

# 融通易支付货币市场证券投资基金 2014 年半年度报告摘要

2014 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：2014 年 8 月 26 日

**§ 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 2014 年 8 月 20 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

**§ 2 基金简介****2.1 基金基本情况**

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	1, 722, 458, 970. 24 份	
基金合同存续期	不定期	
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
下属分级基金的交易代码:	161608	161615
报告期末下属分级基金的份额总额	348, 883, 200. 09 份	1, 373, 575, 770. 15 份

**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	赵天杰
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 58560666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	zhaotianjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		400-883-8088、(0755) 26948088	95568
传真		(0755) 26935005	(010) 58560798

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.rtfund.com">http://www.rtfund.com</a>
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

## § 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
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)	报告期(2014年1月1日 - 2014年6月30日)
本期已实现收益	7,828,696.95	56,615,812.43
本期利润	7,828,696.95	56,615,812.43
本期净值收益率	2.5606%	2.7042%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
期末基金资产净值	348,883,200.09	1,373,575,770.15
期末基金份额净值	1.000	1.000

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	份额净值	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	------	------	-------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	0.5001%	0.0165%	0.0288%	0.0000%	0.4713%	0.0165%
过去三个月	1.2635%	0.0104%	0.0873%	0.0000%	1.1762%	0.0104%
过去六个月	2.5606%	0.0085%	0.1736%	0.0000%	2.3870%	0.0085%
过去一年	4.7185%	0.0064%	0.3500%	0.0000%	4.3685%	0.0064%
过去三年	13.4675%	0.0078%	1.1946%	0.0002%	12.2729%	0.0076%
自基金合同生效起至今	29.6670%	0.0071%	14.3016%	0.0034%	15.3654%	0.0037%

融通易支付货币 B

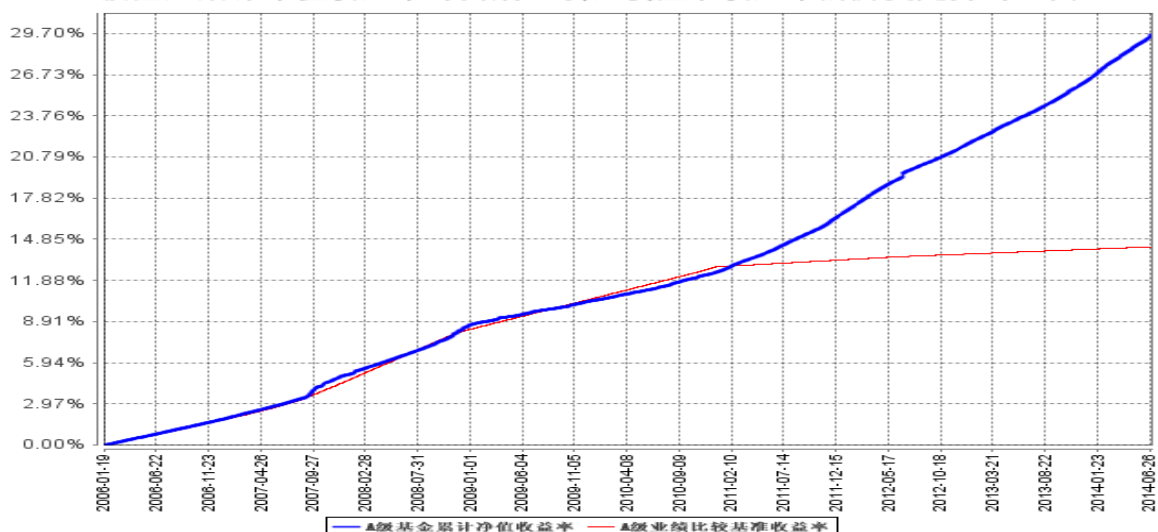
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.5214%	0.0165%	0.0288%	0.0000%	0.4926%	0.0165%
过去三个月	1.3279%	0.0104%	0.0873%	0.0000%	1.2406%	0.0104%
过去六个月	2.7042%	0.0086%	0.1736%	0.0000%	2.5306%	0.0086%
过去一年	5.0118%	0.0064%	0.3500%	0.0000%	4.6618%	0.0064%
过去三年	9.9900%	0.0088%	0.7759%	0.0001%	9.2141%	0.0087%
自基金合同生效起至今	9.9900%	0.0088%	0.7759%	0.0001%	9.2141%	0.0087%

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））”。

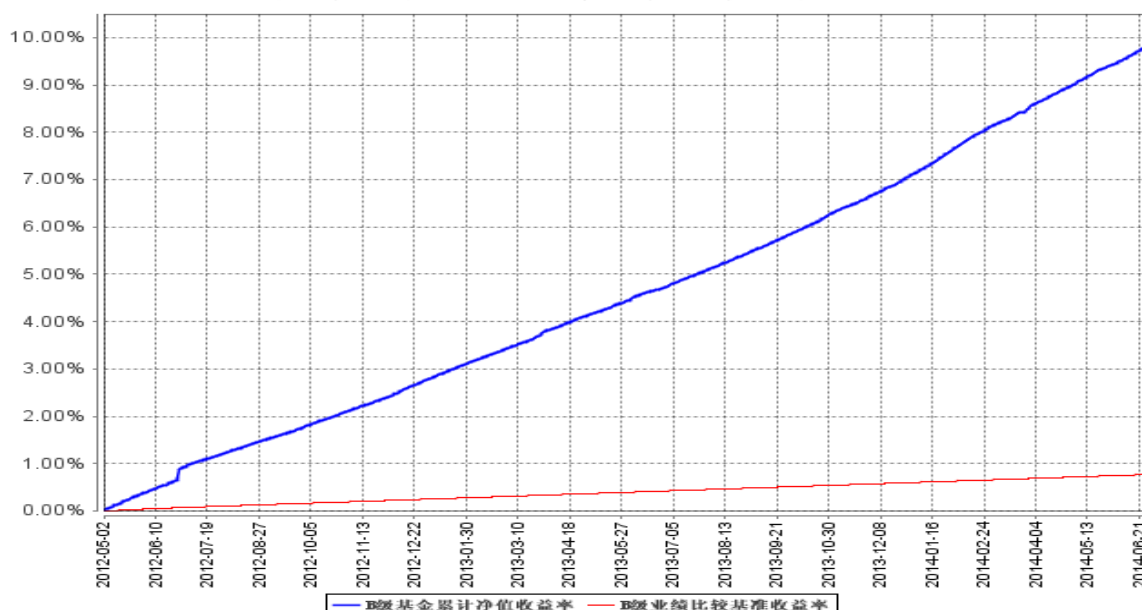
2、自 2012 年 5 月 2 日，本基金实施基金份额分类。

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



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 2014 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有二十五只：一只封闭式基金，即融通通乾封闭基金；二十四只开放式基金，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、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、融通医疗保健行业股票基金、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、融通七天理财债券基金、融通标普中国可转债指数增强基金、融通通泰保本混合基金、融通通泽一年目标触发式混合基金、融通通祥一年目标触发式混合基金、融通通福分级债券基金、融通通源一年目标触发式混合基金和融通通瑞一年目标触发式债券基金。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、融通四季添利债券基金的基金经理、融通岁岁添利定期开放债券基金的基金经理	2011年10月13日	-	8	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。

注：任职日期根据基金管理人对外披露的任职日期填写；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

2014年以来货币政策整体基调转向宽松，加上非标需求的下降银行对协议存款的配置需求回落，货币市场整体流动性呈持续宽松格局，7天回购利率均值稳定在3%-3.5%之间。短端债券的收益率整体下行幅度在80bp-100bp，收益率曲线进一步平坦化。本基金二季度年初以来采取了较为积极的投资策略，保持较高的债券配置比例，为组合积累了一定浮盈。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期 A 类基金份额净值收益率为 2.5606%，B 类基金份额净值收益率为 2.7042%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

#### 4.5 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历，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，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，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

#### 4.6 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

中国民生银行根据《融通易支付货币市场证券投资基金合同》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，中国民生银行在对融通易支付基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，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，按照国家相关法律法规、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人——融通基金管理有限公司在融通易支付基金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。本报告期，基金管理人——融通基金管理有限公司严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

由融通易支付基金管理人——融通基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查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：2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2014 年 6 月 30 日	上年度末 2013 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	640,472,594.75	1,412,495,822.43
结算备付金	150,000.00	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	1,090,758,170.69	559,020,474.41
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,090,758,170.69	559,020,474.41



资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	109,000,483.50	1,433,084,019.62
应收证券清算款	52,172,622.74	-
应收利息	20,493,936.04	12,960,980.67
应收股利	-	-
应收申购款	2,105,236.87	109,287,824.51
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,915,153,044.59	3,526,849,121.64
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2014年6月30日</b>	<b>2013年12月31日</b>
<b>负债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	185,799,667.10	-
应付证券清算款	-	109,972,254.42
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	725,646.19	517,757.13
应付托管费	219,892.82	156,896.10
应付销售服务费	99,021.98	80,307.95
应付交易费用	34,892.66	26,286.99
应交税费	124,200.00	124,200.00
应付利息	15,390.71	-
应付利润	5,569,665.45	3,955,192.15
递延所得税负债	-	-
其他负债	105,697.44	104,000.00
负债合计	192,694,074.35	114,936,894.74
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,722,458,970.24	3,411,912,226.90
未分配利润	-	-
所有者权益合计	1,722,458,970.24	3,411,912,226.90
负债和所有者权益总计	1,915,153,044.59	3,526,849,121.64

注：报告截止日 2014 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,722,458,970.24 份。其中易支付货币 A 级基金份额净值为 1.000 元，基金份额为 348,883,200.09 份；易支付货币 B 级基金份额净值为 1.000 元，基金份额为 1,373,575,770.15 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>	71,419,702.09	73,253,216.21
1. 利息收入	66,065,365.70	67,770,159.04
其中：存款利息收入	34,989,062.40	38,256,972.57
债券利息收入	25,658,944.92	24,292,997.80
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,417,358.38	5,220,188.67
其他利息收入	-	-
2. 投资收益	5,354,336.39	5,483,057.17
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,354,336.39	5,483,057.17
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	-	-
<b>减：二、费用</b>	6,975,192.71	10,839,912.26
1. 管理人报酬	4,170,758.34	5,490,665.43
2. 托管费	1,263,866.21	1,663,838.13
3. 销售服务费	498,307.46	1,139,238.02
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	907,639.73	2,408,302.57
其中：卖出回购金融资产支出	907,639.73	2,408,302.57
6. 其他费用	134,620.97	137,868.11
<b>三、利润总额</b>	64,444,509.38	62,413,303.95
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润</b>	64,444,509.38	62,413,303.95

### 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：2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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)	3,411,912,226.90	-	3,411,912,226.90
二、本期经营活动产生	-	64,444,509.38	64,444,509.38

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	-1,689,453,256.66	-	-1,689,453,256.66
其中: 1. 基金申购款	6,680,630,096.45	-	6,680,630,096.45
2. 基金赎回款	-8,370,083,353.11	-	-8,370,083,353.11
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-64,444,509.38	-64,444,509.38
五、期末所有者权益(基金净值)	1,722,458,970.24	-	1,722,458,970.24
项目	上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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)	6,263,215,851.12	-	6,263,215,851.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	62,413,303.95	62,413,303.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-5,087,486,369.90	-	-5,087,486,369.90
其中: 1. 基金申购款	9,683,970,209.39	-	9,683,970,209.39
2. 基金赎回款	-14,771,456,579.29	-	-14,771,456,579.29
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-62,413,303.95	-62,413,303.95
五、期末所有者权益(基金净值)	1,175,729,481.22	-	1,175,729,481.22

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:

          奚星华                                          朱建华                                          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 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。

### 6.4.2 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。

### 6.4.3 关联方关系

#### 6.4.3.1 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。

#### 6.4.3.2 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
民生银行股份有限公司(托管行)	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”)	基金管理人的股东、基金代销机构
深圳市融通资本财富管理有限公司	基金管理人的子公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.4.1.1 股票交易

本基金为货币基金，不从事股票交易。

##### 6.4.4.1.2 权证交易

本基金为货币基金，不从事权证交易。

##### 6.4.4.1.3 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无应支付关联方的交易佣金。

#### 6.4.4.2 关联方报酬

##### 6.4.4.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014 年6月30日	上年度可比期间 2013年1月1日至2013 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,170,758.34	5,490,665.43
其中：支付销售机构的客户维护费	251,124.91	748,264.52

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。

#### 6.4.4.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日	2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,263,866.21	1,663,838.13

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：

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

#### 6.4.4.2.3 销售服务费

获得销售服务费 各关联方名称	本期		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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	合计
融通基金管理有限公司	61,704.10	99,321.34	161,025.44
中国民生银行	13,780.38	35.85	13,816.23
新时代证券	81.74	-	81.74
合计	75,566.22	99,357.19	174,923.41
获得销售服务费 各关联方名称	上年度可比期间		
	2013 年 1 月 1 日至 2013 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	合计
融通基金管理有限公司	24,418.01	96,097.73	120,515.74
中国民生银行	40,777.57	352.45	41,130.02
新时代证券	40.21	0.00	40.21
合计	65,235.79	96,450.18	161,685.97

注：支付基金销售机构的A级基金份额和B级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%和0.01%的年费率计提。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times \text{约定年费率} / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.4.3 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

银行间市场交 易的 各关联方名称	本期					
	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日					
	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	423,955,843.54	61,359,614.52	-	-	-	-
上年度可比期间						
2013 年 1 月 1 日至 2013 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	-	-	-	-	-	-

6.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.4.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

6.4.4.4.2 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

融通易支付货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 06 月 30 日		上年度末 2013 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
融通国际资产管理有限公司	-	-	-	-

融通易支付货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2014 年 06 月 30 日		上年度末 2013 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
融通国际资产管理有限公司	10,000,000.00	0.73%	-	-

6.4.4.5 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 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2013 年 1 月 1 日至 2013 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	60,472,594.75	3,555,188.75	73,787,365.86	14,598,678.95

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 2014 年上半年的利息收入为 14,981.44 元，2013 年同期的利息收入为 3,482.14 元。

6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.5 期末（2014年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.5.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.5.3.2 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 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	1,090,758,170.69	56.95
	其中：债券	1,090,758,170.69	56.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	109,000,483.50	5.69
	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	640,622,594.75	33.45
4	其他各项资产	74,771,795.65	3.90
5	合计	1,915,153,044.59	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	2.54	
	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	185,799,667.10	10.79
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2014 年 1 月 8 日	20.64	巨额赎回	4
2	2014 年 1 月 9 日	21.01	巨额赎回	4
3	2014 年 1 月 10 日	21.37	巨额赎回	4
4	2014 年 1 月 13 日	21.31	巨额赎回	4

注：因遭遇巨额赎回，导致本基金 1 月 8 日至 1 月 13 日 4 个工作日债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例被动超过了 20%。出现上述情况后，管理人及时进行了调整，从 1 月 14 日开始，基金债券正回购的资金余额占基金资产净值的比例恢复到 20% 之内，符合相关规定。

## 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	111
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	129
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 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。

### 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	24.49	10.79
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.32	-
2	30 天(含)—60 天	6.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-



3	60 天(含)—90 天	24.40	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	9.30	-
4	90 天(含)—180 天	27.86	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	2.28	-
5	180 天(含)—397 天(含)	26.15	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		109.88	10.79

## 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	459,510,657.46	26.68
	其中：政策性金融债	459,510,657.46	26.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	631,247,513.23	36.65
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,090,758,170.69	63.33
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	239,280,437.93	13.89

## 7.5 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	100236	10 国开 36	1,500,000	150,306,376.69	8.73
2	140207	14 国开 07	600,000	60,208,073.58	3.50
3	041351059	13 康美 CP002	500,000	50,309,568.49	2.92
4	041461018	14 沪电力 CP001	500,000	50,253,286.88	2.92
5	071420001	14 长江证券 CP001	500,000	50,046,029.40	2.91
6	140410	14 农发 10	500,000	50,012,182.13	2.90
7	011461003	14 五矿股 SCP003	500,000	50,000,519.69	2.90
8	041452019	14 西王 CP003	500,000	49,961,319.43	2.90
9	011419004	14 国电 SCP004	500,000	49,928,726.05	2.90
10	140204	14 国开 04	400,000	40,044,967.44	2.32

## 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	21

报告期内偏离度的最高值	0.3497%
报告期内偏离度的最低值	-0.1073%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1565%

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 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** 本报告期内本基金没有出现持有剩余期限小于 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。

**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	52,172,622.74
3	应收利息	20,493,936.04
4	应收申购款	2,105,236.87
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	74,771,795.65

## § 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
易支付货币 A	13,367	26,100.34	17,787,173.25	5.10%	331,096,026.84	94.90%
易支付货币 B	28	49,056,277.51	1,336,136,202.42	97.27%	37,439,567.73	2.73%
合计	13,395	128,589.70	1,353,923,375.67	78.60%	368,535,594.57	21.40%

**8.2 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	30,391,358.41	8.71104%
	融通易支付货币 B	0.00	0.00000%
	合计	30,391,358.41	1.76442%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	融通易支付货币 A	>=100
	融通易支付货币 B	-
	合计	>=100
本基金基金经理持有本开放式基金	融通易支付货币 A	>=100
	融通易支付货币 B	-
	合计	>=100

**§ 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
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	372,235,198.73	3,039,677,028.17
本报告期基金总申购份额	977,408,043.60	5,703,222,052.85
减：本报告期基金总赎回份额	1,000,760,042.24	7,369,323,310.87
本报告期末基金份额总额	348,883,200.09	1,373,575,770.15

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**

**1、基金管理人的重大变动**

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

**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**

本报告期内基金托管人未发生重大的人事变动。

**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，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**

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	-	-	928,000,000.00	100.00%	-	-

#### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期未出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

融通基金管理有限公司

二〇一四年八月二十六日