

**易方达易理财货币市场基金**  
**2019 年半年度报告**  
**2019 年 6 月 30 日**

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十四日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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 .....                                  | 4  |
| 2.1 基金基本情况 .....                              | 4  |
| 2.2 基金产品说明 .....                              | 4  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 .....                         | 5  |
| 2.4 信息披露方式 .....                              | 5  |
| 2.5 其他相关资料 .....                              | 5  |
| 3 主要财务指标和基金净值表现 .....                         | 5  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 .....                         | 5  |
| 3.2 基金净值表现 .....                              | 6  |
| 4 管理人报告 .....                                 | 7  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 .....                        | 7  |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....              | 9  |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....                 | 10 |
| 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 .....             | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....             | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....                | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....                 | 12 |
| 5 托管人报告 .....                                 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....                  | 12 |
| 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 ..... | 12 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....     | 12 |
| 6 半年度财务会计报告（未经审计） .....                       | 12 |
| 6.1 资产负债表 .....                               | 12 |
| 6.2 利润表 .....                                 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....                      | 15 |
| 6.4 报表附注 .....                                | 16 |
| 7 投资组合报告 .....                                | 33 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 .....                          | 33 |
| 7.2 债券回购融资情况 .....                            | 33 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限 .....                        | 34 |
| 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....         | 34 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                    | 35 |
| 7.6 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 .....      | 35 |
| 7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....           | 35 |
| 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明 .....                | 36 |
| 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明 .....                 | 36 |
| 7.8 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 .....  | 36 |
| 7.9 投资组合报告附注 .....                            | 36 |
| 8 基金份额持有人信息 .....                             | 38 |

|   |    |
|---|----|
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....             | 38 |
| 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....            | 38 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....          | 39 |
| 8.4 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 ..... | 39 |
| 9 开放式基金份额变动 .....                       | 39 |
| 10 重大事件揭示 .....                         | 39 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                  | 39 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....  | 40 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 40 |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                    | 40 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 40 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....     | 40 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 40 |
| 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....             | 42 |
| 10.9 其他重大事件 .....                       | 42 |
| 11 备查文件目录 .....                         | 42 |
| 11.1 备查文件目录 .....                       | 42 |
| 11.2 存放地点 .....                         | 42 |
| 11.3 查阅方式 .....                         | 43 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                      |
|------------|----------------------|
| 基金名称       | 易方达易理财货币市场基金         |
| 基金简称       | 易方达易理财货币             |
| 基金主代码      | 000359               |
| 交易代码       | 000359               |
| 基金运作方式     | 契约型开放式               |
| 基金合同生效日    | 2013 年 10 月 24 日     |
| 基金管理人      | 易方达基金管理有限公司          |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司         |
| 报告期末基金份额总额 | 162,163,426,579.62 份 |
| 基金合同存续期    | 不定期                  |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。                                 |
| 投资策略   | 本基金利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。 |
| 业绩比较基准 | 中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）   |

|        |  |
|--------|--|
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 |
|--------|--|

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                            | 基金托管人               |
|-------------|------|----------------------------------|---------------------|
| 名称          |      | 易方达基金管理有限公司                      | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张南                               | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 020-85102688                     | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn            | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088                     | 95588               |
| 传真          |      | 020-85104666                     | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-42891（集中办公区） | 北京市西城区复兴门内大街55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55号     |
| 邮政编码        |      | 510620                           | 100140              |
| 法定代表人       |      | 刘晓艳                              | 陈四清                 |

### 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   |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a> |
| 基金半年度报告备置地点          | 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                          |
|--------|-------------|-------------------------------|
| 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40-43楼 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日) |
|---------------|---------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,413,439,051.52                      |
| 本期利润          | 2,413,439,051.52                      |
| 本期净值收益率       | 1.3654%                               |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                 |
| 期末基金资产净值      | 162,163,426,579.62                    |
| 期末基金份额净值      | 1.0000                                |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2019 年 6 月 30 日)                 |
| 累计净值收益率       | 24.8455%                              |

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

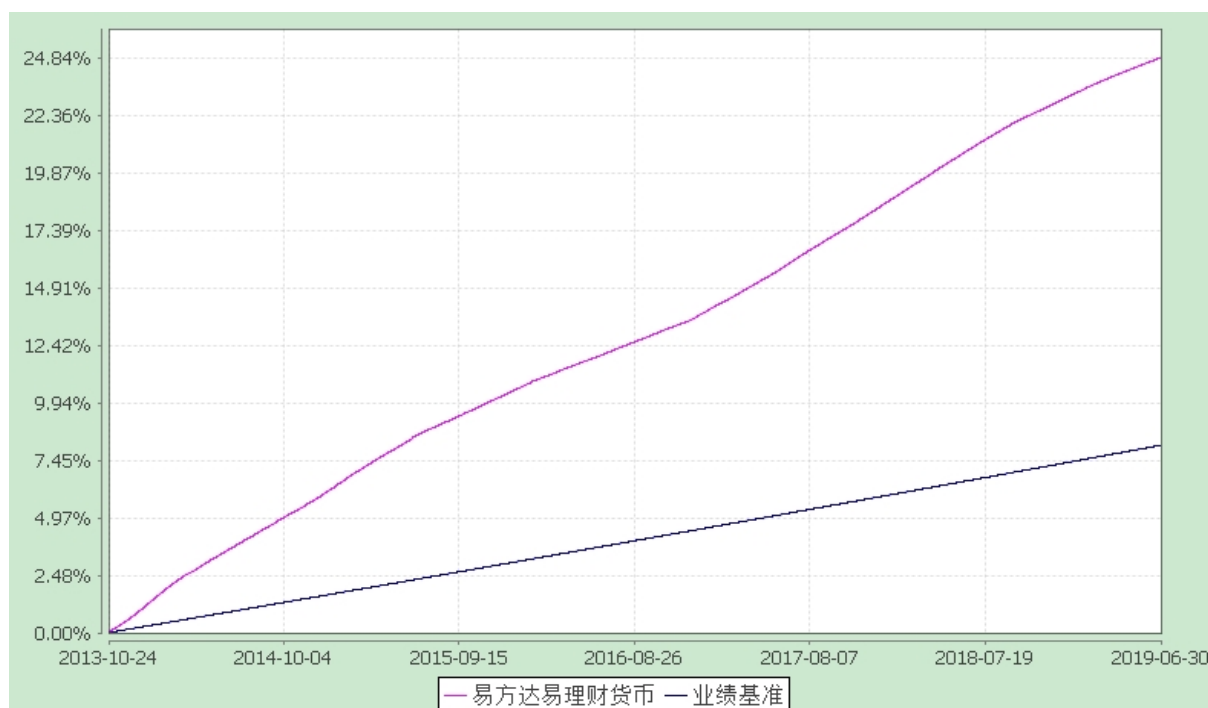
| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③      | ②-④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去一个月      | 0.2073%  | 0.0002%     | 0.1126%    | 0.0000%       | 0.0947%  | 0.0002% |
| 过去三个月      | 0.6373%  | 0.0003%     | 0.3418%    | 0.0000%       | 0.2955%  | 0.0003% |
| 过去六个月      | 1.3654%  | 0.0007%     | 0.6810%    | 0.0000%       | 0.6844%  | 0.0007% |
| 过去一年       | 3.1416%  | 0.0014%     | 1.3781%    | 0.0000%       | 1.7635%  | 0.0014% |
| 过去三年       | 11.4090% | 0.0020%     | 4.1916%    | 0.0000%       | 7.2174%  | 0.0020% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.8455% | 0.0036%     | 8.0959%    | 0.0000%       | 16.7496% | 0.0036% |

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

易方达易理财货币市场基金

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

(2013 年 10 月 24 日至 2019 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值收益率为 24.8455%，同期业绩比较基准收益率为 8.0959%。

## 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，总部设在广州，在北京、上海、广州、成都、大连等地设有分公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终专注于资产管理业务，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，是国内基金行业为数不多的“全牌照”公司之一，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局。

#### 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、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、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、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达天天发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（自 2013 年 01 月 15 日至 2019 年 05 月 27 日）、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达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、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、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（自 2016 年 06 月 02 日至 2019 年 06 月 27 日）、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理 | 2013-10-24 | -    | 10 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。                    |
| 刘朝阳 | 本基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、现金管理部总经理   | 2016-02-19 | -    | 12 年 | 硕士研究生，曾任南方基金管理有限公司固定收益研究员、交易员、高级策略分析师、基金经理。                                      |
| 梁莹  | 本基金的基金经理助理、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、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（自 2014 年 09 月 24 日至 2019 年 05 月 27 日）、易方达龙宝货币市场基金的  | 2015-02-17 | -    | 9 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、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理。 |



|        |  |            |   |     |  |
|--------|--|------------|---|-----|--|
|        | 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<br>璪 | 本基金的基金经理助理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理（自 2018 年 06 月 20 日至 2019 年 05 月 27 日）、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达天天发货币市场基金的基金经理助理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理助理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理助理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理助理、易方达天天增利货币市场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助理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达货币市场基金的基金经理助理 | 2018-06-20 | - | 9 年 | 硕士研究生，曾任汇添富基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司高级债券交易员。 |

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人规定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 62 次，其中 61 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易；1 次为不同基金经理管理的基金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。

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。

### 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

2019 年上半年，国内债券市场收益率先下后上，对国内经济基本面预期的变化和信用风险的波动是驱动债券市场走势的核心因素。春节前，市场资金面宽松，经济下行压力较大，加之美联储加息受阻等因素的影响，国内债券市场收益率快速下行。尽管在 2 月份收益率出现小幅回升，总体来看，一季度债市收益率震荡下行。4 月份公布的一季度经济数据表现较好，市场对通胀的预期升温，加之央行重提“把好货币总闸门”，市场对货币收紧的担忧上升，债券市场收益率上行。5 月，中美贸易摩擦变化超预期，央行定向降准，债券市场收益率重回下行通道，信用利差整体收窄。5 月下旬发生的银行信用风险事件推动市场风险偏好进一步下降，中低评级信用利差开始明显走阔。6 月以来，经济基本面继续有利于债券市场，整体来看二季度债券市场收益率呈现先上后下的走势。货币市场收益率跟随债市大环境波动，上半年也呈现震荡下行的走势，回购利率在 6 月末达到了近年来的低点。受此影响，货币市场基金收益率继续下行。

操作方面，报告期内本基金以同业存款存单、现券和逆回购为主要配置资产。组合灵活调整久期，控制久期风险，把握市场配置机会。总体来看，组合保持了较高的流动性和稳定的收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内基金份额净值收益率为 1.3654%；同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观基本面方面，虽然中美贸易摩擦为全球经济都带来了极大的不确定性，但国内经济基本面的后续走势，仍将是驱动国内债券市场的核心变量。国内经济增长尽管存在下行压力，但韧性仍在，且未来政策空间较大。在金融体系资金面仍处于相对宽松的大背景下，经济失速下行的概率较小。展望 2019 年下半年，全球经济景气下滑、货币宽松、中外利差较高、境外资金流入增多等因素都将有利于债券市场投资。

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好的流动性，并将随着经济基本面或货币政策预期的调整，及时调整组合久期。基金投资类属配置将以银行同业存款存单、利率债券、信用债券和短期回购为主。基金管理人始终将基金资产的安全性、流动性和收益的稳定性置于对高收益的追求之上，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、中国证券投资基金业协会相关指引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，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总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，具备投资、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债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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《易方达易理财货币市场基金基金合同》，本基金每日将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，本基金托管人在对易方达易理财货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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，易方达易理财货币市场基金的管理人——易方达基金管理有限公司在易方达易理财货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

#### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达易理财货币市场基金 2019 年半年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：易方达易理财货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产  | 附注号 | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-----|-----|------------------------|--------------------------|
| 资产： |     |                        |                          |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 61,394,154,692.15         | 81,597,015,189.52           |
| 结算备付金           |            | 946,999,500.00            | 132,678,181.82              |
| 存出保证金           |            | -                         | -                           |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 63,905,995,613.70         | 74,110,584,314.28           |
| 其中：股票投资         |            | -                         | -                           |
| 基金投资            |            | -                         | -                           |
| 债券投资            |            | 62,122,165,655.44         | 72,924,067,352.95           |
| 资产支持证券投资        |            | 1,783,829,958.26          | 1,186,516,961.33            |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 43,061,046,048.18         | 23,086,343,799.90           |
| 应收证券清算款         |            | 75,515,402.24             | -                           |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 748,310,379.59            | 876,754,873.81              |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | -                         | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                         | -                           |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>170,132,021,635.86</b> | <b>179,803,376,359.33</b>   |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2019年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2018年12月31日</b> |
| 负债：             |            |                           |                             |
| 短期借款            |            | -                         | -                           |
| 交易性金融负债         |            | -                         | -                           |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                         | -                           |
| 卖出回购金融资产款       |            | 7,889,131,850.47          | 10,260,691,362.12           |
| 应付证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款           |            | -                         | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 36,497,426.79             | 39,006,686.64               |
| 应付托管费           |            | 6,758,782.74              | 7,223,460.47                |
| 应付销售服务费         |            | 33,793,913.69             | 36,117,302.45               |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 580,246.38                | 709,617.92                  |
| 应交税费            |            | 626,250.12                | 610,449.78                  |
| 应付利息            |            | 976,233.96                | 6,955,661.79                |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.8    | 230,352.09                | 330,500.00                  |
| 负债合计            |            | 7,968,595,056.24          | 10,351,645,041.17           |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.9    | 162,163,426,579.62        | 169,451,731,318.16          |
| 未分配利润           | 6.4.7.10   | -                         | -                           |
| 所有者权益合计         |            | 162,163,426,579.62        | 169,451,731,318.16          |
| 负债和所有者权益总计      |            | 170,132,021,635.86        | 179,803,376,359.33          |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 162,163,426,579.62 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达易理财货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 附注号      | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>                |          | <b>3,000,336,613.68</b>                  | <b>3,686,212,343.45</b>                       |
| 1.利息收入                     |          | 3,070,247,626.61                         | 3,695,346,722.47                              |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.11 | 1,224,781,355.84                         | 2,037,680,566.51                              |
| 债券利息收入                     |          | 1,113,174,781.86                         | 1,220,241,436.35                              |
| 资产支持证券利息收入                 |          | 25,267,049.90                            | -   |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 707,024,439.01                           | 437,424,719.61                                |
| 其他利息收入                     |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | -69,911,207.37                           | -9,134,379.02                                 |
| 其中：股票投资收益                  |          | -  | -   |
| 基金投资收益                     |          | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.12 | -69,911,207.37                           | -9,134,379.02                                 |
| 资产支持证券投资收益                 |          | -  | -   |
| 衍生工具收益                     |          | -  | -   |
| 股利收益                       |          | -  | -   |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      |          | -  | -   |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          |          | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 6.4.7.13 | 194.44                                   | -   |
| <b>减：二、费用</b>              |          | <b>586,897,562.16</b>                    | <b>527,520,367.71</b>                         |
| 1. 管理人报酬                   |          | 237,923,030.69                           | 199,437,213.56                                |
| 2. 托管费                     |          | 44,059,820.46                            | 36,932,817.28                                 |
| 3. 销售服务费                   |          | 220,299,102.47                           | 184,664,086.65                                |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.14 | -  | -   |
| 5. 利息支出                    |          | 83,962,343.22                            | 106,080,881.16                                |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 83,962,343.22                            | 106,080,881.16                                |
| 6. 税金及附加                   |          | 418,054.78                               | 80,404.60                                     |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.15 | 235,210.54                               | 324,964.46                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>2,413,439,051.52</b>                  | <b>3,158,691,975.74</b>                       |
| 减：所得税费用                    |          | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>2,413,439,051.52</b>                  | <b>3,158,691,975.74</b>                       |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达易理财货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日      |                   |                     |
|--|--|-------------------|---------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润             | 所有者权益合计             |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 169,451,731,318.16                         | -                 | 169,451,731,318.16  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 2,413,439,051.52  | 2,413,439,051.52    |
| 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）      | -7,288,304,738.54                          | -                 | -7,288,304,738.54   |
| 其中：1.基金申购款                             | 686,513,163,288.89                         | -                 | 686,513,163,288.89  |
| 2.基金赎回款                                | -693,801,468,027.43                        | -                 | -693,801,468,027.43 |
| 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） | -  | -2,413,439,051.52 | -2,413,439,051.52   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 162,163,426,579.62                         | -                 | 162,163,426,579.62  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |                   |                     |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润             | 所有者权益合计             |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 117,921,858,953.99                         | -                 | 117,921,858,953.99  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 3,158,691,975.74  | 3,158,691,975.74    |
| 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）      | 54,984,723,887.18                          | -                 | 54,984,723,887.18   |
| 其中：1.基金申购款                             | 505,891,669,156.67                         | -                 | 505,891,669,156.67  |
| 2.基金赎回款                                | -450,906,945,269.49                        | -                 | -450,906,945,269.49 |
| 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） | -  | -3,158,691,975.74 | -3,158,691,975.74   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 172,906,582,841.17                         | -                 | 172,906,582,841.17  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达易理财货币市场基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2013]1190号《关于核准易方达易理财货币市场基金募集的批复》核准，由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达易理财货币市场基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达易理财货币市场基金基金合同》于2013年10月24日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,665,887.18份基金份额，其中认购资金利息折合4,418.18份基金份额。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达易理财货币市场基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金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。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融



业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 4,154,692.15           |

|                |                   |
|----------------|-------------------|
| 定期存款           | 61,390,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                 |
| 存款期限 1-3 个月    | 4,000,000,000.00  |
| 存款期限 3 个月以上    | 57,390,000,000.00 |
| 其他存款           | -                 |
| 合计             | 61,394,154,692.15 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |                   |                |         |
|--------|-------|------------------------|-------------------|----------------|---------|
|        |       | 摊余成本                   | 影子定价              | 偏离金额           | 偏离度 (%) |
| 债券     | 交易所市场 | -                      | -                 | -              | -       |
|        | 银行间市场 | 62,122,165,655.44      | 62,240,555,600.00 | 118,389,944.56 | 0.0730  |
|        | 合计    | 62,122,165,655.44      | 62,240,555,600.00 | 118,389,944.56 | 0.0730  |
| 资产支持证券 |       | 1,783,829,958.26       | 1,790,601,600.00  | 6,771,641.74   | 0.0042  |
| 合计     |       | 63,905,995,613.70      | 64,031,157,200.00 | 125,161,586.30 | 0.0772  |

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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<br>2019 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 19,587,961,000.00      | -         |
| 银行间市场 | 23,473,085,048.18      | -         |
| 合计    | 43,061,046,048.18      | -         |

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2019 年 6 月 30 日 |
|----------|------------------------|
| 应收活期存款利息 | 899.66                 |

|            |                |
|------------|----------------|
| 应收定期存款利息   | 469,062,499.23 |
| 应收其他存款利息   | -              |
| 应收结算备付金利息  | 383,534.82     |
| 应收债券利息     | 215,043,148.53 |
| 应收资产支持证券利息 | 23,622,516.64  |
| 应收买入返售证券利息 | 40,197,780.71  |
| 应收申购款利息    | -              |
| 其他         | -              |
| 合计         | 748,310,379.59 |

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                 |
| 银行间市场应付交易费用 | 580,246.38        |
| 合计          | 580,246.38        |

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | -                 |
| 预提费用        | 230,352.09        |
| 合计          | 230,352.09        |

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |                     |
|---------------|----------------------------|---------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额                |
| 上年度末          | 169,451,731,318.16         | 169,451,731,318.16  |
| 本期申购          | 686,513,163,288.89         | 686,513,163,288.89  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -693,801,468,027.43        | -693,801,468,027.43 |
| 本期末           | 162,163,426,579.62         | 162,163,426,579.62  |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----|-------|-------|---------|
|    |       |       |         |

|                |                   |   |                   |
|----------------|-------------------|---|-------------------|
| 上年度末           | -                 | - | -                 |
| 本期利润           | 2,413,439,051.52  | - | 2,413,439,051.52  |
| 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        | -2,413,439,051.52 | - | -2,413,439,051.52 |
| 本期末            | -                 | - | -                 |

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,356,429.54               |
| 定期存款利息收入  | 1,219,030,747.32           |
| 其他存款利息收入  | -                          |
| 结算备付金利息收入 | 4,394,178.98               |
| 其他        | -                          |
| 合计        | 1,224,781,355.84           |

## 6.4.7.12 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 108,542,751,390.47         |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 108,077,155,369.39         |
| 减：应收利息总额                | 535,507,228.45             |
| 买卖债券差价收入                | -69,911,207.37             |

## 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额   | 562,872,350.68             |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 552,000,000.00             |
| 减：应收利息总额       | 10,872,350.68              |
| 资产支持证券投资收益     | -                          |

## 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                          |
| 其他      | 194.44                     |
| 合计      | 194.44                     |

**6.4.7.14 交易费用**

本基金所进行的交易，交易费用均入成本，本报告期末产生交易费用。

**6.4.7.15 其他费用**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 58,019.55                  |
| 信息披露费    | 58,978.70                  |
| 银行汇划费    | 97,911.36                  |
| 银行间账户维护费 | 17,853.84                  |
| 其他       | 2,447.09                   |
| 合计       | 235,210.54                 |

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 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。

**6.4.8.2 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。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

| 关联方名称                      | 与本基金的关系             |
|----------------------------|---------------------|
| 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 |
| 中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”) | 基金托管人               |

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。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 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。

**6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|-----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 237,923,030.69             | 199,437,213.56                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 63,716,362.21              | -                               |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2019年1月1日至2019年6月30日 | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 44,059,820.46              | 36,932,817.28                   |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

## 6.4.10.2.3 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日      |
|-----------------|---------------------------------|
|                 | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |
| 易方达基金管理有<br>限公司 | 110,349,680.81                  |
| 合计              | 110,349,680.81                  |
| 获得销售服务费的各关联方名称  | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |
|                 | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |
| 易方达基金管理有<br>限公司 | 184,571,532.37                  |
| 合计              | 184,571,532.37                  |

注：本基金的年销售服务费率为 0.25%，具体如下：

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

## 6.4.10.3 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日      |        |                   |       |      |                       |                  |
|---------------------------------|--------|-------------------|-------|------|-----------------------|------------------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>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             |
| 中国工商银行                          | -      | 98,184,297.<br>80 | -     | -    | 67,398,035,00<br>0.00 | 6,286,260<br>.56 |
| 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |        |                   |       |      |                       |                  |

| 银行间市场<br>交易的各关<br>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             |
| 中国工商银<br>行             | 20,234,346.30 | 99,852,303.<br>30 | -     | -    | 42,526,284.00<br>0.00 | 4,403,123<br>.88 |

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

无。

##### 6.4.10.5 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<br>2019年1月1日至2019年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2018年1月1日至2018年6月30日 |            |
|-----------------|----------------------------|--------------|---------------------------------|------------|
|                 | 期末余额                       | 当期利息收入       | 期末余额                            | 当期利息收入     |
| 中国工商银行-活<br>期存款 | 4,154,692.15               | 1,356,429.54 | 1,592,266.46                    | 296,974.85 |

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

##### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

###### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

##### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计         | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|----------------------|----|
| 2,413,439,051.52 | -                 | -            | 2,413,439,05<br>1.52 | -  |

##### 6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

###### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

|                          |
|--------------------------|
| 6.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券 |
|--------------------------|



| 证券代码   | 证券名称    | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量(单位:张) | 期末成本总额        | 期末估值总额        | 备注 |
|--------|---------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|---------------|---------------|----|
| 139732 | 永熙优 06  | 2019-06-17 | 2019-07-02 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 400,000  | 40,000,000.00 | 40,000,000.00 | -  |
| 139785 | 链融 9A1  | 2019-06-27 | 2019-07-18 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 220,000  | 22,000,000.00 | 22,000,000.00 | -  |
| 139786 | 链融 9A2  | 2019-06-27 | 2019-07-18 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 340,000  | 34,000,000.00 | 34,000,000.00 | -  |
| 139787 | 链融 9A3  | 2019-06-27 | 2019-07-18 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 340,000  | 34,000,000.00 | 34,000,000.00 | -  |
| 159312 | 信泽 03A1 | 2019-06-10 | 2019-07-01 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 300,000  | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | -  |

#### 6.4.12.2 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股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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 7,889,131,850.47 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           |
|-----------|---------------|------------|--------|------------|------------------|
| 111807164 | 18 招商银行 CD164 | 2019-07-01 | 99.58  | 500,000    | 49,787,651.18    |
| 111807200 | 18 招商银行 CD200 | 2019-07-01 | 99.52  | 3,000,000  | 298,560,367.19   |
| 111807202 | 18 招商银行 CD202 | 2019-07-01 | 99.59  | 6,000,000  | 597,552,885.65   |
| 111808265 | 18 中信银行 CD265 | 2019-07-01 | 99.77  | 5,000,000  | 498,833,456.28   |
| 111808277 | 18 中信银行 CD277 | 2019-07-01 | 99.62  | 2,747,000  | 273,664,122.94   |
| 111817175 | 18 光大银行 CD175 | 2019-07-01 | 99.69  | 11,657,000 | 1,162,102,406.63 |
| 120244    | 12 国开 44      | 2019-07-01 | 100.07 | 1,000,000  | 100,074,362.59   |

|        |          |            |        |            |                  |
|--------|----------|------------|--------|------------|------------------|
| 120312 | 12 进出 12 | 2019-07-01 | 100.19 | 2,612,000  | 261,707,593.08   |
| 130402 | 13 农发 02 | 2019-07-01 | 100.74 | 1,000,000  | 100,742,841.97   |
| 130404 | 13 农发 04 | 2019-07-01 | 101.00 | 800,000    | 80,799,816.53    |
| 150203 | 15 国开 03 | 2019-07-01 | 100.68 | 400,000    | 40,270,973.61    |
| 160420 | 16 农发 20 | 2019-07-01 | 100.03 | 300,000    | 30,009,242.49    |
| 170407 | 17 农发 07 | 2019-07-01 | 100.76 | 1,000,000  | 100,757,164.38   |
| 190201 | 19 国开 01 | 2019-07-01 | 99.93  | 7,100,000  | 709,513,405.68   |
| 190301 | 19 进出 01 | 2019-07-01 | 99.84  | 8,200,000  | 818,700,647.42   |
| 190302 | 19 进出 02 | 2019-07-01 | 99.95  | 19,000,000 | 1,899,030,491.52 |
| 190402 | 19 农发 02 | 2019-07-01 | 99.77  | 12,700,000 | 1,267,026,024.28 |
| 合计     |          |            |        | 83,016,000 | 8,289,133,453.42 |

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 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。

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

##### 6.4.13.2 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 2019 年 6 月 30 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 34.28%(2018 年 12 月 31 日：38.59%)。

#### 6.4.13.2.1 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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 920,231,877.44    | 1,022,296,990.81    |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 15,331,241,909.44 | 12,842,390,798.79   |
| 合计     | 16,251,473,786.88 | 13,864,687,789.60   |

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。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 0.00              | 0.00                |

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 0.00              | 0.00                |

#### 6.4.13.2.4 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<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 1,352,953,317.27  | 561,083,248.72      |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |

|     |                  |                |
|-----|------------------|----------------|
| 未评级 | 0.00             | 0.00           |
| 合计  | 1,352,953,317.27 | 561,083,248.72 |

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。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 1,807,452,474.90  | 1,198,450,380.51    |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 1,807,452,474.90  | 1,198,450,380.51    |

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2019年6月30日 | 上年度末<br>2018年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 44,732,781,699.82 | 58,803,522,953.72   |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 44,732,781,699.82 | 58,803,522,953.72   |

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。

本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2019 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通

暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2019年6月<br>30日 | 1年以内               | 1-5年 | 5年以上 | 不计息            | 合计                 |
|-----------------------|--------------------|------|------|----------------|--------------------|
| 资产                    |                    |      |      |                |                    |
| 银行存款                  | 61,394,154,692.15  | -    | -    | -              | 61,394,154,692.15  |
| 结算备付金                 | 946,999,500.00     | -    | -    | -              | 946,999,500.00     |
| 存出保证金                 | -                  | -    | -    | -              | -                  |
| 交易性金融资产               | 63,905,995,613.70  | -    | -    | -              | 63,905,995,613.70  |
| 衍生金融资产                | -                  | -    | -    | -              | -                  |
| 买入返售金融资产              | 43,061,046,048.18  | -    | -    | -              | 43,061,046,048.18  |
| 应收证券清算款               | -                  | -    | -    | 75,515,402.24  | 75,515,402.24      |
| 应收利息                  | -                  | -    | -    | 748,310,379.59 | 748,310,379.59     |
| 应收股利                  | -                  | -    | -    | -              | -                  |
| 应收申购款                 | -                  | -    | -    | -              | -                  |
| 递延所得税资产               | -                  | -    | -    | -              | -                  |
| 其他资产                  | -                  | -    | -    | -              | -                  |
| 资产总计                  | 169,308,195,854.03 | -    | -    | 823,825,781.83 | 170,132,021,635.86 |
| 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                | 7,889,131,850.47   | -     | -     | -              | 7,889,131,850.47   |
| 应付证券清算款                  | -                  | -     | -     | -              | -                  |
| 应付赎回款                    | -                  | -     | -     | -              | -                  |
| 应付管理人报酬                  | -                  | -     | -     | 36,497,426.79  | 36,497,426.79      |
| 应付托管费                    | -                  | -     | -     | 6,758,782.74   | 6,758,782.74       |
| 应付销售服务费                  | -                  | -     | -     | 33,793,913.69  | 33,793,913.69      |
| 应付交易费用                   | -                  | -     | -     | 580,246.38     | 580,246.38         |
| 应交税费                     | -                  | -     | -     | 626,250.12     | 626,250.12         |
| 应付利息                     | -                  | -     | -     | 976,233.96     | 976,233.96         |
| 应付利润                     | -                  | -     | -     | -              | -                  |
| 递延所得税负债                  | -                  | -     | -     | -              | -                  |
| 其他负债                     | -                  | -     | -     | 230,352.09     | 230,352.09         |
| 负债总计                     | 7,889,131,850.47   | -     | -     | 79,463,205.77  | 7,968,595,056.24   |
| 利率敏感度缺口                  | 161,419,064,003.56 | -     | -     | 744,362,576.06 | 162,163,426,579.62 |
| 上年度末<br>2018 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                     | 81,597,015,189.52  | -     | -     | -              | 81,597,015,189.52  |
| 结算备付金                    | 132,678,181.82     | -     | -     | -              | 132,678,181.82     |
| 存出保证金                    | -                  | -     | -     | -              | -                  |
| 交易性金融资产                  | 74,110,584,314.28  | -     | -     | -              | 74,110,584,314.28  |
| 衍生金融资产                   | -                  | -     | -     | -              | -                  |
| 买入返售金融资产                 | 23,086,343,799.90  | -     | -     | -              | 23,086,343,799.90  |
| 应收证券清算款                  | -                  | -     | -     | -              | -                  |
| 应收利息                     | -                  | -     | -     | 876,754,873.81 | 876,754,873.81     |

|           |                    |   |                |                    |
|-----------|--------------------|---|----------------|--------------------|
| 应收股利      | -                  | - | -              | -                  |
| 应收申购款     | -                  | - | -              | -                  |
| 递延所得税资产   | -                  | - | -              | -                  |
| 其他资产      | -                  | - | -              | -                  |
| 资产总计      | 178,926,621,485.52 | - | 876,754,873.81 | 179,803,376,359.33 |
| 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 | 10,260,691,362.12  | - | -              | 10,260,691,362.12  |
| 应付证券清算款   | -                  | - | -              | -                  |
| 应付赎回款     | -                  | - | -              | -                  |
| 应付管理人报酬   | -                  | - | 39,006,686.64  | 39,006,686.64      |
| 应付托管费     | -                  | - | 7,223,460.47   | 7,223,460.47       |
| 应付销售服务费   | -                  | - | 36,117,302.45  | 36,117,302.45      |
| 应付交易费用    | -                  | - | 709,617.92     | 709,617.92         |
| 应交税费      | -                  | - | 610,449.78     | 610,449.78         |
| 应付利息      | -                  | - | 6,955,661.79   | 6,955,661.79       |
| 应付利润      | -                  | - | -              | -                  |
| 递延所得税负债   | -                  | - | -              | -                  |
| 其他负债      | -                  | - | 330,500.00     | 330,500.00         |
| 负债总计      | 10,260,691,362.12  | - | 90,953,679.05  | 10,351,645,041.17  |
| 利率敏感度缺口   | 168,665,930,123.40 | - | 785,801,194.76 | 169,451,731,318.16 |

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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<br>2019 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------------------|--------------------------|
| 1.市场利率下降 25 个基点 | 51,441,062.78          | 63,837,122.19            |
| 2.市场利率上升 25 个基点 | -51,311,499.27         | -63,692,850.03           |

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，同时本基金不参与可转换债券投资。于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

#### 6.4.14 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 2019 年 6 月 30 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 63,905,995,613.70 元，无属于第一或第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日：第二层次 74,110,584,314.28 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 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 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。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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            | 63,905,995,613.70  | 37.56         |
|    | 其中：债券             | 62,122,165,655.44  | 36.51         |
|    | 资产支持证券            | 1,783,829,958.26   | 1.05          |
| 2  | 买入返售金融资产          | 43,061,046,048.18  | 25.31         |
|    | 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      | 62,341,154,192.15  | 36.64         |
| 4  | 其他各项资产            | 823,825,781.83     | 0.48          |
| 5  | 合计                | 170,132,021,635.86 | 100.00        |

### 7.2 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 |                  | 4.20           |
|    | 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 | 7,889,131,850.47 | 4.86           |

|            |   |   |
|------------|---|---|
| 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%。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 85  |
| 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 | 53  |

### 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。

### 7.3.2 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                 | 33.10               | 4.86                |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 19.44               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 29.40               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 0.99                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 21.54               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 104.45              | 4.86                |

## 7.4 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。

## 7.5 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                 | 887,051,544.96    | 0.55         |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -            |
| 3  | 金融债券                 | 7,549,663,325.60  | 4.66         |
|    | 其中：政策性金融债            | 7,549,663,325.60  | 4.66         |
| 4  | 企业债券                 | -                 | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 7,635,989,418.20  | 4.71         |
| 6  | 中期票据                 | 1,316,679,666.86  | 0.81         |
| 7  | 同业存单                 | 44,732,781,699.82 | 27.59        |
| 8  | 其他                   | -                 | -            |
| 9  | 合计                   | 62,122,165,655.44 | 38.31        |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                 | -            |

## 7.6 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  | 111916161 | 19 上海银行 CD161 | 25,000,000 | 2,484,367,235.01 | 1.53         |
| 2  | 111917027 | 19 光大银行 CD027 | 20,000,000 | 1,933,993,053.97 | 1.19         |
| 3  | 190302    | 19 进出 02      | 19,000,000 | 1,899,030,491.52 | 1.17         |
| 4  | 111817175 | 18 光大银行 CD175 | 18,500,000 | 1,844,290,514.09 | 1.14         |
| 5  | 111907104 | 19 招商银行 CD104 | 18,000,000 | 1,774,690,503.36 | 1.09         |
| 6  | 111909174 | 19 浦发银行 CD174 | 15,000,000 | 1,491,084,316.37 | 0.92         |
| 7  | 190402    | 19 农发 02      | 12,700,000 | 1,267,026,024.28 | 0.78         |
| 8  | 111918196 | 19 华夏银行 CD196 | 12,000,000 | 1,192,488,376.63 | 0.74         |

|    |           |                  |            |                  |      |
|----|-----------|------------------|------------|------------------|------|
| 9  | 111918211 | 19 华夏银行<br>CD211 | 12,000,000 | 1,173,637,699.49 | 0.72 |
| 10 | 111809357 | 18 浦发银行<br>CD357 | 11,000,000 | 1,095,825,020.40 | 0.68 |

### 7.7 “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 | 0       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.1230% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0374% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0782% |

#### 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。

### 7.8 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称     | 数量（份）     | 公允价值           | 占基金资产净值比例<br>（%） |
|----|--------|----------|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 156290 | 宁远 07A3  | 1,790,000 | 179,000,000.00 | 0.11             |
| 2  | 139369 | 万科 33A1  | 1,000,000 | 100,154,288.91 | 0.06             |
| 3  | 139393 | 链融 04A1  | 850,000   | 85,000,000.00  | 0.05             |
| 4  | 139580 | 永熙优 A1   | 800,000   | 80,000,000.00  | 0.05             |
| 5  | 139652 | 永熙 3 优 2 | 760,000   | 76,000,000.00  | 0.05             |
| 6  | 139469 | 链融 08A1  | 720,000   | 72,000,000.00  | 0.04             |
| 7  | 139453 | 链融 07A1  | 680,000   | 68,000,000.00  | 0.04             |
| 8  | 139070 | 万科优 10   | 650,000   | 65,067,677.25  | 0.04             |
| 9  | 139617 | 永熙 2 优 1 | 520,000   | 52,000,000.00  | 0.03             |
| 10 | 139056 | 链融 2A1   | 500,000   | 50,054,410.79  | 0.03             |

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

**7.9.219 浦发银行 CD174（代码：111909174）、18 浦发银行 CD357（代码：111809357）**为易方达易理财货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 7 月 26 日，中国人民银行针对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易的违法违规事实，罚款人民币 170 万元。

**19 招商银行 CD104（代码：111907104）**为易方达易理财货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 7 月 5 日，深圳保监局针对招商银行股份有限公司电话销售欺骗投保人罚款 30 万元。

**19 光大银行 CD027（代码：111917027）、18 光大银行 CD175（代码：111817175）**为易方达易理财货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 11 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对中国光大银行股份有限公司关于以下违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）以误导方式违规销售理财产品；（三）以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品；（四）违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务；（五）同业投资违规接受担保；（六）通过同业投资或贷款虚增存款规模，处以没收违法所得 100 万元，罚款 1020 万元，合计 1120 万元。

**19 上海银行 CD161（代码：111916161）**为易方达易理财货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 9 月 27 日，上海银监局针对上海银行股份有限公司信用卡中心 2014 年至 2017 年间，该中心部分信用卡汽车分期资金用途核查未执行标准统一的业务流程，以及 2017 年，该中心未对某涉嫌套现的特约商户停止服务的违法违规事实，责令上海银行改正，并处罚款共计 100 万元。2018 年 10 月 8 日，上海银监局针对上海银行股份有限公司 2015 年 5 月至 2016 年 5 月，该行违规向其

关系人发放信用贷款的违法违规事实，责令上海银行改正，并罚没合计 1091460.03 元。2018 年 10 月 18 日，上海银监局针对上海银行股份有限公司 2017 年，该行对某同业资金违规投向资本金不足的房地产项目合规性审查未尽职的违法违规事实，责令上海银行改正，并处罚款 50 万元。

本基金投资 19 浦发银行 CD174、18 浦发银行 CD357、19 招商银行 CD104、19 光大银行 CD027、18 光大银行 CD175、19 上海银行 CD161 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 19 浦发银行 CD174、18 浦发银行 CD357、19 招商银行 CD104、19 光大银行 CD027、18 光大银行 CD175、19 上海银行 CD161 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。

### 7.9.3 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 | 75,515,402.24  |
| 3  | 应收利息    | 748,310,379.59 |
| 4  | 应收申购款   | -              |
| 5  | 其他应收款   | -              |
| 6  | 待摊费用    | -              |
| 7  | 其他      | -              |
| 8  | 合计      | 823,825,781.83 |

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |      |       |      |
|----------|-----------|-------|------|-------|------|
|          |           | 机构投资者 |      | 个人投资者 |      |
|          |           | 持有份额  | 占总份额 | 持有份额  | 占总份额 |
|          |           |       |      |       |      |

|            |          |                  |       |                        |        |
|------------|----------|------------------|-------|------------------------|--------|
|            |          |                  | 比例    |                        | 比例     |
| 23,915,298 | 6,780.74 | 3,599,242,877.07 | 2.22% | 158,564,183,702.5<br>5 | 97.78% |

### 8.2 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  | 银行类机构 | 1,059,325,791.63 | 0.65%  |
| 2  | 银行类机构 | 1,000,810,908.78 | 0.62%  |
| 3  | 银行类机构 | 911,803,805.61   | 0.56%  |
| 4  | 银行类机构 | 403,979,650.76   | 0.25%  |
| 5  | 银行类机构 | 105,149,683.26   | 0.06%  |
| 6  | 其他机构  | 104,844,624.82   | 0.06%  |
| 7  | 个人    | 11,864,666.62    | 0.01%  |
| 8  | 信托类机构 | 11,498,789.58    | 0.01%  |
| 9  | 个人    | 11,171,277.77    | 0.01%  |
| 10 | 个人    | 10,318,243.59    | 0.01%  |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 3,310,866.93 | 0.0020%  |

### 8.4 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                                 | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 10~50             |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0~10              |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                            |                    |
|----------------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2013年10月24日）基金份额总额 | 200,665,887.18     |
| 本报告期期初基金份额总额               | 169,451,731,318.16 |
| 本报告期基金总申购份额                | 686,513,163,288.89 |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | 693,801,468,027.43 |
| 本报告期基金拆分变动份额               | -                  |
| 本报告期期末基金份额总额               | 162,163,426,579.62 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会广东监管局《关于对易方达基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》，对公司个别未按规定进行备案报告的事项提出了整改要求。公司已及时完成了整改。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|----|------|-----------|----|
|      |    |      |           |    |



|      | 单元数量 | 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 |   |
|------|------|------|--------------|----|------------|---|
| 长城证券 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 长江证券 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 东北证券 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 国盛证券 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 国信证券 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 海通证券 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 华泰证券 | 2    | -    | -            | -  | -          | - |
| 申万宏源 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 银河证券 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 中金公司 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 中信建投 | 1    | -    | -            | -  | -          | - |
| 中信证券 | 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；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。

#### 10.7.2 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 |
| 长城证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

|      |                |         |                    |         |   |   |
|------|----------------|---------|--------------------|---------|---|---|
| 东北证券 | -              | -       | -                  | -       | - | - |
| 国盛证券 | -              | -       | -                  | -       | - | - |
| 国信证券 | -              | -       | -                  | -       | - | - |
| 海通证券 | -              | -       | -                  | -       | - | - |
| 华泰证券 | 107,472,700.00 | 100.00% | 773,373,866,000.00 | 100.00% | - | - |
| 申万宏源 | -              | -       | -                  | -       | - | - |
| 银河证券 | -              | -       | -                  | -       | - | - |
| 中金公司 | -              | -       | -                  | -       | - | - |
| 中信建投 | -              | -       | -                  | -       | - | - |
| 中信证券 | -              | -       | -                  | -       | - | - |

### 10.8 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。

### 10.9 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成都分公司营业场所变更的公告                             | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-13 |
| 2  | 易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告                      | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-03-19 |
| 3  | 易方达基金管理有限公司关于易方达易理财货币市场基金增加南海农商银行为销售机构的公告               | 中国证券报及基金管理人网站                 | 2019-04-20 |
| 4  | 易方达基金管理有限公司关于提醒网上直销个人投资者及时上传身份证件照片并完善、更新身份信息以免影响日常交易的公告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站 | 2019-05-28 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达易理财货币市场基金募集的文件；
2. 《易方达易理财货币市场基金基金合同》；
3. 《易方达易理财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、营业执照。

### 11.2 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。

### 11.3 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

二〇一九年八月二十四日