

易方达保证金收益货币市场基金

2021 年中期报告

2021 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月二十八日

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。本中期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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 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 2021 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 债券回购融资情况	34
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	35
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	36
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	36
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	37
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	37
7.9 投资组合报告附注	37

8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	41
8.2 期末上市基金前十名持有人	41
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	42
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.5 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	42
9 开放式基金份额变动.....	43
10 重大事件揭示.....	43
10.1 基金份额持有人大会决议	43
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	45
10.9 其他重大事件	45
11 备查文件目录.....	46
11.1 备查文件目录	46
11.2 存放地点	46
11.3 查阅方式	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达保证金收益货币市场基金	
基金简称	易方达保证金货币	
场内简称	货币 ETF	
基金主代码	159001	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 3 月 29 日	
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	
报告期末基金份额总额	42,195,031.00 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2014 年 10 月 20 日	
下属分级基金的基金简称	易方达保证金货币 A	易方达保证金货币 B
下属分级基金的交易代码	159001	159002
报告期末下属分级基金的份额总额	1,865,257.00 份	40,329,774.00 份

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，主要投资策略包括资产配置策略、杠杆投资策略、银行存款及同业存单投资策略、债券回购投资策略、利率品种的投资策略、信用品种的投资策略、其他金融工具投资策略。
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 $\times(1 - \text{利息税税率})$
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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	张南	陆志俊

负责人	联系电话	020-85102688	95559
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		400 881 8088	95559
传真		020-38798812	021-62701216
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）	中国（上海）自由贸易试验区银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码		510620	200336
法定代表人		刘晓艳	任德奇

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

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（2021年1月1日至2021年6月30日）	
	易方达保证金货币 A	易方达保证金货币 B
本期已实现收益	2,088,919.16	31,554,091.41
本期利润	2,088,919.16	31,554,091.41
本期净值收益率	0.9634%	1.0886%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
	易方达保证金货币 A	易方达保证金货币 B
期末基金资产净值	186,525,700.00	4,032,977,400.00
期末基金份额净值	100.0000	100.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	

	易方达保证金货币 A	易方达保证金货币 B
累计净值收益率	26.4009%	29.7516%

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月结转份额。

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

易方达保证金货币 A

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1547%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.1255%	0.0004%
过去三个月	0.4608%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.3723%	0.0004%
过去六个月	0.9634%	0.0014%	0.1760%	0.0000%	0.7874%	0.0014%
过去一年	1.8820%	0.0014%	0.3549%	0.0000%	1.5271%	0.0014%
过去三年	6.1758%	0.0015%	1.0656%	0.0000%	5.1102%	0.0015%
自基金合同生效 起至今	26.4009%	0.0054%	2.9322%	0.0000%	23.4687%	0.0054%

易方达保证金货币 B

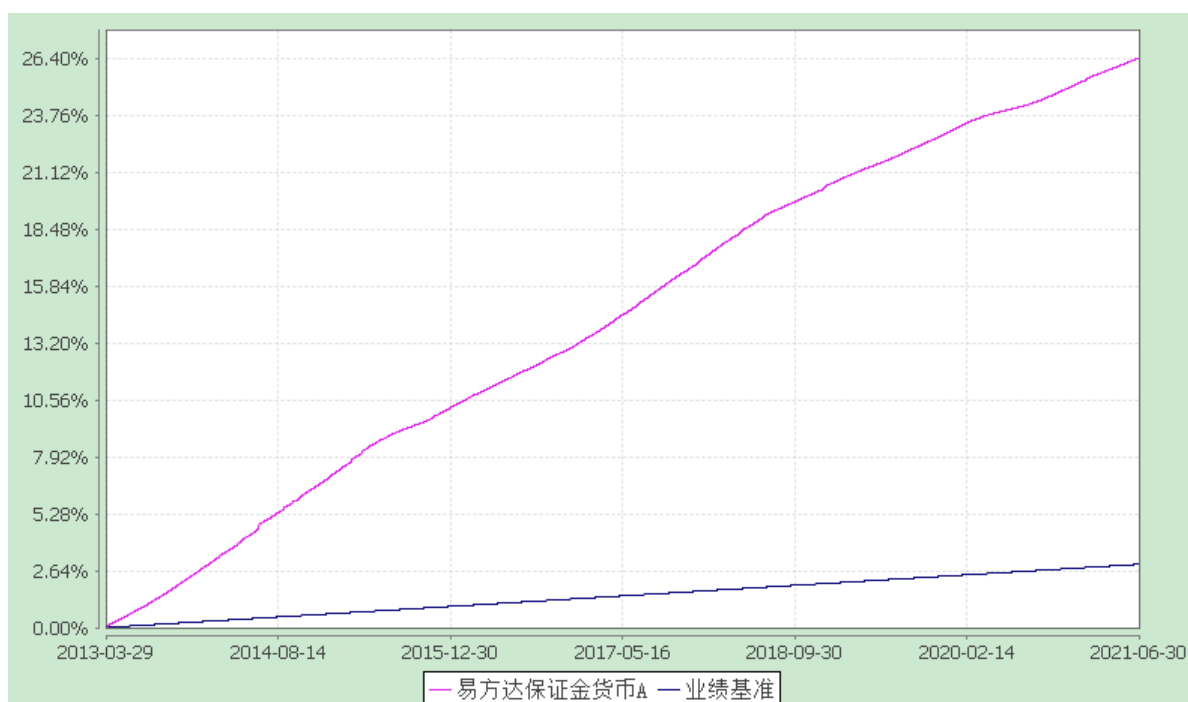
阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1753%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.1461%	0.0004%
过去三个月	0.5235%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.4350%	0.0004%
过去六个月	1.0886%	0.0014%	0.1760%	0.0000%	0.9126%	0.0014%
过去一年	2.1370%	0.0014%	0.3549%	0.0000%	1.7821%	0.0014%
过去三年	6.9751%	0.0015%	1.0656%	0.0000%	5.9095%	0.0015%
自基金合同生效 起至今	29.7516%	0.0055%	2.9322%	0.0000%	26.8194%	0.0055%

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

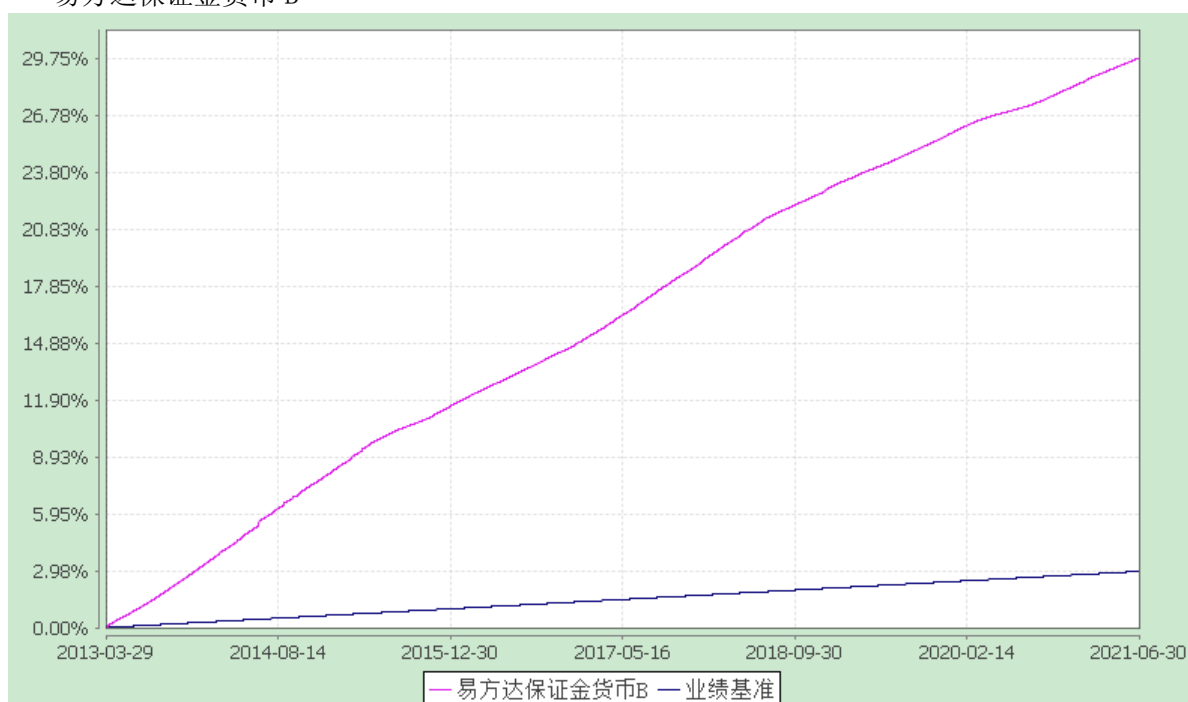
易方达保证金收益货币市场基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年3月29日至2021年6月30日)

易方达保证金货币 A



易方达保证金货币 B



注：自基金合同生效至报告期末，A类基金份额净值收益率为26.4009%，B类基金份额净值收益率为29.7516%，同期业绩比较基准收益率为2.9322%。

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, 本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日, 注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、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, 在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局, 为境内外客户提供资产管理解决方案。

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、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达天天发货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达天天增利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、易方达易理财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、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、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	2013-04-22	-	12 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。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、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金经理。
梁莹	本基金的基金经理、易方达稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达安和中短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利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、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达货	2017-08-08	-	11 年	硕士研究生, 具有基金从业资格。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、投资经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金经理, 易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。

	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、易方达易理财货币市场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、现金管理部总经理助理				
易 璩	本基金的基金经理助理、易方达稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资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、易方达现金增利货币市场基金的基金经理助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理、易方达增金宝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、易方达天天发货币市场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、易方达龙宝货币市场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助理、易方达安和中短债债券型证券投资基金的基金经理助理、投资经理	2018-06-20	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截至报告期末，梁莹没有管理私募资产管理计划。报告期内，梁莹管理的 1 个私募资产管理计划已于 2021 年 3 月 10 日离任。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 15 次，均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。

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

债券市场在年初延续去年 11 月永煤违约事件以来的宽松行情，为了对冲信用风险冲击，央行不断释放流动性维稳信号，打破了原来市场的债熊一致预期，长端利率向下修复。而从 1 月下旬到 2 月底，即春节假期前后，长端收益率转而掉头向上；具体来看，元旦后公开市场投放连续缩量，春节前央行提前收紧流动性再次打破“春节行情”的一致预期，叠加春节后大宗商品上涨引发的通胀加息担忧和节后经济动能恢复强劲，债市重新走熊。3 月以来，在地方债供给上量预期、经济动能表现超预期、央行公开市场操作持续谨慎等诸多担忧之中，利率债走出了一波下行行情；主导市场的运行逻辑就是钱多，同时中美会晤却颇多摩擦、“新疆棉花”事件进一步加大摩擦，避险情绪的“推波助澜”下债市收益率再次下行。进入二季度中上旬，主导债市行情的主要逻辑依然是“钱多”。具体来看，虽然市场普遍担忧二季度地方债供给加速以弥补一季度的空白，以及大宗商品价格涨幅过快带来核心通胀高企的加息问题，而且上述担忧在一定程度上也确实有所实现，但央行的货币政策始终未如大家所预期的那般开始收紧。此外，缓慢的上涨行情中，机构普遍低杠杆运作，叠加国常会提出“应对大宗商品价格过快上涨及其连带影响”稳定了市场情绪，“资产荒”使得机构的配置需求一直较为旺盛。而 6 月初开始，一方面半年末流动性问题即将到来，另一方面经历了五个月的慢牛行情后，利率的进一步下行遇到前低挑战，部分前期做多的资金存在止盈需求，引发了一波调整。但上

述调整行情并未能持续多久，美债走势强势下行提振现券市场情绪，同时央行打破了自 3 月 1 日以来每日 100 亿的公开市场投放惯例，连续两日做了 300 亿元的 7 天逆回购，释放出较为明确的流动性维稳信号，债市收益率再次下行。

操作方面，报告期内基金以同业存单、同业存款和短期逆回购为主要配置资产。根据市场变化情况，调整不同资产的仓位，维持组合合理的剩余期限和杠杆率。总体来看，组合在上半年保持了较好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 A 类基金份额净值收益率为 0.9634%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%；B 类基金份额净值收益率为 1.0886%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于债券市场，我们认为下半年政府对于政策组合的选择是关键，经济基本面未来的走势主要取决于后续政策组合的选择：一种选择就是财政、信用持续收紧，而货币继续宽松，也就是上半年政策组合的延续。政策逻辑可能一方面从债务和结构的角度出发要持续控制地方政府债务和房地产风险，一方面又想适度支持实体经济。但这种组合将对经济造成持续的压制，从而造成宏观经济上的下行风险。另一种选择就是财政信用适度宽松，而货币维持稳定。这种选择意味着政策意识到经济下行的风险，所以对整体政策做适当的调整。随后可能对偏紧的财政和信用政策也作适度的调整。这种政策组合下，经济下行的压力可能会得到相应的缓解，市场对于经济的预期也会相应调整。目前来看，延续第一种紧财政紧信用同时宽货币的概率更高，有利于债券市场。但是从收益率的角度，目前已经处于偏低的水平，隐含了较多的收益下行的预期。综合来看，债券采取中性配置，增加资产流动性，可能是较优的选择。

基于以上判断，本基金将继续维持合理的组合久期和杠杆，坚持货币市场基金是流动性管理工具的定位，在保持组合流动性安全的前提下，把握市场的波段操作机会，尽量提高组合收益率。基金管理人将坚持规范运作、审慎投资、勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、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，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直接的重大利益冲突。

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《易方达保证金收益货币市场基金基金合同》，本基金每日将各类基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在易方达保证金收益货币市场基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，易方达基金管理有限公司在易方达保证金收益货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由易方达基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关易方达保证金收益货币市场基金的中期报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：易方达保证金收益货币市场基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,301,001,639.64	62,902,303.07
结算备付金		81,961,111.11	38,810,476.19
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,481,715,789.08	209,476,806.59
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,481,715,789.08	209,476,806.59
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,219,968,348.45	974,770,299.96
应收证券清算款		133,054,318.63	83,025,891.07
应收利息	6.4.7.5	6,476,538.14	2,377,401.11
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,224,177,745.05	1,371,363,177.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
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		-	-
应付证券清算款		6,622.56	211,843,222.95
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		718,995.55	173,248.53
应付托管费		287,598.19	69,299.40
应付销售服务费		43,269.99	37,004.00
应付交易费用	6.4.7.7	22,563.20	6,992.35

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		3,497,331.34	1,092,510.76
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	98,264.22	189,300.00
负债合计		4,674,645.05	213,411,577.99
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,219,503,100.00	1,157,951,600.00
未分配利润	6.4.7.10	0.00	0.00
所有者权益合计		4,219,503,100.00	1,157,951,600.00
负债和所有者权益总计		4,224,177,745.05	1,371,363,177.99

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 100.0000 元，B 类基金份额净值 100.0000 元；基金份额总额 42,195,031.00 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,865,257.00 份，B 类基金份额总额 40,329,774.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达保证金收益货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		38,639,614.14	9,537,468.37
1.利息收入		38,580,401.05	9,521,975.81
其中：存款利息收入	6.4.7.11	6,560,128.57	1,201,023.28
债券利息收入		12,541,639.86	3,931,470.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		19,478,632.62	4,389,482.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		59,213.09	15,492.56
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	59,213.09	15,492.56
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
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	-	-
减：二、费用		4,996,603.57	1,741,627.59
1. 管理人报酬		3,180,383.93	823,673.22
2. 托管费		1,272,153.56	329,469.23
3. 销售服务费		275,705.68	271,390.73
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		148,152.05	203,694.59
其中：卖出回购金融资产支出		148,152.05	203,694.59
6. 税金及附加		-	291.45
7. 其他费用	6.4.7.15	120,208.35	113,108.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,643,010.57	7,795,840.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,643,010.57	7,795,840.78

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达保证金收益货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	1,157,951,600.00	-	1,157,951,600.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,643,010.57	33,643,010.57
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）	3,061,551,500.00	-	3,061,551,500.00
其中：1.基金申购款	74,695,576,200.00	-	74,695,576,200.00
2.基金赎回款	-71,634,024,700.00	-	-71,634,024,700.00
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）	-	-33,643,010.57	-33,643,010.57
五、期末所有者权益（基金净值）	4,219,503,100.00	-	4,219,503,100.00
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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	449,938,300.00	-	449,938,300.00

净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,795,840.78	7,795,840.78
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)	13,059,900.00	-	13,059,900.00
其中: 1.基金申购款	29,103,199,700.00	-	29,103,199,700.00
2.基金赎回款	-29,090,139,800.00	-	-29,090,139,800.00
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)	-	-7,795,840.78	-7,795,840.78
五、期末所有者权益(基金净值)	462,998,200.00	-	462,998,200.00

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

易方达保证金收益货币市场基金(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]62 号《关于核准易方达保证金收益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《易方达保证金收益货币市场基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达保证金收益货币市场基金基金合同》于 2013 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 4,222,011,130.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 142,130.00 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金已于 2014 年 10 月 10 日进行了基金份额折算，中国证券登记结算有限责任公司按每 100 份基金份额相应折算成 1 份，对 2014 年 10 月 10 日(权益登记日)登记在册的本基金的基金份额实施折算，并于 2014 年 10 月 10 日进行了变更登记。本基金折算后，基金份额总额为 4,210,100 份，基金份额净值为 100.00 元；基金份额持有人原来持有的每 100 份基金份额变更为 1 份。

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<年度报告和中期报告>》、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》、《易方达保证金收益货币市场基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、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更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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 2021年6月30日
活期存款	1,001,639.64
定期存款	1,300,000,000.00
其中:存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	300,000,000.00
存款期限 3 个月以上	1,000,000,000.00
其他存款	-
合计	1,301,001,639.64

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目		本期末 2021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	1,481,715,78 9.08	1,481,807,000. 00	91,210.92	0.0022
	合计	1,481,715,78 9.08	1,481,807,000. 00	91,210.92	0.0022
资产支持证券		-	-	-	-
合计		1,481,715,78 9.08	1,481,807,000. 00	91,210.92	0.0022

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 2021年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,121,000,000.00	-
银行间市场	98,968,348.45	-
合计	1,219,968,348.45	-

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 2021年6月30日
应收活期存款利息	277.58
应收定期存款利息	3,406,472.51
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	33,194.25
应收债券利息	2,645,161.64
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	391,432.16
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	6,476,538.14

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 2021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	22,563.20
合计	22,563.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	98,264.22
合计	98,264.22

6.4.7.9 实收基金**易方达保证金货币 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,483,985.00	148,398,500.00
本期申购	512,716,581.00	51,271,658,100.00
本期赎回（以“-”号填列）	-512,335,309.00	-51,233,530,900.00
本期末	1,865,257.00	186,525,700.00

易方达保证金货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,095,531.00	1,009,553,100.00
本期申购	234,239,181.00	23,423,918,100.00
本期赎回（以“-”号填列）	-204,004,938.00	-20,400,493,800.00
本期末	40,329,774.00	4,032,977,400.00

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额，赎回含转换出、级别调整出份额。

6.4.7.10 未分配利润**易方达保证金货币 A**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.00	-	0.00
本期利润	2,088,919.16	-	2,088,919.16
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	-2,088,919.16	-	-2,088,919.16
本期末	0.00	-	0.00

易方达保证金货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.00	-	0.00
本期利润	31,554,091.41	-	31,554,091.41
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	-31,554,091.41	-	-31,554,091.41
本期末	0.00	-	0.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	15,609.50
定期存款利息收入	5,786,246.84
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	758,272.23
其他	-
合计	6,560,128.57

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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	2,337,819,009.36
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	2,328,477,796.27
减：应收利息总额	9,282,000.00
买卖债券差价收入	59,213.09

6.4.7.13 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,903.01
信息披露费	59,507.37

银行汇划费	12,344.13
银行间账户维护费	17,853.84
其他	600.00
合计	120,208.35

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
交通银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,180,383.93	823,673.22
其中：支付销售机构的客户	338,103.65	32,974.74

维护费		
-----	--	--

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.2% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年6月30日	2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,272,153.56	329,469.23

注：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。

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		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达保证金货币 A	易方达保证金货币 B	合计
易方达基金管理有限公司	25,010.75	-	25,010.75
广发证券	18,991.20	-	18,991.20
合计	44,001.95	-	44,001.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达保证金货币 A	易方达保证金货币 B	合计

易方达基金管理有限 公司	46,647.48	-	46,647.48
广发证券	22,339.39	-	22,339.39
合计	68,986.87	-	68,986.87

注：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。

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 2021年1月1日至2021年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	-	-	839,936,000.00	48,058.37	-	-
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

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自有资金投资本基金。

6.4.10.4 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达保证金货币 A

无。

易方达保证金货币 B

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
交通银行-活期存款	1,001,639.64	15,609.50	14,613,487.11	10,484.73

注：本基金的上述银行存款由基金托管人交通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

易方达保证金货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
-	2,072,703.02	16,216.14	2,088,919.16	-

易方达保证金货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
-	29,165,486.97	2,388,604.44	31,554,091.41	-

6.4.12 期末（2021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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 2021 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为 0，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 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、基金投资部门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、监察合规管理部门、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，属于证券投资基金中高流动性、低风险品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。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 2021 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 29.43%(2020 年 12 月 31 日: 10.32%)。

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	242,513,449.82	92,249,173.15
合计	242,513,449.82	92,249,173.15

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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	1,241,847,500.90	119,462,248.20
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	1,241,847,500.90	119,462,248.20

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 2021 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 2021年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,301,001,639.64	-	-	-	1,301,001,639.64
结算备付金	81,961,111.11	-	-	-	81,961,111.11
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	1,481,715,789.08	-	-	-	1,481,715,789.08
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,219,968,348.45	-	-	-	1,219,968,348.45
应收证券清算款	-	-	-	133,054,318.63	133,054,318.63
应收利息	-	-	-	6,476,538.14	6,476,538.14
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,084,646,888.28	-	-	139,530,856.77	4,224,177,745.05
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	-	-	-	-	-
应付证券清	-	-	-	6,622.56	6,622.56

算款					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	718,995.55	718,995.55
应付托管费	-	-	-	287,598.19	287,598.19
应付销售服务费	-	-	-	43,269.99	43,269.99
应付交易费用	-	-	-	22,563.20	22,563.20
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	3,497,331.34	3,497,331.34
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	98,264.22	98,264.22
负债总计	-	-	-	4,674,645.05	4,674,645.05
利率敏感度缺口	4,084,646,888.28	-	-	134,856,211.72	4,219,503,100.00
上年度末 2020 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	62,902,303.07	-	-	-	62,902,303.07
结算备付金	38,810,476.19	-	-	-	38,810,476.19
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	209,476,806.59	-	-	-	209,476,806.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	974,770,299.96	-	-	-	974,770,299.96
应收证券清算款	-	-	-	83,025,891.07	83,025,891.07
应收利息	-	-	-	2,377,401.11	2,377,401.11
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,285,959,885.81	-	-	85,403,292.18	1,371,363,177.99
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	211,843,222.95	211,843,222.95
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	173,248.53	173,248.53
应付托管费	-	-	-	69,299.40	69,299.40
应付销售服务费	-	-	-	37,004.00	37,004.00
应付交易费用	-	-	-	6,992.35	6,992.35
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	1,092,510.76	1,092,510.76
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	189,300.00	189,300.00
负债总计	-	-	-	213,411,577.99	213,411,577.99
利率敏感度缺口	1,285,959,885.81	-	-	-128,008,285.81	1,157,951,600.00

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

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 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	776,699.78	71,934.32
	2.市场利率上升25个基点	-774,800.82	-71,867.49

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。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投

资股票、权证等其他交易性金融资产。

于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

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 2021 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 1,481,715,789.08 元，无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第二层次 209,476,806.59 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2021 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(2020 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	1,481,715,789.08	35.08
	其中：债券	1,481,715,789.08	35.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,219,968,348.45	28.88
	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	1,382,962,750.75	32.74
4	其他各项资产	139,530,856.77	3.30
5	合计	4,224,177,745.05	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	0.50	
	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%。

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	44
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	62
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	7

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	69.32	0.00
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	7.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	4.74	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	9.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	9.32	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	99.96	0.00

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	89,996,258.81	2.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,872,029.37	3.55

	其中：政策性金融债	149,872,029.37	3.55
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,241,847,500.90	29.43
8	其他	-	-
9	合计	1,481,715,789.08	35.12
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	112010278	20 兴业银行 CD278	2,000,000	199,711,761.84	4.73
2	112004095	20 中国银行 CD095	2,000,000	199,579,264.94	4.73
3	112182839	21 宁波银行 CD161	1,500,000	149,794,829.83	3.55
4	112105002	21 建设银行 CD002	1,500,000	147,861,383.29	3.50
5	112105013	21 建设银行 CD013	1,500,000	147,520,757.96	3.50
6	112003124	20 农业银行 CD124	1,000,000	99,872,215.57	2.37
7	112109164	21 浦发银行 CD164	1,000,000	99,869,009.99	2.37
8	112105073	21 建设银行 CD073	1,000,000	97,856,320.27	2.32
9	2103674	21 进出 674	800,000	79,897,349.31	1.89
10	112009469	20 浦发银行 CD469	500,000	49,901,172.77	1.18

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	0.0223%
报告期内偏离度的最低值	-0.0102%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0079%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

7.9.2 2020 年 8 月 21 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司资金营运中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：2017 年 7 月至 2019 年 6 月，该中心黄金租赁业务严重违反审慎经营规则。2020 年 8 月 31 日，中国银保监会福建监管局对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元”的行政处罚决定：同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。2020 年 9 月 4 日，中国人民银行福州中心支行对兴业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款”的行政处罚决定：1.为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2.为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3.违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4.违反银行

卡收单外包管理规定；5.未按规定履行客户身份识别义务。2020 年 10 月 22 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对兴业银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款人民币 50 万元”的行政处罚决定：信用卡授信审批严重违反审慎经营规则。

2020 年 12 月 1 日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司“原油宝”产品风险事件中的如下违法违规行为作出罚款 5050 万元的行政处罚决定：产品管理不规范，包括保证金相关合同条款不清晰、产品后评价工作不独立、未对产品开展压力测试相关工作等；风险管理不审慎，包括市场风险限额设置存在缺陷、市场风险限额调整和超限操作不规范、交易系统功能存在缺陷未按要求及时整改等；内控管理不健全，包括绩效考核和激励机制不合理、消费者权益保护履职不足、全行内控合规检查未涵盖全球市场部对私产品销售管理等；销售管理不合规，包括个别客户年龄不满足准入要求、部分宣传销售文本内容存在夸大或者片面宣传、采取赠送实物等方式销售产品等。

2021 年 5 月 17 日，中国银行保险监督管理委员会对中国银行股份有限公司的如下违法违规行为罚没 8761.355 万元：一、向未纳入预算的政府购买服务项目发放贷款；二、违规向关系人发放信用贷款；三、向无资金缺口企业发放流动资金贷款；四、存款月末冲时点；五、为无真实贸易背景企业签发银行承兑汇票；六、贷款管理不严，信贷资金被挪用；七、票据贴现资金直接回流至出票人或其关联人账户；八、理财产品质押贸易融资业务风险控制有效性不足；九、超比例发放并购贷款；十、向未经备案的跨境并购业务提供并购贷款；十一、违规为私募股权基金收购境内企业发放并购贷款；十二、超授权期限办理汇出汇款融资业务；十三、与名单外交易对手开展同业业务；十四、违规为他行开立投融资性同业账户；十五、以同业返存方式不当吸收存款；十六、自营和代客理财业务未能实现风险隔离；十七、面向一般客户销售的理财产品投资二级市场股票；十八、未按规定向投资者充分披露理财产品投资非标准化债权风险状况；十九、违规向四证不全房地产项目提供融资；二十、理财资金违规用于支付土地款或置换股东购地借款；二十一、理财资金违规用于土地储备项目；二十二、理财非标融资入股商业银行；二十三、理财非标融资用于商业银行注册验资；二十四、超授信额度提供理财非标融资；二十五、买入返售业务标的资产不合规；二十六、个人住房贷款业务搭售保险产品；二十七、单家分支行代销 3 家以上保险公司保险产品；二十八、主承销债券包销余券未通过风险处置专户处置；二十九、通过平移贷款延缓风险暴露；三十、债券投资业务未分类，表内人民币债券未计提减值准备；三十一、与资产管理公司合作设立有限合伙基金，不洁净转让不良资产；三十二、迟报案件信息；三十三、案件问责不到位；三十四、提供质价不符的服务；三十五、违规收取福费廷风险承担费；三十六、违规向部分已签约代发工资客户收取年费。

2020 年 10 月 16 日，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款人民币 30 万元，并责令该行对贷后管理不到位直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚：授信业务未

履行关系人回避制度、贷后管理不到位。2021 年 6 月 10 日，宁波银保监局对宁波银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款人民币 25 万元，并责令该行对相关直接责任人员给予纪律处分”的行政处罚：代理销售保险不规范。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对中国建设银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“罚款合计 3920 万元”的行政处罚决定：（一）内控管理不到位，支行原负责人擅自为同业投资违规提供担保并发生案件；（二）理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及提供土地储备融资；（三）逆流程开展业务操作；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）未做到理财业务与自营业务风险隔离；（六）个人理财资金违规投资；（七）违规为理财产品提供隐性担保；（八）同业投资违规接受担保。

2020 年 8 月 10 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款共计 2100 万元”的行政处罚：1. 未按专营部门制规定开展同业业务；2. 同业投资资金违规投向“四证”不全的房地产项目；3. 延迟支付同业投资资金吸收存款；4. 为银行理财资金投向非标准化债权资产违规提供担保；5. 未按规定进行贷款资金支付管理与控制；6. 个人消费贷款贷后管理未尽职；7. 通过票据转贴现业务调节信贷规模；8. 银行承兑汇票业务保证金来源审核未尽职；9. 办理无真实贸易背景的贴现业务；10. 委托贷款资金来源审查未尽职；11. 未按权限和程序办理委托贷款业务；12. 未按权限和程序办理非融资性保函业务。2020 年 11 月 26 日，国家外汇管理局上海市分局对上海浦东发展银行股份有限公司如下违法违规行为罚款 140 万元人民币：1、违反公正、公平、诚信原则，违规开展外汇市场交易。2、违反银行交易记录管理规定。2021 年 4 月 23 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司的如下违法违规行为罚款 760 万元人民币：2016 年 5 月至 2019 年 1 月，该行未按规定开展代销业务。2021 年 5 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司的如下违法违规行为罚款 40 万元人民币：信用卡资金流向管控严重违反审慎经营规则。

2020 年 7 月 13 日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 55.3 万元，罚款 5260.3 万元，罚没合计 5315.6 万元”的行政处罚决定：（一）向关系人发放信用贷款；（二）批量处置不良资产未公告；（三）批量处置不良资产未向监管部门报告；（四）违规转让正常类贷款；（五）个人住房贷款首付比例违规；（六）流动资金贷款被用于固定资产投资；（七）超过实际需求发放流动资金贷款；（八）贷后管理缺失导致企业套取扶贫贷款资金用于房地产开发；（九）贷款用于偿还银行承兑汇票垫款；（十）承兑业务贸易背景审查不严；（十一）保理业务授权管理不到位；（十二）贴现资金直接回流至银行承兑汇票出票人；（十三）贷款资金直接转存银行承兑汇票保证金；（十四）信贷资金用于兑付到期理财产品；（十五）信贷资金用于

承接承销债券；（十六）销售非保本理财产品违规出具承诺函；（十七）提供与事实不符的报告；（十八）理财产品相互交易、相互调节收益；（十九）面向一般个人投资者销售的理财产品投向股权投资；（二十）将系统内资金纳入一般存款核算，虚增存款；（二十一）开立同业银行结算账户不合规；（二十二）个别人员未经核准即履行高管人员职责；（二十三）对小微企业不当收费；（二十四）未按规定报送案件。2020 年 12 月 7 日，中国银行保险监督管理委员会对中国农业银行股份有限公司的如下违法违规行为作出“没收违法所得 49.59 万元和罚款 148.77 万元，罚没金额合计 198.36 万元”的行政处罚决定：农业银行收取已签约开立的代发工资账户、退休金账户、低保账户、医保账户、失业保险账户、住房公积金账户的年费和账户管理费（含小额账户管理费）。2021 年 1 月 19 日，中国银行保险监督管理委员会对农业银行的如下违法违规行为罚款 420 万元：（一）发生重要信息系统突发事件未报告；（二）制卡数据违规明文留存；（三）生产网络、分行无线互联网络保护不当；（四）数据安全较粗放，存在数据泄露风险；（五）网络信息系统存在较多漏洞；（六）互联网门户网站泄露敏感信息。

本基金投资 20 兴业银行 CD278、20 中国银行 CD095、21 宁波银行 CD161、21 建设银行 CD002、21 建设银行 CD013、21 浦发银行 CD164、20 农业银行 CD124、21 建设银行 CD073、20 浦发银行 CD469 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 20 兴业银行 CD278、20 中国银行 CD095、21 宁波银行 CD161、21 建设银行 CD002、21 建设银行 CD013、21 浦发银行 CD164、20 农业银行 CD124、21 建设银行 CD073、20 浦发银行 CD469 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	133,054,318.63
3	应收利息	6,476,538.14
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	139,530,856.77

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达保证金货币 A	2,202	847.07	481,127.00	25.79%	1,384,130.00	74.21%
易方达保证金货币 B	202	199,652.35	37,717,786.00	93.52%	2,611,988.00	6.48%
合计	2,404	17,552.01	38,198,913.00	90.53%	3,996,118.00	9.47%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	恒生前海基金—深圳市金凯工贸发展有限公司—恒生前海融新 2 号混合型单一资产管理计划	1,072,900.00	2.54%
2	兴证证券资管—兴业银行—证券行业支持民企发展系列之兴业证券 1 号 FOF 集合资产管理计划	999,900.00	2.37%
3	五矿国际信托有限公司	944,624.00	2.24%
4	景顺长城基金—招商银行—景顺长城价值优选 1 号集合资产管理计划	803,800.00	1.90%
5	国泰基金—渤海银行封闭式固定收益型人民币理财产品(零售公募—2020GG24)—国泰基金渤祥系列 9 号单一资产管理计划	798,919.00	1.89%
6	李威	794,721.00	1.88%
7	上海展弘投资管理有限公司—雅佳一号	580,010.00	1.37%

	私募投资基金		
8	国泰基金—渤海银行封闭式固定收益型人民币理财产品（零售公募—2020GG23）—国泰基金渤祥系列 8 号单一资产管理计划	515,000.00	1.22%
9	北京卓识私募基金管理有限公司—卓识佳鑫私募证券投资基金	500,029.00	1.19%
10	景顺长城基金—工商银行—景顺长城基金景裕 1 号集合资产管理计划	460,000.00	1.09%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 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	基金类机构	1,072,900.00	2.54%
2	券商类机构	999,900.00	2.37%
3	信托类机构	944,624.00	2.24%
4	基金类机构	803,800.00	1.90%
5	基金类机构	798,919.00	1.89%
6	个人	794,721.00	1.88%
7	基金类机构	580,010.00	1.37%
8	基金类机构	515,000.00	1.22%
9	基金类机构	500,029.00	1.19%
10	基金类机构	460,000.00	1.09%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达保证金货币 A	0.00	0.0000%
	易方达保证金货币 B	0.00	0.0000%
	合计	0.00	0.0000%

8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	易方达保证金货币 A	0
	易方达保证金货币 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达保证金货币 A	0
	易方达保证金货币 B	0

	合计	0
--	----	---

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达保证金货币 A	易方达保证金货币 B
基金合同生效日（2013 年 3 月 29 日）基金份额总额	1,078,871,033.00	3,143,140,097.00
本报告期期初基金份额总额	1,483,985.00	10,095,531.00
本报告期基金总申购份额	512,716,581.00	234,239,181.00
减：本报告期基金总赎回份额	512,335,309.00	204,004,938.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	1,865,257.00	40,329,774.00

注：总申购份额含因份额升降级、二级市场买入等导致的强制调增份额，总赎回份额含因份额升降级、二级市场卖出等导致的强制调减份额。

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

本基金管理人于 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员。

本报告期内，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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，基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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

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

c) 基金交易单元的选择程序如下:

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

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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	1,367,263,000.00	1.20%	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	112,797,400,000.00	98.80%	-	-

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旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2021-01-21
2	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证券报	2021-03-30
4	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02

5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2021-04-19
6	易方达基金管理有限公司关于易方达保证金收益货币市场基金流动性服务商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-21

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保证金收益货币市场基金募集的文件；
- 2.《易方达保证金收益货币市场基金基金合同》；
- 3.《易方达保证金收益货币市场基金托管协议》；
- 4.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

二〇二一年八月二十八日