易方达货币市场基金

2016 年年度报告摘要

2016 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：二〇一七年三月三十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月27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2016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	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	60,099,951,881.28 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	4,018,345,718.21 份	51,533,039,311.78 份	4,548,566,851.29 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

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.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

§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	2016年			2015年			2014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	75,437,331.58	1,599,029,600.72	365,634,588.45	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
本期利润	75,437,331.58	1,599,029,600.72	365,634,588.45	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
本期净值收益率	2.4393%	2.6859%	2.4373%	3.1206%	3.3685%	3.1180%	4.8261%	5.0776%	0.4792%
3.1.2 期末数据和指标	**2016年末**			**2015年末**			**2014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	4,018,345,718.21	51,533,039,311.78	4,548,566,851.29	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
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

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.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，增设当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	0.6695%	0.0012%	0.0880%	0.0000%	0.5815%	0.0012%
过去六个月	1.2748%	0.0015%	0.1761%	0.0000%	1.0987%	0.0015%
过去一年	2.4393%	0.0013%	0.3506%	0.0000%	2.0887%	0.0013%
过去三年	10.7340%	0.0098%	1.0550%	0.0000%	9.6790%	0.0098%
过去五年	20.2161%	0.0078%	1.8297%	0.0001%	18.3864%	0.0077%
自基金合同生效起至今	43.5494%	0.0071%	13.1826%	0.0032%	30.3668%	0.0039%

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	0.7299%	0.0012%	0.0880%	0.0000%	0.6419%	0.0012%
过去六个月	1.3968%	0.0015%	0.1761%	0.0000%	1.2207%	0.0015%
过去一年	2.6859%	0.0013%	0.3506%	0.0000%	2.3353%	0.0013%
过去三年	11.5344%	0.0098%	1.0550%	0.0000%	10.4794%	0.0098%
过去五年	21.6657%	0.0078%	1.8297%	0.0001%	19.8360%	0.0077%
自基金合同生效起至今	42.7044%	0.0074%	10.5396%	0.0033%	32.1648%	0.0041%

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	0.6685%	0.0012%	0.0880%	0.0000%	0.5805%	0.0012%

过去六个月	1.2735%	0.0015%	0.1761%	0.0000%	1.0974%	0.0015%
过去一年	2.4373%	0.0013%	0.3506%	0.0000%	2.0867%	0.0013%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	6.1376%	0.0048%	0.7363%	0.0000%	5.4013%	0.0048%

注：1.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。

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，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

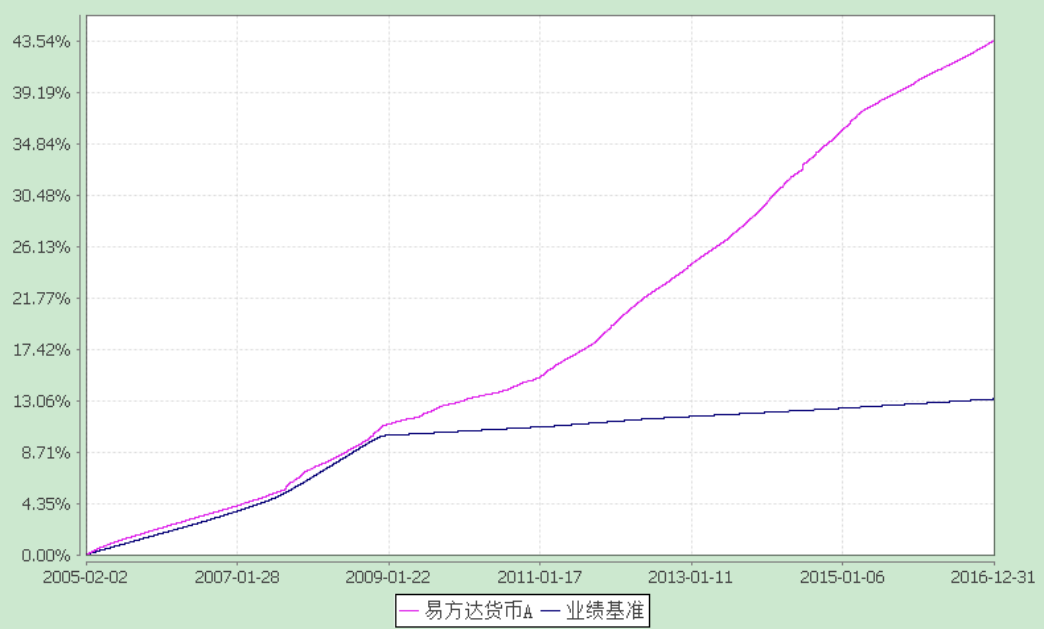
易方达货币市场基金

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 2016 年 12 月 31 日）

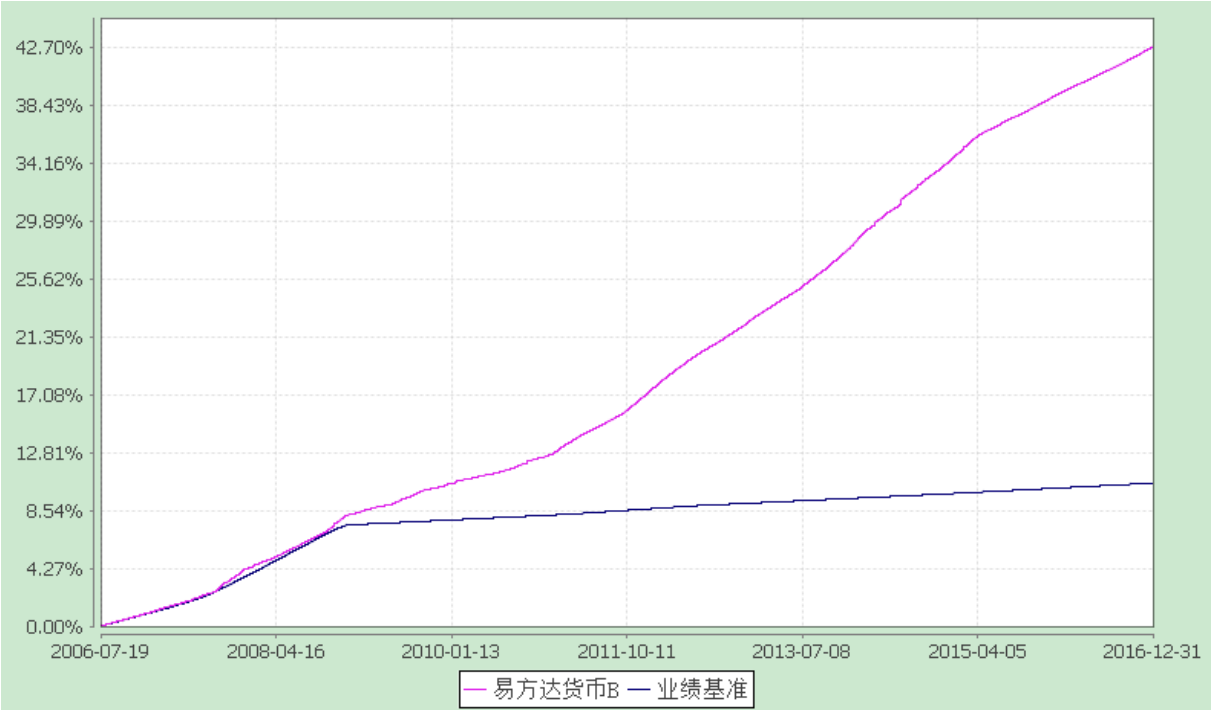
易方达货币 A

（2005 年 2 月 2 日至 2016 年 12 月 31 日）



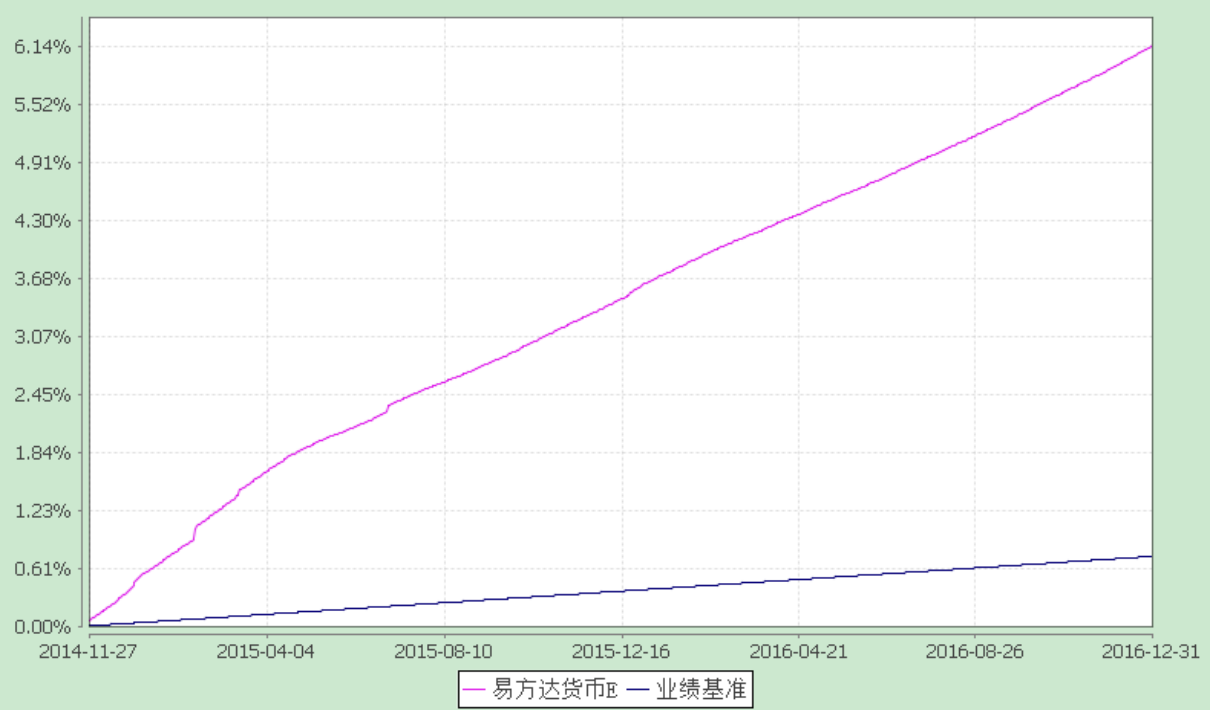
易方达货币 B

（2006 年 7 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日）



易方达货币 E

（2014 年 11 月 27 日至 2016 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－利息税率）×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×(1－利息税率))”。

2.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。

3.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，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

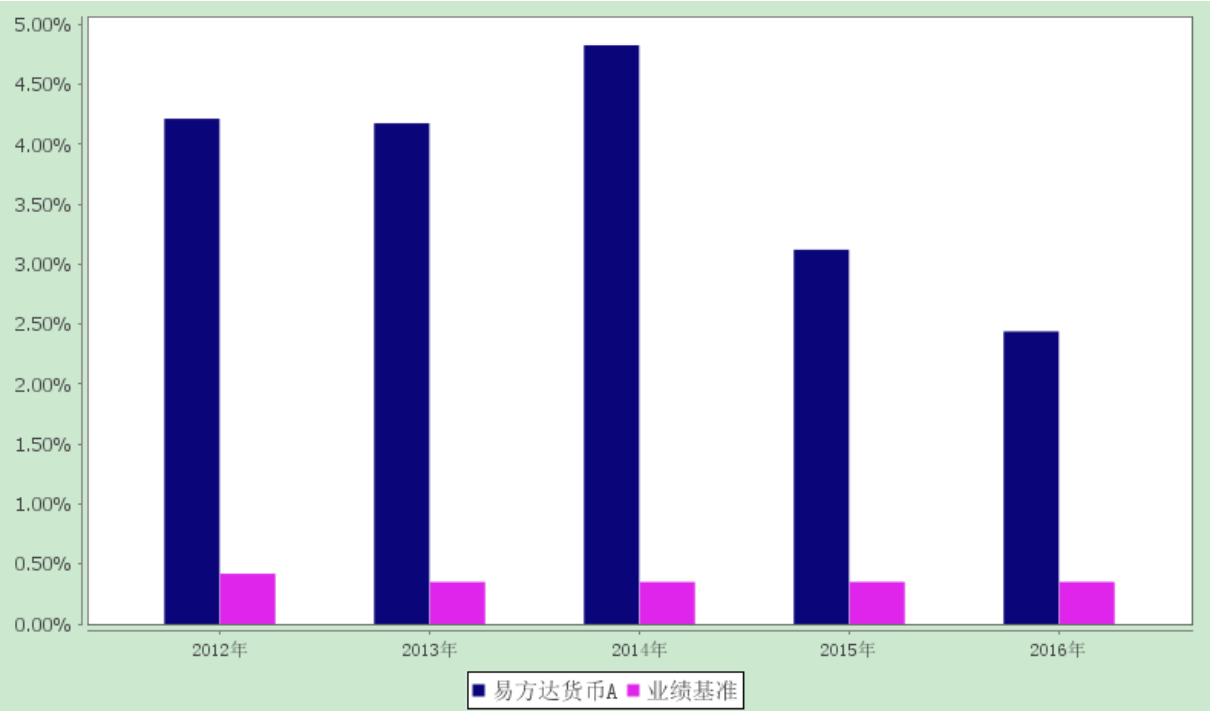
4.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值收益率为 43.5494%，同期业绩比较基准收益率为 13.1826%。B 类基金份额净值收益率为 42.7044%，同期业绩比较基准收益率为 10.5396%。E 类基金份额净值收益率为 6.1376%，同期业绩比较基准收益率为 0.7363%。

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

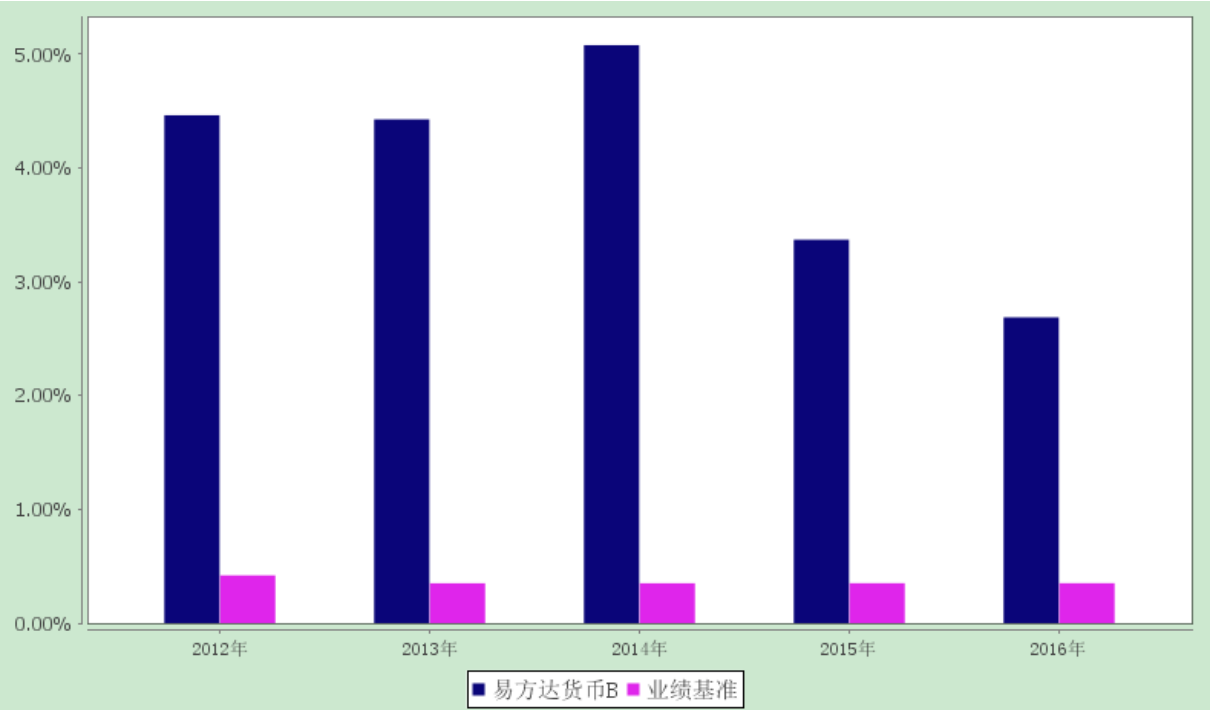
易方达货币市场基金

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

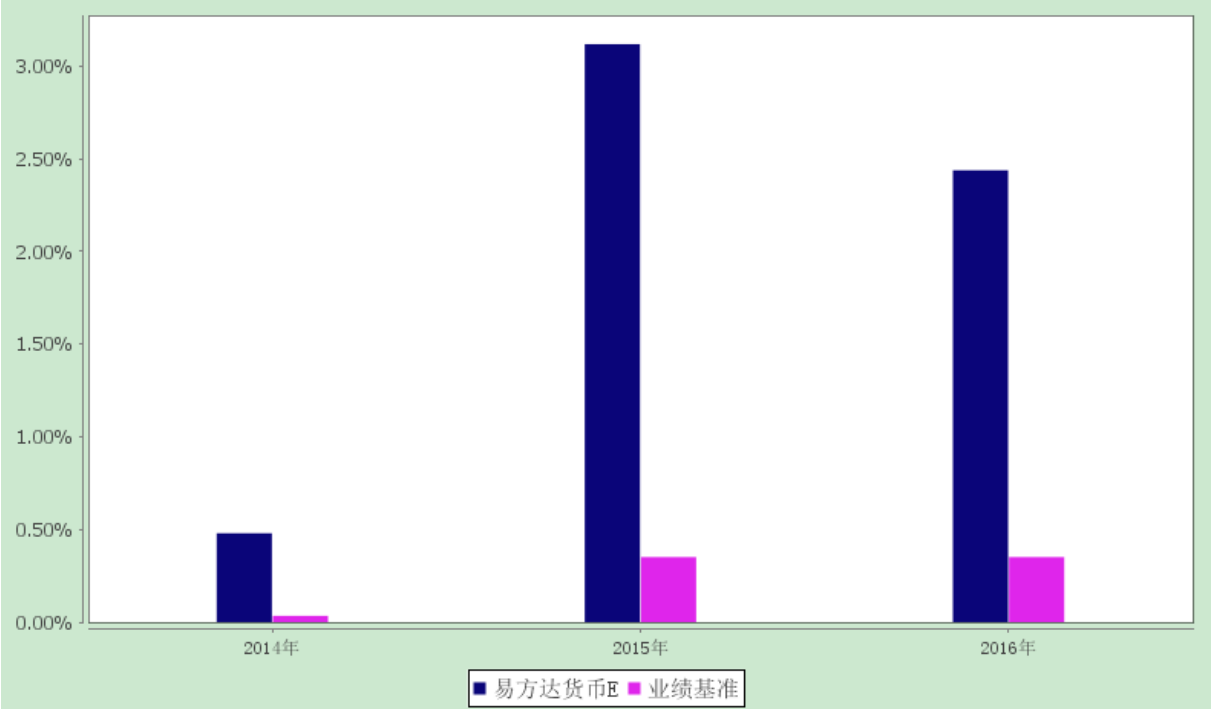
易方达货币 A



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，份额申购首次确认日为 2014 年 11 月 27 日，增设当期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
2016年	75,124,185.47	-	313,146.11	75,437,331.58	-
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	-
合计	509,153,443.68	718,136.63	-21,901,457.66	487,970,122.65	-

易方达货币B

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
2016年	1,598,548,152.10	-	481,448.62	1,599,029,600.72	-
2015年	1,881,506,966.62	-	1,576,485.37	1,883,083,451.99	-
2014年	1,644,292,490.33	207,056,883.16	-24,202,570.34	1,827,146,803.15	-
合计	5,124,347,609.05	207,056,883.16	-22,144,636.35	5,309,259,855.86	-

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
2016年	368,547,735.95	-	-2,913,147.50	365,634,588.45	-
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	626,248.97	-	33,627.02	659,875.99	-

效日）至2014年12月31日					
合计	494,659,329.37	-	954,265.38	495,613,594.75	-

§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（简称“易方达”）成立于2001年4月17日，旗下设有北京、广州、上海、成都、大连、南京等六个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。2012年10月，易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016年12月，易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至2016年12月31日，公司旗下管理的各类资产总规模10491亿元，其中公募基金规模4283亿元，公募基金规模排名连续12年保持在行业前五名，服务客户超过5000万户，公司净资产66亿元，在国内资产管理行业具有领先的市场地位和综合实力。

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、易方达月月利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	2013-04-22	-	7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

	基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利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、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达财富快线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、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理				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、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达月月利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、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、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	2015-02-17	-	6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》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2016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29次，其中26次为旗下指数及量化组合因

投资策略需要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

2016年全年国内生产总值(GDP)增长6.7%。具体来看，一季度经济出现较多积极因素，进入二、三季度之后，增长略显乏力，但微观数据下半年开始逐渐走强，并从四季度的主要经济指标中逐步反映出来。投资方面，一季度投资数据受十三五开年计划的影响较为强劲，但经济增长依然内生乏力。受到制造业投资的拖累，以及地产投资持续维持在低位的影响，二季度投资数据大幅下滑。三季度制造业投资企稳，随后在基建投资的持续发力下，四季度投资数据整体呈现出较为强劲的企稳迹象。受到2016年初以来房地产去库存政策的影响，地产销售数据出现了较大幅度的上涨，在9月30日之后，十六个重点城市依次推出了相应的地产调整政策，调控城市的销售金额和销量大幅下滑。但是全年房地产投资保持了相对平稳的走势，受销售的波动影响较小。全年来看，通胀比较温和。中上游价格则呈现大幅上涨的态势，但是对下游传导较弱。

2016年全年债券市场出现了较大幅度震荡，无风险收益方面，由于一季度的经济预期较好和信用事件冲击，债券市场收益率4月份出现了快速上行。此后英国退欧事件引发避险情绪及货币宽松预期上升，伴随6月末配置需求开始释放，推动收益率再度明显下行，中长端利率债收益率一度快速下行。四季度经济复苏预期增强伴随着海外利率上升造成的冲击，11月以来银行间市场流动性不断收紧，导致货币市场利率持续攀升。在债市收益率上升的背景下，由于资产端收缩传导的链条较长，去杠杆过程带来的市场调整剧烈程度超出预期，货币市场、债券市场利率均出现大幅上行。12月下旬在汇率贬值压力减轻，央行投放流动性后市场情绪出现缓解，短期和长期收益率出现快速下行，信用债调整较为缓慢，信用利差扩大。

报告期内，基金的运作仍以保证资产的流动性为首要任务，降低了短期融资券的配置比例，降低了组合的剩余期限，并提高了现金资产的配置比例。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2.4393%；B类基金份额净值收益率为2.6859%；E类基金份额净值收益率为2.4373%；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

随着债券市场利率的快速上行，站在当前节点我们对于2017年的债券市场可以更加乐观。从基本面上来看，当前支撑经济稳定的主要动力是基建和房地产投资。基建投资依赖于稳增长的意愿，

中央经济工作会议中对于稳增长的表态明显弱化，这意味着2017年基建投资难以出现显著增长，甚至存在一定的退出风险。房地产投资在短期之内由于补库存需要仍然可以保持稳定，但是考虑到房地产新政和利率抬升对于房地产销售的系统性抑制，2017年下半年可能将会看到房地产库存的堆积和投资的下滑，届时将会再次对经济产生较大的拖累。此外过去两年实体经济明显受益于低利率和宽松的融资环境，当前货币边际收紧导致广谱利率的抬升对于制造业投资的抑制作用也将在未来一年逐步显现，这也会对经济产生一定的负面影响。另一方面通胀相对温和，由于居民收入的持续下滑，工业品价格的上涨很难对通胀产生明显的传导，而如果下半年经济下滑，通缩压力将会再次显现。基于对经济增长和通胀的判断，我们认为货币政策可能会在一到两个季度内保持偏紧态势，利率可能会处于高位震荡，但是随着经济和通胀的回落，货币宽松的窗口有望再次打开，利率将重回下行趋势。不确定性仍然在于美国经济的回暖力度，这将会对货币政策和利率下行的节奏产生较大的扰动和影响。综上来看，短期内债券市场仍然处于震荡格局，但是全年来看利率仍存在较大的下行压力，考虑到国内外环境存在一定的不确定性，债券市场波动也会显著放大。

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。

4.7 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》，本基金每日将各类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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	22,372,494,252.58	102,033,987,358.40

结算备付金	771,240,927.27	8,194,194,000.00
存出保证金	-	-
交易性金融资产	17,693,299,297.60	65,149,222,078.35
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	17,693,299,297.60	65,149,222,078.35
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	17,684,936,898.72	27,378,875,810.61
应收证券清算款	-	20,149,513.66
应收利息	116,911,022.80	631,990,389.87
应收股利	-	-
应收申购款	1,551,383,379.86	4,690,318,339.13
递延所得税资产	-	-
其他资产	12,500.00	80,000.00
资产总计	60,190,278,278.83	208,098,817,490.02

负债和所有者权益	**本期末** **2016年12月31日**	**上年度末** **2015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	-	3,815,397,930.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	53,598,688.09	204,031,682.72
应付管理人报酬	15,271,900.42	28,991,720.06
应付托管费	4,627,848.62	8,785,369.71
应付销售服务费	1,932,042.71	5,440,361.34
应付交易费用	569,810.87	478,498.38

应交税费	315,450.00	315,450.00
应付利息	-	232,541.61
应付利润	13,253,797.28	15,372,350.05
递延所得税负债	-	-
其他负债	756,859.56	679,505.32
负债合计	**90,326,397.55**	**4,079,725,409.19**
所有者权益：		
实收基金	60,099,951,881.28	204,019,092,080.83
未分配利润	-	-
所有者权益合计	**60,099,951,881.28**	**204,019,092,080.83**
负债和所有者权益总计	**60,190,278,278.83**	**208,098,817,490.02**

注：报告截止日2016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60,099,951,881.28份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额4,018,345,718.21份，B类基金份额总额51,533,039,311.78份，E类基金份额总额4,548,566,851.29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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	**本期** 2016年1月1日至2016年12月31日	**上年度可比期间** 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入	**2,563,870,663.31**	**2,571,824,471.37**
1.利息收入	2,941,620,813.91	2,754,319,590.72
其中：存款利息收入	1,276,183,984.00	1,274,783,682.72
债券利息收入	1,489,644,313.40	1,289,038,478.18
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	175,792,516.51	190,497,429.82
其他利息收入	-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）	-377,790,255.10	-182,495,119.35
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-377,790,255.10	-182,495,119.35
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）	40,104.50	-
减：二、费用	**523,769,142.56**	**422,914,673.31**
1．管理人报酬	263,675,204.50	237,920,104.50
2．托管费	79,901,577.18	72,097,001.33
3．销售服务费	52,987,564.92	27,990,643.22
4．交易费用	-	-
5．利息支出	126,240,182.21	83,905,450.64
其中：卖出回购金融资产支出	126,240,182.21	83,905,450.64
6．其他费用	964,613.75	1,001,473.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	**2,040,101,520.75**	**2,148,909,798.06**
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	**2,040,101,520.75**	**2,148,909,798.06**

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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期

	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）	204,019,092,080.83	-	204,019,092,080.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,040,101,520.75	2,040,101,520.75
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）	-143,919,140,199.55	-	-143,919,140,199.55
其中：1.基金申购款	537,666,420,329.00	-	537,666,420,329.00
2.基金赎回款	-681,585,560,528.55	-	-681,585,560,528.55
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）	-	-2,040,101,520.75	-2,040,101,520.75
五、期末所有者权益（基金净值）	60,099,951,881.28	-	60,099,951,881.28
项目	**上年度可比期间** 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	-	-2,148,909,798.06	-2,148,909,798.06

分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	204,019,092,080.83	-	204,019,092,080.83

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 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。

7.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6税项

(1)印花税

证券（股票）交易印花税税率为1‰，由出让方缴纳。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2)营业税、增值税、企业所得税

以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

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，免征营业税。

自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税；买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

(3)个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，减按25%计入应纳税所得额；自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7 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

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 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。

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	263,675,204.50	237,920,104.50
其中：支付销售机构的客户维护费	7,955,565.90	6,896,578.97

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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	79,901,577.18	72,097,001.33

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。

7.4.8.2.3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 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			
	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	1,594,044.71	5,776,734.23	14,317,972.88	21,688,751.82

中国银行	907,340.59	5,658.96	-	912,999.55
广发证券	304,170.41	98,885.06	1,096,246.93	1,499,302.40
合计	2,805,555.71	5,881,278.25	15,414,219.81	24,101,053.77

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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。

7.4.8.3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 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	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	-	680,016,863.15	-	-	72,236,874,000.00	5,282,222.80
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日						
银行间市场	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

交易的各关联方名称	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	238,155,082.94	2,500,000,000.00	1,187,921.10	83,852,300,000.00	5,159,053.36

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日			上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	-	-	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-	150,016,555.23	-
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	-
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。

7.4.8.4.2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 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	持有的	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额占

	基金份额	占基金总份额的比例	基金份额	基金总份额的比例
易方达资产管理有限公司	1,018,351.93	0.03%	8,016,325.57	0.11%
广东省易方达教育基金会	795,925.86	0.02%	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 2016年12月31日		上年度末 2015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	500,000,000.00	0.97%	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 2016年12月31日		上年度末 2015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%
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。

7.4.8.5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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	1,862,494,252.58	119,921,428.36	545,987,358.40	18,240,651.83

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。

7.4.8.6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 2016年1月1日至2016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
广发证券	011699195	16淮南矿SCP002	分销	1,500,000	149,921,250.00
上年度可比期间 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

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1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。

7.4.9.2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股票。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016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为0，无抵押债券。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016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。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金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中属于第二层次的余额为17,693,299,297.60元，无属于第一或第三层次的余额(2015年12月31日：第二层次65,149,222,078.35元，无属于第一或第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	17,693,299,297.60	29.40
	其中：债券	17,693,299,297.60	29.40
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	17,684,936,898.72	29.38
	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	23,143,735,179.85	38.45
4	其他各项资产	1,668,306,902.66	2.77
5	合计	60,190,278,278.83	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	8.70
	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	-	-
	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	70
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	107
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	42.47	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.63	-
2	30天（含）—60天	6.47	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.74	-
3	60天（含）—90天	12.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	13.48	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	22.09	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		97.37	-

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

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

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	3,598,375,455.65	5.99
	其中：政策性金融债	3,598,375,455.65	5.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	14,094,923,841.95	23.45
8	其他	-	-
9	合计	17,693,299,297.60	29.44
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	2,025,126,329.67	3.37

8.6 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	150214	15国开14	16,000,000	1,583,164,506.46	2.63
2	111617322	16光大CD322	10,000,000	979,933,280.87	1.63
3	111609365	16浦发CD365	10,000,000	960,866,960.88	1.60
4	160419	16农发19	5,400,000	536,703,001.21	0.89

5	111611204	16平安CD204	5,000,000	496,203,555.17	0.83
6	111610269	16兴业CD269	5,000,000	495,889,259.91	0.83
7	111608322	16中信CD322	5,000,000	494,497,419.30	0.82
8	111608251	16中信CD251	5,000,000	491,737,000.74	0.82
9	111611333	16平安CD333	5,000,000	490,960,445.92	0.82
10	111617233	16光大CD233	5,000,000	485,501,100.32	0.81

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	112
报告期内偏离度的最高值	0.4697%
报告期内偏离度的最低值	0.0167%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2476%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在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

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到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名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 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。

8.9.216 浦发CD365（代码：111609365）为易方达货币市场基金的前十大持仓证券。2016年6月17日，针对浦发银行在天猫上以虚假价格进行促销的行为，上海市物价局给予警告并处人民币5000元罚款的行政处罚。

本基金投资16浦发CD365的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除16浦发CD365外，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。

8.9.3 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	116,911,022.80
4	应收申购款	1,551,383,379.86
5	其他应收款	12,500.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,668,306,902.66

§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	178,092	22,563.31	617,997,753.92	15.38%	3,400,347,964.29	84.62%
易方达货币B	278	185,370,645.01	50,399,441,963.31	97.80%	1,133,597,348.47	2.20%
易方达货币E	5,042	902,135.43	3,114,615,678.	68.47%	1,433,951,172.	31.53%

			48		81	
合计	183,412	327,677.32	54,132,055,395.71	90.07%	5,967,896,485.57	9.93%

9.2 期末上市基金前十名持有人

易方达货币E

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中诚信托有限责任公司	2,335,500.00	5.14%
2	易方达基金－建设银行－中国人寿－中国人寿委托易方达基金公司混合型组合	2,048,761.00	4.51%
3	国信证券股份有限公司	1,483,936.00	3.26%
4	宁波康科德投资发展有限公司	1,480,312.00	3.26%
5	易方达基金－农业银行－中油财务有限责任公司	1,343,499.00	2.95%
6	麦格理银行有限公司－自有资金	1,200,081.00	2.64%
7	文登市森鹿制革有限公司	1,000,259.00	2.20%
8	凉山州国有投资发展有限责任公司	1,000,001.00	2.20%
9	四川国栋建设集团有限公司	1,000,000.00	2.20%
10	金元顺安基金－广发证券－吉富 1 号广发金元顺安资产管理计划	984,411.00	2.16%

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	1,296,331.71	0.0323%
	易方达货币 B	0.00	0.0000%
	易方达货币 E	0.00	0.0000%

	合计	1,296,331.71	0.0022%

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）基金份额总额	3,622,219,215.04	-	-
本报告期期初基金份额总额	7,405,191,969.96	142,489,664,773.88	54,124,235,336.99
本报告期基金总申购份额	23,473,761,701.80	488,985,640,391.25	25,207,018,235.95
减：本报告期基金总赎回份额	26,860,607,953.55	579,942,265,853.35	74,782,686,721.65
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	4,018,345,718.21	51,533,039,311.78	4,548,566,851.29

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

本基金管理人于 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司

董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理；于2016年8月27日发布公告，自2016年8月27日起聘任吴欣荣先生担任公司副总经理。

2016年12月，郭德秋先生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12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、个股分析的报告及丰富全面

的信息服务；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	-	-	390,545,100,000.00	100.00%	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
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。

易方达基金管理有限公司

二〇一七年三月三十一日