

融通易支付货币市场证券投资基金

2009 年半年度报告

2009 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：二〇〇九年八月二十五日

§ 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 2009 年 8 月 10 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 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
§ 4 管理人报告	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	7
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	7
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	7
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	8
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	8
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	8
§ 5 托管人报告	8
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	8
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	9
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	9
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	9
6.1 资产负债表	9
6.2 利润表	10
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	11
6.4 报表附注	12
§ 7 投资组合报告	22
7.1 报告期末基金资产组合情况	22
7.2 报告期债券回购融资情况	22
7.3 基金投资组合平均剩余期限	22
7.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合	23
7.5 报告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	23
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	23
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	24
7.8 投资组合报告附注	24
§ 8 基金份额持有人信息	24
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	24
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	24
§ 9 开放式基金份额变动	25

§ 10 重大事件揭示	25
10.1 基金份额持有人大会决议	25
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	25
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	25
10.4 基金投资策略的改变	25
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	25
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	26
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	26
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	26
10.9 其他重大事件	26
§ 11 备查文件目录	27

§ 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
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
报告期末基金份额总额	486,948,615.75 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 (以下简称“中国民生银行”)
信息披露 负责人	姓名	吴治平	辛洁
	联系电话	(0755) 26948666	(010) 58560666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com	xinjie@cmbc.com.cn
客户服务电话		4008838088; (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	孟立坤	董文标
-------	-----	-----

2.4 信息披露方式

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	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层融通基金管理有限 公司 北京市西城区复兴门内大街 2 号中国民生银行资产托管部

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	融通基金管理有限公司
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	6,266,209.45
本期利润	6,266,209.45
本期净值收益率	0.0087
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
期末基金资产净值	486,948,615.75
期末基金份额净值	1.00
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
累计净值收益率	9.6106%

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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

3. 本基金收益分配按月结转份额。

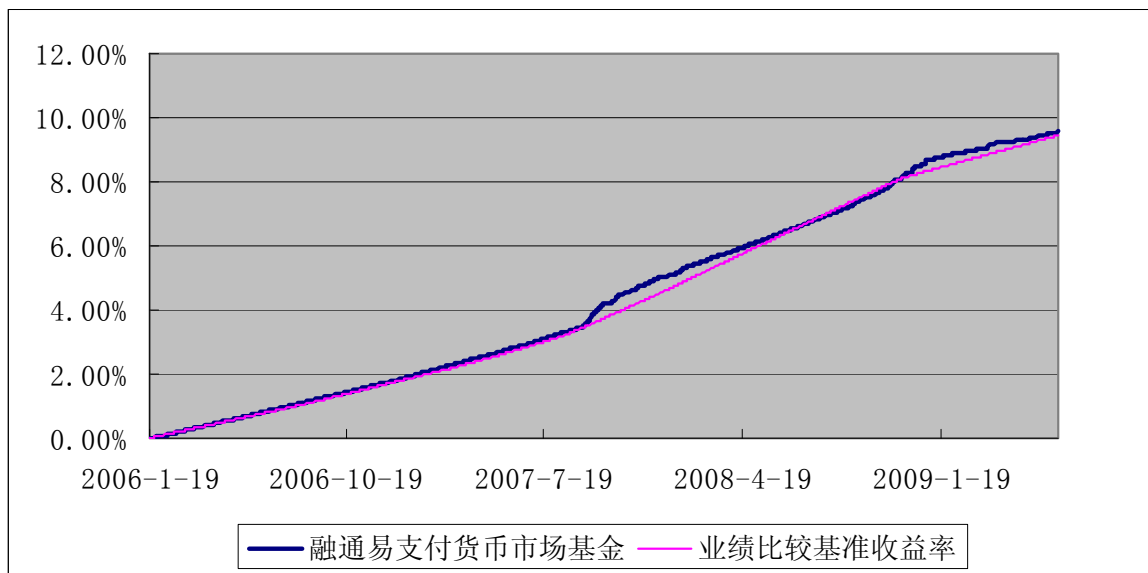
3.2 基金净值表现

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

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	0.2102%	0.0119%	0.1844%	0.0000%	0.0258%	0.0119%
过去三个月	0.3764%	0.0071%	0.5594%	0.0000%	-0.1830%	0.0071%

过去六个月	0.8655%	0.0069%	1.1127%	0.0000%	-0.2472%	0.0069%
过去一年	2.8679%	0.0087%	2.9191%	0.0021%	-0.0512%	0.0066%
过去三年	8.7020%	0.0066%	8.6472%	0.0023%	0.0548%	0.0043%
自基金合同生效起至今	9.6106%	0.0064%	9.4510%	0.0023%	0.1596%	0.0041%

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



注：本基金的建仓期为基金合同生效之日起满 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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 2009 年 6 月 30 日，公司管理的基金共有九只，一只封闭式基金：融通通乾封闭基金，八只开放式基金：融通新蓝筹混合基金、融通通利系列基金、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）和融通内需驱动股票基金，其中融通通利系列基金由融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长混合基金三只子基金构成，融通领先成长股票基金（LOF）由封闭式基金基金通宝转型而来。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

乔羽夫	本基金的 基金经理、 融通债券 基金基金 经理	2008 年 03 月 31 日	-	5	经济学硕士。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。2005 年通过基金从业人员资格考试，2006 年获得全国银行间同业拆借中心交易员资格、债券托管结算业务资格。
-----	-------------------------------------	---------------------	---	---	---

注：任职日期和离任日期均指公司董事会作出决定之日，证券从业年限是以从事证券行业工作的时间来计算的。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与本基金投资风格相似的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

2009 年上半年，我国经济复苏迹象明显，经济领先指标中国制造业采购经理指数（PMI）连续 4 个月运行在 50 以上，表明经济处于扩张期；固定资产投资、社会消费品零售总额增速等指标持续高速增长；虽然出口仍没有见底回升迹象，但国内内需的启动，尤其是房屋、汽车销售量持续放大回暖，带动了其相关产业链的复苏，也有望带动我国经济走出低谷。

09 年上半年债券市场走势主要分为两个阶段。第一阶段，经济的复苏以及信贷的过快增长使债券市场投资者产生强烈的通胀预期，以基金公司为代表的交易型投资者集中减持长期限债券品种，长端利率快速上行，收益率曲线“陡峭化”。第二阶段，商业银行超额存款准备金率的不断下降和股票市场 IPO 重启使银行间资金面由宽松趋于紧张。在回购利率、通胀预期的双重推动下，债券收益率曲线进一步上移，由于短端利率上行更为明显，收益率曲线趋于“平坦化”。

我们在密切关注宏观经济走势，把握货币政策走向的投资原则指导下，本基金上半年缩短了组合久期，对组合重点配置的短期融资券逐步进行了减持，以应对利率上行和 IPO 重启可能对货币市场带来的利率风险和流动性风险。

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，宽松的货币政策有力地支撑了经济复苏，但宽松的货币政策在经济向好的情况下也可能会带来通货膨胀。在逐步确认经济回暖的同时，我们将密切关注通胀预期的变化趋势以及货币政策转向的可能性对债券市场的影响。基金配置方面，我们将继续关注 IPO 对货币市场短期冲击而可能带来的投资机会以及短期债券利率调整到位后进行配置的机会以提高基金收益。

我们将继续以勤勉尽责的工作态度，在保证基金流动性和安全性的前提下，追求持有人利益最大化。

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，公司设立由研究策划部、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究策划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、基金会估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的约定，本基金的收益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 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。2009 年上半年，本基金以再投资形式发放利润总额 6,266,209.45 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基金）。

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

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

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

5.3 托管人对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

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

§ 6 半年度财务会计报告（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：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	505,742.32	65,344,253.76
结算备付金		180,000,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	300,786,209.25	279,862,069.28
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		300,786,209.25	279,862,069.28
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.6.5	5,066,299.78	453,492.20
应收股利		-	-
应收申购款		1,773,731.22	34,225,404.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		488,131,982.57	379,885,219.76
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬	6.4.9.2	190,318.58	85,265.19
应付托管费	6.4.9.2	57,672.29	25,837.90
应付销售服务费	6.4.9.2	144,180.79	64,594.79
应付交易费用	6.4.6.7	11,483.05	10,629.80
应交税费		124,200.00	124,200.00
应付利息		-	-
应付利润		556,792.56	624,491.85
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	98,719.55	94,500.00
负债合计		1,183,366.82	1,029,519.53
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.6.9	486,948,615.75	378,855,700.23
未分配利润	6.4.6.10	-	-
所有者权益合计		486,948,615.75	378,855,700.23
负债和所有者权益总计		488,131,982.57	379,885,219.76

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.00 元，基金份额总额 486,948,615.75 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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 至 2008 年 6 月 30 日
一、收入		9,744,312.69	3,812,200.54
1. 利息收入		8,006,679.91	3,741,257.21
其中：存款利息收入	6.4.6.11	2,241,281.78	239,970.74
债券利息收入		5,723,401.35	2,409,117.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		41,996.78	1,092,169.28
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,737,632.78	70,943.33
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.12	1,737,632.78	70,943.33
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（损失以“-”号填列）		-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6. 4. 6. 13	-	-
二、费用（以“-”号填列）		-3, 478, 103. 24	-886, 160. 54
1. 管理人报酬	6. 4. 9. 2	-1, 357, 498. 98	-344, 004. 42
2. 托管费	6. 4. 9. 2	-411, 363. 30	-104, 243. 68
3. 销售服务费	6. 4. 9. 2	-1, 028, 408. 39	-260, 609. 32
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		-566, 174. 31	-48, 868. 69
其中：卖出回购金融资产支出		-566, 174. 31	-48, 868. 69
6. 其他费用	6. 4. 6. 14	-114, 658. 26	-128, 434. 43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6, 266, 209. 45	2, 926, 040. 00
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6, 266, 209. 45	2, 926, 040. 00

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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 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）	378, 855, 700. 23	-	378, 855, 700. 23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6, 266, 209. 45	6, 266, 209. 45
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	108, 092, 915. 52	-	108, 092, 915. 52
其中：1. 基金申购款	4, 269, 631, 030. 78	-	4, 269, 631, 030. 78
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-4, 161, 538, 115. 26	-	-4, 161, 538, 115. 26
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-6, 266, 209. 45	-6, 266, 209. 45
五、期末所有者权益（基金净值）	486, 948, 615. 75	-	486, 948, 615. 75
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 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）	360, 156, 695. 48	-	360, 156, 695. 48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2, 926, 040. 00	2, 926, 040. 00

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-158,334,234.46	-	-158,334,234.46
其中：1. 基金申购款	880,081,500.10	-	880,081,500.10
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,038,415,734.56	-	-1,038,415,734.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-2,926,040.00	-2,926,040.00
五、期末所有者权益（基金净值）	201,822,461.02	-	201,822,461.02

注：所附报表附注为本会计报表的组成部分。

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第195号《关于同意融通易支付货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由融通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集,本基金为契约型开放式,存续期限不定,募集期间为2005年12月28日至2006年1月16日,本基金首次设立募集不包括认购资金利息份额部分共募集2,823,042,601.54份基金份额。有效认购金额产生的利息折份额为175,572.79份基金份额,共计实收基金2,823,218,174.33份基金份额,已经安永华明会计师事务所有限公司安永华明(2006)验字第243506-01号验资报告予以验证。募集资金产生剩余利息1,200.42元已一次性划入基金资产。经向中国证监会备案,《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》于2006年1月19日正式生效。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通易支付货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于货币市场工具,包括:现金、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单,剩余期限在397天以内(含397天)的债券、期限在1年以内(含1年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据,以及中国证监会、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,其中持有的资产支持证券剩余期限在397天以内且不得超过基金资产净值的20%,并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2009年6月30日的财务状况以及2009年1月1日至2009年6月30日期间的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

(1) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(2) 个人所得税

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

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
活期存款	505,742.32
定期存款	-
其他存款	-
合计	505,742.32

6.4.6.2 交易性金融资产

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	300,786,209.25	301,876,000.00	1,089,790.75	0.2238%
	合计	300,786,209.25	301,876,000.00	1,089,790.75	0.2238%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/基金资产净值。

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产和衍生金融负债。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应收活期存款利息	682.68
应收定期存款利息	0.00
应收其他存款利息	0.00
应收结算备付金利息	71,750.00
应收债券利息	4,993,867.10
应收买入返售证券利息	0.00
应收申购款利息	0.00
其他	0.00
合计	5,066,299.78

6.4.6.6 其他资产

无余额。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009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	11,483.05
合计	11,483.05

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	44,630.98
预提信息披露费	49,588.57
预提银行间账户维护费	4,500.00
合计	98,719.55

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	378,855,700.23	378,855,700.23
本期申购	4,269,631,030.78	4,269,631,030.78
本期赎回	-4,161,538,115.26	-4,161,538,115.26
本期末	486,948,615.75	486,948,615.75

注：本期申购含红利再投资和转换入份额，本期赎回含转换出份额。

6.4.6.10 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	0.00	-	0.00
本期利润	6,266,209.45	-	6,266,209.45
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	-6,266,209.45	-	-6,266,209.45
本期末	0.00	-	0.00

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

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	250,994.68
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,986,287.10
其他	4,000.00
合计	2,241,281.78

注：“其他”为申购款利息收入。

6.4.6.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日
卖出债券及债券到期兑付成交金额	959,048,105.83
卖出债券及债券到期兑付成本总额	-953,634,372.40
应收利息总额	-3,676,100.65
债券投资收益	1,737,632.78

6.4.6.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	0.00
其他	0.00

合计	0.00
----	------

6.4.6.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日 至2009年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	49,588.57
银行费用	11,438.71
债券托管账户维护费	9,000.00
其他	0.00
合计	114,658.26

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金为货币基金，不从事股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金为货币基金，不从事权证交易。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度均未租用关联方的交易单元。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日	2008 年 1 月 1 日 至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	1,357,498.98	344,004.42
其中：当期已支付	1,167,180.40	288,050.31
期末未支付	190,318.58	55,954.11

注：（1）基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

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

（2）上述表格中“当期已支付”的金额不包含本年已支付的上一年应付管理费的金额。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日 至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	411,363.30	104,243.68
其中：当期已支付	353,691.01	87,287.89
期末未支付	57,672.29	16,955.79

注：（1）基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

（2）上述表格中“当期已支付”的金额不包含本年已支付的上一年应付托管费的金额。

6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
融通基金管理有限公司	120,706.64	17,774.68	138,481.32
中国民生银行	67,123.75	10,275.48	77,399.23
新时代证券	143.67	37.99	181.66
合计	187,974.06	28,088.15	216,062.21
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日		
	当期应支付的销售服务费		
	当期已支付	期末未支付	合计
融通基金管理有限公司	27,453.27	7,083.38	34,536.65
中国民生银行	71,470.23	12,262.81	83,733.04

新时代证券	5.73	0.00	5.73
合计	98,929.23	19,346.19	118,275.42

注：（1）基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费。本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

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

H 为每日应支付的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

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

（2）上述表格中“当期已支付”不包含当年已支付的上年的应付销售服务费的金额。

6.4.9.3 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

本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 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	0.00	20,162,728.22	0.00	0.00	0.00	0.00
上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 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	49,569,852.46	29,878,574.26	0.00	0.00	0.00	0.00

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的基金管理人于本报告期及上年度同期均未投资于本基金。

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国民生银行保管，并按银行间同业利率计息。由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入如下：

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日		本期 2008 年 1 月 1 日 至 2008 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	505,742.32	250,994.68	27,439,541.34	232,010.90

6.4.9.6 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同期均未买入管理人、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同期均未投资管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期承销的股票。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 利润分配情况——货币市场基金

单位：人民币元

项目	本期累计分配金额
再投资形式发放	6,266,209.45

6.4.11 期末（2009年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金为货币基金，不从事股票交易。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，均可在证券交易所的债券回购交易或在银行间同业市场交易。于 2009 年 6 月 30 日本基金未持有流通受限证券，因此均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，债券正回购的资金余额在每个交易日一般均不超过基金资产净值的 20%。于资产负债表日，本基金所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 利率风险

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

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

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009年6月30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	505,742.32	-	-	-	-	505,742.32
结算备付金	180,000,000.00	-	-	-	-	180,000,000.00
交易性金融资产	-	180,603,753.89	120,182,455.36	-	-	300,786,209.25
应收利息	-	-	-	-	5,066,299.78	5,066,299.78
应收申购款	-	-	-	-	1,773,731.22	1,773,731.22
资产总计	180,505,742.32	180,603,753.89	120,182,455.36	-	6,840,031.00	488,131,982.57
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	190,318.58	190,318.58
应付托管费	-	-	-	-	57,672.29	57,672.29
应付销售服务费	-	-	-	-	144,180.79	144,180.79
应付交易费用	-	-	-	-	11,483.05	11,483.05
应交税费	-	-	-	-	124,200.00	124,200.00
应付利润	-	-	-	-	556,792.56	556,792.56
其他负债	-	-	-	-	98,719.55	98,719.55
负债总计	-	-	-	-	1,183,366.82	1,183,366.82

利率敏感度缺口	180,505,742.32	180,603,753.89	120,182,455.36	-	-	-
上年度末 2008 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	65,344,253.76	-	-	-	-	65,344,253.76
交易性金融资产	-	170,149,836.52	109,712,232.76	-	-	279,862,069.28
应收利息	-	-	-	-	453,492.20	453,492.20
应收申购款	-	-	-	-	34,225,404.52	34,225,404.52
资产总计	65,344,253.76	170,149,836.52	109,712,232.76	-	34,678,896.72	379,885,219.76
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	85,265.19	85,265.19
应付托管费	-	-	-	-	25,837.90	25,837.90
应付销售服务费	-	-	-	-	64,594.79	64,594.79
应付交易费用	-	-	-	-	10,629.80	10,629.80
应交税费	-	-	-	-	124,200.00	124,200.00
应付利润	-	-	-	-	624,491.85	624,491.85
其他负债	-	-	-	-	94,500.00	94,500.00
负债总计	-	-	-	-	1,029,519.53	1,029,519.53
利率敏感度缺口	65,344,253.76	170,149,836.52	109,712,232.76	-	-	-

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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（2009 年 6 月 30 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	1. 利率上升 25 个基点	-373,665.96	-1,498,928.14
2. 利率下降 25 个基点	375,297.98	1,507,814.79	

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

6.4.12.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无其他重大市场价格风险。

§ 7 投资组合报告

7.1 报告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	300,786,209.25	61.62
	其中：债券	300,786,209.25	61.62
	资产支持证券	0.00	0.00
2	买入返售金融资产	0.00	0.00
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	0.00	0.00
3	银行存款和结算备付金合计	180,505,742.32	36.98
4	其他资产	6,840,031.00	1.40
5	合计	488,131,982.57	100.00

7.2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	13.78
	其中：买断式回购融资	-	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	-	0.00
	其中：买断式回购融资	-	0.00

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的比例 (%)	原因	调整期
1	2009 年 02 月 26 日	21.29	基金规模发生变动	1 个工作日
2	2009 年 03 月 26 日	20.11	基金规模发生变动	1 个工作日

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

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	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	150
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	66

注：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 报告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	37.07	0.00

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
2	30 天(含)-60 天	16.46	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	10.30	0.00
3	60 天(含)-90 天	20.63	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
4	90 天(含)-180 天	8.22	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
5	180 天(含)-397 天(含)	16.46	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.00	0.00
合计		98.84	0.00

7.4 报告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	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	0.00	0.00
2	央行票据	0.00	0.00
3	金融债券	180,603,753.89	37.09
	其中：政策性金融债	180,603,753.89	37.09
4	企业债券	0.00	0.00
5	企业短期融资券	120,182,455.36	24.68
6	其他	0.00	0.00
7	合计	300,786,209.25	61.77
8	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	50,133,011.36	10.30

7.5 报告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	080415	08 农发 15	1,000,000	100,459,077.04	20.63
2	070413	07 农发 13	500,000	50,133,011.36	10.30
3	070309	07 进出 09	300,000	30,011,665.49	6.16
4	0981002	09 甘电投 CP01	200,000	20,047,173.38	4.12
5	0881264	08 莱钢 CP01	200,000	20,041,742.78	4.12
6	0981106	09 中牧 CP01	200,000	20,036,241.35	4.11
7	0881256	08 太不锈 CP01	200,000	20,032,079.04	4.11
8	0981067	09 农六师 CP01	200,000	20,023,920.74	4.11
9	0881255	08 天医药 CP01	200,000	20,001,298.07	4.11

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	49
报告期内偏离度的最高值	0.4376%

报告期内偏离度的最低值	0.0543%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2424%

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 基金计价方法说明

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的 20%的情况。

7.8.3 本基金投资的前十名证券中报告期内无发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	其他资产	金额
1	存出保证金	0.00
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	5,066,299.78
4	应收申购款	1,773,731.22
5	其他应收款	0.00
6	待摊费用	0.00
7	其他	0.00
8	合计	6,840,031.00

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比 例	持有份额	占总份 额比 例
6,116	79,618.81	111,787,822.65	22.96%	375,160,793.10	77.04%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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

基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	177,883.93	0.04%
----------------------	------------	-------

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 1 月 19 日）基金份额总额	2,823,218,174.33
报告期期初基金份额总额	378,855,700.23
报告期期间基金总申购份额	4,269,631,030.78
报告期期间基金总赎回份额	-4,161,538,115.26
报告期期末基金份额总额	486,948,615.75

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大变动

(1) 股权变动

经公司股东会会议审议通过并经中国证监会核准，新时代证券有限责任公司受让河北证券有限责任公司持有的本公司 40% 股权。公司于 2009 年 3 月 13 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上公告，本次股权转让事项的相关变更登记手续已办理完毕。

(2) 增聘副总经理

经公司董事会审议并报经中国证监会核准，聘任秦玮先生为公司副总经理。

具体内容请参阅 2009 年 3 月 3 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上刊登的公告。

10.2.2 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金投资策略在本报告期未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，仍为安永华明会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，中国证监会对我司旗下深证100 指数基金、巨潮100 指数基金（以下简称“两指数基金”）原基金经理张野涉嫌违规从事股票交易进行了调查，于2009年6月19日发布处罚决定，取消张野的基金从业资格，没收违法所得2,294,791.90元并处以400万元罚款，同时处以终身证券市场禁入；另对公司作出了限期整改的行政监管措施。

本公司已根据中国证监会的初步调查意见作出决定，于2009年5月15日发布公告更换了两指数基金的基金经理，并对张野予以除名。

尽管调查结果显示张野的违规行为是个人行为，但对行业声誉及公司形象都带来了严重的负面影响，我公司将从该事件中深刻吸取教训，认真落实中国证监会的整改要求，强化员工法制观念和职业操守教育，进一步完善内控制度建设，全方位、全过程地对投资管理机构的日常行为加强管理。作为基金管理人，我们深感受托责任重大，持有人利益重于泰山，我们将坚持以“尽责、合规、专业”的理念管理基金资产，不负持有人所托，自觉接受持有人、托管行和社会公众的监督。

10.6.2 本基金本报告期托管人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

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		回购交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
长江证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

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、报告期内，本基金未发生席位交易单元的变更。

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	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》	2009-1-15
2	关于深圳平安银行股份有限公司代理融通旗下基金销售业务的公告	《上海证券报》	2009-1-15
3	融通易支付货币市场证券投资基金春节长假前暂停申购的公告	《上海证券报》	2009-1-16
4	融通基金关于开通招商银行借记卡网上交易的公告	《上海证券报》	2009-1-19
5	融通易支付货币市场证券投资基金 2008 年第 4 季度报告	《上海证券报》	2009-1-21
6	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》	2009-2-16
7	融通易支付货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要	《上海证券报》	2009-2-27
8	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》	2009-3-16
9	关于华夏银行股份有限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》	2009-3-27
10	融通易支付货币市场证券投资基金 2008 年年度报告	《上海证券报》	2009-3-28
11	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》	2009-4-15
12	融通易支付货币市场证券投资基金 2009 年第 1 季度报告	《上海证券报》	2009-4-22
13	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》	2009-5-15
14	关于融通易支付货币市场证券投资基金“端午节”假期前暂停申购的公告	《上海证券报》	2009-5-21
15	关于上海证券有限责任公司新增代理融通旗下开放式基金销售业务的公告	《上海证券报》	2009-5-25
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》	2009-6-15

§ 11 备查文件目录

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

存放地点：基金管理人、基金托管人处

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