的解决方案;识别和评估新产品、新业务的新增风险,并制定控制措施;重点关注内控机制薄弱环节和那些可能给公司带来重大损失的事件,提出控制措施和解决方案;协调突发性重大风险事件的处理;审定风险事件责任人的责任;根据公司风险管理总体策略和各职能部门与业务单元职责分工,组织实施风险应对方案。

各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规,遵守公司业务管理制度,执行风险管理的基本制度流程,定期对本部门的风险进行评估,对其风险管理制度和流程的有效性负责。公司所有员工是本岗位风险管理的直接责任人,各业务部门负责人是其部门风险管理的第一责任人,基金经理是相应投资组合风险管理的第一责任人。

风险管理部对公司风险管理承担独立评估、监控、检查和报告职责,负责执行公司的风险管

理战略和决策，拟定公司风险管理制度，并协同各业务部门制定风险管理流程、评估指标；对风险进行定性和定量评估，改进风险管理方法、技术和模型，组织推动建立、持续优化风险管理信息系统；对新产品、新业务进行独立监测和评估，提出风险防范和控制建议；负责督促相关部门落实风险管理委员会的各项决策和风险管理制度，并对风险管理决策和风险管理制度执行情况进行检查、评估和报告。

监察稽核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，确保既定的风险管理措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

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和部分定期存款存放在本基金的托管行中国民生银行；其他定期存款存放在具有基金托管资格的平安银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、工商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、光大银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司，及其他大中型商业银行如上海农村商业银行股份有限公司、瑞丰银行股份有限公司、恒丰银行股份有限公司等，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 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。

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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	69,978,647.89
A-1 以下	-	-
未评级	70,112,876.71	139,990,773.54
合计	70,112,876.71	209,969,421.43

注：未评级债券为短期融资券、超短期融资券、政策性金融债。债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.2 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	395,121,489.17	479,053,405.34
合计	395,121,489.17	479,053,405.34

6.4.13.2.3 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 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	10,015,974.86	-
AAA 以下	-	-
未评级	119,729,317.51	129,790,004.85
合计	129,745,292.37	129,790,004.85

注：未评级债券为政策性金融债。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。

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 120 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%。

于 2018 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 56,079,774.96 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的全部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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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 个交易日内的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2017 年 12 月 31 日，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 45.99%，本基金投资组合的平均剩余期限为 19 天，平均剩余存续期为 61 天。

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发行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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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 2018 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	37,399,380.61	160,000,000.00	-	-	-	-	197,399,380.61
结算备付金	472,229.55	-	-	-	-	-	472,229.55
存出保证金	313,563.26	-	-	-	-	-	313,563.26
交易性金融资产	5,000,000.00	333,072,614.12	256,907,044.13	-	-	-	594,979,658.25

买入返售金融资产	379,897,689.84	-	-	-	-	-	379,897,689.84
应收利息	-	-	-	-	-	2,958,567.85	2,958,567.85
应收申购款	-	-	-	-	-	458,395.58	458,395.58
资产总计	423,082,863.26	493,072,614.12	256,907,044.13	-	-	3,416,963.43	1,176,479,484.94
负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	56,079,774.96	-	-	-	-	-	56,079,774.96
应付证券清算款	-	-	-	-	-	2,001,344.66	2,001,344.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	331,530.80	331,530.80
应付托管费	-	-	-	-	-	100,463.84	100,463.84
应付销售服务费	-	-	-	-	-	96,903.33	96,903.33
应付交易费用	-	-	-	-	-	36,002.97	36,002.97
应付利息	-	-	-	-	-	20,957.64	20,957.64
应交税费	-	-	-	-	-	134,900.17	134,900.17
应付利润	-	-	-	-	-	215,286.10	215,286.10
其他负债	-	-	-	-	-	152,806.31	152,806.31
负债总计	56,079,774.96	-	-	-	-	3,090,195.82	59,169,970.78
利率敏感度缺口	367,003,088.30	493,072,614.12	256,907,044.13	-	-	326,767.61	1,117,309,514.16
上年度末 2017年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	162,489,306.25	80,000,000.00	-	-	-	-	242,489,306.25
结算备付金	545,454.55	-	-	-	-	-	545,454.55
存出保证金	161,583.23	-	-	-	-	-	161,583.23
交易性金融资产	678,869,077.00	69,965,106.73	69,978,647.89	-	-	-	818,812,831.62
买入返售金融资产	677,189,475.81	-	-	-	-	-	677,189,475.81
应收利息	-	-	-	-	-	10,071,641.57	10,071,641.57
应收申购款	-	-	-	-	-	145,373,661.66	145,373,661.66
资产总计	1,519,254,896.84	149,965,106.73	69,978,647.89	-	-	155,445,303.23	1,894,643,954.69
负债							
卖出回购金融资产款	88,899,666.65	-	-	-	-	-	88,899,666.65
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	403,066.96	403,066.96
应付托管费	-	-	-	-	-	122,141.52	122,141.52
应付销售服务费	-	-	-	-	-	87,780.42	87,780.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	33,653.99	33,653.99
应付税金	-	-	-	-	-	124,200.00	124,200.00
应付利息	-	-	-	-	-	120,801.10	120,801.10
应付利润	-	-	-	-	-	803,597.62	803,597.62
其他负债	-	-	-	-	-	159,000.00	159,000.00
负债总计	88,899,666.65	-	-	-	-	1,854,241.61	90,753,908.26

利率敏感度缺口	1,430,355,230.19	149,965,106.73	69,978,647.89	-	-153,591,061.62	1,803,890,046.43
---------	------------------	----------------	---------------	---	-----------------	------------------

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（2018年6月30日）	上年度末（2017年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	413,977.62	902,977.44
	2. 市场利率上升 25 个基点	-413,226.40	-900,619.13

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。

6.4.14 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	594,979,658.25	50.57
	其中：债券	594,979,658.25	50.57
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	379,897,689.84	32.29
	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	197,871,610.16	16.82
4	其他各项资产	3,730,526.69	0.32
5	合计	1,176,479,484.94	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	0.93	
	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	56,079,774.96	5.02
	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

调整期从正回购融资余额超过基金资产净值比例 20% 后的第一个交易日起开始计算。

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	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	58
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	15

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	45.91	4.66
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
2	30 天(含)—60 天	23.22	0.00
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
3	60 天(含)—90 天	21.81	0.00
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
4	90 天(含)—120 天	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
5	120 天(含)—397 天(含)	14.05	0.00

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	-
合计		104.99	4.66

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

报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	119,729,317.51	10.72
	其中：政策性金融债	119,729,317.51	10.72
4	企业债券	10,015,974.86	0.90
5	企业短期融资券	70,112,876.71	6.28
6	中期票据	-	-
7	同业存单	395,121,489.17	35.36
8	其他	-	-
9	合计	594,979,658.25	53.25
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序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	160202	16 国开 02	900,000	89,891,724.49	8.05
2	111818128	18 华夏银行 CD128	500,000	49,695,394.00	4.45
3	111809163	18 浦发银行 CD163	500,000	49,637,602.54	4.44
4	111819227	18 恒丰银行 CD227	500,000	49,625,490.22	4.44
5	111805132	18 建设银行 CD132	500,000	49,564,321.74	4.44
6	111821219	18 渤海银行 CD219	400,000	39,150,659.73	3.50
7	011800393	18 平安租赁 SCP003	300,000	30,094,866.50	2.69
8	111783160	17 广州农村商业银行 CD150	300,000	29,825,614.13	2.67
9	111821169	18 渤海银行 CD169	300,000	29,190,913.56	2.61
10	011800975	18 中航租赁 SCP005	200,000	20,017,863.77	1.79

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	0.1419%
报告期内偏离度的最低值	0.0092%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0572%
------------------------	---------

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期未出现负偏离度绝对值达到 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

本基金本报告期未出现正偏离度绝对值达到 0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内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、处罚情形:

18 浦发银行 CD163:

本基金投资的前十名证券中的 18 浦发银行 CD163, 其发行主体为上海浦东发展银行股份有限公司。

2018 年 1 月 20 日, 公司公告成都分行于 2018 年 1 月 19 日收到中国银行业监督管理委员会四川监管局(以下简称“银监会四川监管局”)行政处罚决定书(川银监罚字[2018]2 号), 对成都分行内控管理严重失效, 授信管理违规, 违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处, 执行罚款 46,175 万元人民币。

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	313,563.26
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,958,567.85
4	应收申购款	458,395.58
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,730,526.69

§ 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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
融通易支付货币 A	252,102	1,227.95	7,687,719.47	2.48%	301,881,289.06	97.52%
融通易支付货币 B	17	41,703,255.49	668,742,710.25	94.33%	40,212,633.10	5.67%
融通易支付货币 E	288	343,004.04	39,888,830.98	40.38%	58,896,331.30	59.62%
合计	252,407	4,426.62	716,319,260.70	64.11%	400,990,253.46	35.89%

注：融通易支付货币 E(511910) 份额上市交易，基金份额面值为 100 元，本表所列融通易支付货币 E 的份额面值已折算为 1 元。

8.2 期末上市基金前十名持有人

融通易支付货币 E

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	文登市森鹿制革有限公司	37,999,100.00	38.47%
2	何冠英	6,040,000.00	6.11%
3	刘阳	4,570,100.00	4.63%
4	席晓丽	3,612,600.00	3.66%
5	林瑞明	3,531,000.00	3.57%
6	王子腾	3,027,400.00	3.06%
7	陈奕达	2,100,200.00	2.13%
8	陆海燕	2,090,500.00	2.12%
9	邬镇邦	2,012,000.00	2.04%
10	欧恒兴	1,889,700.00	1.91%

注：融通易支付货币 E(511910) 份额上市交易，基金份额面值为 100 元，本表所列融通易支付货币 E 的份额面值已折算为 1 元。

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例
1	基金类机构	203,165,490.55	18.18%
2	其他机构	200,588,901.14	17.95%
3	银行类机构	83,643,860.50	7.49%
4	银行类机构	44,108,507.68	3.95%
5	其他机构	37,999,100.00	3.40%
6	基金类机构	34,671,220.06	3.10%
7	基金类机构	30,581,290.55	2.74%
8	其他机构	24,248,879.82	2.17%
9	个人	15,506,354.61	1.39%
10	个人	14,130,790.90	1.26%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
----	------	------------	----------

基金管理人所有 从业人员持有本 基金	融通易支付货币 A	164,005.69	0.0530%
	融通易支付货币 B	0.00	0.0000%
	融通易支付货币 E	0.00	0.0000%
	合计	164,005.69	0.0147%

8.5 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的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持 有本开放式基金	融通易支付货币 A	0
	融通易支付货币 B	0
	融通易支付货币 E	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	融通易支付货币 A	0
	融通易支付货币 B	0
	融通易支付货币 E	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	融通易支付货 币 A	融通易支付 货币 B	融通易支付 货币 E
基金合同生效日（2006 年 1 月 19 日）基金份额总额	2,823,218,174.33	-	-
本报告期初基金份额总额	188,930,012.16	1,049,124,604.12	565,835,430.15
本报告期基金总申购份额	1,118,372,237.04	1,750,798,805.11	340,651,267.04
减：本报告期基金总赎回份额	997,733,240.67	2,090,968,065.88	807,701,534.91
本报告期末基金份额总额	309,569,008.53	708,955,343.35	98,785,162.28

注：总申购份额含因份额升降级导致的强制调增份额，总赎回份额含因份额升降级导致的强制调减份额。

§ 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

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

2018 年 7 月 28 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第六届董事会第五次临时会议审议并通过，同意刘晓玲女士辞去公司副总经理职务。

10.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人中国民生银行股份有限公司于 2018 年 4 月 19 日公告，根据工作需要，任命张庆先生担任本公司资产托管部总经理，主持资产托管部相关工作。

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，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，该事务所自 2011 年 10 月 20 日以来为本基金提供审计服务至今。

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，本基金的基金管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	2	-	-	-	-	-

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) 资质雄厚，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	35,860,762.58	100.00%	453,900,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期未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	关于融通易支付货币市场基金 2018 年春节假期前暂停申购（含定投及转换入）业务的公告	上海证券报、管理人网站	2018-2-10
2	关于新时代证券代销的旗下部分开放式基金新增开通定期定额投资业务的公告	上海证券报、管理人网站	2018-3-13
3	融通基金关于新增中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、管理人网站	2018-3-22
4	融通关于旗下部分开放式基金在上海基煜基金销售有限公司开通定期定额投资及转换业务的公告	上海证券报、管理人网站	2018-3-22
5	关于修改《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》部分条款的公告	上海证券报、管理人网站	2018-3-23
6	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	2018-3-24

7	融通基金关于新增北京蛋卷基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2018-4-16
8	融通基金管理有限公司关于新增金惠家保险代理有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务、转换业务及参加其申购费率优惠活动的公告	上海证券报、管理人网站	2018-5-14
9	融通基金管理有限公司关于网上直销交易系统调整旗下货币市场基金快速取现业务额度的公告	证券时报、管理人网站	2018-6-26

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180130, 20180223-20180521, 20180529-20180621, 20180626-20180630	199,522,799.81	38,813,910.80	500,000.00	237,836,710.61	21.29%
	2	20180531-20180608	0.00	200,588,901.14	0.00	200,588,901.14	17.95%
	3	20180522	0.00	300,000,000.00	300,000,000.00	0.00	0.00%
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

当基金份额持有人占比过于集中时，可能存在因某单一基金份额持有人大额赎回而引起基金单位份额净值剧烈波动的风险及流动性风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据 2016 年 12 月 25 日财政部、国家税务总局联合下发的《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〔2016〕140 号）、2017 年 1 月 10 日财政部、国家税务总局联合下发的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税〔2017〕2 号）及财政部 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税〔2017〕56 号）的通知，现明确自 2018 年 1 月 1 日起，基金管理人运营公募基金及资管产品（以下简称“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。

自 2018 年 1 月 1 日（含）起，本基金管理人将对旗下存续及新增产品发生的增值税应税行为按照相关规定以及税务机关的要求计算和缴纳增值税税款及附加税费。前述税款及附加税费是产品管理、运作和处分过程中发生的，将由产品资产承担，从产品资产中提取缴纳，可能对产品收益水平有所影响，敬请广大投资者知悉。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的要求，本基金管理人经与基金托管人协商一致，对本基金合同进行了修订和更新。本次修订和更新仅涉及与《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》相关的条款，包括前言、释义、基金份额的申购与赎回、基金的投资、基金资产估值、基金的信息披露等，具体内容详见 2018 年 3 月 23 日基金管理人网站披露的相关公告和修订更新后的法律文件。

§ 12 备查文件目录

12.1 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批准成立批件、营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件，或登录本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查阅。