

## Disclosure

D77

**第一节 重要提示**  
 基金管理人的董事会及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责任。  
 基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2008年4月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容，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。

本报告期中财务资料未经审计。本报告期自2008年1月1日起至2008年3月31日止。

**第二节 基金产品概况**

(一) 基金基本情况  
 基金简称：融通易支付货币市场证券投资基金  
 基金运作方式：契约型开放式  
 基金合同生效日：2002年1月19日  
 报告期内总份额：242,288,137.20份  
 投资目标：在保证本金安全、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.根据各类属资产的收益率水平，平均剩余期限、流动性特征，决定基金投资组合中各类型资产的配置比例；  
 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。  
 在长期持有的单一债券选择上利用收益率曲线策略、收益率曲线策略以及权券价值变动策略选择收益率较高的债券进行投资决策。  
 业绩比较基准：银行一年定期存款利率后收益。  
 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、债券等混合型基金。  
 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

**第三节 主要财务指标和基金净值表现**

重要提示：本报告所列示的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将低于所列数字。

**(一) 主要财务指标**

单位：人民币元

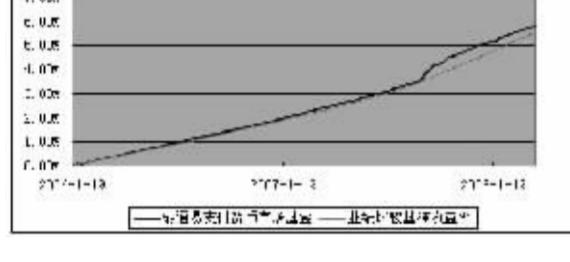
1.本期利润	1,479,991.60
2.本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,479,991.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0068
4.期末基金资产净值	242,288,137.20
5.期末基金份额净值	1.000

注：2007年7月1日基金重新评估后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，原“加权平均基金份额本期利润”为第2项/第1项/第3项。

**(二) 历史各时间段基金收益率与同期平均基准收益率比较：**

阶段	基金收益率	收益率差	比较基准差	比较基准收益率	标准差(%)	①-③	②-④
过去三个月	0.724%	0.03%	0.977%	0.000%	-0.253%	0.003%	
自基金合同生效起至今	5.690%	0.005%	5.644%	0.002%	0.242%	0.003%	

(三) 基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比

**第一节 重要提示**

本公司承诺以诚实信用、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。投资风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本系列基金的招募说明书。

本报告期中财务资料未经审计。本报告期自2008年1月1日起至2008年3月31日止。

**第二节 基金产品概况**

(一) 基金基本情况  
 基金简称：融通利系列货币市场基金  
 基金运作方式：契约型开放式  
 基金合同生效日：2003年9月30日  
 基金份额总额：

融通货币基金份额	511,225,846.44份
融通深证100指数基金	6,816,996,690.92份
融通蓝筹成长基金	3,459,685,908.43份

基金管理人：融通基金管理有限公司  
 基金托管人：中国工商银行股份有限公司

基金类型：货币型基金，投资风格：业绩比较基准，风险收益特征

投资目标：在确保基金资产的安全前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略：以组合为基础策略，根据收益曲线模型和债券品种定价模型，在获取较好的稳定收益的基础上，捕捉市场近期的短期投资机会。

业绩比较基准：全国银行间同业拆借中心公布的银行间债券综合指数。

风险收益特征：属于相对较低风险的货币基金品种。

2、融通深证100指数基金：通过对标的股票投资组合与深证100指数的跟踪误差，力求实现对深证100指数的跟踪，谋求在中长期内获得的超额收益，从而增长长期中国证券市场的投资，实现基金资产的长期增长。

投资策略：以非现金资产50%以上的资金对深证100指数的成分股进行股票型指数投资，股票指数化投资部分不低于基金资产的50%，采制深证100指数，因为对流动性等原因导致无法完全复制100指数的情况，将采用剩余组合等策略。

业绩比较基准：深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

风险收益特征：力求获得超过平均水平的收益，承担相适的风险。

**第三节 主要财务指标和基金净值表现**

重要提示：本报告所列示的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将低于所列数字。

**(一) 主要财务指标**

单位：人民币元

项目 2008年1月1日至2008年3月31日

1.本期利润	8,575,092.80	-3,062,145,291.79	-1,658,006,311.68
2.本期利润扣减本期公允价值变动后的净额	1,225,130.90	43,577,336.21	679,565,021.11
3.加权平均基金份额本期利润	0.0111	-0.4526	-0.4421
4.期末基金资产净值	611,438,060.15	10,331,157,528.31	5,007,096,114.66
5.期末基金份额净值	1.196	1.516	1.447

注：2007年7月1日基金重新评估后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动后的净额”，原“加权平均基金份额本期利润”为第2项/第1项/第3项。

**(二) 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率比较表**

融通货币基金

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差③	①-③	②-④
过去3个月	2.84%	0.19%	1.20%	0.11%	1.64%

融通深证100指数基金

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差③	①-③	②-④
过去3个月	-22.46%	2.73%	-22.59%	2.79%	0.13%

融通蓝筹成长基金

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差③	①-③	②-④
过去3个月	-23.64%	2.10%	-19.23%	2.17%	-4.41%

(三) 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较



注：上表中深证100指数基金业绩比较基准分段计算，其中：2005年8月21日之前（含此日）采用“深证100指数收益率×25%+银行间债券综合指数”，2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”。

融通货币基金

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差③	①-③	②-④
过去3个月	2.84%	0.19%	1.20%	0.11%	1.64%

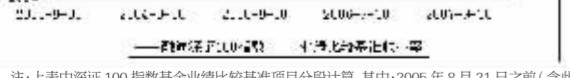
融通深证100指数基金

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差③	①-③	②-④
过去3个月	-22.46%	2.73%	-22.59%	2.79%	0.13%

融通蓝筹成长基金

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差③	①-③	②-④
过去3个月	-23.64%	2.10%	-19.23%	2.17%	-4.41%

(三) 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势比较



注：上表中深证100指数基金业绩比较基准分段计算，其中：2005年8月21日之前（含此日）采用“深证100指数收益率×25%+银行间债券综合指数”，2005年8月22日起使用新基准即“深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”。

融通货币基金

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差③	①-③	②-④
过去3个月	2.84%	0.19%	1.20%	0.11%	1.64%

融通深证100指数基金

阶段	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率差③	①-③	
----	--------	------------	-------------	-----	--