

## 易方达保证金收益货币市场基金更新的招募说明书摘要

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二〇一六年十一月

### 重要提示

本基金根据 2013 年 1 月 28 日中国证券监督管理委员会《关于核准易方达保证金收益货币市场基金募集的批复》（证监许可【2013】62 号）和 2013 年 3 月 18 日《关于易方达保证金收益货币市场基金募集时间安排的确认函》（基金部函[2013]194 号）的核准，进行募集。本基金的基金合同于 2013 年 3 月 29 日正式生效。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人保证《招募说明书》的内容真实、准确、完整。本《招募说明书》经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

本基金为货币市场基金，属证券投资基金中的较低风险收益品种。投资者购买本货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响的市场风险，因金融市场利率的波动而导致证券市场价格和收益率变动的利率风险或负收益风险，因债券和票据发行主体信用状况恶化而可能产生的到期不能兑付的信用风险，因本产品相关技术、规则、操作等创新性造成基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程等引致的风险，因达到当日累计申购份额上限或累计赎回份额上限或单个账户当日累计申购上限造成申购或赎回申请失败的风险，因发生特定情况收取强制赎回费用的风险，因本基金收益分配安排造成的再投资风险和收益支付时间风险，因二级市场交易费用、交易价格而影响投资收益的风险，因买卖基金份额所在证券公司未开通代收代付功能而延迟获取投资收益的风险、因影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法确定的基金资产净值偏离度达到一定程度而导致暂停申购，或者暂停

赎回并终止基金合同的风险等等。本基金预期风险和预期收益均低于股票基金、混合基金及债券基金。投资者在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。

基金不同于银行储蓄与债券，基金投资者有可能获得较高的收益，也有可能损失本金。投资有风险，投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除非另有说明，本招募说明书所载内容截止日为2016年9月29日，有关财务数据截止日为2016年6月30日，净值表现截止日为2016年6月30日。（本报告中财务数据未经审计）

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人基本情况

#### 1、基金管理人：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室

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

法定代表人：刘晓艳

设立日期：2001年4月17日

注册资本：12,000万元人民币

联系人：贺晋

联系电话：400 881 8088

批准设立机关及文号：中国证券监督管理委员会，证监基金字[2001]4号

经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务

#### 2、股权结构：

股东名称 出资比例

广东粤财信托有限公司 1/4

广发证券股份有限公司 1/4

盈峰投资控股集团有限公司 1/4

广东省广晟资产经营有限公司 1/6

广州市广永国有资产经营有限公司 1/12

总 计 100%

### (二) 主要人员情况

#### 1、董事、监事及高级管理人员

詹余引先生，经济学硕士，董事长。曾任中国平安保险公司证券部研究咨询室总经理助理；平安证券有限责任公司研究咨询部副总经理（主持工作）、国债部副总经理（主持工作）、资产管理部副总经理、总经理；中国平安保险股份有限公司投资管理部副总经理（主持工作）；全国社会保障基金理事会投资部资产配置处处长、投资部副主任、境外投资部主任、投资部主任、证券投资部主任。现任易方达基金管理有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事长。

刘晓艳女士，经济学博士，董事、总裁。曾任广发证券有限责任公司投资理财部副经理、

基金经理，基金投资理财部副总经理、基金资产管理部总经理；易方达基金管理有限公司督察员、监察部总经理、市场部总经理、总裁助理、公司副总裁、常务副总裁。现任易方达基金管理有限公司总裁；易方达资产管理（香港）有限公司董事长；易方达国际控股有限公司董事。

秦力先生，经济学博士，董事。曾任广发证券投资银行部常务副总经理、投资理财部总经理、资金营运部总经理、规划管理部总经理、投资自营部总经理、公司总经理助理、副总经理。现任广发证券股份有限公司董事、常务副总经理；广发控股（香港）有限公司董事；广东金融高新区股权交易中心有限公司董事长。

杨力先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），董事。曾任美的集团空调事业部技术主管、企划经理；佛山顺德百年科技有限公司行政总监；美的空调深圳营销中心区域经理；佛山顺德创佳电器有限公司董事、副总经理；长虹空调广州营销中心营销总监；广东盈峰投资控股集团有限公司战略总监、董事、副总裁。现任盈峰投资控股集团有限公司董事；盈峰资本管理有限公司总经理；开源证券股份有限公司副董事长。

王海先生，经济学、工商管理（国际）硕士，董事。曾任工商银行江西省分行法律顾问室科员；工商银行珠海分行法律顾问室办事员、营业部计划信贷部信贷员、办公室行长室秘书、信贷管理部业务主办、资产风险管理部经理助理兼法律室副主任、资产风险管理部副总经理兼法律室主任、资产风险管理部总经理；招商银行总行法律事务部行员；工商银行珠海分行资产风险部总经理兼特殊资产管理部负责人、公司业务部总经理、副行长；工商银行广东省分行公司业务部副总经理（主持工作）、总经理；工商银行韶关分行行长、党委书记。现任广东粤财信托有限公司总经理。

刘初先生，经济学硕士，董事。曾任湖南证券发行部经理助理；湘财证券投资银行总部总经理助理；财富证券投资银行总部副总经理；五矿二十三冶建设集团副总经理、党委委员；深圳市中金岭南有色金属股份有限公司监事。现任广东省广晟资产经营有限公司总经理助理、资本运营部部长；新晟期货有限公司董事；广晟有色金属股份有限公司董事；东江环保股份有限公司董事长。

朱征夫先生，法学博士，独立董事。曾任广东经济贸易律师事务所金融房地产部主任；广东大陆律师事务所合伙人；广东省国土厅广东地产法律咨询服务中心副主任。现任广东东方昆仑律师事务所主任。

忻榕女士，工商管理博士，独立董事。曾任中科院研究生院讲师；美国加州高温橡胶公司市场部经理；美国加州大学讲师；美国南加州大学助理教授；香港科技大学副教授；中欧国际工商学院教授；瑞士洛桑管理学院教授。现任中欧国际工商学院教授。

谭劲松先生，管理学博士（会计学），独立董事。曾任邵阳市财会学校教师；中山大学管理学院助教、讲师、副教授。现任中山大学管理学院教授。

陈国祥先生，经济学硕士，监事会主席。曾任交通银行广州分行江南西营业部经理；广东粤财信托投资公司证券部副总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司市场拓展部总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司监事会主席。

李舫金先生，经济学硕士，监事。曾任华南师范大学外语系党总支书记；中国证监会广州证管办处长；广州市广永国有资产经营有限公司董事长；广州股权交易中心有限公司董事长；立根融资租赁有限公司董事长。现任广州金融控股集团有限公司副董事长、总经理；万联证券有限责任公司董事长；广州银行副董事长；广州汽车集团股份有限公司独立董事；广州金控资本管理有限公司董事长；广州中盈（三明）基金管理有限公司董事长；广永期货有限公司董事；广州立根小额再贷款股份有限公司董事长。

廖智先生，经济学硕士，监事。曾任广东证券股份有限公司基金部主管；易方达基金管理有限公司综合管理部副总经理、人力资源部副总经理、市场部总经理、互联网金融部总经理。现任易方达基金管理有限公司总裁助理；广东粤财互联网金融股份有限公司董事。

张优造先生，工商管理硕士(MBA)，常务副总裁。曾任南方证券交易中心业务发展部经理；广东证券公司发行上市部经理；深圳证券业务部总经理、基金部总经理；易方达基金管理有限公司董事、副总裁。现任易方达基金管理有限公司常务副总裁；易方达国际控股有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事。

陈彤先生，经济学博士，副总裁。曾任中国经济开发信托投资公司成都营业部研发部副经理、交易部经理、研发部经理、证券总部研究部行业研究员；易方达基金管理有限公司市场拓展部主管、基金科瑞基金经理、市场部华东区大区销售经理、市场部总经理助理、南京分公司总经理、成都分公司总经理、上海分公司总经理、总裁助理、市场总监。现任易方达基金管理有限公司副总裁。

马骏先生，高级管理人员工商管理硕士（EMBA），副总裁。曾任君安证券有限公司营业部职员；深圳众大投资有限公司投资部副总经理；广发证券有限责任公司研究员；易方达基金管理有限公司固定收益部总经理、现金管理部总经理、总裁助理、固定收益投资总监、固定收益首席投资官、基金科讯基金经理、易方达 50 指数证券投资基金基金经理、易方达深证 100 交易型开放式指数基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁兼固定收益总部总经理；易方达资产管理有限公司董事；易方达资产管理（香港）有限公司董事、人民币合格境外投资者（RQFII）业务负责人、证券交易负责人员（RO）、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO）、RQFII/QFII 产品投资决策委员会委员；中债资信评估有限责任公司独立董事。

吴欣荣先生，工学硕士。曾任易方达基金管理有限公司研究员、投资管理部经理、基金投资部副总经理、研究部副总经理、研究部总经理、基金投资部总经理、公募基金投资部总经理、总裁助理、权益投资总监、主动权益投资的分管领导、基金科瑞基金经理、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达价值精选股票型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司副总裁，兼权益投资总部总经理。

张南女士，经济学博士，督察长。曾任广东省经济贸易委员会主任科员、副处长；易方达基金管理有限公司市场拓展部副总经理、监察部总经理。现任易方达基金管理有限公司督察长。

范岳先生，工商管理硕士(MBA)，首席产品官。曾任中国工商银行深圳分行国际业务部科

员；深圳证券登记结算公司办公室经理、国际部经理；深圳证券交易所北京中心助理主任、上市部副总监、基金债券部副总监、基金管理部总监。现任易方达基金管理有限公司首席产品官；易方达资产管理（香港）有限公司董事、另类投资决策委员会委员。

## 2、基金经理

石大怿先生，经济学硕士。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。现任易方达基金管理有限公司易方达月月利理财债券型证券投资基金基金经理（自2012年11月26日起任职）、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理（自2013年1月15日起任职）、易方达天天理财货币市场基金基金经理（自2013年3月4日起任职）、易方达货币市场基金基金经理（自2013年4月22日起任职）、易方达保证金收益货币市场基金基金经理（自2013年4月22日起任职）、易方达易理财货币市场基金基金经理（自2013年10月24日起任职）、易方达财富快线货币市场基金基金经理（自2014年6月17日起任职）、易方达天天增利货币市场基金基金经理（自2014年6月25日起任职）、易方达龙宝货币市场基金基金经理（自2014年9月12日起任职）、易方达现金增利货币市场基金基金经理（自2015年2月5日起任职）、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。

梁莹女士，经济学硕士、金融学硕士。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。现任易方达基金管理有限公司易方达月月利理财债券型证券投资基金基金经理（自2014年9月24日起任职）、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理（自2014年9月24日起任职）、易方达增金宝货币市场基金基金经理（自2015年1月20日起任职）、易方达龙宝货币市场基金基金经理（自2015年3月17日起任职）、易方达天天增利货币市场基金基金经理（自2015年3月17日起任职）、易方达财富快线货币市场基金基金经理（自2015年3月17日起任职）、易方达现金增利货币市场基金基金经理（自2015年6月19日起任职）、易方达货币市场基金基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理、易方达易理财货币市场基金基金经理助理。

本基金历任基金经理情况：马喜德先生，管理时间为2013年3月29日至2013年4月21日（根据相关公告，2013年4月20日至2013年4月21日由王晓晨女士、石大怿先生代为履行易方达保证金收益货币市场基金的基金经理职责）；王晓晨女士，管理时间为2013年4月22日至2014年11月21日。

## 3、固定收益投资决策委员会成员

本公司固定收益投资决策委员会成员包括：马骏先生、袁方女士、王晓晨女士、胡剑先生、张清华先生。

马骏先生，同上。

袁方女士，工学硕士。曾任中慧会计师事务所审计师、资产评估师；湘财证券有限责任公司投资经理；泰康人寿保险公司投资经理；天弘基金管理有限公司基金经理、固定收益总

监；泰康资产管理有限责任公司年金投资部高级投资经理、执行总监；易方达基金管理有限公司固定收益投资部总经理助理、固定收益总部总经理助理。现任易方达基金管理有限公司固定收益机构投资部总经理、投资经理。

王晓晨女士，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益总部总经理助理、易方达增强回报债券型证券投资基金基金经理、易方达投资级信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金基金经理、易方达保本一号混合型证券投资基金基金经理，兼任易方达资产管理（香港）有限公司基金经理、就证券提供意见负责人员（RO）、提供资产管理负责人员（RO），易方达资产管理（香港）有限公司 RQFII/QFII 产品投资决策委员会委员。

胡剑先生，经济学硕士。曾任易方达基金管理有限公司固定收益部债券研究员、基金经理助理兼债券研究员、固定收益研究部负责人、固定收益总部总经理助理、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）基金经理、易方达纯债 1 年定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金基金经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益研究部总经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金基金经理、易方达信用债债券型证券投资基金基金经理、易方达裕惠回报定期开放式混合型发起式证券投资基金基金经理、易方达瑞财灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达裕景添利 6 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。

张清华先生，物理学硕士。曾任晨星资讯（深圳）有限公司数量分析师；中信证券股份有限公司研究员；易方达基金管理有限公司投资经理。现任易方达基金管理有限公司固定收益基金投资部总经理、易方达安心回报债券型证券投资基金基金经理、易方达裕丰回报债券型证券投资基金基金经理、易方达裕如灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达安心回馈混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达裕祥回报债券型证券投资基金基金经理、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达新享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金基金经理、易方达裕鑫债券型证券投资基金基金经理。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：牛锡明

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：742.62 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：汤嵩彦

电话：95559

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额销售机构

##### 1、申购、赎回代办证券公司（以下排序不分先后）

###### （1）广发证券

注册地址：广州天河区天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼（4301-4316 房）

办公地址：广东省广州天河区大都会广场 5、18、19、36、38、41、42、43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

###### （2）安信证券

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

深圳市福田区深南大道 2008 号中国凤凰大厦 1 栋 9 层

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑虹

联系电话：0755-82825551

客户服务电话：4008001001

传真：0755-82558355

网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

###### （3）渤海证券

注册地址：天津市经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

办公地址：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

联系电话：022-28451991

客户服务电话：400-651-5988



传真：022-28451892

网址：www.ewww.com.cn

(4) 财达证券

注册地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦

办公地址：河北省石家庄市桥西区自强路 35 号庄家金融大厦 23-26 层

法定代表人：翟建强

联系人：马辉

联系电话：0311-66006342

客户服务电话：400-612-8888

传真：0311-66006414

网址：www.s10000.com

(5) 财富证券

注册地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

办公地址：长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26 楼

法定代表人：蔡一兵

联系人：郭磊

联系电话：0731-84403360、0731-84403319

客户服务电话：4008835316

传真：0731-84403439

网址：www.cfzq.com

(6) 财通证券

注册地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

办公地址：浙江省杭州市杭大路 15 号嘉华国际商务中心

法定代表人：沈继宁

联系人：夏吉慧

联系电话：0571-87925129

客户服务电话：95336（浙江）、40086-96336（全国）

网址：www.ctsec.com

(7) 长城国瑞证券

注册地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

办公地址：厦门市莲前西路 2 号莲富大厦十七楼

法定代表人：王勇

联系人：赵钦

联系电话：0592-5161642

客户服务电话：0592-5163588

传真：0592-5161140

网址: [www.xmzq.cn](http://www.xmzq.cn)

(8) 长城证券

注册地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

办公地址: 深圳市福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人: 丁益

联系人: 胡永君

联系电话: 0755-83516289

客户服务电话: 400-6666-888

传真: 0755-83515567

网址: [www.cgws.com](http://www.cgws.com)

(9) 大通证券

注册地址: 辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦  
38、39 层

办公地址: 辽宁省大连市沙河口区会展路 129 号大连国际金融中心 A 座-大连期货大厦  
38、39 层

法定代表人: 李红光

联系人: 谢立军

联系电话: 0411-39991807

客户服务电话: 4008-169-169

传真: 0411-39673214

网址: [www.daton.com.cn](http://www.daton.com.cn)

(10) 大同证券

注册地址: 大同市城区迎宾街 15 号桐城中央 21 层

办公地址: 山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 F12、F13

法定代表人: 董祥

联系人: 薛津

联系电话: 0351-4130322

客户服务电话: 4007121212

传真: 0351-4192803

网址: [www.dtsbc.com.cn](http://www.dtsbc.com.cn)

(11) 德邦证券

注册地址: 上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

办公地址: 上海市浦东新区福山路 500 号城建国际中心 26 楼

法定代表人: 姚文平

联系人: 朱磊

联系电话: 021-68761616

客户服务电话：400-8888-128

传真：021-68767880

网址：www.tebon.com.cn

(12) 第一创业证券

注册地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 20 楼

办公地址：深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 18 楼

法定代表人：刘学民

联系人：毛诗莉

联系电话：0755-23838750

客户服务电话：4008881888

网址：www.firstcapital.com.cn

(13) 东北证券

注册地址：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市净月开发区生态大街 6666 号东北证券 503 室

法定代表人：李福春

联系人：安岩岩

联系电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

客户服务电话：95360

网址：www.nesc.cn

(14) 东方证券

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层、23 层、25 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 21 层-23 层、25 层-29 层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

联系电话：021-63325888

客户服务电话：95503

传真：021-63326729

网址：www.dfzq.com.cn

(15) 东海证券

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 层

办公地址：上海市浦东新区东方路 1928 号东海证券大厦

法定代表人：赵俊

联系人：王一彦

联系电话：021-20333333

客户服务电话：95531；400-8888-588

传真：021-50498825

网址：www.longone.com.cn

(16) 东吴证券

注册地址：苏州工业园区星阳街5号

办公地址：苏州工业园区星阳街5号

法定代表人：范力

联系人：方晓丹

联系电话：0512-65581136

客户服务电话：95330

传真：0512-65588021

网址：www.dwzq.com.cn

(17) 东兴证券

注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：魏庆华

联系人：汤漫川

联系电话：010-66555316

客户服务电话：400-8888-993

传真：010-66555133

网址：www.dxzq.net

(18) 方正证券

注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：何其聪

联系人：徐锦福

联系电话：010-68546765

客户服务电话：95571

传真：010-68546792

网址：www.95571.cn

(19) 光大证券

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路1508号

法定代表人：薛峰

联系人：刘晨、李芳芳

联系电话：021-22169999

客户服务电话：95525、400-8888-788、10108998

传真：021-22169134

网址：www.ebscn.com

(20) 广州证券

注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层

法定代表人：邱三发

联系人：梁微

联系电话：020-88836999

客户服务电话：95396

传真：020-88836654

网址：www.gzs.com.cn

(21) 国都证券

注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：王少华

联系人：汪嘉楠

联系电话：010-84183122

客户服务电话：400-818-8118

开放式基金业务传真：010-84183311-3122

网址：www.guodu.com

(22) 国海证券

注册地址：广西桂林市辅星路13号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦3楼

法定代表人：何春梅

联系人：牛孟宇

联系电话：0755-83709350

客户服务电话：95563

传真：0755-83704850

网址：www.ghzq.com.cn

(23) 国金证券

注册地址：成都市青羊区东城根上街95号

办公地址：成都市青羊区东城根上街95号

法定代表人：冉云

联系人：刘婧漪、贾鹏

联系电话：028-86690057、028-86690058

客户服务电话：95310

传真：028-86690126

网址：www.gjq.com.cn

(24) 国融证券

注册地址：内蒙古呼和浩特市锡林南路 18 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街一号 长安兴融中心 4 号楼 2 层 国融证券

法定代表人：张智河

联系人：董晶珊

联系电话：010-83991737

客户服务电话：400-660-9839

传真：010-66412537

网址：www.grzq.com

(25) 国泰君安证券

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：杨德红

联系人：芮敏祺

客户服务电话：95521

传真：021-38670666

网址：www.gtja.com

(26) 国信证券

注册地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层

法定代表人：何如

联系人：周杨

联系电话：0755-82130833

客户服务电话：95536

传真：0755-82133952

网址：www.guosen.com.cn

(27) 国元证券

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号国元大厦

办公地址：安徽省合肥市寿春路 179 号国元大厦

法定代表人：凤良志

联系人：李蔡

开放式基金咨询电话：95578

开放式基金业务传真：0551-2272100

网址：www.gyzq.com.cn

(28) 海通证券

注册地址：上海市广东路 689 号

办公地址：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

联系人：金芸、李笑鸣

联系电话：021-23219000

客户服务电话：95553

传真：021-23219100

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(29) 恒泰证券

注册地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座

办公地址：内蒙古呼和浩特赛罕区敕勒川大街东方君座 D 座 14F

法定代表人：庞介民

联系人：熊丽

电话：0471-4972675

传真：0471-4979545

客户服务电话：4001966188

公司网站：[www.cnht.com.cn](http://www.cnht.com.cn)

(30) 红塔证券

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 7-11 楼

法定代表人：况雨林

网址：[www.hongtastock.com](http://www.hongtastock.com)

(31) 华安证券

注册地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号

办公地址：安徽省合肥市政务文化新区天鹅湖路 198 号财智中心 B1 座

法定代表人：李工

联系人：范超

联系电话：0551-65161821

客户服务电话：95318

开放式基金业务传真：0551-65161672

网址：[www.hazq.com](http://www.hazq.com)

(32) 华宝证券

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 100 号 57 层

法定代表人：陈林

联系人：刘闻川  
联系电话：021-20515589  
客户服务电话：400-820-9898  
传真：021-20515593  
网址：www.cnhbstock.com

(33) 华福证券

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层  
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1088 号招商银行大厦 18-19 楼  
法定代表人：黄金琳  
联系人：郭相兴  
联系电话：021-20655175  
客户服务电话：0591-96326  
传真：021-20655196  
网址：www.hfzq.com.cn

(34) 华龙证券

注册地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心  
办公地址：兰州市城关区东岗西路 638 号财富中心  
法定代表人：李晓安  
联系人：李昕田  
联系电话：0931-4890208  
客户服务电话：400-689-8888、0931-96668  
传真：0931-4890628  
网址：www.hlzq.com

(35) 华泰证券

注册地址：南京市江东中路 228 号  
办公地址：南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场  
法定代表人：周易  
联系人：庞晓芸  
联系电话：0755-82492193  
传真：0755-82492962  
客户服务电话：95597  
网址：www.htsc.com.cn

(36) 华鑫证券

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 28 层 A01、B01 (b) 单元  
办公地址：上海市徐汇区肇嘉浜路 750 号  
法定代表人：俞洋



联系人：杨莉娟

联系电话：021-54967552

客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918

传真：021-54967293

网址：www.cfsc.com.cn

(37) 江海证券

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

联系人：周俊

联系电话：0451-85863726

传真：0451-82337279

客户服务电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(38) 金元证券

注册地址：海南省海口市南宝路 36 号证券大厦 4 层

办公地址：深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 层

法定代表人：陆涛

联系人：马贤清

联系电话：0755-83025022

客户服务电话：400-8888-228

传真：0755-83025625

网址：www.jyzq.cn

(39) 开源证券

注册地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

办公地址：西安市高新区锦业路 1 号都市之门 B 座 5 层

法定代表人：李刚

联系人：袁伟涛

联系电话：029-63387256

客户服务电话：400-860-8866

传真：029-88447611

网址：www.kysec.cn

(40) 南京证券

注册地址：江苏省南京市大钟亭 8 号

法定代表人：步国甸

联系人：王万君

联系电话：025-8337029

客户服务电话：95386

传真：025-83369725

网址：www.njzq.com.cn

(41) 山西证券

注册地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

办公地址：太原市府西街 69 号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

联系人：郭熠

联系电话：0351-8686659

客户服务电话：95573 或 400-666-1618

传真：0351-8686619

网址：www.i618.com.cn

(42) 上海证券

注册地址：上海市黄浦区四川中路 213 号 7 楼

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：李俊杰

联系人：邵珍珍

联系电话：021-53686262

客户服务电话：021-962518

传真：021-53686100, 021-53686200

网址：www.962518.com

(43) 申万宏源西部证券

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

法定代表人：李季

联系人：李巍

联系电话：010-88085858

客户服务电话：400-800-0562

传真：010-88085195

网址：www.hysec.com

(44) 申万宏源证券

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

联系人：曹晔

联系电话：021-33389888

客户服务电话：95523、4008895523

传真：021-33388224

网址：www.swhysc.com

(45) 西南证券

注册地址：重庆市江北区桥北苑 8 号

办公地址：重庆市江北区桥北苑 8 号西南证券大厦

法定代表人：吴坚

联系人：张煜

联系电话：023-63786633

客户服务电话：4008096096

传真：023-63786212

网址：www.swsc.com.cn

(46) 湘财证券

注册地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 A 栋 11 层

法定代表人：林俊波

联系人：李欣

联系电话：021-68634510-88193

开放式基金咨询电话：400-888-1551

开放式基金业务传真：021-68865680

网址：www.xcsc.com

(47) 新时代证券

注册地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：田德军

联系人：田芳芳

联系电话：010-83561146

客户服务电话：4006989898

网址：www.xsdzq.cn

(48) 信达证券

注册地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

联系人：尹旭航

联系电话：010-63081000

客户服务电话：95321

传真：010-63080978

网址：www.cindasc.com

(49) 兴业证券

注册地址：福州市湖东路 268 号

办公地址：上海浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 12 楼

法定代表人：兰荣

联系人：夏中苏

联系电话：0591-38281963

客户服务电话：95562

网址：www.xyzq.com.cn

(50) 银河证券

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：邓颜

联系电话：010-66568292

客户服务电话：400-888-8888

传真：010-66568990

网址：www.chinastock.com.cn

(51) 银泰证券

注册地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行 18 楼

办公地址：深圳市福田区竹子林四路紫竹七道 18 号光大银行 18 楼

法定代表人：黄冰

联系人：张祥

电话：0755-83709901

传真：0755-83703200

客户服务电话：0755-83710885

公司网站：<http://www.ytzq.com>

(52) 英大证券

注册地址：广东省深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

办公地址：广东省深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：吴骏

联系人：吴尔晖

联系电话：0755-83007159

客户服务电话：4000-188-688

传真：0755-83007038

网址：www.ydsc.com.cn

(53) 招商证券

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

联系人：黄婵君

联系电话：0755-82943666

客户服务电话：95565、400-8888-111

传真：0755-82943636

网址：www.newone.com.cn

(54) 浙商证券

注册地址：浙江省杭州市杭大路 1 号

办公地址：浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A 座 6/7

法定代表人：吴承根

联系人：陈韵

联系电话：021-80108518

客户服务电话：95345

传真：021-80106010

网址：www.stocke.com.cn

(55) 中航证券

注册地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

办公地址：南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座 41 楼

法定代表人：王宜四

联系人：史江蕊

联系电话：010-64818301

客户服务电话：400-8866-567

传真：0791-86770178

网址：www.avicsec.com

(56) 中泰证券

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

法定代表人：李玮

联系人：许曼华

联系电话：021-20315290

客户服务电话：95538

传真：0531-68889095

网址: [www.zts.com.cn](http://www.zts.com.cn)

(57) 中投证券

注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心 A 栋第 18 层-21 层及第 04 层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

办公地址: 深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人: 高涛

联系人: 万玉琳

联系电话: 0755-82026907

客户服务电话: 95532

网址: [www.china-invs.cn](http://www.china-invs.cn)

(58) 中信建投证券

注册地址: 北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址: 北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人: 王常青

联系人: 权唐

开放式基金咨询电话: 95587

开放式基金业务传真: 010-65182261

网址: [www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(59) 中信证券

注册地址: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

联系人: 顾凌

联系电话: 010-60838888

传真: 010-60833739

客户服务电话: 95548

网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(60) 中信证券 (山东)

注册地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

办公地址: 青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层

法定代表人: 杨宝林

联系人: 赵艳青

联系电话: 0532-85023924

客户服务电话: 95548

传真: 0532-85022605

网址: [www.citicssd.com](http://www.citicssd.com)

(61) 中银国际证券

注册地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39-40 层

法定代表人：钱卫

联系人：王炜哲

开放式基金咨询电话：400-620-8888

开放式基金业务传真：021-50372474

网址：www.bocichina.com

(62) 中原证券

注册地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

法定代表人：菅明军

联系人：程月艳 范春艳

联系电话：0371-69099882

联系传真：0371-65585899

客户服务电话：95377

网址：www.ccnew.com

2、二级市场交易代办证券公司

投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。

(二) 登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系人：严峰、朱立元

电话：0755-25946013、010-59378839

传真：010-59378907

(三) 律师事务所和经办律师

律师事务所：上海市通力律师事务所

地址：上海市浦东新区银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

经办律师：吕红、安冬

联系人：安冬

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

首席合伙人：李丹

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

经办注册会计师：陈玲、周祎

联系人：周祎

#### 四、基金的名称

易方达保证金收益货币市场基金

#### 五、基金的类型

本基金为契约型开放式货币市场基金

#### 六、基金的投资目标

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。

#### 七、基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金，期限在一年以内（含一年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单，剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券，以及法律法规或中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后对货币市场基金的投资范围与限制进行调整，本基金将随之调整。

#### 八、基金的投资策略

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。

##### 1、资产配置策略

基金管理人根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量市场资金面走向、存款银行的信用资质、信用债券的信用评级以及各类资产的收益率水平、流动性特征等，确定各类资产的配置比例。

##### 2、杠杆投资策略

本基金将对回购利率与短期债券收益率、存款利率进行比较，并在对资金面进行综合分析的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作。

##### 3、银行存款及同业存单投资策略



本基金在向交易对手银行进行询价的基础上，选取利率报价较高的银行进行存款投资，在投资过程中注重对交易对手信用风险的评估和选择。当银行存款投资具有较高投资价值时，本基金存款投资比例上限最高可达 100%。

#### 4、债券回购投资策略

首先，基于对资金面走势的判断，选择回购品种和期限。若资产配置中有逆回购，则在判断资金面趋于宽松的情况下，优先进行相对较长期限逆回购配置；反之，则进行相对较短期限逆回购操作。若在组合进行杠杆操作时，判断资金面趋于宽松，则进行相对较短期限正回购操作；反之，则进行相对较长期限正回购操作，锁定融资成本。

#### 5、利率品种的投资策略

本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。

#### 6、信用品种的投资策略

基金管理人通过建立“内部信用评级体系”对市场公开发行的所有短期融资券、中期票据、企业债、公司债、可分离转债存债等信用品种进行研究和筛选，形成信用债券投资备选库。在此基础上，基金管理人结合本基金的投资与配置需要，通过对到期收益率、剩余期限、流动性特征等进行分析比较，挑选适当的短期信用品种进行投资。

#### 7、其他金融工具投资策略

本基金将密切跟踪银行承兑汇票、商业承兑汇票等商业票据以及各种衍生产品的动向，一旦监管机构允许基金参与此类金融工具的投资，本基金将在届时相应法律法规的框架内，根据对该金融工具的研究，制定符合本基金投资目标的投资策略，在充分考虑该投资品种风险和收益特征的前提下，谨慎投资。

### 九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：中国人民银行公布的活期存款基准利率的税后收益率，即活期存款基准利率 $\times$ (1-利息税税率)。

### 十、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 十一、基金投资组合报告（未经审计）

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

本基金的托管人中国交通银行股份有限公司根据本基金合同的规定，复核了本报告的内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告有关数据的期间为 2016 年 4 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日。

### 1、 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 固定收益投资 753,385,588.31 93.57

其中：债券 753,385,588.31 93.57

资产支持证券 --

2 买入返售金融资产 --

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 2,182,434.48 0.27

4 其他资产 49,555,573.32 6.16

5 合计 805,123,596.11 100.00

### 2、 报告期债券回购融资情况

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 0.09

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%。

### 3、 基金投资组合平均剩余期限

#### （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 112

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 112

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 32

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

本基金合同约定“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天”，本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限无超过 120 天的情况。

#### （2）报告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 13.34 0.02  
 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --  
 2 30天（含）—60天 2.49 --  
 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --  
 3 60天（含）—90天 21.05 --  
 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --  
 4 90天（含）—180天 62.77 --  
 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --  
 5 180天（含）—397天（含） --  
 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 --  
 合计 99.64 0.02

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摊余成本（元） 占基金资产净值比例（%）

1 国家债券 --  
 2 央行票据 --  
 3 金融债券 59,987,750.79 7.47  
 其中：政策性金融债 59,987,750.79 7.47  
 4 企业债券 --  
 5 企业短期融资券 119,926,557.42 14.93  
 6 中期票据 --  
 7 同业存单 573,471,280.10 71.38  
 8 其他 --  
 9 合计 753,385,588.31 93.77  
 10 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 --

5、报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 债券数量

（张） 摊余成本（元） 占基金资产净值比例（%）

1 111510387 15 兴业 CD387 1,000,000 99,300,095.04 12.36  
 2 150215 15 国开 15 600,000 59,987,750.79 7.47  
 3 111608203 16 中信 CD203 600,000 59,588,184.48 7.42  
 4 111618154 16 华夏 CD154 600,000 59,586,884.38 7.42  
 5 111617088 16 光大 CD088 600,000 59,297,297.31 7.38  
 6 111610257 16 兴业 CD257 600,000 59,296,153.39 7.38  
 7 111618164 16 华夏 CD164 600,000 59,118,471.71 7.36  
 8 111615123 16 民生 CD123 600,000 59,118,413.97 7.36  
 9 111611181 16 平安 CD181 600,000 59,097,377.33 7.36

10 111609196 16 浦发 CD196 600,000 59,068,402.49 7.35

## 6、“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 5 次

报告期内偏离度的最高值 0.3376%

报告期内偏离度的最低值 0.0734%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.1910%

## 7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8、投资组合报告附注

### (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。

(2) 本基金本报告期内不存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

(3) 15 兴业 CD387（代码：111510387）、16 兴业 CD257(代码：111610257)为易方达保证金货币市场基金的前十大持仓证券。2015 年 9 月 25 日，福建银监局对于兴业银行信贷资产非真实、完全转让处以 50 万元罚款的行政处罚。

16 浦发 CD196（代码：111609196）为易方达保证金货币市场基金的前十大持仓证券之一。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。

16 民生 CD123（代码：111615123）为易方达保证金货币市场基金的前十大持仓证券之一。2016 年 2 月 19 日，北京银监局对于民生银行当事人业务续做不审慎、未对交易背景进行认真审查、管理缺位导致对应车辆完全脱离监控的行为给予罚款人民币 50 万元的行政处罚。

本基金投资 15 兴业 CD387（代码：111510387）、16 兴业 CD257(代码：111610257)、

16 浦发 CD196（代码：111609196）、16 民生 CD123（代码：111615123）的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 15 兴业 CD387（代码：111510387）、16 兴业 CD257(代码：111610257)、16 浦发

CD196（代码：111609196）、16 民生 CD123（代码：111615123）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。

（4）其他各项资产构成

序号 名称 金额（元）

1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	45,009,691.00
3	应收利息	4,545,882.32
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	49,555,573.32

十一、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

本基金合同生效日为 2013 年 3 月 29 日，基金合同生效以来（截至 2016 年 6 月 30 日）的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示：

1、易方达保证金收益货币 A 类基金份额净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较表  
阶段 净值收益率（1） 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）

基金合同生效至 2013 年 12 月 31 日 2.6873% 0.0015% 0.2703% 0.0000% 2.4170% 0.0015%

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 4.0578% 0.0111% 0.3549% 0.0000% 3.7029%

0.0111%

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 3.1297% 0.0083% 0.3549% 0.0000% 2.7748%

0.0083%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 1.3114% 0.0008% 0.1769% 0.0000% 1.1345%

0.0008%

基金合同生效至 2016 年 6 月 30 日 11.6427% 0.0078% 1.1569% 0.0000% 10.4858%

0.0078%

2、易方达保证金收益货币 B 类基金份额净值收益率与同期业绩比较基准收益率比较表  
阶段 净值收益率（1） 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)

基金合同生效至 2013 年 12 月 31 日 3.1580% 0.0015% 0.2703% 0.0000% 2.8877% 0.0015%

2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日 4.6136% 0.0112% 0.3549% 0.0000% 4.2587%

0.0112%

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日 3.3901% 0.0084% 0.3549% 0.0000% 3.0352%

0.0084%

2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日 1.4375% 0.0008% 0.1769% 0.0000% 1.2606%

0.0008%

基金合同生效至 2016 年 6 月 30 日 13.1787% 0.0079% 1.1569% 0.0000% 12.0218%

0.0079%

### 十三、费用概览

#### (一) 基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 6、基金上市费及年费；
- 7、基金托管人办理清算、交割过程中相关的银行日内垫资费用；
- 8、基金份额持有人大会费用；
- 9、基金的证券交易费用；
- 10、基金的银行汇划费用；
- 11、证券账户开户费用、银行账户维护费用；
- 12、银行对本基金授信所产生的费用；
- 13、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$

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，基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 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、公休假或不可抗力等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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，基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

### 3、销售服务费

本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%；B 类基金份额的销售服务费年费率为 0。对于 A 类份额升级为 B 类份额或 B 类份额降级为 A 类份额，基金年销售服务费自份额类别变化后下一工作日起适用于新份额类别的费率。

销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

H 为该类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为该类基金份额前一日的基金资产净值

R 为该类基金份额适用的销售服务费年费率

销售服务费每日计提，按月支付。基金管理人和基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月前 3 个工作日内从基金资产中划出，经登记结算机构或基金管理人支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务等。基金募集期间的上述费用不从销售服务费中列支。

上述“一、基金费用的种类中第 4—12 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

#### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）与基金销售有关的费用

本基金不收取申购费用和赎回费用。

#### （五）费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等费率，无须召开基金份额持有人

大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒体上公告。

#### 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》、《关于实施〈货币市场基金监督管理办法〉有关问题的规定》等有关法律法规及《易方达保证金收益货币市场基金基金合同》，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对2016年5月13日刊登的本基金更新的招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、在“重要提示”、“一、绪言”、“二、释义”、“十、基金份额的申购、赎回”、“十一、基金的投资”、“十四、基金资产的估值”、“十九、风险揭示”、“二十一、基金合同的内容摘要”、“二十二、基金托管协议的内容摘要”部分，根据相关公告的内容进行了更新。
- 2、在“三、基金管理人”部分，更新了部分内容。
- 3、在“四、基金托管人”部分，根据最新资料进行了更新。
- 4、在“五、相关服务机构”部分，更新了基金份额销售机构信息和会计师事务所信息。
- 5、在“十、基金份额的申购、赎回”部分，更新了“7. 申购、赎回清单的内容与格式”部分的内容。
- 6、在“十一、基金的投资”部分，补充了本基金2016年第2季度投资组合报告的内容。
- 7、在“十二、基金的业绩”部分，更新了基金合同生效以来的投资业绩数据。
- 8、在“二十四、其他应披露事项”部分，根据相关公告的内容进行了更新。

易方达基金管理有限公司

2016年11月12日