

易方达货币市场基金

2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一六年三月二十五日

§ 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（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 2015 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	12
§ 4	管理人报告.....	13
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	16
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
§ 5	托管人报告.....	19
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	20
§ 6	审计报告.....	20
6.1	管理层对财务报表的责任.....	20
6.2	注册会计师的责任.....	20
6.3	审计意见.....	20
§ 7	年度财务报表.....	21
7.1	资产负债表.....	21
7.2	利润表.....	22
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4	报表附注.....	25
§ 8	投资组合报告.....	51
8.1	期末基金资产组合情况.....	51
8.2	债券回购融资情况.....	51
8.3	基金投资组合平均剩余期限.....	52
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
8.5	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.....	53
8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	54

8.7	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	54
8.8	投资组合报告附注	54
§ 9	基金份额持有人信息	55
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
9.2	期末上市基金前十名持有人	55
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
9.4	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	56
§ 10	开放式基金份额变动	56
§ 11	重大事件揭示	57
11.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4	基金投资策略的改变	57
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	57
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	57
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	59
11.9	其他重大事件	59
§ 12	备查文件目录	64
12.1	备查文件目录	64
12.2	存放地点	64
12.3	查阅方式	64

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达货币市场基金		
基金简称	易方达货币		
基金主代码	110006		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2005 年 2 月 2 日		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	204,019,092,080.83 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	2014-12-08		
下属分级基金的基金简称	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E
下属分级基金场内简称	-	-	易货币
下属分级基金的交易代码	110006	110016	511800
报告期末下属分级基金的份额总额	7,405,191,969.96 份	142,489,664,773.88 份	54,124,235,336.99 份

注：1.易方达货币市场基金 E 类基金份额上市交易。

2.自 2014 年 11 月 21 日起，易方达货币市场基金增设 E 类份额类别，基金份额面值为 100 元，本表所列 E 类份额数据面值已折算为 1 元。

2.2 基金产品说明

投资目标	在确保本金安全和高流动性的前提下，追求超过基准的回报。
投资策略	在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。
业绩比较基准	税后活期存款利率(即活期存款利率×(1-利息税率))
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都低于股票基金、债券基金和混合基金。

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		易方达基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张南	王永民
	联系电话	020-85102688	010-66594896
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-85104666	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-8室	北京市西城区复兴门内大街1 号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		510620	100818
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普 通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永 大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司 上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保 险大厦 36 楼

注：本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额的注册登记机构为易方达基金管理有限公司，E 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司上海分公司。

§ 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	2015 年			2014 年			2013 年		
	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E
本期已实现收益	136,507,215.76	1,883,083,451.99	129,319,130.31	276,025,575.31	1,827,146,803.15	659,875.99	455,225,885.70	1,237,739,877.79	-
本期利润	136,507,215.76	1,883,083,451.99	129,319,130.31	276,025,575.31	1,827,146,803.15	659,875.99	455,225,885.70	1,237,739,877.79	-
本期净值收益率	3.1206%	3.3685%	3.1180%	4.8261%	5.0776%	0.4792%	4.1752%	4.4254%	-
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末			2014 年末			2013 年末		
	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E
期末基金资产净值	7,405,191,969.96	142,489,664,773.88	54,124,235,336.99	6,172,483,115.14	37,405,101,691.16	139,160,925.70	10,211,690,314.09	16,681,028,618.09	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	2015 年末			2014 年末			2013 年末		
	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E
累计净值收益率	40.1312%	38.9717%	3.6122%	35.8907%	34.4430%	0.4792%	29.6351%	27.9472%	-

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金自成立起至 2014 年 11 月 20 日，利润分配是按月结转份额；自 2014 年 11 月 21 日起至今，利润分配是按日结转份额。

3.根据《关于易方达货币市场基金实施基金份额分级的公告》，本基金于 2006 年 7 月 18 日实施分级，分级后本基金设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额，升级后的 B 级基金份额从 2006 年 7 月 19 日起享受 B 级基金收益。

4.相关财务指标中的“累计净值收益率”，A 级基金按分级前后延续计算，即本基金分级前的数据全部纳入 A 级基金进行核算；B 级基金自 2006 年 7 月 19 日开始计算。

5.本基金 E 类合同生效日为 2014 年 11 月 21 日，本报告期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

易方达货币 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	0.6845%	0.0021%	0.0883%	0.0000%	0.5962%	0.0021%
过去六个月	1.2598%	0.0017%	0.1766%	0.0000%	1.0832%	0.0017%
过去一年	3.1206%	0.0060%	0.3506%	0.0000%	2.7700%	0.0060%
过去三年	12.6098%	0.0097%	1.0533%	0.0000%	11.5565%	0.0097%
过去五年	21.9567%	0.0079%	1.9455%	0.0002%	20.0112%	0.0077%
自基金合同生效 起至今	40.1312%	0.0074%	12.7872%	0.0032%	27.3440%	0.0042%

易方达货币 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	0.7450%	0.0021%	0.0883%	0.0000%	0.6567%	0.0021%
过去六个月	1.3820%	0.0017%	0.1766%	0.0000%	1.2054%	0.0017%
过去一年	3.3685%	0.0060%	0.3506%	0.0000%	3.0179%	0.0060%
过去三年	13.4231%	0.0097%	1.0533%	0.0000%	12.3698%	0.0097%
过去五年	23.4243%	0.0079%	1.9455%	0.0002%	21.4788%	0.0077%
自基金份额分级 起至今	38.9717%	0.0078%	10.1534%	0.0034%	28.8183%	0.0044%

易方达货币 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	0.6855%	0.0021%	0.0883%	0.0000%	0.5972%	0.0021%
过去六个月	1.2606%	0.0017%	0.1766%	0.0000%	1.0840%	0.0017%
过去一年	3.1180%	0.0060%	0.3506%	0.0000%	2.7674%	0.0060%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	3.6122%	0.0063%	0.3843%	0.0000%	3.2279%	0.0063%

3.2.2 自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

易方达货币市场基金

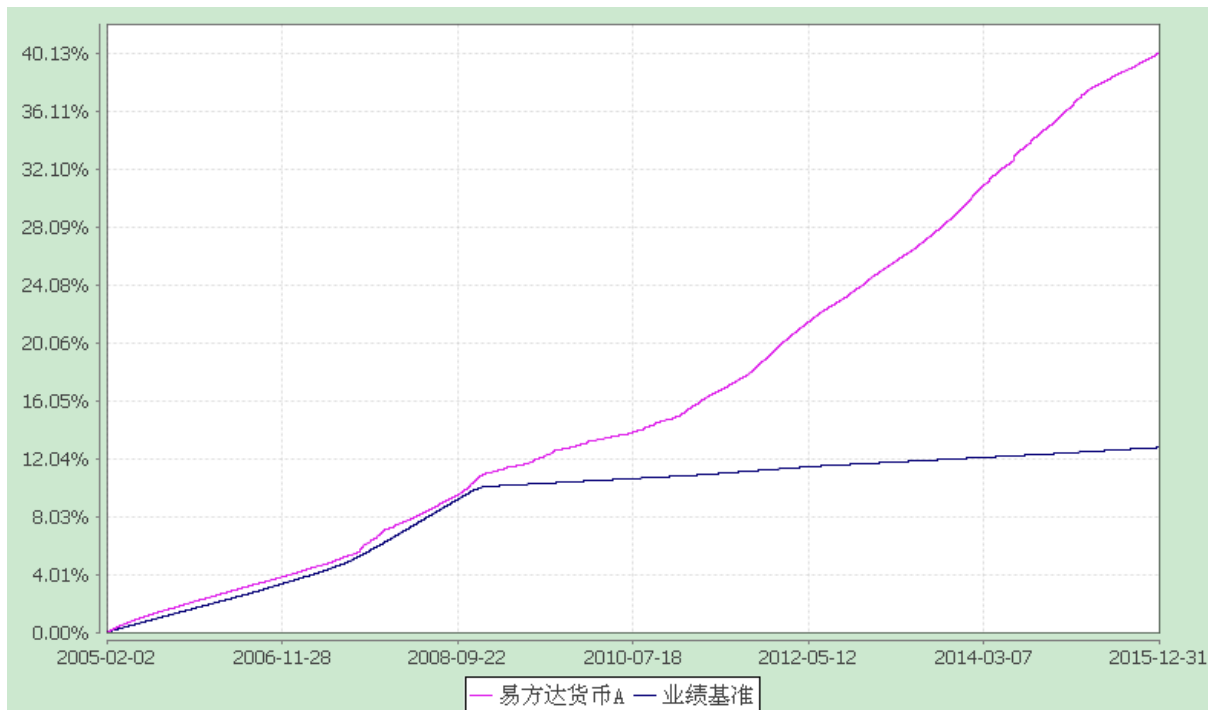
第 8 页共 64 页

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005 年 2 月 2 日至 2015 年 12 月 31 日)

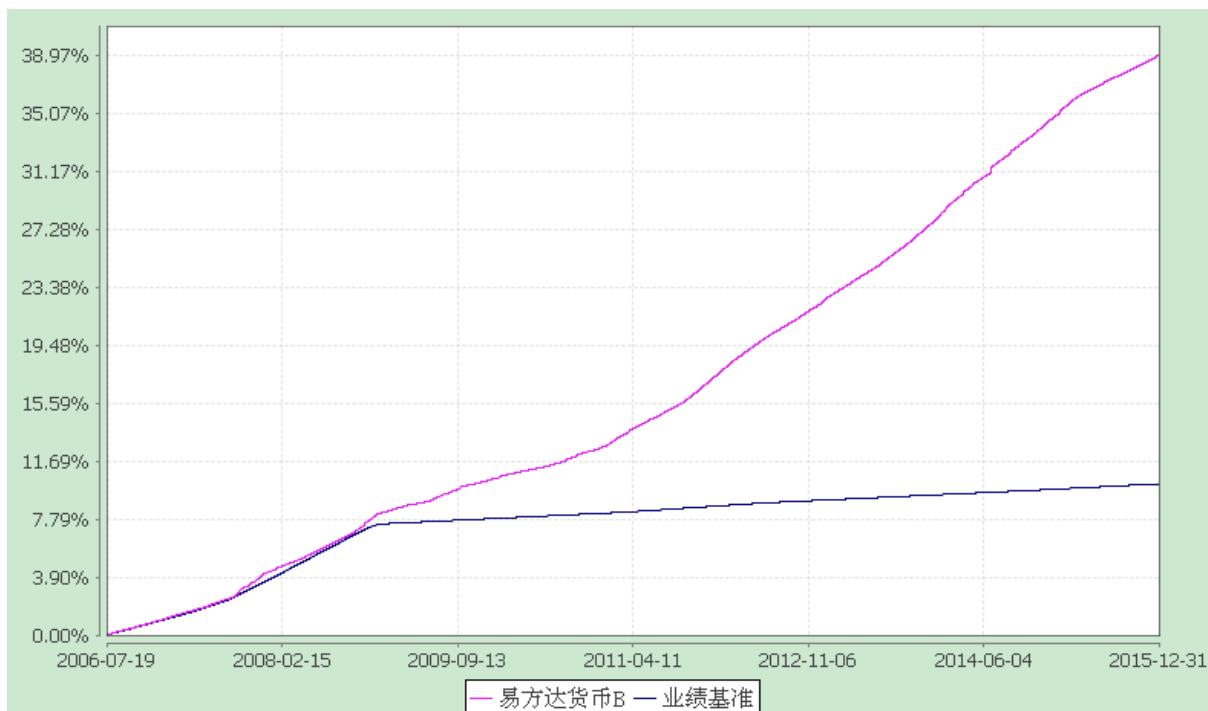
易方达货币 A

(2005 年 2 月 2 日至 2015 年 12 月 31 日)



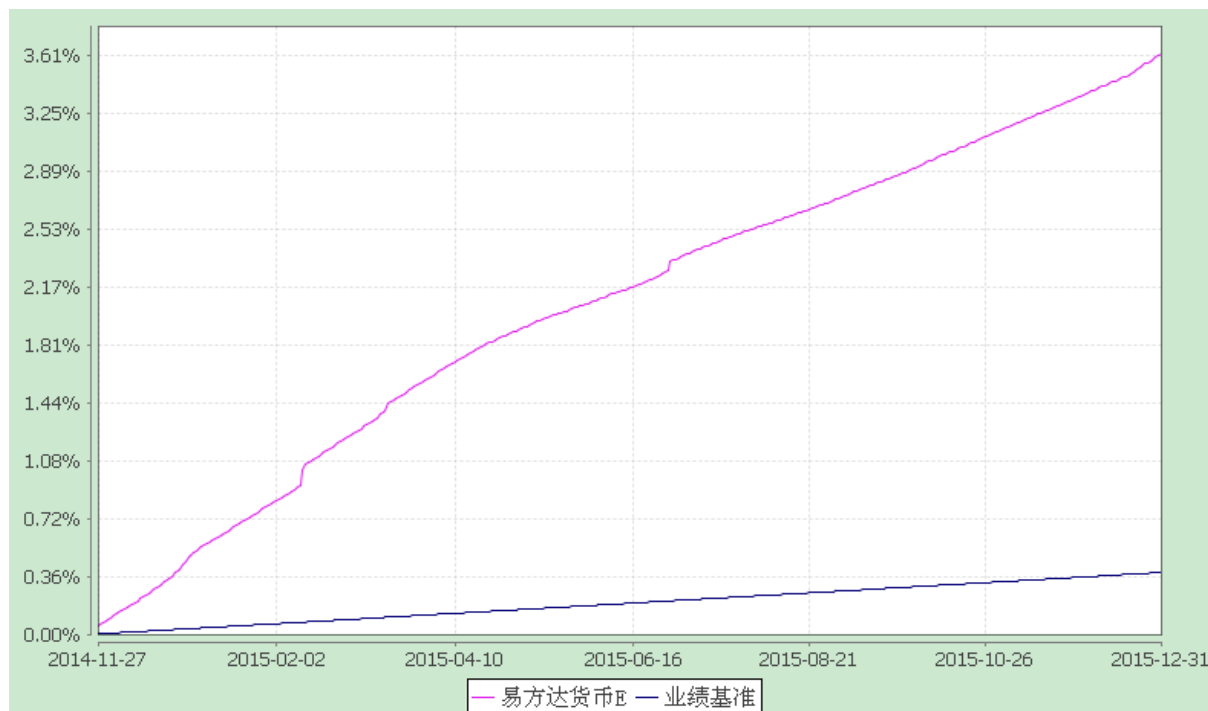
易方达货币 B

(2006 年 7 月 19 日至 2015 年 12 月 31 日)



易方达货币 E

(2014 年 11 月 27 日至 2015 年 12 月 31 日)



注：1.根据 2008 年 12 月 25 日《易方达基金管理有限公司关于变更易方达货币市场基金业绩比较基准的公告》，自 2009 年 1 月 1 日起，本基金原约定的业绩比较基准“一年期银行定期储蓄存款的税后利率： $(1 - \text{利息税率}) \times \text{一年期银行定期储蓄存款利率}$ ”，变更为：“税后活期存款利率(即活期存款利率 $\times(1 - \text{利息税率})$)”。

2.自 2014 年 11 月 21 日起，本基金增设 E 类份额类别，份额申购首次确认日为 2014 年 11 月 27 日。

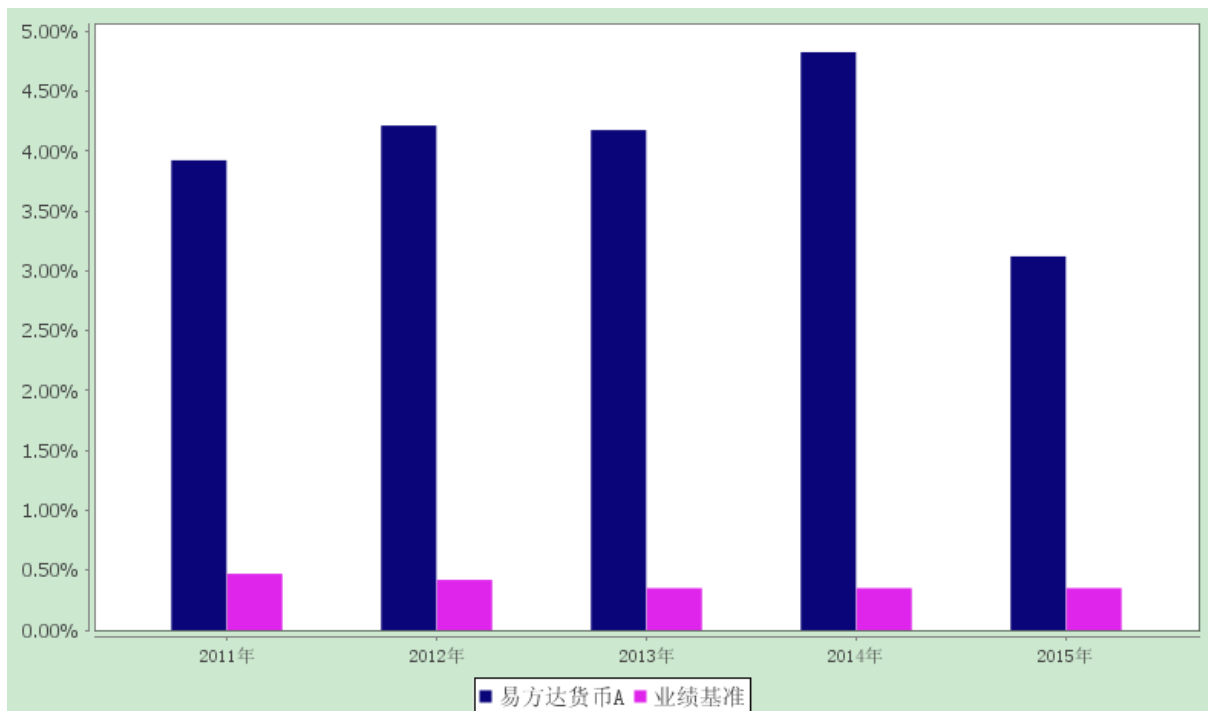
3.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值收益率为 40.1312%，同期业绩比较基准收益率为 12.7872%；自基金分级至报告期末，B 类基金份额净值收益率为 38.9717%，同期业绩比较基准收益率为 10.1534%；自 E 类基金合同生效至报告期末，E 类基金份额净值收益率为 3.6122%，同期业绩比较基准收益率为 0.3843%。

3.2.3 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比较

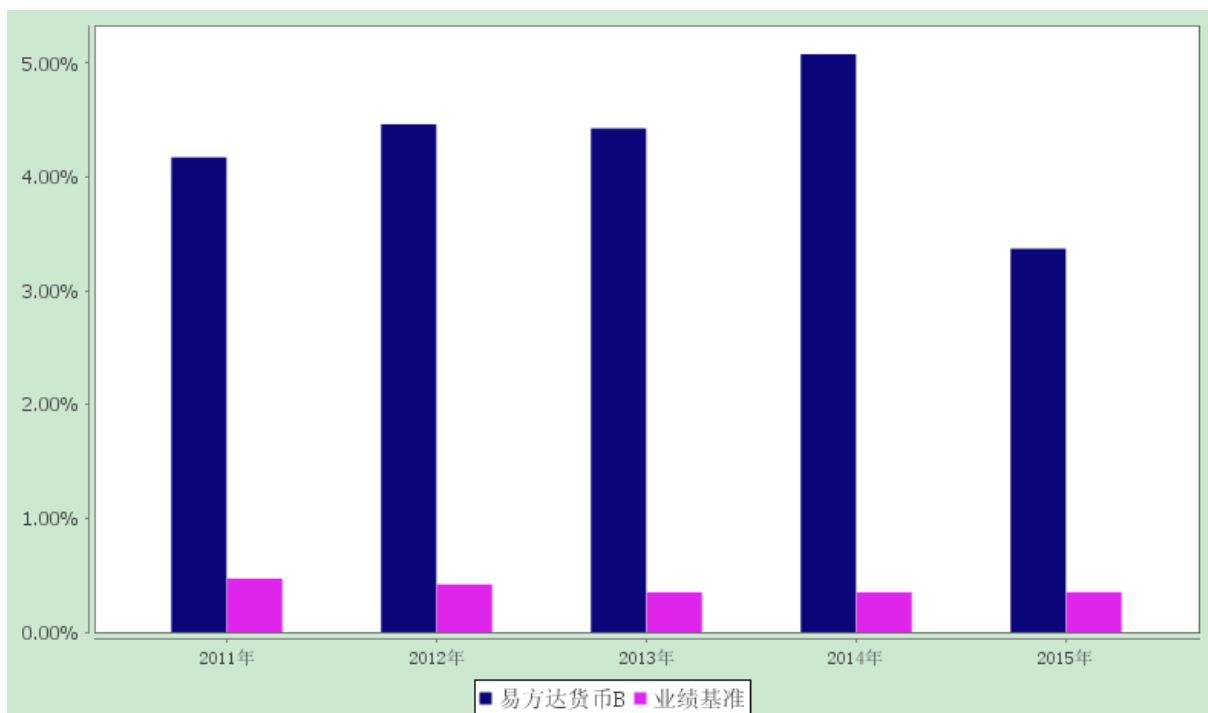
易方达货币市场基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

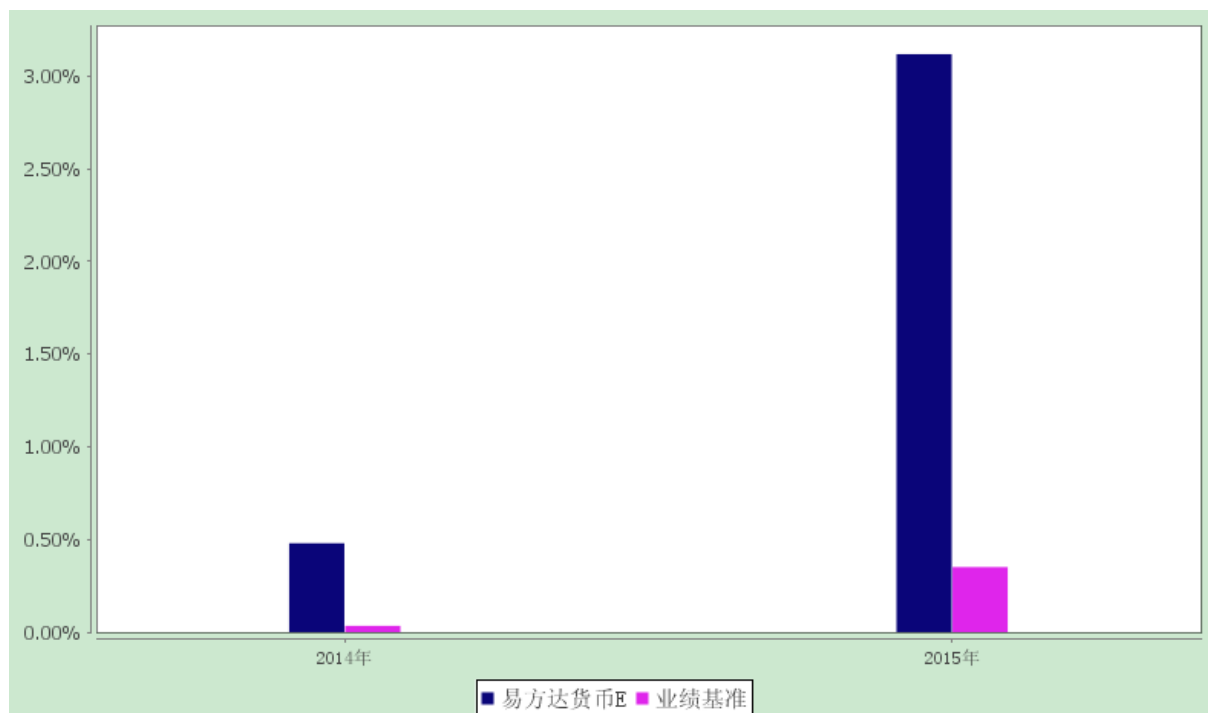
易方达货币 A



易方达货币 B



易方达货币 E



注：自 2014 年 11 月 21 日起，本基金增设 E 类份额类别，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

易方达货币 A

单位：人民币元

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
2015 年	137,487,833.09	-	-980,617.33	136,507,215.76	-
2014 年	296,541,425.12	718,136.63	-21,233,986.44	276,025,575.31	-
2013 年	420,738,978.53	58,990,652.98	-24,503,745.81	455,225,885.70	-
合计	854,768,236.74	59,708,789.61	-46,718,349.58	867,758,676.77	-

易方达货币 B

单位：人民币元

年度	已按再投资形式转实收	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

	基金				
2015 年	1,881,506,96 6.62	-	1,576,485.37	1,883,083,451.99	-
2014 年	1,644,292,49 0.33	207,056,883.16	-24,202,570.34	1,827,146,803.15	-
2013 年	1,078,619,76 0.18	197,442,195.66	-38,322,078.05	1,237,739,877.79	-
合计	4,604,419,21 7.13	404,499,078.82	-60,948,163.02	4,947,970,132.93	-

易方达货币 E

单位：人民币元

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
2015 年	125,485,344. 45	-	3,833,785.86	129,319,130.31	-
2014 年 11 月 21 日 (基金合 同生效 日) 至 2014 年 12 月 31 日	626,248.97	-	33,627.02	659,875.99	-
合计	126,111,593. 42	-	3,867,412.88	129,979,006.30	-

§ 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

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 1.2 亿元，旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承“取信于市场，取信于社会”的宗旨，坚持“在诚信规范的前提下，通过专业化运作和团队合作实现持续稳健增长”的经营理念，以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩，赢得市场认可。2004 年 10 月，易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005 年 8 月，易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007 年 12 月，易

方达获得合格境内机构投资者（QDII）资格。2008年2月，易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2015年12月31日，易方达旗下共管理88只开放式基金、1只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，资产管理总规模8269.58亿元。

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		
石大怿	本基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达月月理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达双月理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理	2013-04-22	-	6年	硕士研究生，曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。
梁莹	本基金的基金经理助理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达双月理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达月月理财债券型证券投资基金的基金经理	2015-02-17	-	5年	硕士研究生，曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员，易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金经理助理。

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

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

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差；建立集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制，对于发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合 2015 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 11 次，其中 8 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

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

2015 年国内经济增长总体保持了平稳态势，全年国内生产总值按可比价格计算比上年增长 6.9%。全年全国规模以上工业增加值按可比价格计算比上年增长 6.1%，其中新产业增长较快，全年高技术产业增加值比上年增长 10.2%，占规模以上工业比重为 11.8%，比上年提高 1.2 个百分点。2015 年全年固定资产投资增速继续回落，相比上年名义增长 10.0%，扣除价格因素实际增长 12.0%，实际增速比上年回落 2.9 个百分点。全年社会消费品零售总额比上年名义增长 10.7%，扣除价格因素实际增长 10.6%。全年进出口总额比上年下降 7.0%，其中出口总额下降 1.8%，进口总额下降 13.2%。全年居民消费价格比上年上涨 1.4%。工业生产者出厂价格比上年下降 5.2%。全年货币信贷平稳增长，M2 年末余额比上年末增长 13.3%。2015 年国内经济结构继续优化升级，体现在产业结构继续优化、区域结构协调性增强以及节能降耗继续取得进展。2015 年是经济发展进入新常态的一年，也是金融领域的改革继续深入推进的一年。这一年利率市场化改革基本完成、在中国人民银行完善人民币中间价报价机制后人民币成功地加入 SDR，新股发行注册制也有望在不久的将来启动。2015 年也是资本市场剧烈动荡的一年，波澜壮阔的 A 股牛市戛然而止、人民币汇率贬值预期增加、外汇储备开始下降。中国人民银行在 2015 年 5 次下调金融机构人民币贷款和存款基准利率、5 次下调金融机构人民币存款准备金率，在宽松的货币政策下，国内债券市场延续了牛市的格局。尽管收益率曲线平坦化下行，但行业信用利差伴随着债券违约事件而有所扩大。2015 年全年货币市场利率维持低位，货币

市场基金行业规模继续增长，年末全市场货币基金总规模 4.58 万亿元，同比增长 109%。随着规模的增长，货币市场基金的资产配置结构也发生了深刻的变化，大额可转让同业存单的配置比例逐渐增加。报告期内，基金的运作仍以保证资产的流动性为首要任务，提高了大额可转让同业存单的配置比例，降低了组合的剩余期限，并提高了现金资产的比例。本基金抓住年末市场资金利率阶段性走高的机会，提高了短期定期存款的配置比例，提高了组合的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内 A 类基金份额净值收益率为 3.1206%；B 类基金份额净值收益率为 3.3685%；E 类基金份额净值收益率为 3.1180%；同期业绩比较基准收益率为 0.3506%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016 年，美联储大概率将开启加息进程，尽管最终加息的次数和频率将取决于美国经济数据的表现，但美国就业情况的显著改善相比于全球经济的疲弱情况使得美元指数仍将继续走强。处于转型期的中国，经济发展长期向好的基本面没有改变，经济的增长已经从“三期叠加”走向“新常态”。去年底召开的中央经济工作会议强调要着力推进的供给侧结构性改革，将开启中国经济持续健康发展的新进程。在推进供给侧改革的过程中，宏观政策的重点和力度都将有所调整，根据权威人士的解读，“稳健的货币政策要灵活适度，主要体现在为结构性改革营造适宜的货币金融环境，降低融资成本，既要防止顺周期紧缩，也绝不要随便放水，而是针对金融市场的变化进行预调微调，保持流动性合理充裕和社会融资总量适度增长。”在人民币国际化的历史背景下，短期内人民银行的工作重心将是稳住人民币汇率。蒙代尔不可能三角理论已经显出巨大的威力，我们不认为短期利率在未来将延续 2015 年持续下行的走势，市场利率波动的频率和区间都将增大。尽管人民银行面临着资本自由流动、货币政策独立性和汇率稳定性的艰难选择，我们仍判断 2016 年不会发生区域性、系统性的金融风险。相对于市场走势和波动的研判，我们更加关注的是，中国货币政策的传导机制正愈发有效、中国资本市场多层次多主体参与者的结构正愈发健全、金融资产的定价正变得愈发高效合理。尽管全球资本市场的走势在可见的未来仍诡谲难测，但一次次危机过后我国金融监管制度在不断完善、监管水平在不断提升；市场化竞争的大浪淘沙，使得我国一批有竞争力的金融机构在一次次危机后脱颖而出。这是改革时代的主题，是我国资本市场的希望。道路曲折不改前途光明，我们对中国经济的未来和转型的成功充满信心。新的《货币市场基金监督管理办法》于 2016 年 2 月 1 日施行，新规对于货币市场基金资产配置的分散化、资产的流动性提出了更高的监管要求，这与我们所一直坚持的管理理念完全相同。

本基金将坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，继续保持投资组合较高的流动性。本基金将保持较低的剩余期限和较高的现金比例，并在货币市场工具的投资中把握波段操作的机会。

基金管理人将坚持规范运作、审慎投资，勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、防控内幕交易等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动完善相关制度流程的建立、健全，及时贯彻落实新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

(2) 严守合规底线、管好合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育及考试谈话，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易和市场操纵等违法违规行，完善利益冲突管理相关制度机制。

(3) 坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保了旗下基金资产严格按照法律法规和基金合同的要求稳健、规范运作。

(4) 对投资交易、销售宣传、人员规范及个人投资申报、运营维稳、反洗钱、客户服务、IT 治理等方面开展了一系列专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

(5) 积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

(6) 督促落实销售适当性管理制度，推动完善客户投诉处理机制流程。

(7) 深入贯彻风险为本的监管精神，加强公司洗钱风险管理体系建设，建立优化客户、产品、业务的洗钱风险识别和洗钱风险自评估工作机制，探索实施符合基金业务特征的可疑交易监控模型和方法，开展反洗钱系统开发测试、宣传培训、内部审计、信息报送、问题调研与意见反馈等各项工作。

(8) 紧跟法规变化和业务发展，认真做好公司及旗下各基金的各项信息披露工作，力求信息披露真实、完整、准确、及时、简明易懂。

(9) 不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、

针对性与有效性得到提升。

2015 年，公司按计划继续开展了 ISAE3402（《鉴证业务国际准则第 3402 号》）认证项目；同时，公司顺利通过了 GIPS（全球投资业绩标准）认证。通过开展上述外部审计鉴证及认证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升公司核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司营运总监担任估值委员会主席，研究部、固定收益总部、投资风险管理部、监察部和核算部指定人员担任委员。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《易方达货币市场基金基金合同》，本基金每日将各级基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

§ 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的

计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明(2016)审字第 60468000_G05 号

易方达货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的易方达货币市场基金的财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表、2015 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人易方达基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达货币市场基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师 赵雅 李明明

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2016-03-18

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达货币市场基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	102,033,987,358.40	15,614,598,997.32
结算备付金		8,194,194,000.00	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	65,149,222,078.35	16,923,380,535.99
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		65,149,222,078.35	16,923,380,535.99
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	27,378,875,810.61	13,137,021,865.52
应收证券清算款		20,149,513.66	-
应收利息	7.4.7.5	631,990,389.87	421,816,603.48
应收股利		-	-
应收申购款		4,690,318,339.13	14,145,849.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	80,000.00	37,500.00
资产总计		208,098,817,490.02	46,111,001,351.75
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		3,815,397,930.00	2,350,986,259.14
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		204,031,682.72	14,451,627.21
应付管理人报酬		28,991,720.06	10,409,891.89
应付托管费		8,785,369.71	3,154,512.69
应付销售服务费		5,440,361.34	1,449,822.19
应付交易费用	7.4.7.7	478,498.38	365,825.96
应交税费		315,450.00	315,450.00
应付利息		232,541.61	1,532,777.24
应付利润		15,372,350.05	10,942,696.15
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	679,505.32	646,757.28
负债合计		4,079,725,409.19	2,394,255,619.75
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	204,019,092,080.83	43,716,745,732.00
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		204,019,092,080.83	43,716,745,732.00
负债和所有者权益总计		208,098,817,490.02	46,111,001,351.75

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额净值 1.0000 元，E 类基金份额净值 100.0000 元；基金份额总额 204,019,092,080.83 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 7,405,191,969.96 份，B 类基金份额总额 142,489,664,773.88 份，E 类基金份额总额 54,124,235,336.99 份，其中 E 类份额净值已折算为 1 元。

7.2 利润表

会计主体：易方达货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		2,571,824,471.37	2,407,105,834.14
1.利息收入		2,754,319,590.72	2,365,351,415.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,274,783,682.72	1,472,772,383.14
债券利息收入		1,289,038,478.18	806,474,926.52
资产支持证券利息收入		-	76,562.32
买入返售金融资产收入		190,497,429.82	86,027,543.04
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-182,495,119.35	41,721,429.12
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-182,495,119.35	41,721,429.12
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）	7.4.7.13	-	32,990.00
减：二、费用		422,914,673.31	303,273,579.69
1. 管理人报酬		237,920,104.50	151,650,515.51
2. 托管费		72,097,001.33	45,954,701.66
3. 销售服务费		27,990,643.22	18,735,613.48
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		83,905,450.64	86,140,343.01
其中：卖出回购金融资产支出		83,905,450.64	86,140,343.01

6. 其他费用	7.4.7.15	1,001,473.62	792,406.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,148,909,798.06	2,103,832,254.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,148,909,798.06	2,103,832,254.45

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达货币市场基金

本报告期：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2015 年 1 月 1 日至 2015 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）	43,716,745,732.00	-	43,716,745,732.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,148,909,798.06	2,148,909,798.06
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）	160,302,346,348.83	-	160,302,346,348.83
其中：1.基金申购款	798,868,769,323.85	-	798,868,769,323.85
2.基金赎回款	-638,566,422,975.02	-	-638,566,422,975.02
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）	-	-2,148,909,798.06	-2,148,909,798.06
五、期末所有者权益（基金净值）	204,019,092,080.83	-	204,019,092,080.83
项目	上年度可比期间		
	2014 年 1 月 1 日至 2014 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）	26,892,718,932.18	-	26,892,718,932.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,103,832,254.45	2,103,832,254.45
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）	16,824,026,799.82	-	16,824,026,799.82
其中：1.基金申购款	472,671,479,368.59	-	472,671,479,368.59
2.基金赎回款	-455,847,452,568.77	-	-455,847,452,568.77
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）	-	-2,103,832,254.45	-2,103,832,254.45
五、期末所有者权益（基金净值）	43,716,745,732.00	-	43,716,745,732.00

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：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达货币市场基金（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[2004]217 号文件“关于同意易方达货币市场基金设立的批复”批准，向社会公开募集，首次募集规模为 3,622,219,215.04 份基金份额。根据基金部函[2005]26 号《关于易方达货币市场基金备案确认的函》，本基金合同于 2005 年 2 月 2 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）。

本基金于 2006 年 7 月 18 日实施分级，基金分级后，在任何一个开放日，若 A 级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 1000 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 级基金份额升级为 B 级基金份额；若 B 级基金份额持有人在单个基金帐户保留的基金份额低于 1000 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 级基金份额降级为 A 级基金份额。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基金日收益和基金七日收益率。

自 2014 年 11 月 21 日起，本基金增设 E 类份额类别，份额申购首次确认日为 2014 年 11 月 27 日。经上海证券交易所自律监管决定书 [2014] 655 号核准同意，E 类 2,009,926 份基金份额于 2014 年 12 月 8 日在上海交易所上市交易。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及应收款项。

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目；应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格(附注 7.4.4.5)，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其接近于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

(1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际利率逐日计提利息；

(2) 债券投资

基金持有的付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3) 回购协议

A.基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在回购期内逐日计提利息；

B.基金持有的买断式回购以成本列示，所产生的利息在回购期内逐日计提。回购期满，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

(4) 其他

A.如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值；

B.为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.5% 的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

C.如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份 A 类基金份额和 B 类基金份额面值为人民币 1 元，每份 E 类基金份额的面值为人民币 100 元，本报告所列 E 类份额数据面值已折算为 1 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3)买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4)债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.9 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值乘以 0.33% 的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值乘以 0.10% 的年费率逐日计提；

(3)A 类基金份额按前一日 A 类基金份额资产净值的 0.25% 的年费率，B 类基金份额按前一日 B 类基金份额资产净值的 0.01% 的年费率，E 类基金份额按前一日 E 类基金份额资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提基金销售服务费；

(4)卖出回购金融资产支出，按融入资金应收或实际收到的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金每日将 A 类基金份额和 B 类份额的基金已实现收益分配给相应的基金份额持有人（该收益将于下一工作日会计确认为实收基金）。通常情况下，本基金每月 15 日（如遇节假日顺延）集中支付收益，结转为相应的基金份额；对于可支持按日支付的销售机构，本基金的收益支付方式经基金管理人和销售机构双方协商一致后可以按日支付。不论何种支付方式，当日收益均参与下一日的收益分配，不影响基金份额持有人实际获得的投资收益。基金合同生效不满 1 个月时可不结转。投资者当日收益的精度为 0.01 元，第三位采用去尾的方式，因去尾形成的余额进行再次分配。

(2)本基金每日将 E 类基金份额的基金已实现收益分配给相应的基金份额持有人，并记入 E 类份额持有人的收益账户（该收益将于下一工作日会计确认为实收基金），当日收益参与下一日的收益分配。若 E 类基金份额持有人收益账户内的累计收益不低于 100 元时，则 100 元整数倍的累计收益将兑付为相应 E 类基金份额。投资者当日收益的精度为 0.01 元，第三位采用去尾的方式，因去尾形成的余额进行再次分配。

(3)本基金的分红方式限于红利再投资。对按月支付收益的情形，如 A 类基金份额和 B 类基金份额当月累计分配的基金收益为正，则为持有人增加相应的基金份额；如当月累计分配的基金收益为负，则为持有人缩减相应的基金份额。对按日支付收益的情形，如 A 类基金份额和 B 类基金份额当日分配的基金收益为正，则为持有人增加相应的基金份额；如当日分配的基金收益为负，则为持有

人缩减相应的基金份额。投资者可通过赎回基金份额获取现金收益。

(4)对按月支付收益的情形,在 A 类基金份额持有人或 B 类基金份额持有人全部赎回基金份额时,其账户在本月累计的基金收益将立即结算,并随赎回款项一起支付给投资者,如本月累计的基金收益为负,则扣减赎回金额;在 A 类基金份额持有人和 B 类基金份额持有人部分赎回基金份额时,不结算基金收益,而是待全部赎回时再一并结算基金收益。对按日支付收益的情形,在 A 类基金份额持有人或 B 类基金份额持有人全部赎回基金份额时,其账户在当日的基金收益将立即结算,并随赎回款项一起支付给投资者,如当日的基金收益为负,则扣减赎回金额;在 A 类基金份额持有人和 B 类基金份额持有人部分赎回基金份额时,不结算基金收益,而是待全部赎回时再一并结算基金收益。在 E 类基金份额持有人赎回基金份额时,其对应比例的累计收益将立即结清,以现金支付给投资人,如累计的基金收益为负,则扣减赎回金额。

(5)基金份额持有人部分卖出 E 类基金份额时,不支付对应的收益,全部卖出 E 类基金份额时,以现金方式将全部累计收益与基金份额持有人结清。若累计收益为负,则投资人应当以现金方式全额弥补,否则基金管理人有权向基金份额持有人追索相应收益及损失。

(6)T 日申购的基金份额不享有 T 日分红权益,T 日赎回的基金份额仍享有 T 日分红权益。当日买入的 E 类基金份额自买入当日起享有基金的分红权益;当日卖出的 E 类基金份额自卖出当日起,不享有基金的分红权益。

(7)相同类别的基金份额享有同等收益分配权。

(8)在不影响基金份额持有人利益的前提下,基金管理人可在中国证监会允许的条件调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会。

(9)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6 税项

7.4.6.1 营业税、企业所得税

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入，免征营业税。

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

7.4.6.2 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金取得的债券的利息收入及储蓄利息收入，由债券发行企业及金融机构在向基金派发债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴个人所得税；暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
活期存款	545,987,358.40	4,598,997.32
定期存款	101,488,000,000.00	15,610,000,000.00
其中：存款期限		
1-3 个月	16,500,000,000.00	3,300,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	32,288,000,000.00	1,830,000,000.00
存款期限 1 个月以内	52,700,000,000.00	10,480,000,000.00
其他存款	-	-
合计	102,033,987,358.40	15,614,598,997.32

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2015 年 12 月 31 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	65,149,222,078.35	65,391,147,400.00	241,925,321.65	0.1186

	合计	65,149,222,078.35	65,391,147,400.00	241,925,321.65	0.1186
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 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	16,923,380,535.99	16,999,941,000.00	76,560,464.01	0.1751
	合计	16,923,380,535.99	16,999,941,000.00	76,560,464.01	0.1751

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	27,378,875,810.61	-
合计	27,378,875,810.61	-
项目	上年度末 2014 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	13,137,021,865.52	-
合计	13,137,021,865.52	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2015 年 12 月 31 日	2014 年 12 月 31 日

应收活期存款利息	8,352.77	732.69
应收定期存款利息	145,293,820.77	69,336,972.35
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,540,078.04	4.76
应收债券利息	477,928,172.90	343,585,405.61
应收买入返售证券利息	7,219,965.39	8,893,488.07
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	631,990,389.87	421,816,603.48

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
其他应收款	80,000.00	37,500.00
待摊费用	-	-
合计	80,000.00	37,500.00

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	478,498.38	365,825.96
合计	478,498.38	365,825.96

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	10,505.32	37,757.28
预提费用	669,000.00	609,000.00

合计	679,505.32	646,757.28
----	------------	------------

7.4.7.9 实收基金

易方达货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,172,483,115.14	6,172,483,115.14
本期申购	55,141,555,085.59	55,141,555,085.59
本期赎回（以“-”号填列）	-53,908,846,230.77	-53,908,846,230.77
本期末	7,405,191,969.96	7,405,191,969.96

易方达货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	37,405,101,691.16	37,405,101,691.16
本期申购	680,325,129,493.81	680,325,129,493.81
本期赎回（以“-”号填列）	-575,240,566,411.09	-575,240,566,411.09
本期末	142,489,664,773.88	142,489,664,773.88

易方达货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	139,160,925.70	139,160,925.70
本期申购	63,402,084,744.45	63,402,084,744.45
本期赎回（以“-”号填列）	-9,417,010,333.16	-9,417,010,333.16
本期末	54,124,235,336.99	54,124,235,336.99

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额。

7.4.7.10 未分配利润

易方达货币 A

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	-	-	-
本期利润	136,507,215.76	-	136,507,215.76
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	-136,507,215.76	-	-136,507,215.76
本期末	-	-	-

易方达货币 B

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	-	-	-
本期利润	1,883,083,451.99	-	1,883,083,451.99
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	-1,883,083,451.99	-	-1,883,083,451.99
本期末	-	-	-

易方达货币 E

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	-	-	-
本期利润	129,319,130.31	-	129,319,130.31
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	-129,319,130.31	-	-129,319,130.31
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
活期存款利息收入	998,269.90	320,413.26
定期存款利息收入	1,269,421,329.26	1,472,195,523.44
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	4,355,607.31	228,460.11
其他	8,476.25	27,986.33
合计	1,274,783,682.72	1,472,772,383.14

7.4.7.12 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	122,477,314,490.55	116,717,448,856.68
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	121,107,348,328.91	115,447,786,664.83
减：应收利息总额	1,552,461,280.99	1,227,940,762.73
买卖债券差价收入	-182,495,119.35	41,721,429.12

7.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	32,990.00

合计	-	32,990.00
----	---	-----------

7.4.7.14 交易费用

本基金所进行的交易，交易费用均入成本，本报告期及上年度可比期间未产生交易费用。

7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
审计费用	120,000.00	130,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	399,219.48	232,856.05
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
上市费	60,000.00	10,000.00
交易单元使用费	80,000.00	80,000.00
其他	6,254.14	3,549.98
合计	1,001,473.62	792,406.03

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司（以下简称“广发证券”）	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司（以下简称“粤财信托”）	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
广东新三联投资发展有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	237,920,104.50	151,650,515.51
其中：支付销售机构的客户 维护费	6,896,578.97	12,043,186.21

注：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：

每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.33%/当年天数

基金管理费每日计算，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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31 日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31 日
当期发生的基金应支付的托 管费	72,097,001.33	45,954,701.66

注：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：

每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.10%/当年天数

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。

7.4.10.2.3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 2015年1月1日至2015年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E	合计
易方达基金管理有限公司	1,800,961.13	5,988,337.07	6,369,873.89	14,159,172.09
中国银行	1,537,734.47	16,314.20	-	1,554,048.67
广发证券	193,546.54	10,587.30	205,017.20	409,151.04
合计	3,532,242.14	6,015,238.57	6,574,891.09	16,122,371.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E	合计
易方达基金管理有限公司	2,308,643.73	3,398,937.72	129.75	5,707,711.20
中国银行	3,435,531.15	46,996.36	-	3,482,527.51
广发证券	342,238.22	15,828.42	10,917.37	368,984.01
合计	6,086,413.10	3,461,762.50	11,047.12	9,559,222.72

注：本基金 A 类基金份额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；B 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提；E 类基金份额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。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

每日应支付的各级基金销售服务费=前一日该级基金份额的基金资产净值×R÷当年天数

R 为该级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付给基金销售机构，于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.10.3 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 2015年1月1日至2015年12月31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
中国银行	50,927,045.89	238,155,08 2.94	2,500,000,0 00.00	1,187,921 .10	83,852,300,00 0.00	5,159,053 .36
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31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
中国银行	20,106,956.16	2,121,760,6 41.47	-	-	34,234,340,00 0.00	11,040,41 9.20

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日			上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E
报告期 初持有的 基金份 额	-	-	-	-	640,572,313.87	-
报告 期间申 购/买 入总 份额	-	150,016,555.23	-	-	5,809,133.09	-
报告 期间因 拆分变 动份 额	-	-	-	-	-	-
减：报 告期 间赎 回/卖 出总 份额	-	150,016,555.23	-	-	646,381,446.96	-
报告 期	-	-	-	-	-	-

末持有的基金份额						
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.4.2 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

易方达货币 A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014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
易方达资产管理有 限公司	8,016,325.57	0.11%	604,541.01	0.01%
广东省易方达教育 基金会	776,798.80	0.01%	-	-
广东新三联投资发 展有限公司	101,862.15	0.00%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

易方达货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014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
广东省易方达教育 基金会	-	-	20,752,434.82	0.06%

广发证券	1,000,000,000.00	0.70%	-	-
------	------------------	-------	---	---

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

易方达货币 E

份额单位：份

关联方名称	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014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
广发证券	28.00	0.00%	2,417.00	0.00%
广发信德投资管理 有限公司	1,392,331.00	0.00%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。广发信德投资管理有限公司是基金管理人股东广发证券控制的机构。

7.4.10.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国银行	545,987,358.40	18,240,651.83	182,598,997.32	23,348,213.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中国银行	011537004	15 中建材 SCP004	分销	4,000,000	399,500,000.00

中国银行	011543002	15 中核建 SCP002	分销	3,500,000	350,000,000.00
中国银行	011599195	15 凤传媒 SCP002	分销	400,000	40,000,000.00
中国银行	011599339	15 鲁黄金 SCP005	分销	500,000	50,000,000.00
广发证券、中 国银行	071501003	15 招商 CP003	分销	800,000	79,980,000.00
上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中国银行	011410005	14 中电投 SCP005	分销	2,000,000	200,000,000.00
中国银行	011411002	14 大唐集 SCP002	分销	5,000,000	500,000,000.00
中国银行	011411004	14 大唐集 SCP004	分销	5,000,000	500,000,000.00
中国银行	011414004	14 中粮 SCP004	分销	4,000,000	399,850,000.00
中国银行	011415002	14 中铝业 SCP002	分销	3,000,000	300,000,000.00
中国银行	011415003	14 中铝业 SCP003	分销	2,500,000	249,625,000.00
中国银行	011417002	14 华电 SCP002	分销	4,000,000	400,000,000.00
中国银行	011420001	14 中铝 SCP001	分销	1,000,000	100,000,000.00
中国银行	011420003	14 中铝 SCP003	分销	1,800,000	180,000,000.00
中国银行	011420004	14 中铝 SCP004	分销	500,000	50,000,000.00
中国银行	011420006	14 中铝 SCP006	分销	1,000,000	100,000,000.00
中国银行	011422001	14 神华 SCP001	分销	3,000,000	299,700,000.00
中国银行	011423002	14 大唐 SCP002	分销	3,000,000	300,000,000.00
中国银行	011424002	14 中冶 SCP002	分销	2,800,000	279,910,000.00
中国银行	011425001	14 中化股	分销	2,000,000	199,915,000.00

		SCP001			
中国银行	011433002	14 五矿 SCP002	分销	2,600,000	260,000,000.00
中国银行	011437003	14 中建材 SCP003	分销	4,500,000	450,000,000.00
中国银行	011437005	14 中建材 SCP005	分销	3,000,000	299,700,000.00
中国银行	011440001	14 港中旅 SCP001	分销	4,000,000	400,000,000.00
中国银行	011442002	14 中航空 SCP002	分销	1,000,000	100,000,000.00
中国银行	011443001	14 中核建 SCP001	分销	1,000,000	100,000,000.00
中国银行	011461003	14 五矿股 SCP003	分销	1,000,000	100,000,000.00
中国银行	011474002	14 陕煤化 SCP002	分销	1,300,000	129,707,500.00
中国银行	011474005	14 陕煤化 SCP005	分销	600,000	59,977,500.00
中国银行	011475001	14 中信股 SCP001	分销	2,000,000	200,000,000.00
中国银行	011477001	14 申能集 SCP001	分销	1,500,000	150,000,000.00
中国银行	011487001	14 中电建 SCP001	分销	1,500,000	150,000,000.00
广发证券	041459013	14 海淀国资 CP001	分销	3,200,000	320,000,000.00
中国银行	041464012	14 晋焦煤 CP001	分销	2,800,000	279,720,000.00
中国银行	041466008	14 淮南矿业 CP002	分销	1,400,000	139,860,000.00

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

1、易方达货币 A

单位：人民币元

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
137,487,833.09	-	-980,617.33	136,507,215. 76	-

2、易方达货币 B

单位：人民币元

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
1,881,506,966.62	-	1,576,485.37	1,883,083,45 1.99	-

3、易方达货币 E

单位：人民币元

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
125,485,344.45	-	3,833,785.86	129,319,130. 31	-

7.4.12 期末（2015 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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 3,815,397,930.00 元，是以如下债券作为质押：

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
130241	13 国开 41	2016-01-04	99.07	2,000,000	198,135,150.33
150202	15 国开 02	2016-01-04	100.09	17,800,000	1,781,561,874.65
150211	15 国开 11	2016-01-04	100.28	1,100,000	110,312,162.92
150214	15 国开 14	2016-01-04	98.27	16,000,000	1,572,295,376.65
159908	15 贴现国债 08	2016-01-04	99.68	1,300,000	129,581,656.07
合计				38,200,000	3,791,886,220.62

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 年 12 月 31 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为 0，无抵押债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金是货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在确保本金安全和高流动性的前提下，追求超过基准的回报。

7.4.13.2 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2015 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 26.21%(2014 年 12 月 31 日：30.97%)。

7.4.13.2.1 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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
A-1	3,820,157,516.44	10,012,354,040.59
A-1 以下	0.00	0.00-

未评级	61,806,992,734.81	7,224,530,468.34
合计	65,627,150,251.25	17,236,884,508.93

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
AAA	0.00	30,081,432.67
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	30,081,432.67

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金、一年以内（含一年）的银行定期存款和大量存单、剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券（不包括可转换债券）、期限在一年以内（含一年）的债券回购、剩余期限在一年以内（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其他具有良好流动性的货币市场工具。无重大流动性风险。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	102,033,987,358.40	-	-	-	102,033,987,358.40
结算备付金	8,194,194,000.00	-	-	-	8,194,194,000.00
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	65,149,222,078.35	-	-	-	65,149,222,078.35
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	27,378,875,810.61	-	-	-	27,378,875,810.61
应收证券清算款	-	-	-	20,149,513.66	20,149,513.66
应收利息	-	-	-	631,990,389.87	631,990,389.87
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	4,690,318,339.13	4,690,318,339.13
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	80,000.00	80,000.00
资产总计	202,756,279,247.36	-	-	5,342,538,242.66	208,098,817,490.02
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	3,815,397,930.00	-	-	-	3,815,397,930.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	204,031,682.72	204,031,682.72
应付管理人	-	-	-	28,991,720.06	28,991,720.06

报酬					
应付托管费	-	-	-	8,785,369.71	8,785,369.71
应付销售服务费	-	-	-	5,440,361.34	5,440,361.34
应付交易费用	-	-	-	478,498.38	478,498.38
应交税费	-	-	-	315,450.00	315,450.00
应付利息	-	-	-	232,541.61	232,541.61
应付利润	-	-	-	15,372,350.05	15,372,350.05
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	679,505.32	679,505.32
负债总计	3,815,397,930.00	-	-	264,327,479.19	4,079,725,409.19
利率敏感度缺口	198,940,881,317.36	-	-	5,078,210,763.47	204,019,092,080.83
上年度末 2014 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,614,598,997.32	-	-	-	15,614,598,997.32
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	16,923,380,535.99	-	-	-	16,923,380,535.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	13,137,021,865.52	-	-	-	13,137,021,865.52
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	421,816,603.48	421,816,603.48
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	14,145,849.44	14,145,849.44
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	37,500.00	37,500.00
资产总计	45,675,001,398.83	-	-	435,999,952.92	46,111,001,351.75
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	2,350,986,259.14	-	-	-	2,350,986,259.14
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	14,451,627.21	14,451,627.21
应付管理人报酬	-	-	-	10,409,891.89	10,409,891.89
应付托管费	-	-	-	3,154,512.69	3,154,512.69
应付销售服务费	-	-	-	1,449,822.19	1,449,822.19
应付交易费用	-	-	-	365,825.96	365,825.96
应交税费	-	-	-	315,450.00	315,450.00
应付利息	-	-	-	1,532,777.24	1,532,777.24
应付利润	-	-	-	10,942,696.15	10,942,696.15
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	646,757.28	646,757.28
负债总计	2,350,986,259.14	-	-	43,269,360.61	2,394,255,619.75
利率敏感度缺口	43,324,015,139.69	-	-	392,730,592.31	43,716,745,732.00

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 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 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
	1.市场利率下降 25 个基点	63,385,220.32	20,331,163.20
2.市场利率上升 25 个基点	-63,191,761.53	-20,275,875.01	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性金融资产，于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	65,149,222,078.35	31.31
	其中：债券	65,149,222,078.35	31.31
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	27,378,875,810.61	13.16
	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	110,228,181,358.40	52.97
4	其他各项资产	5,342,538,242.66	2.57
5	合计	208,098,817,490.02	100.00

注：在报告期内，根据流动性管理的需要，本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

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	5.39	
	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	3,815,397,930.00	1.87
	其中：买断式回购融资	-	-

注：上表中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基金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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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	53
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	136
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

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，本基金投资组合平均剩余期限无超过 180 天的情况。

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	48.60	1.87
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.77	-
2	30 天（含）—60 天	12.07	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.34	-
3	60 天（含）—90 天	10.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—180 天	26.10	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的	-	-

	浮动利率债		
5	180 天（含）—397 天（含）	2.31	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		99.39	1.87

8.4 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	1,485,250,084.14	0.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,730,738,654.96	5.26
	其中：政策性金融债	10,490,724,712.48	5.14
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	22,354,050,092.98	10.96
6	中期票据	-	-
7	同业存单	30,579,183,246.27	14.99
8	其他	-	-
9	合计	65,149,222,078.35	31.93
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	2,259,815,435.27	1.11

8.5 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	111510315	15 兴业 CD315	29,000,000	2,875,442,905.53	1.41
2	111517166	15 光大 CD166	27,300,000	2,708,751,302.86	1.33
3	111510405	15 兴业 CD405	23,000,000	2,291,869,744.95	1.12
4	111591761	15 宁波银行 CD102	22,000,000	2,183,533,661.82	1.07
5	111519105	15 恒丰银行 CD105	20,000,000	1,969,910,915.31	0.97
6	150202	15 国开 02	17,800,000	1,781,561,874.65	0.87
7	110402	11 农发 02	17,500,000	1,750,253,228.84	0.86

8	150214	15 国开 14	16,000,000	1,572,295,376.65	0.77
9	111509219	15 浦发 CD219	15,000,000	1,487,364,164.59	0.73
10	111511268	15 平安 CD268	15,000,000	1,479,919,428.94	0.73

8.6 “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	151
报告期内偏离度的最高值	0.4555%
报告期内偏离度的最低值	0.1186%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2680%

8.7 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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

(1) 基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

(2) 基金持有的回购以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；

(3) 基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

8.8.2 本基金本报告期内不存在剩余期限小于 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。

8.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情形。

8.8.4 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	20,149,513.66
3	应收利息	631,990,389.87
4	应收申购款	4,690,318,339.13
5	其他应收款	80,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	5,342,538,242.66

§ 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
易方达货币 A	196,301	37,723.66	711,712,298.90	9.61%	6,693,479,671.06	90.39%
易方达货币 B	482	295,621,711.15	138,484,078.47	97.19%	4,005,586,295.42	2.81%
易方达货币 E	23,894	2,265,181.02	40,455,497,334.17	74.75%	13,668,738,002.82	25.25%
合计	220,677	924,514.53	179,651,288,111.53	88.06%	24,367,803,969.30	11.94%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	华泰证券—中国结算—华泰紫金天天发集合资产管理计划	30,002,859.00	5.54%
2	招商证券股份有限公司	27,983,264.00	5.17%

3	瑞士信贷(香港)有限公司	17,706,900.00	3.27%
4	长安基金—浦发银行—深圳平安大华汇通财富管理有限公司	9,998,552.00	1.85%
5	中国银河证券股份有限公司	8,710,219.00	1.61%
6	兴业证券股份有限公司	7,000,751.00	1.29%
7	齐鲁证券有限公司	5,700,968.00	1.05%
8	中信建投基金—广发银行—中信建投—熙健稳赢 5 号资产管理计划	5,000,476.00	0.92%
9	中诚信托有限责任公司	5,000,000.00	0.92%
10	上海汽车集团财务有限责任公司	4,970,493.00	0.92%

注：本表统计的上市基金前十名持有人为场内 E 类份额持有人。

9.3 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	易方达货币 A	6,752,013.02	0.0912%
	易方达货币 B	0.00	0.0000%
	易方达货币 E	0.00	0.0000%
	合计	6,752,013.02	0.0033%

9.4 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	易方达货币 A	>100
	易方达货币 B	0
	易方达货币 E	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达货币 A	0~10
	易方达货币 B	0
	易方达货币 E	0
	合计	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达货币 A	易方达货币 B	易方达货币 E
基金合同生效日（2005 年 2 月 2 日）	3,622,219,215.04	-	-

基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	6,172,483,115.14	37,405,101,691.16	139,160,925.70
本报告期基金总申购份额	55,141,555,085.59	680,325,129,493.81	63,402,084,744.45
减：本报告期基金总赎回份额	53,908,846,230.77	575,240,566,411.09	9,417,010,333.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	7,405,191,969.96	142,489,664,773.88	54,124,235,336.99

注：A 类和 B 类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

2015 年 6 月 2 日，本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作，公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

2015 年 4 月，李爱华先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 11 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 120,000.00 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

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
国泰君安	1	-	-	80,000.00	100.00%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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
国泰君安	-	-	100,216,700,000.00	99.50%	-	-
平安证券	-	-	503,248,000.00	0.50%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

11.9 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	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加吴江农村商业银行销售机构、在吴江农村商业银行推出定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-13
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加龙湾农商银行为销售机构、在龙湾农商银行推出定期定额投资业务及参加龙湾农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-15
3	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加上海证券为销售机构、在上海证券推出定期定额投资业务及参加上海证券申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-19
4	易方达基金管理有限公司关于开通易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金与旗下部分开放式基金场外基金份额之间转换业务及与易方达货币市场基金之间赎回转申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-23
5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-01-26
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加长安银行为销售机构、在长安银行推出定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-02
7	易方达货币市场基金春节前两个工作日暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-09
8	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泉州银行为销售机构、在泉州银行推出定期定额投资业务及参加泉州银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-10
9	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-02-17
10	易方达基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-20

11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信建投期货为销售机构、在中信建投期货推出定期定额投资业务及参加中信建投期货申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-23
12	易方达基金管理有限公司关于调整在交通银行的货币基金实时提现业务适用范围的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-26
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞丰银行为销售机构、在瑞丰银行推出定期定额投资业务及参加瑞丰银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-03-30
14	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加利得基金为销售机构、参加利得基金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-10
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加昆仑银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-23
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加洛阳银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-24
17	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加恒丰银行为销售机构、参加恒丰银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-28
18	易方达基金管理有限公司关于成立易方达国际控股有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-29
19	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加天津银行为销售机构、参加天津银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-04-30
20	易方达基金管理有限公司关于开通易方达深证 100 交易型开放式指数基金与旗下部分开放式基金场外基金份额之间转换业务及与易方达货币市场基金之间赎回转申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-05-20
21	易方达基金管理有限公司对市场上出现假冒公司客服电话进行诈骗活动的特别提示	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-06-11
22	易方达基金管理有限公司关于公司、高管及基金经理投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-07
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汇付金融为销售机构、参加汇付金融申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-22
24	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2015-07-27

	式基金增加河北银行为销售机构、参加河北银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加贵阳银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-07-30
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鑫鼎盛为销售机构、参加鑫鼎盛申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-05
27	关于易方达基金管理有限公司子公司变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-05
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中信期货为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-12
29	易方达货币市场基金在中国人民抗日战争暨世界反法西斯战争胜利 70 周年纪念日前两个工作日暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-25
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加乐清农商银行作为销售机构、参加乐清农商银行申购及定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-08-27
31	易方达基金管理有限公司关于开通易方达中证 500 交易型开放式指数证券投资基金与旗下部分开放式基金场外基金份额之间转换业务及与易方达货币市场基金之间赎回转申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-15
32	易方达基金管理有限公司关于降低易方达货币市场基金 A 类基金份额申购单笔最低金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-15
33	易方达基金管理有限公司关于易方达货币市场基金直销渠道赎回业务办理时间调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-16
34	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加济安财富为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-21
35	易方达基金管理有限公司关于新增易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-22
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加新浪仓石为销售机构、参加新浪仓石申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-09-22
37	易方达基金管理有限公司关于新增招商证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-12

38	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加盈米财富为销售机构、参加盈米财富申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-12
39	易方达基金管理有限公司关于新增银河证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-14
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加积木基金为销售机构、参加积木基金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-15
41	易方达基金管理有限公司关于新增易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-21
42	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加陆金所资管为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-21
43	易方达基金管理有限公司关于新增易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-22
44	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加临海农商银行作为销售机构、参加临海农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-23
45	易方达基金管理有限公司关于新增易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-10-29
46	易方达基金管理有限公司关于新增国泰君安证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-02
47	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加联泰资产为销售机构、参加联泰资产申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-02
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加恒泰证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-04
49	易方达基金管理有限公司关于设立大连分公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-04
50	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在民族证券开通定期定额投资业务并参加民族证券定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-05
51	易方达基金管理有限公司关于新增恒泰证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-05

52	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加德阳银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-06
53	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鹿城农商银行为销售机构、参加鹿城农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-06
54	易方达基金管理有限公司关于新增易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-10
55	易方达基金管理有限公司关于易方达货币市场基金 E 类基金份额证券交易佣金设置为零的证券公司名单的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-10
56	易方达基金管理有限公司关于新增华福证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-12
57	易方达基金管理有限公司关于新增中投证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-16
58	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加凯石财富为销售机构、参加凯石财富申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-20
59	易方达基金管理有限公司关于新增易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-25
60	易方达基金管理有限公司关于新增东兴证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-11-27
61	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加联讯证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-02
62	易方达基金管理有限公司关于新增平安证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-03
63	易方达基金管理有限公司关于新增华泰证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-09
64	易方达基金管理有限公司关于新增浙商证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-14
65	易方达基金管理有限公司关于新增国信证券为易方达货币市场基金 E 类基金份额申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-15
66	关于易方达基金管理有限公司北京直销中心	中国证券报、上海证券	2015-12-18

	办公地址变更的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
67	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大泰金石为销售机构、参加大泰金石申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-21
68	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加新昌农商银行作为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-31
69	易方达基金管理有限公司关于在深圳新兰德开通旗下部分开放式基金定期定额投资及转换业务、参加深圳新兰德定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2015-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准易方达货币市场基金设立的文件；
2. 《易方达货币市场基金基金合同》；
3. 《易方达货币市场基金托管协议》；
4. 《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 基金管理人业务资格批件和营业执照。

12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

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。

易方达基金管理有限公司

二〇一六年三月二十五日