

融通易支付货币市场证券投资基金 2017 年年度报告摘要

2017 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：2018 年 3 月 29 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 2018 年 3 月 26 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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(特殊普通合伙)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 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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		
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	1,803,890,046.43 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
下属分级基金的场内简称：	-	-	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	188,930,012.16 份	1,049,124,604.12 份	565,835,430.15 份

注：(1) 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；

(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。

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		融通基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	涂卫东	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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处、上海证券交易所

§ 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	2017 年	2016 年	2015 年

	融通易支付货币 A	融通易支付货币 B	融通易支付货币 E	融通易支付货币 A	融通易支付货币 B	融通易支付货币 E	融通易支付货币 A	融通易支付货币 B
本期已实现收益	5,580,597.61	177,137,495.60	7,698,759.92	8,439,544.06	931,357,981.50	16,579,551.09	11,646,944.18	278,812,343.52
本期利润	5,580,597.61	177,137,495.60	7,698,759.92	8,439,544.06	931,357,981.50	16,579,551.09	11,646,944.18	278,812,343.52
本期净值收益率	3.0667%	3.3155%	3.0005%	2.4061%	2.6529%	1.2163%	3.3528%	3.6001%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末			2016 年末			2015 年末	
	188,930,012.16	1,049,124,604.12	565,835,430.15	315,694,882.21	30,495,701,342.40	1,835,744,162.09	1,061,982,703.32	42,190,357,867.58
	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.000	1.000

3.1. 3 累计 期末指 标	2017 年末			2016 年末			2015 年末	
	44.4555%	23.5737%	4.2533%	40.1573%	19.6082%	1.2163%	36.8644%	16.5173%
累计净值收益率								

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、本基金自成立以来至 2016 年 6 月 14 日，利润分配是按月结转份额；自 2016 年 6 月 15 日起至今，利润分配是按日结转份额。

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
过去三个月	0.9114%	0.0016%	0.0882%	0.0000%	0.8232%	0.0016%
过去六个月	1.8018%	0.0014%	0.1764%	0.0000%	1.6254%	0.0014%
过去一年	3.0667%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	2.7167%	0.0021%
过去三年	9.3018%	0.0037%	1.0500%	0.0000%	8.2518%	0.0037%
过去五年	18.9312%	0.0050%	1.7500%	0.0000%	17.1812%	0.0050%
自基金合同生效起至今	44.4555%	0.0064%	15.5280%	0.0033%	28.9275%	0.0031%

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
过去三个月	0.9722%	0.0016%	0.0882%	0.0000%	0.8840%	0.0016%
过去六个月	1.9266%	0.0014%	0.1764%	0.0000%	1.7502%	0.0014%
过去一年	3.3155%	0.0021%	0.3500%	0.0000%	2.9655%	0.0021%
过去三年	10.1046%	0.0037%	1.0500%	0.0000%	9.0546%	0.0037%
过去五年	20.4566%	0.0050%	1.7500%	0.0000%	18.7066%	0.0050%
自基金合同	23.5737%	0.0065%	2.0023%	0.0001%	21.5714%	0.0064%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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
过去三个月	0.8783%	0.0017%	0.0882%	0.0000%	0.7901%	0.0017%
过去六个月	1.7460%	0.0014%	0.1764%	0.0000%	1.5696%	0.0014%
过去一年	3.0005%	0.0020%	0.3500%	0.0000%	2.6505%	0.0020%
自基金合同生效起至今	4.2533%	0.0019%	0.5346%	0.0000%	3.7187%	0.0019%

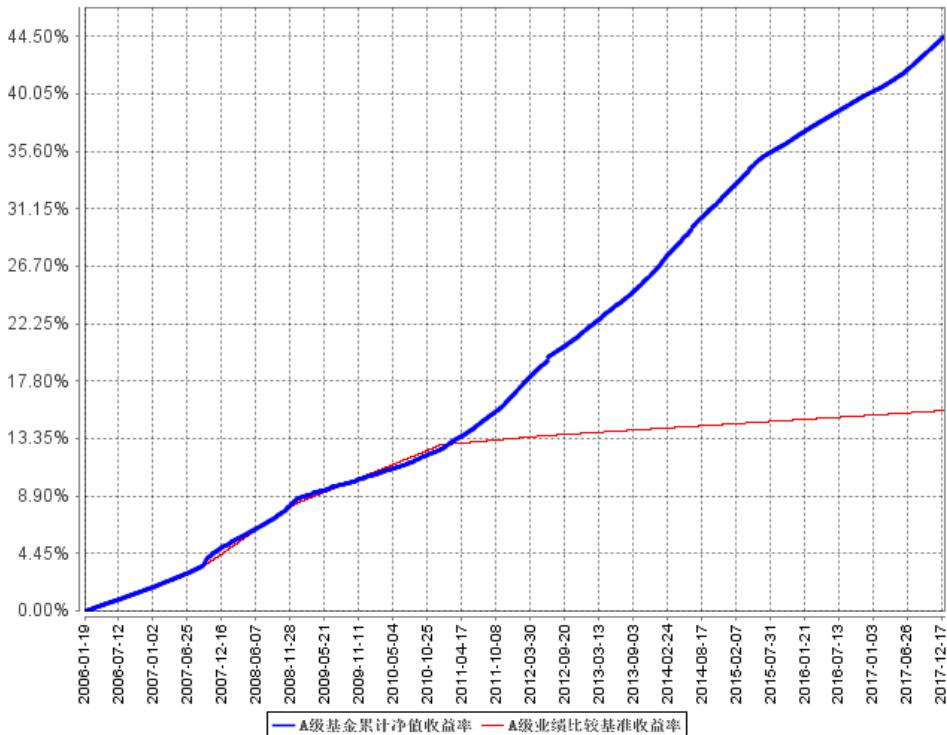
注：1、融通易支付货币 A 的业绩比较基准项目分段计算，其中 2010 年 12 月 31 日之前（含此日）采用“银行一年期定期存款税后利率。”，2011 年 1 月 1 日起使用新基准即“银行活期存款利率（税后）（即银行活期存款利率 \times (1-利息税率)）”。

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。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。

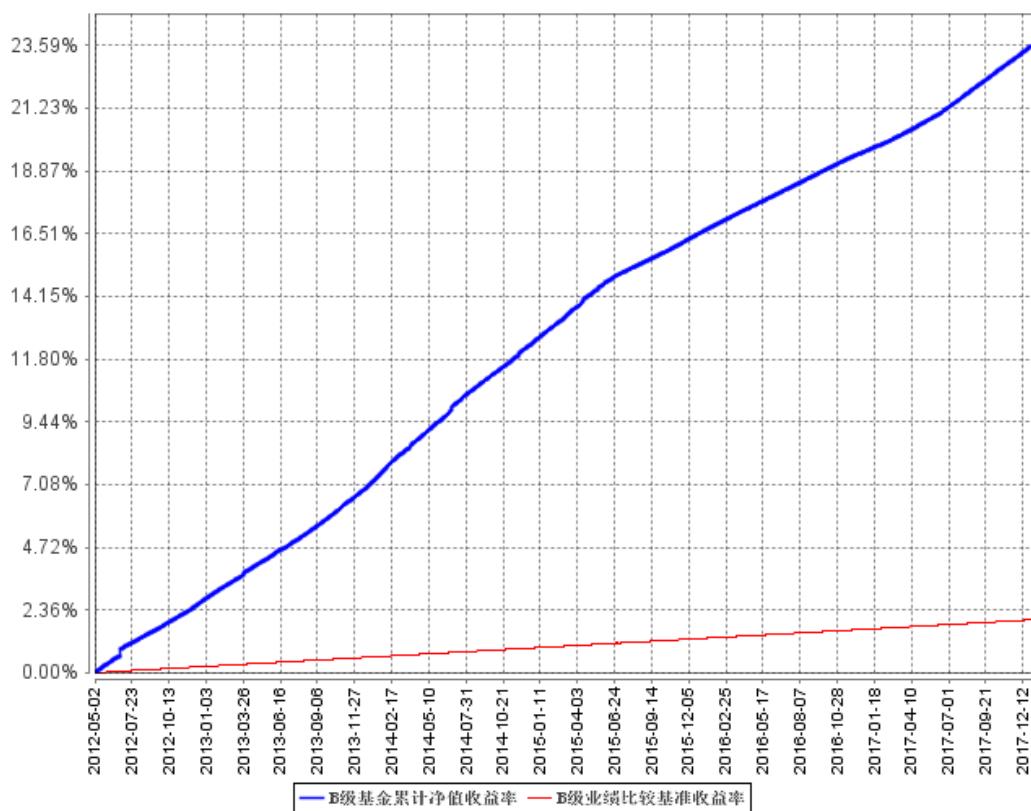
3、自 2016 年 6 月 20 日，本基金实施基金份额分类，增设 E 类份额。上表中融通易支付货币 B 相关数据的统计起始日为 2016 年 6 月 22 日。

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

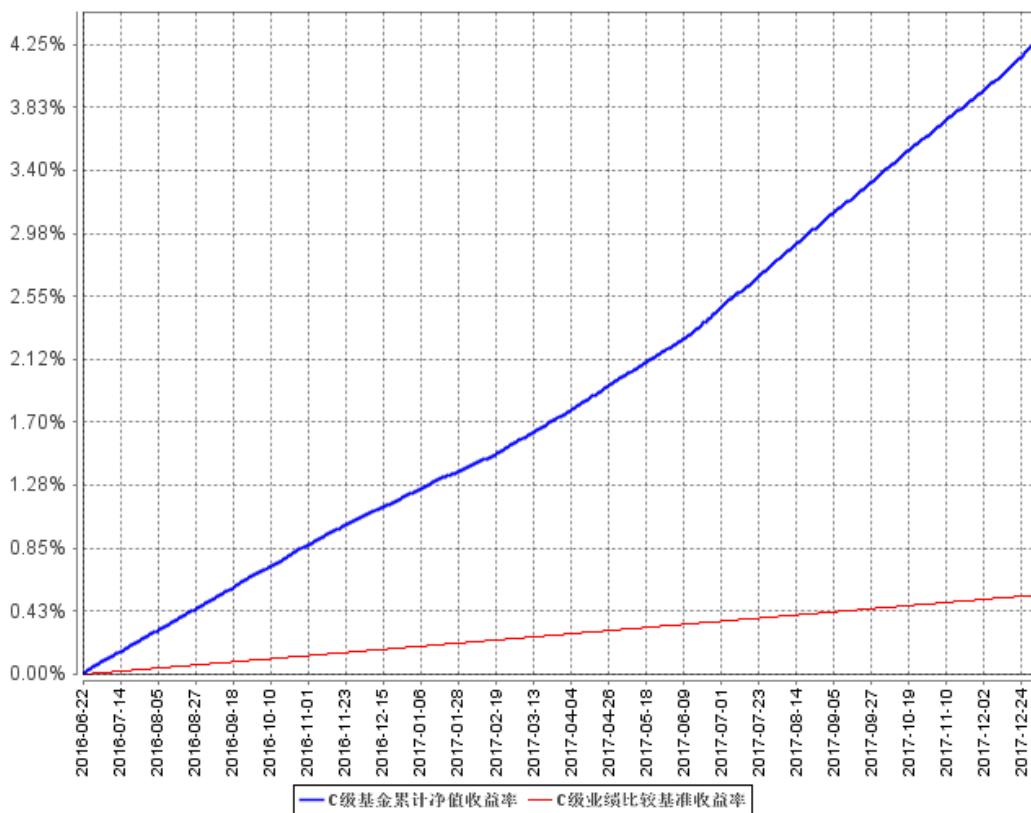
A 级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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



C 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

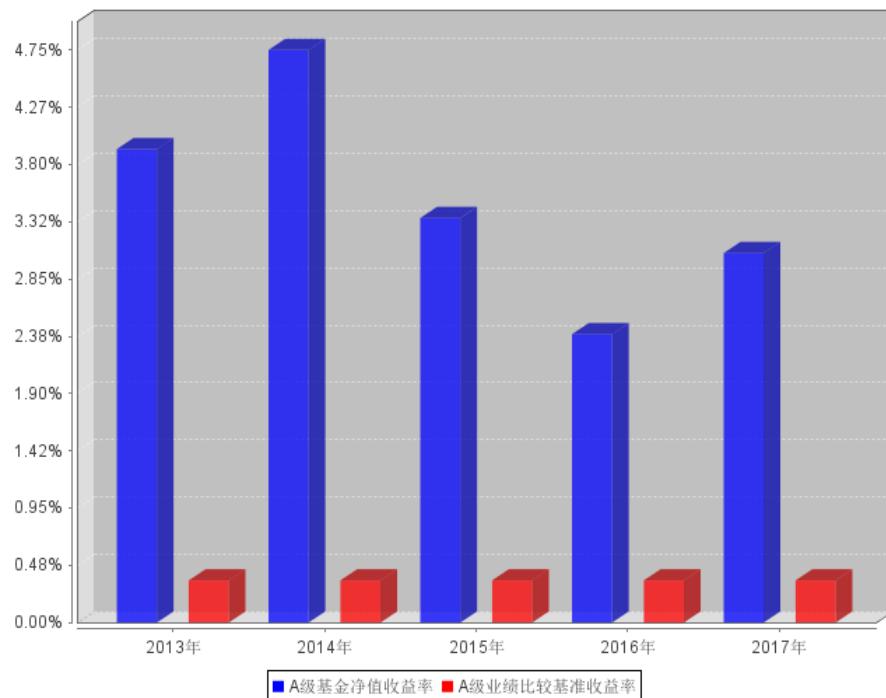
银行活期存款利率 $\times (1 - \text{利息税率})$)”。

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。

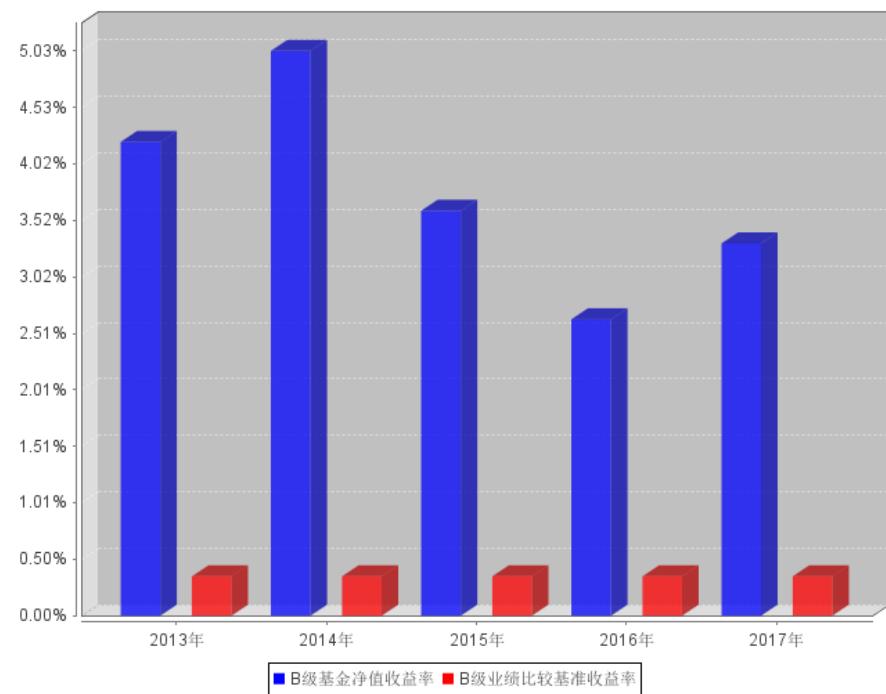
3、自 2016 年 6 月 20 日，本基金实施基金份额分类，增设 E 类份额。融通易支付货币 E 的数据统计期间为 2016 年 6 月 22 日至本报告期末止。

3.2.3 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

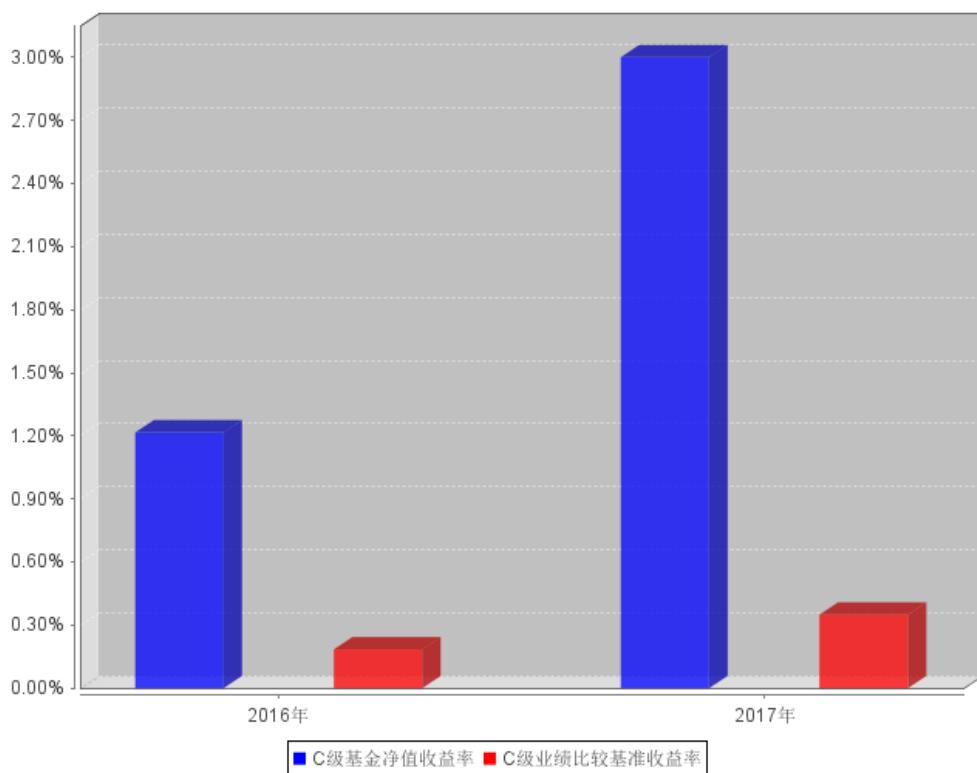
A 级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B 级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C 级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



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 \times (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，本基金实施基金份额分类，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。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

融通易支付货币 A					
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
2017	5,532,956.09	-	47,641.52	5,580,597.61	
2016	10,136,028.55	811,968.92	-2,508,453.41	8,439,544.06	
2015	12,211,712.18	2,223,069.86	-2,787,837.86	11,646,944.18	
合计	27,880,696.82	3,035,038.78	-5,248,649.75	25,667,085.85	

单位：人民币元

融通易支付货币 B					
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

2017	180,395,403.38	-	-3,257,907.78	177,137,495.60	
2016	929,527,217.82	26,250,176.81	-24,419,413.13	931,357,981.50	
2015	215,507,322.10	33,881,048.25	29,423,973.17	278,812,343.52	
合计	1,325,429,943.30	60,131,225.06	1,746,652.26	1,387,307,820.62	

单位：人民币元

融通易支付货币 E					
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
2017	7,653,512.81	-	45,247.11	7,698,759.92	
2016	16,379,642.08	-	199,909.01	16,579,551.09	
合计	24,033,154.89	-	245,156.12	24,278,311.01	

§ 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 AssetManagement Co., Ltd.）40%。

截至2017年12月31日，公司共管理六十五只开放式基金：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、融通汇财宝货币市场基金、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、融通中证大农业指数基金（LOF）、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、融通增丰债券基金、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、融通通尚混合基金、融通通裕债券基金、融通通和债券基金、融通沪港深智慧生活混合基金、融通现金宝货币市场基金、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）、融通新动力灵活配置混合、融通收益增强债券基金和融通中国概念债券基金（QDII）。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	-	11	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）。11 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，现任融通易支付货币、融通通盈保本、融通增裕债券、融通增祥债券、融通增丰债券、融通通瑞债券、融通通优债券、融通月月添利定期开放债券、融通通鑫灵活配置混合、融通新机遇灵活配置混合、融通通裕债券、融通收益增强债券基金的基金经理。

王涛	本基金的基金经理	2015年1月6日	2017年7月29日	13	王涛先生，南开大学经济学硕士，13年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任中国工商银行深圳市分行外汇及衍生品交易员、招商银行总行金融市场部交易员、东莞证券固定收益类产品投资经理。2014年9月加入融通基金管理有限公司，曾任融通易支付货币、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、融通通弘债券、融通通颐定期开放债券基金的基金经理。
----	----------	-----------	------------	----	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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3月24日，基金管理人发布了《融通易支付货币市场证券投资基金管理基金经理变更公告》，自2018年3月24日起，张一格不再继续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遵规守信情况的说明

报告期内，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，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为，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 公平交易制度和控制方法

为了保证旗下的不同投资组合得到公平对待，基金管理人制定了《融通基金管理有限公司公平交易制度》，公平交易制度所规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

基金管理人通过建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段来保证公平交易原则的实现。同时，基金管理人通过对投资交易行为的监

控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.3 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

海外方面，自 2016 年四季度开始，全球经济开始了新一轮的复苏，其中美国经济第三季度实际 GDP 环比 3.1%，处于两年来高位，欧元区及日本经济亦维持复苏态势。货币政策方面，2017 年美联储的货币政策正常化引导了全球的货币政策周期，年内美联储共加息三次，目前基准利率已上行至 1.5%，2017 年 10 月份正式启动缩表，长期债券收益率上行。

国内经济方面，在全球经济复苏的带动下，2017 年国内经济增速企稳，前三季度实际 GDP 增速分别为 6.9%、6.9% 和 6.8%，其中外贸部门贡献了 0.2% 的 GDP 增速，比去年全年的-0.4% 高出 0.6%，是经济企稳的主要贡献，固定资产投资同比增长为 7.2%。2016 年以来，供给侧改革叠加需求复苏，PPI 开始触底反弹，企业利润也随着价格的上涨出现明显改善，工业企业利润总额同比增长 21%，整体经济表现稳健。

2017 年金融去杠杆延续，M2 增速大幅回落，金融机构负债端持续收紧，央行主要通过公开市场操作提供基础货币供给，总体资金面相对中性，但中小行和非银资金面在关键时点出现结构性紧张，与此同时，2017 年央行三次上调逆回购利率，两次上调 MLF 利率，短端国债利率和存单利率大幅上涨，10 年国债收益率从年初的 3.0% 附近位置升至年底的 3.9% 左右，上行幅度接近 90BP，整体收益率曲线趋于平坦。在操作上，组合适当调整资产到期结构，加大了关键时点资产配置力度，同时适当降低了组合久期，提高了基金的流动性。

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 3.0667%，本报告期融通易支付货币 B 的基金份额净值收益率为 3.3155%，本报告期融通易支付货币 E 的基金份额净值收益率为 3.0005%，

同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预计 2018 年全球经济的复苏局面仍将持续，但复苏过程难以进一步增强，对国内经济而言，2018 年出口仍将对中国经济形成支撑，但伴随着人民币升值及贸易保护主义抬头，数据上表现的增速弱于 2017 年。在盈利持续改善和政策推动下，2018 年制造业投资增速有望低位回升，总产能再降空间有限。2018 年房地产投资不改边际下行趋势，但在低库存支撑下，增速仍将维持在一定水平，周期的波动性或将进一步减缓。通胀方面，PPI 对 CPI 的影响在增强，尤其是二者的“传导”关系已逐渐显现，后续上游向中游工业的价格传导能否愈发畅通，取决于中游行业去产能的推进力度以及终端需求扩张的可持续性，此外原油供给的不确定性可能会对原油价格带来冲击，也将在一定程度上给通胀带来压力。

当前货币市场利率处于相对较高位置，具备一定的配置价值，但阶段性时点资金波动仍较大，需控制好估值及流动性风险。此外，随着企业信用风险逐渐暴露，组合仍将以高评级、高流动性债券为重点配置方向，严控信用风险。总体上，组合将继续做好流动性管理，通过资产配置时点和品种的选择，维持组合相对稳健的投资收益。

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、参考独立第三方估值服务机构的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专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含本基金基金经理。

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适用性的情况下及时修订估值方法，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与基金托管人核对，同时负责对外进行信息披露。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。本基金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 2017 年度利润分配符合基金合同约定，利润分配总额 190,416,853.13 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，本基金托管人在对融通易支付货币市场证券投资基金管理的托管过程中，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，本托管人对基金管理人—融通基金管理有限公司在融通易支付货币市场证券投资基金管理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 5,580,597.61 元，融通易支付货币 B 实施利润分配的金额为 177,137,495.60 元，融通易支付货币 E 实施利润分配的金额为 7,698,759.92 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

由融通易支付货币市场证券投资基金管理人—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 审计报告

本基金 2017 年年度财务会计报告已经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为

本基金出具了标准无保留意见的审计报告（普华永道中天审字（2018）第 22323 号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 资产负债表

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： 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	242,489,306.25	16,012,795,516.14
结算备付金	545,454.55	112,680,611.56
存出保证金	161,583.23	2,989,001.89
交易性金融资产	818,812,831.62	12,415,214,158.54
其中：股票投资	—	—
基金投资	—	—
债券投资	818,812,831.62	12,415,214,158.54
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	677,189,475.81	8,091,874,946.47
应收证券清算款	—	—
应收利息	10,071,641.57	138,711,145.81
应收股利	—	—
应收申购款	145,373,661.66	252,811,004.70
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	1,894,643,954.69	37,027,076,385.11
负债和所有者权益	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
负债：		
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	88,899,666.65	4,362,232,486.64
应付证券清算款	—	780,197.16
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	403,066.96	7,385,550.36
应付托管费	122,141.52	2,238,045.54

应付销售服务费	87,780.42	515,813.73
应付交易费用	33,653.99	244,726.01
应交税费	124,200.00	124,200.00
应付利息	120,801.10	2,287,362.20
应付利润	803,597.62	3,968,616.77
递延所得税负债	—	—
其他负债	159,000.00	159,000.00
负债合计	90,753,908.26	4,379,935,998.41
所有者权益:		
实收基金	1,803,890,046.43	32,647,140,386.70
未分配利润	—	—
所有者权益合计	1,803,890,046.43	32,647,140,386.70
负债和所有者权益总计	1,894,643,954.69	37,027,076,385.11

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，融通易支付货币 A 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 188,930,012.16 份；融通易支付货币 B 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 1,049,124,604.12 份；融通易支付货币 E 基金份额净值 1.000 元，基金份额总额 565,835,430.15 份。融通易支付货币份额总额合计为 1,803,890,046.43 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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	252,003,933.11	1,222,079,541.43
1.利息收入	254,560,187.89	1,200,289,351.07
其中：存款利息收入	109,362,876.78	738,066,078.43
债券利息收入	107,932,191.26	439,093,352.86
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	37,265,119.85	23,129,919.78
其他利息收入	—	—
2.投资收益	-2,558,178.14	21,773,037.04
其中：股票投资收益	—	—
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-2,558,178.14	21,773,037.04
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	1,923.36	17,153.32
减：二、费用	61,587,079.98	265,702,464.78
1. 管理人报酬	22,781,562.10	120,831,018.09
2. 托管费	6,903,503.61	36,615,460.00
3. 销售服务费	1,865,858.28	6,248,897.36
4. 交易费用	—	—
5. 利息支出	29,625,978.60	101,375,340.65
其中：卖出回购金融资产支出	29,625,978.60	101,375,340.65
6. 其他费用	410,177.39	631,748.68
三、利润总额	190,416,853.13	956,377,076.65
减：所得税费用	—	—
四、净利润	190,416,853.13	956,377,076.65

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：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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)	32,647,140,386.70	—	32,647,140,386.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	190,416,853.13	190,416,853.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-30,843,250,340.27	—	-30,843,250,340.27
其中：1. 基金申购款	22,526,089,464.98	—	22,526,089,464.98
2. 基金赎回款	-53,369,339,805.25	—	-53,369,339,805.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	-190,416,853.13	-190,416,853.13
五、期末所有者权益(基金净值)	1,803,890,046.43	—	1,803,890,046.43
项目	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 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)	43,252,340,570.90	—	43,252,340,570.90
二、本期经营活动产生	—	956,377,076.65	956,377,076.65

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	-10,605,200,184.20	-	-10,605,200,184.20
其中：1. 基金申购款	166,886,848,699.69	-	166,886,848,699.69
2. 基金赎回款	-177,492,048,883.89	-	-177,492,048,883.89
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-956,377,076.65	-956,377,076.65
五、期末所有者权益（基金净值）	32,647,140,386.70	-	32,647,140,386.70

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：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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

7.4.1.1 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。

7.4.1.2 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。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.2 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（“融通基金”）	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
日兴资产管理有限公司	基金管理人的股东
深圳市融通资本管理股份有限公司	基金管理人的子公司
融通国际资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 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。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	22,781,562.10	120,831,018.09
其中：支付销售机构的客户维护费	331,923.57	860,651.01

注：1、支付基金管理人融通基金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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,903,503.61	36,615,460.00

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。

7.4.3.2.3 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	165,262.37	617,230.42	-	782,492.79
中国民生银行	10,023.68	-	-	10,023.68
新时代证券	-	-	248,978.50	248,978.50
合计	175,286.05	617,230.42	248,978.50	1,041,494.97
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	320,653.74	3,498,724.64	-	3,819,378.38
中国民生银行	10,171.56	-	-	10,171.56
新时代证券	-	-	295,197.43	295,197.43
合计	330,825.30	3,498,724.64	295,197.43	4,124,747.37

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：

A/B/E 类基金份额日销售服务费=前一日该类别基金资产净值×约定年费率/当年天数。

7.4.3.3 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 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 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	-	111,154,909.59	-	-	130,200,000.00	16,593.87
上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 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	-	-	-	-	2,516,200,000.00	208,008.50

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 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 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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 股份有限公 司	-	-	300,000,000.00	0.98%
深圳市融通 资本管理股 份有限公司	10,414,394.66	0.99%	44,700,833.53	0.15%

融通易支付货币 E

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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 股份有限公 司	4,265,800.00	0.75%	61,844,000.00	3.37%

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。

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 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 -活期存款	12,489,306.25	499,396.25	32,795,516.14	754,449.00
中国民生银行 -定期存款	60,000,000.00	4,704,806.75	550,000,000.00	48,388,511.03

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。

7.4.3.6 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。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.4 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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 88,899,666.65 元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
150315	15 进出 15	2018 年 1 月 5 日	100.00	100,000	10,000,000.00
160309	16 进出 09	2018 年 1 月 5 日	98.86	300,000	29,658,000.00
160202	16 国开 02	2018 年 1 月 5 日	99.55	500,000	49,775,000.00
合计				900,000	89,433,000.00

7.4.4.3.2 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。

§ 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	818,812,831.62	43.22
	其中：债券	818,812,831.62	43.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	677,189,475.81	35.74
	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	243,034,760.80	12.83
4	其他各项资产	155,606,886.46	8.21
5	合计	1,894,643,954.69	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	6.84	
	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	88,899,666.65	4.93
	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	2017 年 1 月 5 日	26.46	连续巨额赎回; 债券市场波动	5 个交易日
2	2017 年 1 月 6 日	29.21	连续巨额赎回; 债券市场波动	4 个交易日
3	2017 年 1 月 9 日	26.52	连续巨额赎回; 债券市场波动	3 个交易日
4	2017 年 1 月 10 日	27.38	连续巨额赎回; 债券市场波动	2 个交易日
5	2017 年 1 月 11 日	20.99	连续巨额赎回; 债券市场波动	1 个交易日
6	2017 年 1 月 20 日	26.47	连续巨额赎回; 债券市场波动	9 个交易日
7	2017 年 1 月 23 日	26.55	连续巨额赎回; 债券市场波动	8 个交易日
8	2017 年 1 月 24 日	28.18	连续巨额赎回; 债券市场波动	7 个交易日
9	2017 年 1 月 25 日	27.12	连续巨额赎回; 债券市场波动	6 个交易日
10	2017 年 1 月 26 日	27.11	连续巨额赎回; 债券市场波动	5 个交易日
11	2017 年 2 月 3 日	23.56	连续巨额赎回; 债券市场波动	4 个交易日
12	2017 年 2 月 6 日	21.21	连续巨额赎回; 债券市场波动	3 个交易日
13	2017 年 2 月 7 日	22.54	连续巨额赎回; 债券市场波动	2 个交易日
14	2017 年 2 月 8 日	20.13	连续巨额赎回; 债券市场波动	1 个交易日
15	2017 年 4 月 20 日	28.88	连续巨额赎回; 债券市场波动	2 个交易日
16	2017 年 4 月 21 日	21.36	连续巨额赎回; 债券市场波动	1 个交易日
17	2017 年 6 月 26 日	27.65	连续巨额赎回; 债券市场波动	2 个交易日
18	2017 年 6 月 27 日	23.12	连续巨额赎回; 债券市场波动	1 个交易日

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

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	19
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	18
-------------------	----

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。

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	84.22	4.93
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	5.54	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	1.66	—
3	60 天(含)—90 天	2.77	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天(含)—120 天	3.88	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天(含)—397 天(含)	—	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
合计		96.41	4.93

8.4 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。

8.5 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	239,783,871.71	13.29
	其中：政策性金融债	239,783,871.71	13.29
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	99,975,554.57	5.54
6	中期票据	—	—
7	同业存单	479,053,405.34	26.56
8	其他	—	—
9	合计	818,812,831.62	45.39
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	29,985,023.13	1.66

8.6 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	170401	17 农发 01	1,100,000	109,993,866.86	6.10
2	111714215	17 江苏银行 CD215	1,000,000	99,878,162.77	5.54
3	160202	16 国开 02	900,000	89,821,804.80	4.98
4	041769004	17 国家核电 CP001	700,000	69,978,647.89	3.88
5	111708213	17 中信银行 CD213	500,000	49,940,432.45	2.77
6	111780998	17 长沙银行 CD069	500,000	49,931,524.86	2.77
7	111781462	17 齐鲁银行 CD053	500,000	49,892,805.22	2.77
8	111781562	17 四川天府银行 CD117	500,000	49,877,582.73	2.77
9	111781615	17 昆仑银行 CD030	500,000	49,859,998.08	2.76
10	111781675	17 九江银行 CD113	500,000	49,858,461.84	2.76

8.7 “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	—
报告期内偏离度的最高值	0.0589%
报告期内偏离度的最低值	-0.1801%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0461%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期末未出现负偏离度的绝对值达到 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

本基金本报告期末未出现正偏离度绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1

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。

8.9.2

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。

8.9.3 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	161, 583. 23
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	10, 071, 641. 57
4	应收申购款	145, 373, 661. 66
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	155, 606, 886. 46

§ 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

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	245, 434	769. 78	12, 413, 641. 30	6. 57%	176, 516, 370. 86	93. 43%
融通易支付货币 B	40	26, 228, 115. 10	731, 722, 126. 34	69. 75%	317, 402, 477. 78	30. 25%
融通易支付货币 E	427	1, 325, 141. 52	458, 851, 111. 51	81. 09%	106, 984, 318. 64	18. 91%
合计	245, 901	7, 335. 84	1, 202, 986, 879. 15	66. 69%	600, 903, 167. 28	33. 31%

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。

9.2 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	天津易鑫安资产管理有限公司—易鑫安资管鑫安 6 期	50, 049, 400. 00	8. 85%
2	西藏银帆投资管理有限公司—银帆 9 期私募基金	50, 039, 400. 00	8. 84%
3	兴业国际信托有限公司—兴享进取汇利	50, 039, 400. 00	8. 84%

	1号证券投资集合资金信托计划		
4	西藏银帆投资管理有限公司—银帆 10 期私募基金	50,039,400.00	8.84%
5	中国对外经济贸易信托有限公司—外贸信托—汇鑫 183 号结构化债券投资集合资金信托	50,005,700.00	8.84%
6	上海通泽投资管理有限公司—泰泽聚力私募投资基金	31,708,700.00	5.60%
7	北京华创智业投资有限公司	30,011,600.00	5.30%
8	观富(北京)资产管理有限公司—观富恒盈一号私募投资基金	27,014,000.00	4.77%
9	深圳市华银精治资产管理有限公司—华银精选基金	20,016,700.00	3.54%
10	上海银湖资产管理有限公司—银湖 2 期私募证券投资基金	20,009,100.00	3.54%

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。

9.3 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	199,522,799.81	11.06%
2	银行类机构	167,131,884.23	9.27%
3	银行类机构	82,144,153.51	4.55%
4	基金类机构	69,558,301.08	3.86%
5	个人	60,024,463.41	3.33%
6	基金类机构	50,437,904.29	2.80%
7	基金类机构	50,078,317.51	2.78%
8	基金类机构	50,068,303.86	2.78%
9	基金类机构	50,068,303.86	2.78%
10	信托类机构	50,068,303.86	2.78%

9.4 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	352.10	0.00019%
	融通易支付货币 B	—	—
	融通易支付货币 E	—	—
	合计	352.10	0.00002%

9.5 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	融通易支付货币 A	0
	融通易支付货币 B	0

有本开放式基金	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

§ 10 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	-	-
本报告期期初基金份额总额	315,694,882.21	30,495,701,342.40	1,835,744,162.09
本报告期基金总申购份额	1,585,276,950.82	18,519,051,801.35	2,421,760,712.81
减:本报告期基金总赎回份额	1,712,041,820.87	47,965,628,539.63	3,691,669,444.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	188,930,012.16	1,049,124,604.12	565,835,430.15

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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 基金管理人的重大人事变动

1、2017 年 3 月 4 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第五届董事会第十七次临时会议审议并通过，同意孟朝霞女士辞去公司总经理职务，并决定由公司董事长高峰先生代为履行公司总经理职务。

2、2017 年 6 月 3 日，本基金管理人发布了《融通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》，经本基金管理人第五届董事会第十八次临时会议决议审议并通过，决定由张帆先生担任公司总经理职务，公司董事长高峰先生不再代为履行公司总经理职务。

11.2.2 基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金托管人无重大人事变更。

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，无涉及基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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。本年度应支付的审计费用为人民币 150,000.00 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，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。

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	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、交易单元变更情况

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	1,436,595,329.20	100.00%	42,199,000,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期末出现偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20170626, 20171010–20171221	122,394,127.95	534,324,336.47	457,597,783.19	199,120,674.23	11.05%
	2	20170705–20170815, 20170912–20170918, 20171110–20171124	566,584,518.02	2,015,432,771.33	2,500,000,000.00	82,017,289.35	4.55%
	3	20171030–20171109	455,953,499.97	11,962,940.10	467,916,440.07	-	-
	4	20170214–20170623	3,061,357,026.55	29,820,366.30	3,091,177,392.85	-	-
	5	20170316–20170330	2,006,210,676.00	17,453,410.45	2,023,664,086.45	-	-
	6	20170803–20170808	1,205,772,395.68	2,004,905,047.10	3,210,677,442.78	-	-
	7	20171010–20171027	1,524,833,916.89	503,239,200.20	2,028,073,117.09	-	-
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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。

融通基金管理有限公司

二〇一八年三月二十九日