

# 易方达现金增利货币市场基金

## 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二二年三月三十日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|     |  |    |
|-----|--|----|
| § 1 | 重要提示及目录.....                             | 2  |
| 1.1 | 重要提示.....                                | 2  |
| 1.2 | 目录.....                                  | 3  |
| § 2 | 基金简介.....                                | 5  |
| 2.1 | 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 | 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 | 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 | 其他相关资料.....                              | 6  |
| § 3 | 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....                | 6  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标.....                         | 6  |
| 3.2 | 基金净值表现.....                              | 7  |
| 3.3 | 过去三年基金的利润分配情况.....                       | 12 |
| § 4 | 管理人报告.....                               | 13 |
| 4.1 | 基金管理人及基金经理情况.....                        | 13 |
| 4.2 | 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....              | 15 |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 15 |
| 4.4 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 17 |
| 4.5 | 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 17 |
| 4.6 | 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....                 | 18 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 20 |
| 4.8 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 20 |
| § 5 | 托管人报告.....                               | 20 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 20 |
| 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..... | 20 |
| 5.3 | 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....      | 20 |
| § 6 | 审计报告.....                                | 21 |
| 6.1 | 审计意见.....                                | 21 |
| 6.2 | 形成审计意见的基础.....                           | 21 |
| 6.3 | 管理层和治理层对财务报表的责任.....                     | 21 |
| 6.4 | 注册会计师对财务报表审计的责任.....                     | 22 |
| § 7 | 年度财务报表.....                              | 23 |
| 7.1 | 资产负债表.....                               | 23 |
| 7.2 | 利润表.....                                 | 24 |
| 7.3 | 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 26 |
| 7.4 | 报表附注.....                                | 27 |
| § 8 | 投资组合报告.....                              | 58 |
| 8.1 | 期末基金资产组合情况.....                          | 58 |
| 8.2 | 债券回购融资情况.....                            | 58 |
| 8.3 | 基金投资组合平均剩余期限.....                        | 58 |
| 8.4 | 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....         | 59 |
| 8.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 59 |

|      |  |    |
|------|--|----|
| 8.6  | 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....     | 60 |
| 8.7  | “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....         | 60 |
|      | 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明 .....           | 61 |
|      | 报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明 .....            | 61 |
| 8.8  | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 ..... | 61 |
| 8.9  | 投资组合报告附注 .....                           | 61 |
| § 9  | 基金份额持有人信息 .....                          | 62 |
| 9.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                  | 62 |
| 9.2  | 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                 | 63 |
| 9.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....               | 63 |
| 9.4  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....       | 63 |
| § 10 | 开放式基金份额变动 .....                          | 64 |
| § 11 | 重大事件揭示 .....                             | 64 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                        | 64 |
| 11.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....        | 64 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....             | 64 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 .....                          | 64 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                   | 65 |
| 11.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....           | 65 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                  | 65 |
| 11.8 | 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                   | 67 |
| 11.9 | 其他重大事件 .....                             | 68 |
| § 12 | 备查文件目录 .....                             | 69 |
| 12.1 | 备查文件目录 .....                             | 69 |
| 12.2 | 存放地点 .....                               | 69 |
| 12.3 | 查阅方式 .....                               | 69 |

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

|                   |                      |                         |                 |
|-------------------|----------------------|-------------------------|-----------------|
| 基金名称              | 易方达现金增利货币市场基金        |                         |                 |
| 基金简称              | 易方达现金增利货币            |                         |                 |
| 基金主代码             | 000620               |                         |                 |
| 基金运作方式            | 契约型开放式               |                         |                 |
| 基金合同生效日           | 2015 年 2 月 5 日       |                         |                 |
| 基金管理人             | 易方达基金管理有限公司          |                         |                 |
| 基金托管人             | 中国建设银行股份有限公司         |                         |                 |
| 报告期末基金份额总额        | 180,353,206,739.31 份 |                         |                 |
| 基金合同存续期           | 不定期                  |                         |                 |
| 下属分级基金的基金简称       | 易方达现金增利货<br>币 A      | 易方达现金增利货<br>币 B         | 易方达现金增利货<br>币 C |
| 下属分级基金的交易代码       | 000620               | 000621                  | 005097          |
| 报告期末下属分级基金的份<br>额 | 581,362,964.56 份     | 179,728,089,355.76<br>份 | 43,754,418.99 份 |

注：自 2018 年 3 月 8 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2018 年 3 月 12 日。

## 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                       | 中国建设银行股份有限公司          |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 张南                                | 李申                    |
|             | 联系电话 | 020-85102688                      | 021-60637102          |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn             | lishen.zh@ccb.com     |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088                      | 021-60637111          |
| 传真          |      | 020-38798812                      | 021-60635778          |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区荣粤道<br>188号6层           | 北京市西城区金融大街25号         |
| 办公地址        |      | 广州市天河区珠江新城珠江东<br>路30号广州银行大厦40-43楼 | 北京市西城区闹市口大街1号<br>院1号楼 |
| 邮政编码        |      | 510620                            | 100033                |
| 法定代表人       |      | 刘晓艳                               | 田国立                   |

## 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 中国证券报   |
| 登载基金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<br>银行大厦 43 楼                              |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                                  |
|--------|--------------------------|---------------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊<br>普通合伙) | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼               |
| 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<br>银行大厦 40-43 楼 |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年         |                    |               | 2020 年         |                    |               | 2019 年         |                   |             |
|---------------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|----------------|-------------------|-------------|
|               | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B        | 易方达现金增利货币 C   | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B        | 易方达现金增利货币 C   | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B       | 易方达现金增利货币 C |
| 本期已实现收益       | 8,543,172.41   | 3,990,786,372.27   | 1,152,604.86  | 9,229,409.42   | 1,755,073,661.16   | 430,587.82    | 12,850,472.86  | 984,699,440.24    | 12,671.63   |
| 本期利润          | 8,543,172.41   | 3,990,786,372.27   | 1,152,604.86  | 9,229,409.42   | 1,755,073,661.16   | 430,587.82    | 12,850,472.86  | 984,699,440.24    | 12,671.63   |
| 本期净值收益率       | 2.3905%        | 2.6364%            | 2.5953%       | 2.3297%        | 2.5756%            | 2.5350%       | 2.8250%        | 3.0724%           | 3.0362%     |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末        |                    |               | 2020 年末        |                    |               | 2019 年末        |                   |             |
|               | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B        | 易方达现金增利货币 C   | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B        | 易方达现金增利货币 C   | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B       | 易方达现金增利货币 C |
| 期末基金资产净值      | 581,362,964.56 | 179,728,089,355.76 | 43,754,418.99 | 373,570,638.32 | 100,166,315,191.54 | 38,862,930.83 | 346,777,646.19 | 50,466,059,678.58 | 882,367.77  |
| 期末基金份额净值      | 1.0000         | 1.0000             | 1.0000        | 1.0000         | 1.0000             | 1.0000        | 1.0000         | 1.0000            | 1.0000      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末        |                    |               | 2020 年末        |                    |               | 2019 年末        |                   |             |
|               | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B        | 易方达现金增利货币 C   | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B        | 易方达现金增利货币 C   | 易方达现金增利货币 A    | 易方达现金增利货币 B       | 易方达现金增利货币 C |
| 累计净值收益率       | 24.0024%       | 26.0704%           | 11.9934%      | 21.1073%       | 22.8320%           | 9.1603%       | 18.3501%       | 19.7478%          | 6.4615%     |

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

易方达现金增利货币 A：

| 阶段    | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.5874%  | 0.0003%     | 0.3456%    | 0.0000%       | 0.2418% | 0.0003% |
| 过去六个月 | 1.1585%  | 0.0003%     | 0.6924%    | 0.0000%       | 0.4661% | 0.0003% |

|            |          |         |         |         |          |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去一年       | 2.3905%  | 0.0004% | 1.3781% | 0.0000% | 1.0124%  | 0.0004% |
| 过去三年       | 7.7358%  | 0.0010% | 4.1955% | 0.0000% | 3.5403%  | 0.0010% |
| 过去五年       | 17.0573% | 0.0026% | 7.0872% | 0.0000% | 9.9701%  | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 24.0024% | 0.0053% | 9.9190% | 0.0000% | 14.0834% | 0.0053% |

**易方达现金增利货币 B:**

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③      | ②—④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.6481%  | 0.0002%     | 0.3456%    | 0.0000%       | 0.3025%  | 0.0002% |
| 过去六个月      | 1.2807%  | 0.0003%     | 0.6924%    | 0.0000%       | 0.5883%  | 0.0003% |
| 过去一年       | 2.6364%  | 0.0004%     | 1.3781%    | 0.0000%       | 1.2583%  | 0.0004% |
| 过去三年       | 8.5145%  | 0.0010%     | 4.1955%    | 0.0000%       | 4.3190%  | 0.0010% |
| 过去五年       | 18.4694% | 0.0026%     | 7.0872%    | 0.0000%       | 11.3822% | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 26.0704% | 0.0053%     | 9.9190%    | 0.0000%       | 16.1514% | 0.0053% |

**易方达现金增利货币 C:**

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月      | 0.6380%  | 0.0002%     | 0.3456%    | 0.0000%       | 0.2924% | 0.0002% |
| 过去六个月      | 1.2602%  | 0.0003%     | 0.6924%    | 0.0000%       | 0.5678% | 0.0003% |
| 过去一年       | 2.5953%  | 0.0004%     | 1.3781%    | 0.0000%       | 1.2172% | 0.0004% |
| 过去三年       | 8.3901%  | 0.0012%     | 4.1955%    | 0.0000%       | 4.1946% | 0.0012% |
| 过去五年       | -        | -           | -          | -             | -       | -       |
| 自基金合同生效起至今 | 11.9934% | 0.0020%     | 5.3546%    | 0.0000%       | 6.6388% | 0.0020% |

### 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

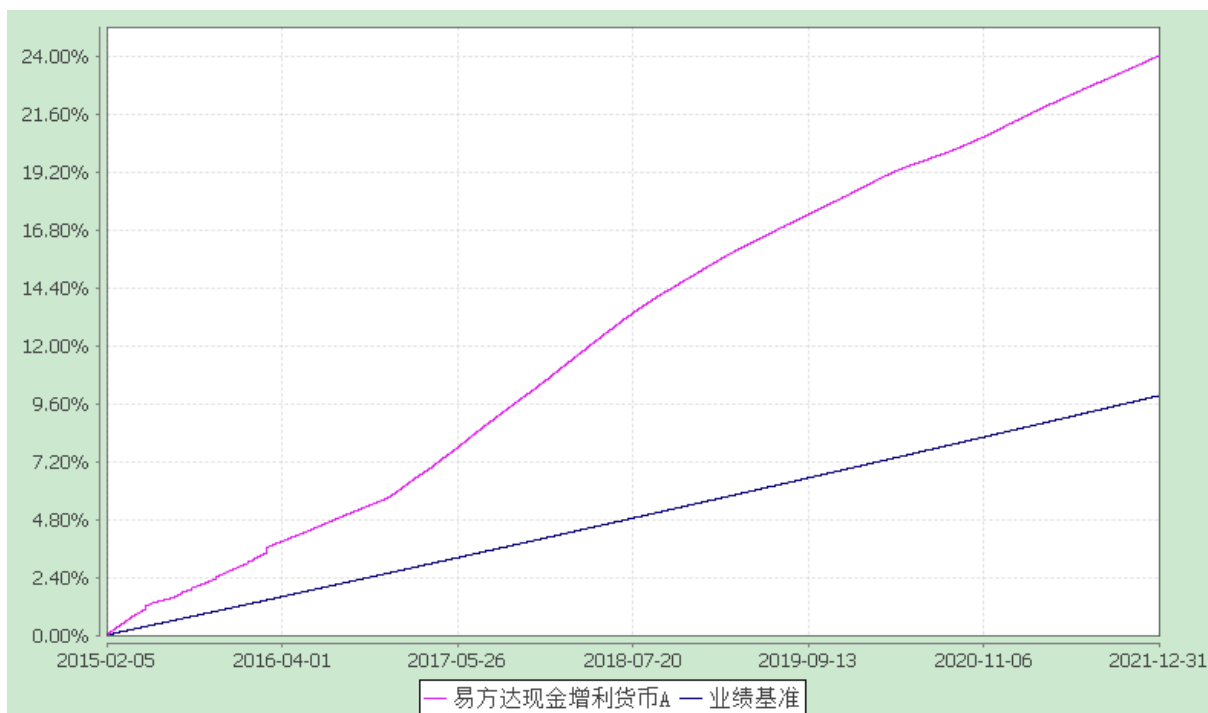
## 易方达现金增利货币市场基金

## 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

## 易方达现金增利货币 A

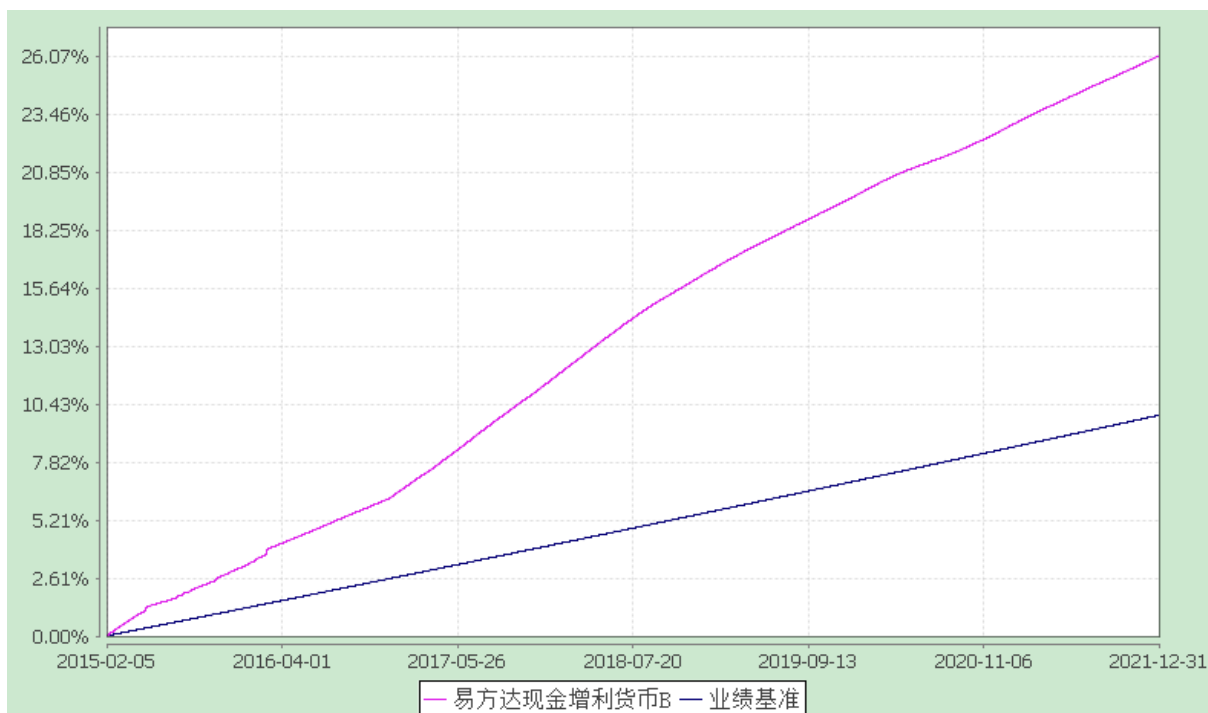
(2015 年 2 月 5 日至 2021 年 12 月 31 日)





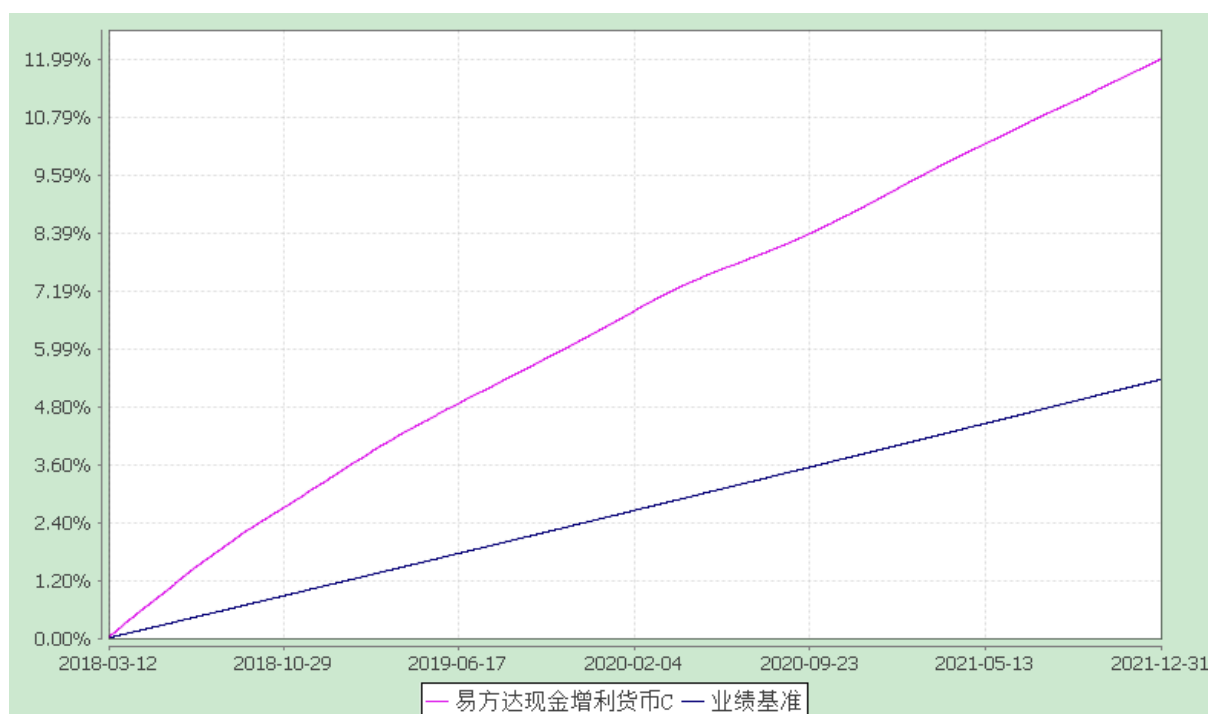
易方达现金增利货币 B

(2015 年 2 月 5 日至 2021 年 12 月 31 日)



易方达现金增利货币 C

(2018 年 3 月 12 日至 2021 年 12 月 31 日)



注：1.自 2018 年 3 月 8 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2018 年 3 月 12 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

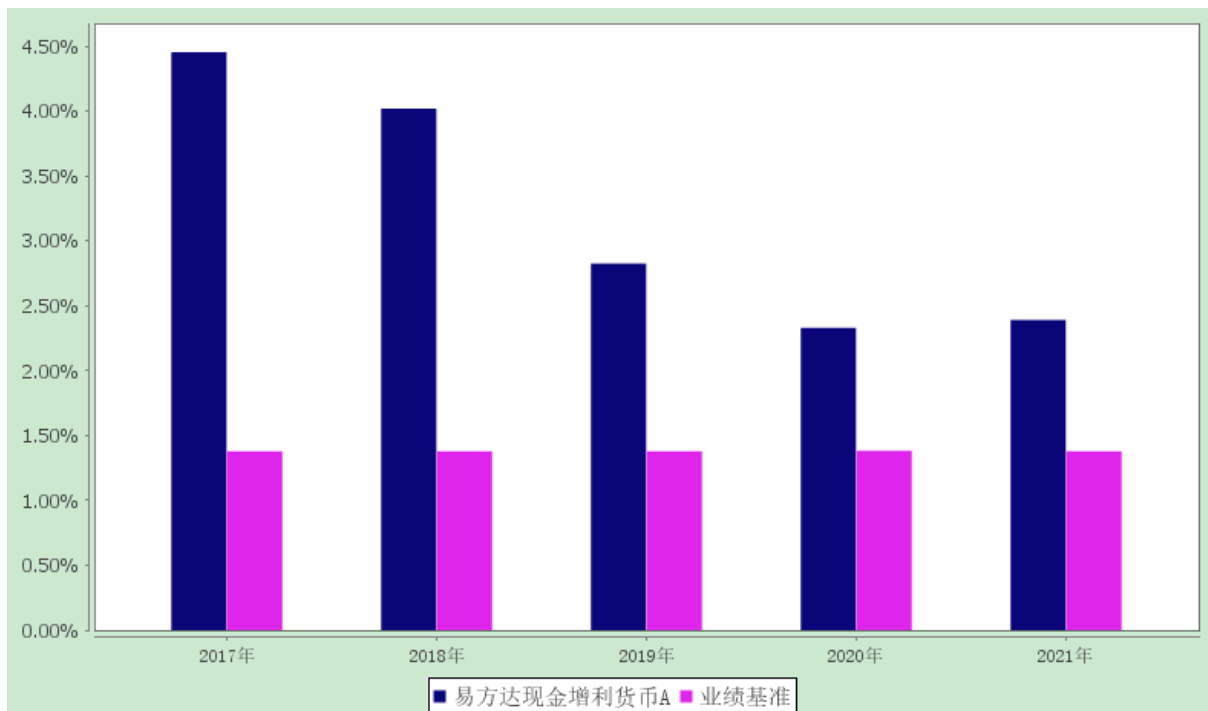
2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值收益率为 24.0024%，B 类基金份额净值收益率为 26.0704%，同期业绩比较基准收益率为 9.9190%。C 类基金份额净值收益率为 11.9934%，同期业绩比较基准收益率为 5.3546%。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

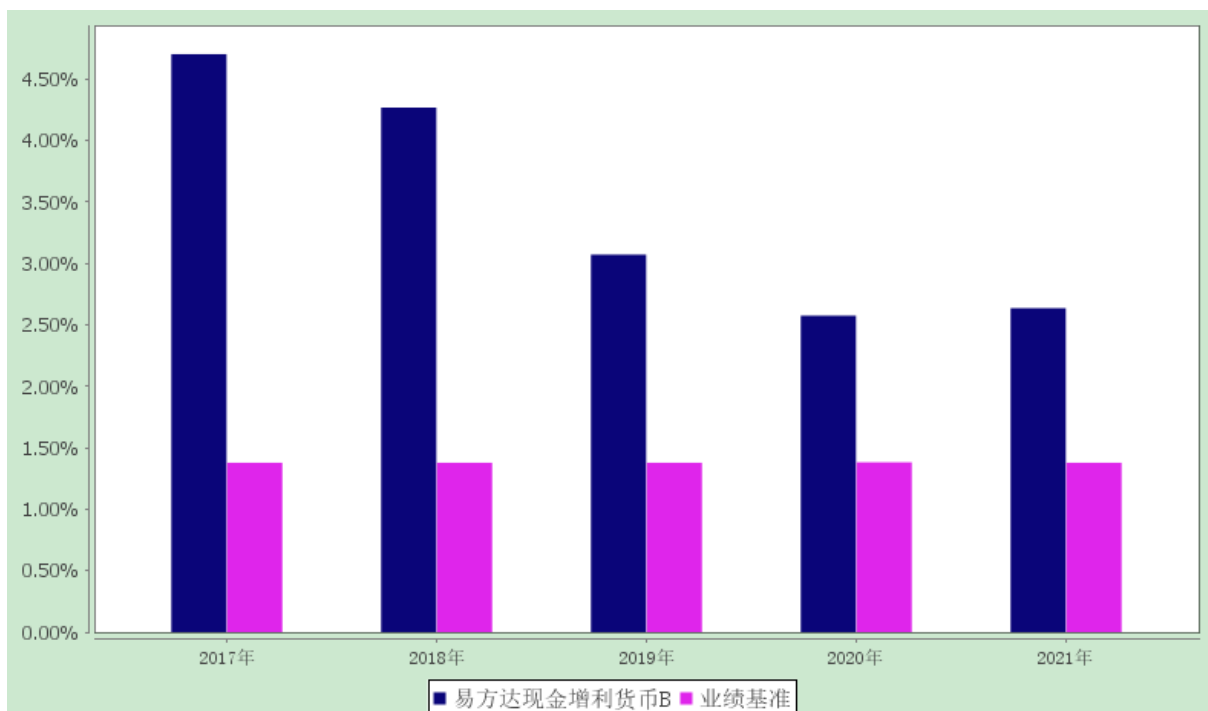
易方达现金增利货币市场基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

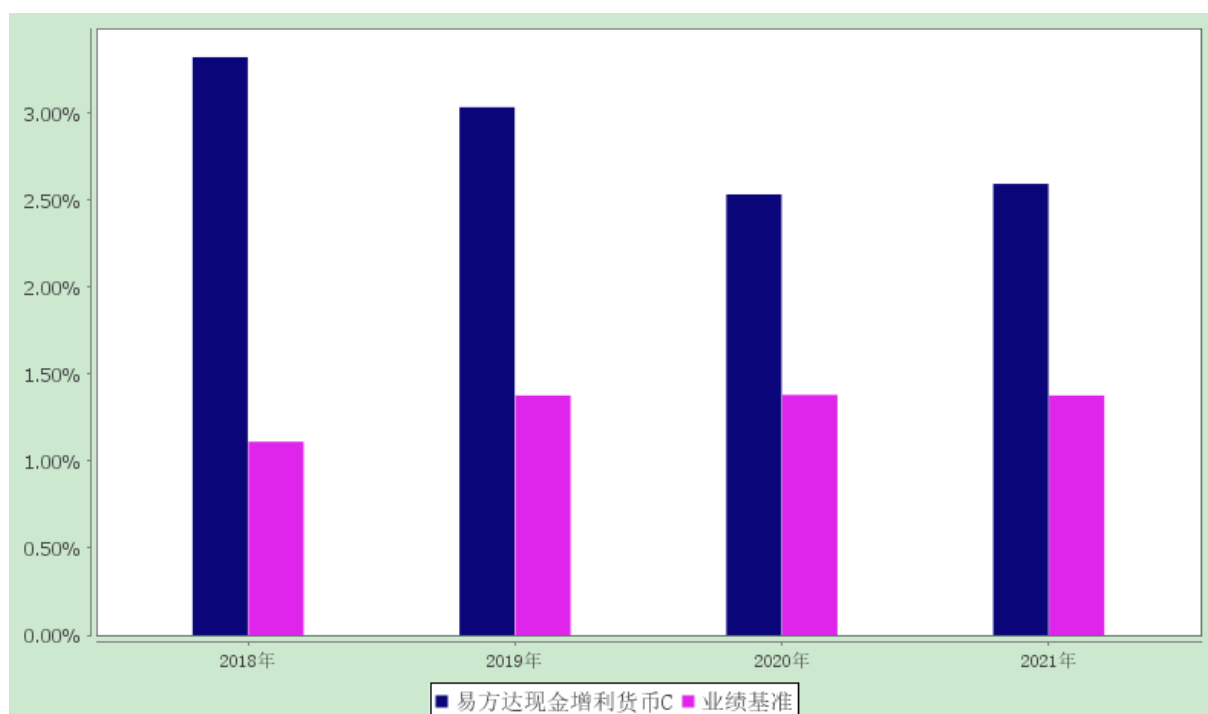
易方达现金增利货币 A



易方达现金增利货币 B



易方达现金增利货币 C



注：自 2018 年 3 月 8 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2018 年 3 月 12 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

易方达现金增利货币 A

单位：人民币元

| 年度     | 已按再投资形式转实收基金  | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计      | 备注 |
|--------|---------------|---------------|----------|---------------|----|
| 2021 年 | 8,543,172.41  | -             | -        | 8,543,172.41  | -  |
| 2020 年 | 9,229,409.42  | -             | -        | 9,229,409.42  | -  |
| 2019 年 | 12,850,472.86 | -             | -        | 12,850,472.86 | -  |
| 合计     | 30,623,054.69 | -             | -        | 30,623,054.69 | -  |

易方达现金增利货币 B

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资形式转实收基金 | 直接通过应付赎回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|----|--------------|---------------|----------|----------|----|
|    |              |               |          |          |    |

|        |                      |   |   |                  |   |
|--------|----------------------|---|---|------------------|---|
| 2021 年 | 3,990,786,37<br>2.27 | - | - | 3,990,786,372.27 | - |
| 2020 年 | 1,755,073,66<br>1.16 | - | - | 1,755,073,661.16 | - |
| 2019 年 | 984,699,440.<br>24   | - | - | 984,699,440.24   | - |
| 合计     | 6,730,559,47<br>3.67 | - | - | 6,730,559,473.67 | - |

易方达现金增利货币 C

单位：人民币元

| 年度     | 已按再投资<br>形式转实收<br>基金 | 直接通过应付赎<br>回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合<br>计 | 备注 |
|--------|----------------------|-------------------|----------|--------------|----|
| 2021 年 | 1,152,604.86         | -                 | -        | 1,152,604.86 | -  |
| 2020 年 | 430,587.82           | -                 | -        | 430,587.82   | -  |
| 2019 年 | 12,671.63            | -                 | -        | 12,671.63    | -  |
| 合计     | 1,595,864.31         | -                 | -        | 1,595,864.31 | -  |

## § 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<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                  |
|----|------------------------------------|-------------------------|----------|----------------|-------------------------------------|
|    |                                    | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |                                     |
| 石大 | 本基金的基金经理、易方达易理财<br>货币市场基金的基金经理、易方达 | 2015-<br>02-05          | -        | 12 年           | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾<br>任南方基金管理有限公司交易管理 |

|    |  |            |   |      |  |
|----|--|------------|---|------|--|
| 恽  | 天天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、易方达保证金收益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(自 2014 年 06 月 17 日至 2021 年 07 月 01 日)、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(自 2014 年 09 月 12 日至 2021 年 10 月 19 日)、易方达天天发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、易方达稳悦 120 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理、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                 |            |   |      | 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、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达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、易方达保证金收益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、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、易方达稳丰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达易理财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 | 2015-06-19 | - | 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 |
| 易臻 | 本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、易方达财富快线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、易方达龙宝货币市场基金的基金经理助理、易方达天天发  | 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、投资经理  |

|   |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|
| 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、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳悦 120 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安和中短债债券型证券投资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、易方达稳丰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理助理 |  |  |  |  |
|---|--|--|--|--|

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

报告期内，梁莹曾兼任1个私募资产管理计划的投资经理，已于2021年3月10日离任。报告期末，梁莹没有兼任私募资产管理计划的投资经理。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，具体按其对产品业绩和投资团队的贡献等情况综合评定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易

控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

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

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

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形，公司进一步加强了对投资指令下达、交易执行和反向交易控制等环节的控制措施，同时强化了对相关同反向交易价差及组合收益率差异的事后监测分析，按监管要求完善了相关信息披露，进一步落实对兼任基金经理投资交易行为的规范和监督。本报告期内，相关制度措施执行情况良好，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。



本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 30 次，其中 27 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，3 次为不同基金经理管理的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。

#### 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

2021 年，受益于中国优异的疫情防控效果，宏观经济逐步企稳回升，呈现了相对稳健的发展态势。全年经济增速前高后低，但是四季度仍然受到需求下降和供给侧收缩的影响，增速有所回落。2021 年 GDP（国内生产总值）同比增长 8.1%，两年平均增长 5.1%。1 月份，人民银行针对货币政策“不急转弯”的表态扭转了市场的宽松预期，债券市场调整。春节后，股票市场的波动引发市场的避险情绪；同时央行维持了宽松的货币政策环境，地方债发行量低于市场预期，债券市场的配置压力加大，债券市场收益率在二季度持续下行。7 月份，央行超预期下调存款准备金率，市场流动性宽松预期增强；地产销售和地产投资压力导致市场对经济增长的预期悲观，债券市场收益率快速下行。8 月中旬开始，大宗商品价格快速上涨，引发了市场对通胀上行的担忧，债券市场调整，收益率波动中上行。四季度，部分地产企业出现信用风险事件，经济数据相对偏弱；同时通胀预期有所下降，市场收益率重新下行。12 月份，央行第二次下调存款准备金率和 1 年期贷款市场报价利率，带动市场收益率降至年内低点。全年债券市场收益率呈现波动中下行的走势。在全年整体宽松的流动性环境下，货币市场收益率整体呈现波动中下行的走势，一年期同业存单利率从一季度 3.12% 的高点持续下行至 8 月份的最低点 2.64%，三季末和四季度初回调至最高 2.79% 后，年底再次下行至 2.60%。

报告期内，基金的运作在以保证资产流动性的前提下，尽力为投资者创造稳定的收益。本基金结合负债端特点，根据货币市场的变化情况，在全年保持了中性偏长的剩余期限，并抓住了季末、半年末、年末货币市场收益率阶段性走高的机会，重点加大对同业存款、同业存单等资产的配置力度，在 2021 年年底保持了较长的剩余期限。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内 A 类基金份额净值收益率为 2.3905%，同期业绩比较基准收益率为 1.3781%；B 类基金份额净值收益率为 2.6364%，同期业绩比较基准收益率为 1.3781%；C 类基金份额净值收益率为 2.5953%，同期业绩比较基准收益率为 1.3781%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2022 年，固定投资方面，房地产调控政策的冲击可能继续纵深调整。但在改善性、市民化、城市群三大新发展动能的支撑下，房地产销售的基本面仍有支撑，且房地产行业的发展将更紧密地

内嵌到高质量发展的进程中，对房地产投资可能不需过度悲观。制造业投资方面，在绿色转型和技术攻坚撬动下，制造业投资成为高质量发展的关键增量来源，2022 年制造业投资对经济的贡献可能加大。但出口景气高位回落、绿色转型路径更加明晰前，其贡献度也相对有限。出口和消费方面，2022 年出口对经济的拉动效应可能弱于 2021 年，中国经济更多转向内循环为主，但国内消费潜力的释放仍存挑战。

货币政策和财政政策将加强协调联动。货币政策方面，稳增长目标要求货币政策需要以我为主，稳字当头，我们判断央行 2022 年将延续稳健的货币政策基调，保持流动性合理充裕。再贷款等结构性货币政策工具将继续在基础货币投放中发挥作用。财政政策方面，我们判断财政支出强度将超过 2021 年，同时财政支出节奏也将体现“前置”特征。

整体来看，2022 年经济增长出现企稳的概率较大，如果这一预判得到印证，债券市场利率继续大幅下行的空间则较为有限。在投资管理的过程中，我们需要密切关注经济增速如果出现趋势性回升后债券市场可能面临的风险，在此之前，在流动性宽松支持下利率仍然会保持震荡格局。

本基金长期坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，力求在保持投资组合流动性安全的前提下，为持有人提供持续、稳定的回报。本基金将继续坚持自上而下的投资理念，以经济基本面的分析和宏观调控政策判断为基础，结合负债端的特点和变化，适时调整组合久期和杠杆水平，并在货币市场工具的投资中把握相对确定的交易性机会。基金管理人将恪尽职守、审慎投资、勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务创新发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等进一步完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 培育合规文化、严守合规底线、防控违法违规行为是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，秉持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，树立弘扬“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，促进公司合规文化建设。加大力度持续开展员工合规风控教育培训、强化合规监督考评机制，不断提高员工合规风控意识，深入践行“受人之托、为人理财”的信义义务。

(2) 坚持“守底线、保合规、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示；认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务

运作的监控检查和反馈提示；持续完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，有效确保旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(3) 参与新产品设计、新业务拓展工作，持续督促健全公募基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，严格进行合规审查，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券基金期货经营机构投资者投诉处理工作指引（试行）》等法律法规和监管政策、自律准则，进一步完善基金销售相关业务规范，加强投资者权益保护、促进长期理性投资。持续优化投资者适当性管理和客户投诉纠纷处理机制，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”职责义务，保障投资者合法权益。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，进一步健全信息披露管理工作机制流程，不断推进信息披露文件制作审核的系统化，持续做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 全面落实《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》等最新反洗钱法规与监管要求，下大力气完善提升洗钱风险管理体系和内控机制：进一步修订制度流程、充实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，健全洗钱风险自评估工作机制方法，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，不断提高反洗钱合规和风险管理水平，推动反洗钱工作以风险为本向纵深发展。

(7) 深入贯彻落实《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》《公开募集证券投资基金管理人及从业人员职业操守和道德规范指南》等规定，不断完善业务过程中的廉洁从业管理机制，加强对员工廉洁从业、职业操守和道德规范等方面的教育宣导和培训，努力将廉洁从业、职业操守和道德规范要求渗透落实到业务活动和日常经营的各个环节。

(8) 以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、产品运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，坚持不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司内控及合规管理有效性的提升。

(9) 不断检讨回顾合规管控框架和机制，促进监察稽核自身制度流程和工具手段的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

(10) 继续顺利通过 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，获得 GIPS 鉴证报告，鉴证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和

控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《易方达现金增利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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额：易方达现金增利货币 A 为 8,543,172.41 元，易方达现金增利货币 B 为 3,990,786,372.27 元，易方达现金增利货币 C 为 1,152,604.86 元。

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

本托管人复核审查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。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 25208 号

易方达现金增利货币市场基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

#### (一)我们审计的内容

我们审计了易方达现金增利货币市场基金的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

#### (二)我们的意见

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了易方达现金增利货币市场基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达现金增利货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。

### 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

易方达现金增利货币市场基金的基金管理人易方达基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估易方达现金增利货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算易方达现金增利货币市场基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督易方达现金增利货币市场基金的财务报告过程。

#### 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对易方达现金增利货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达现金增利货币市场基金不能持续经营。

(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

陈熹 陈轶杰

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2022 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：易方达现金增利货币市场基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资 产             | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |                                  |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 115,692,906,047.49              | 51,641,940,102.23                |
| 结算备付金           |            | 10,436,199,931.82               | 97,367,619.05                    |
| 存出保证金           |            | -                               | -                                |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 68,910,769,239.19               | 39,045,720,327.97                |
| 其中：股票投资         |            | -                               | -                                |
| 基金投资            |            | -                               | -                                |
| 债券投资            |            | 64,350,988,435.18               | 36,514,963,121.61                |
| 资产支持证券投资        |            | 4,559,780,804.01                | 2,530,757,206.36                 |
| 贵金属投资           |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 16,827,747,551.67               | 16,804,717,380.98                |
| 应收证券清算款         |            | -                               | 894,855.50                       |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 1,000,635,157.32                | 366,057,864.08                   |
| 应收股利            |            | -                               | -                                |
| 应收申购款           |            | 63,661,657.82                   | 108,431,562.06                   |
| 递延所得税资产         |            | -                               | -                                |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>212,931,919,585.31</b>       | <b>108,065,129,711.87</b>        |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负 债：</b>     |            |                                 |                                  |

|                   |          |                           |                           |
|-------------------|----------|---------------------------|---------------------------|
| 短期借款              |          | -                         | -                         |
| 交易性金融负债           |          | -                         | -                         |
| 衍生金融负债            | 7.4.7.3  | -                         | -                         |
| 卖出回购金融资产款         |          | 22,309,978,394.60         | 7,275,889,655.19          |
| 应付证券清算款           |          | 10,113,754,040.13         | -                         |
| 应付赎回款             |          | 117,887,487.64            | 188,815,896.64            |
| 应付管理人报酬           |          | 22,324,330.28             | 12,297,525.10             |
| 应付托管费             |          | 7,972,975.10              | 4,391,973.26              |
| 应付销售服务费           |          | 1,687,532.74              | 958,498.71                |
| 应付交易费用            | 7.4.7.7  | 812,968.26                | 582,478.16                |
| 应交税费              |          | 834,778.62                | 558,552.49                |
| 应付利息              |          | 3,214,238.63              | 2,640,371.63              |
| 应付利润              |          | -                         | -                         |
| 递延所得税负债           |          | -                         | -                         |
| 其他负债              | 7.4.7.8  | 246,100.00                | 246,000.00                |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>32,578,712,846.00</b>  | <b>7,486,380,951.18</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     |          |                           |                           |
| 实收基金              | 7.4.7.9  | 180,353,206,739.31        | 100,578,748,760.69        |
| 未分配利润             | 7.4.7.10 | 0.00                      | 0.00                      |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>180,353,206,739.31</b> | <b>100,578,748,760.69</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>212,931,919,585.31</b> | <b>108,065,129,711.87</b> |

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额净值 1.0000 元，C 类基金份额净值 1.0000 元；基金份额总额 180,353,206,739.31 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 581,362,964.56 份，B 类基金份额总额 179,728,089,355.76 份，C 类基金份额总额 43,754,418.99 份。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达现金增利货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元



| 项 目                   | 附注号      | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|-----------------------|----------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|                       |          | 2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 12 月 31 日 | 2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 12 月 31 日 |
| <b>一、收入</b>           |          | <b>4,489,554,110.01</b>             | <b>2,003,515,155.61</b>             |
| 1.利息收入                |          | 4,549,991,245.35                    | 2,052,903,197.91                    |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.11 | 2,157,415,773.80                    | 967,353,951.17                      |
| 债券利息收入                |          | 1,507,275,051.52                    | 699,286,541.34                      |
| 资产支持证券利息收入            |          | 162,736,241.80                      | 46,514,179.95                       |
| 买入返售金融资产收入            |          | 722,564,178.23                      | 339,748,525.45                      |
| 其他利息收入                |          | -                                   | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | -60,489,265.16                      | -49,401,119.45                      |
| 其中：股票投资收益             |          | -                                   | -                                   |
| 基金投资收益                |          | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                | 7.4.7.12 | -61,366,630.97                      | -49,406,571.03                      |
| 资产支持证券投资收益            |          | 877,365.81                          | 5,451.58                            |
| 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）     | 7.4.7.13 | 52,129.82                           | 13,077.15                           |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>489,071,960.47</b>               | <b>238,781,497.21</b>               |
| 1. 管理人报酬              |          | 216,545,935.15                      | 96,727,813.86                       |
| 2. 托管费                |          | 77,337,833.90                       | 34,545,647.81                       |
| 3. 销售服务费              |          | 16,351,496.06                       | 7,877,687.44                        |
| 4. 交易费用               | 7.4.7.14 | -                                   | -                                   |
| 5. 利息支出               |          | 177,307,971.78                      | 98,710,703.72                       |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |          | 177,307,971.78                      | 98,710,703.72                       |
| 6. 税金及附加              |          | 1,069,506.55                        | 499,526.02                          |

|                            |          |                         |                         |
|----------------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 7. 其他费用                    | 7.4.7.15 | 459,217.03              | 420,118.36              |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>4,000,482,149.54</b> | <b>1,764,733,658.40</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                       | -                       |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>4,000,482,149.54</b> | <b>1,764,733,658.40</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达现金增利货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期                               |                   |                     |
|--|----------------------------------|-------------------|---------------------|
|  | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日 |                   |                     |
|  | 实收基金                             | 未分配利润             | 所有者权益合计             |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 100,578,748,760.69               | -                 | 100,578,748,760.69  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 4,000,482,149.54  | 4,000,482,149.54    |
| 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）      | 79,774,457,978.62                | -                 | 79,774,457,978.62   |
| 其中：1.基金申购款                             | 259,817,385,936.31               | -                 | 259,817,385,936.31  |
| 2.基金赎回款                                | -180,042,927,957.69              | -                 | -180,042,927,957.69 |
| 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） | -                                | -4,000,482,149.54 | -4,000,482,149.54   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 180,353,206,739.31               | -                 | 180,353,206,739.31  |
| 项目                                     | 上年度可比期间                          |                   |                     |
|  | 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日 |                   |                     |
|  | 实收基金                             | 未分配利润             | 所有者权益合计             |

|  |                     |                   |                     |
|--|---------------------|-------------------|---------------------|
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 50,813,719,692.54   | -                 | 50,813,719,692.54   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                   | 1,764,733,658.40  | 1,764,733,658.40    |
| 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）      | 49,765,029,068.15   | -                 | 49,765,029,068.15   |
| 其中：1.基金申购款                             | 156,712,568,350.46  | -                 | 156,712,568,350.46  |
| 2.基金赎回款                                | -106,947,539,282.31 | -                 | -106,947,539,282.31 |
| 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） | -                   | -1,764,733,658.40 | -1,764,733,658.40   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 100,578,748,760.69  | -                 | 100,578,748,760.69  |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

易方达现金增利货币市场基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]326号《关于核准易方达现金增利货币市场基金募集的批复》和证券基金机构监管部函[2014]1713号《关于易方达现金增利货币市场基金延期募集备案的回函》进行募集，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《易方达现金增利货币市场基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达现金增利货币市场基金基金合同》于2015年2月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为201,866,693.89份基金份额，其中认购资金利息折合23.31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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

自2018年3月8日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2018年3月12日。

### 7.4.2 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》、《易方达现金增利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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的债券投资和资产支持证券分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金

持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。基金管理人应根据相关法律法规控制影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定金融工具的公允价值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持

的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小则按直线法计算。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；

(2)本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(3)本基金根据每日基金收益情况，以基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配（该收益将会计确认为实收基金，参与下一日的收益分配），每月定期集中支付。对于可支持按日支付的销售机构，本基金的收益支付方式经基金管理人和销售机构双方协商一致后可以按日支付。

不论何种支付方式，当日收益均参与下一日的收益分配，不影响基金份额持有人实际获得的投资收益。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位；

(4)本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

(5)本基金每日进行收益计算并分配时，每月定期累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月定期累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额；

(6)基金份额持有人在全部赎回其持有的本基金某类基金份额余额时，基金管理人自动将该基金份额持有人的该类基金份额未付收益一并结算并与赎回款一起支付给该基金份额持有人；基金份额持有人部分赎回其持有的某类基金份额时，当该类基金份额未付收益为正时，未付收益不进行支付；当该类基金份额未付收益为负时，其剩余的该类基金份额需足以弥补其当前未付收益为负时的损益，否则将自动按比例结转当前未付收益,再进行赎回款项结算；

(7)当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(8)在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议；

(9)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 7.4.6 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末                | 上年度末              |
|----------------|--------------------|-------------------|
|                | 2021 年 12 月 31 日   | 2020 年 12 月 31 日  |
| 活期存款           | 2,906,047.49       | 1,940,102.23      |
| 定期存款           | 115,690,000,000.00 | 51,640,000,000.00 |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                  | -                 |
| 存款期限 1-3 个月    | -                  | 500,000,000.00    |
| 存款期限 3 个月以上    | 115,690,000,000.00 | 51,140,000,000.00 |
| 其他存款           | -                  | -                 |
| 合计             | 115,692,906,047.49 | 51,641,940,102.23 |

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末               |                   |                |         |
|--------|-------|-------------------|-------------------|----------------|---------|
|        |       | 2021 年 12 月 31 日  |                   |                |         |
|        |       | 摊余成本              | 影子定价              | 偏离金额           | 偏离度 (%) |
| 债券     | 交易所市场 | -                 | -                 | -              | -       |
|        | 银行间市场 | 64,350,988,435.18 | 64,442,540,100.00 | 91,551,664.82  | 0.0508  |
|        | 合计    | 64,350,988,435.18 | 64,442,540,100.00 | 91,551,664.82  | 0.0508  |
| 资产支持证券 |       | 4,559,780,804.01  | 4,568,851,800.00  | 9,070,995.99   | 0.0050  |
| 合计     |       | 68,910,769,239.19 | 69,011,391,900.00 | 100,622,660.81 | 0.0558  |
| 项目     |       | 上年度末              |                   |                |         |
|        |       | 2020 年 12 月 31 日  |                   |                |         |
|        |       | 摊余成本              | 影子定价              | 偏离金额           | 偏离度 (%) |

|        |       |                   |                   |               |        |
|--------|-------|-------------------|-------------------|---------------|--------|
| 债券     | 交易所市场 | -                 | -                 | -             | -      |
|        | 银行间市场 | 36,514,963,121.61 | 36,588,318,500.00 | 73,355,378.39 | 0.0729 |
|        | 合计    | 36,514,963,121.61 | 36,588,318,500.00 | 73,355,378.39 | 0.0729 |
| 资产支持证券 |       | 2,530,757,206.36  | 2,533,209,800.00  | 2,452,593.64  | 0.0024 |
| 合计     |       | 39,045,720,327.97 | 39,121,528,300.00 | 75,807,972.03 | 0.0754 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 10,000,000,000.00        | -         |
| 银行间市场 | 6,827,747,551.67         | -         |
| 合计    | 16,827,747,551.67        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 4,001,000,000.00         | -         |
| 银行间市场 | 12,803,717,380.98        | -         |
| 合计    | 16,804,717,380.98        | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|----------|-------------------------|--------------------------|
| 应收活期存款利息 | 401.41                  | 98,582.67                |
| 应收定期存款利息 | 756,432,065.32          | 198,131,691.36           |
| 应收其他存款利息 | -                       | -                        |

|            |                  |                |
|------------|------------------|----------------|
| 应收结算备付金利息  | 1,100,249.90     | 43,815.40      |
| 应收债券利息     | 188,476,393.35   | 134,191,325.77 |
| 应收资产支持证券利息 | 49,562,145.79    | 11,767,513.99  |
| 应收买入返售证券利息 | 5,063,901.55     | 21,824,934.89  |
| 应收申购款利息    | -                | -              |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                | -              |
| 其他         | -                | -              |
| 合计         | 1,000,635,157.32 | 366,057,864.08 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | -                  | -                   |
| 银行间市场应付交易费用 | 812,968.26         | 582,478.16          |
| 合计          | 812,968.26         | 582,478.16          |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                  | -                   |
| 应付赎回费       | 100.00             | -                   |
| 预提费用        | 246,000.00         | 246,000.00          |
| 合计          | 246,100.00         | 246,000.00          |

#### 7.4.7.9 实收基金

易方达现金增利货币 A

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |
|----|-----------------------------|
|    |                             |

|               | 基金份额（份）           | 账面金额              |
|---------------|-------------------|-------------------|
| 上年度末          | 373,570,638.32    | 373,570,638.32    |
| 本期申购          | 1,346,553,328.61  | 1,346,553,328.61  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,138,761,002.37 | -1,138,761,002.37 |
| 本期末           | 581,362,964.56    | 581,362,964.56    |

易方达现金增利货币 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                     |
|---------------|-----------------------------|---------------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额                |
| 上年度末          | 100,166,315,191.54          | 100,166,315,191.54  |
| 本期申购          | 258,274,446,160.64          | 258,274,446,160.64  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -178,712,671,996.42         | -178,712,671,996.42 |
| 本期末           | 179,728,089,355.76          | 179,728,089,355.76  |

易方达现金增利货币 C

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                 |
|---------------|-----------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                     | 账面金额            |
| 上年度末          | 38,862,930.83               | 38,862,930.83   |
| 本期申购          | 196,386,447.06              | 196,386,447.06  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -191,494,958.90             | -191,494,958.90 |
| 本期末           | 43,754,418.99               | 43,754,418.99   |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

易方达现金增利货币 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 | 8,543,172.41 | -     | 8,543,172.41 |

|                |               |   |               |
|----------------|---------------|---|---------------|
| 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        | -8,543,172.41 | - | -8,543,172.41 |
| 本期末            | 0.00          | - | 0.00          |

**易方达现金增利货币 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           | 3,990,786,372.27  | -     | 3,990,786,372.27  |
| 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        | -3,990,786,372.27 | -     | -3,990,786,372.27 |
| 本期末            | 0.00              | -     | 0.00              |

**易方达现金增利货币 C**

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           | 1,152,604.86  | -     | 1,152,604.86  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -     | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | -     | -             |
| 基金赎回款          | -             | -     | -             |
| 本期已分配利润        | -1,152,604.86 | -     | -1,152,604.86 |
| 本期末            | 0.00          | -     | 0.00          |

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------|-----------------------|-----------------------|
|           | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 活期存款利息收入  | 488,484.09            | 1,008,510.11          |
| 定期存款利息收入  | 2,142,748,933.82      | 942,603,289.91        |
| 其他存款利息收入  | -                     | -                     |
| 结算备付金利息收入 | 14,178,355.89         | 23,742,151.15         |
| 其他        | -                     | -                     |
| 合计        | 2,157,415,773.80      | 967,353,951.17        |

#### 7.4.7.12 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                         | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 189,580,590,765.75    | 126,695,363,169.70    |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 189,011,112,256.25    | 126,412,559,736.44    |
| 减：应收利息总额                | 630,845,140.47        | 332,210,004.29        |
| 买卖债券差价收入                | -61,366,630.97        | -49,406,571.03        |

#### 7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益

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12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 卖出资产支持证券成交总额   | 5,727,928,724.44      | 1,509,037,400.51      |
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 5,626,364,531.35      | 1,466,565,500.00      |
| 减：应收利息总额       | 100,686,827.28        | 42,466,448.93         |
| 资产支持证券投资收益     | 877,365.81            | 5,451.58              |

#### 7.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|    |    |         |

|         | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
|---------|-----------------------|-----------------------|
| 基金赎回费收入 | -                     | -                     |
| 其他      | 52,129.82             | 13,077.15             |
| 合计      | 52,129.82             | 13,077.15             |

#### 7.4.7.14 交易费用

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

#### 7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

| 项目       | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----------|-----------------------|-----------------------|
|          | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 审计费用     | 117,000.00            | 117,000.00            |
| 信息披露费    | 120,000.00            | 120,000.00            |
| 银行汇划费    | 182,374.83            | 145,918.36            |
| 银行间账户维护费 | 35,730.00             | 36,000.00             |
| 其他       | 4,112.20              | 1,200.00              |
| 合计       | 459,217.03            | 420,118.36            |

### 7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9关联方关系

| 关联方名称               | 与本基金的关系             |
|---------------------|---------------------|
| 易方达基金管理有限公司         | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国建设银行股份有限公司        | 基金托管人               |
| 广发证券股份有限公司          | 基金管理人股东             |
| 广东粤财信托有限公司          | 基金管理人股东             |
| 广东省广晟控股集团有限公司       | 基金管理人股东             |
| 广州市广永国有资产经营有限公司     | 基金管理人股东             |
| 盈峰集团有限公司            | 基金管理人股东             |
| 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东             |
| 珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东             |

|                     |               |
|---------------------|---------------|
| 珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东       |
| 珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东       |
| 珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东       |
| 珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙） | 基金管理人股东       |
| 易方达资产管理有限公司         | 基金管理人的子公司     |
| 易方达国际控股有限公司         | 基金管理人的子公司     |
| 易方达资产管理（香港）有限公司     | 基金管理人子公司控制的公司 |
| 广东省易方达公益基金会         | 基金管理人发起的公益基金会 |
| 广东易方达源臻投资管理有限公司     | 基金管理人子公司控制的公司 |
| 易方达私募基金管理（上海）有限公司   | 基金管理人子公司控制的公司 |

注：1.广东省广晟资产经营有限公司自 2021 年 3 月 12 日起将名称变更为广东省广晟控股集团有限公司；盈峰控股集团有限公司自 2021 年 7 月 26 日起将名称变更为盈峰集团有限公司；易方达海外投资（深圳）有限公司自 2021 年 11 月 9 日起将名称变更为易方达私募基金管理（上海）有限公司；广东省易方达教育基金会自 2021 年 12 月 9 日起将名称变更为广东省易方达公益基金会。2. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                  | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                  |
|-------|-----------------------------|------------------|----------------------------------|------------------|
|       | 成交金额                        | 占当期债券成交总额的<br>比例 | 成交金额                             | 占当期债券成交总额的<br>比例 |
| 广发证券  | 1,162,774,200.00            | 37.01%           | 40,640,000.00                    | 12.60%           |

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |
|-------|-----------------------------|----------------------------------|
|-------|-----------------------------|----------------------------------|



|      | 成交金额               | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 |
|------|--------------------|----------------|-------------------|----------------|
| 广发证券 | 102,880,734,000.00 | 8.82%          | 80,070,194,000.00 | 13.11%         |

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                    | 上年度可比期间               |
|-----------------|-----------------------|-----------------------|
|                 | 2021年1月1日至2021年12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 216,545,935.15        | 96,727,813.86         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 34,069.36             | 83,136.89             |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.14% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.14\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

##### 7.4.10.2.2 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12月31日 | 2020年1月1日至2020年12月31日 |

|                |               |               |
|----------------|---------------|---------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 77,337,833.90 | 34,545,647.81 |
|----------------|---------------|---------------|

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日      |               |             |               |
|----------------|----------------------------------|---------------|-------------|---------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |               |             |               |
|                | 易方达现金增利货币 A                      | 易方达现金增利货币 B   | 易方达现金增利货币 C | 合计            |
| 易方达基金管理有限公司    | 608,346.82                       | 15,426,617.23 | 22,508.11   | 16,057,472.16 |
| 合计             | 608,346.82                       | 15,426,617.23 | 22,508.11   | 16,057,472.16 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |               |             |               |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                 |               |             |               |
|                | 易方达现金增利货币 A                      | 易方达现金增利货币 B   | 易方达现金增利货币 C | 合计            |
| 易方达基金管理有限公司    | 1,002,498.64                     | 6,866,412.51  | 8,604.17    | 7,877,515.32  |
| 合计             | 1,002,498.64                     | 6,866,412.51  | 8,604.17    | 7,877,515.32  |

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，C 类基金份额的年销售服务费率为 0.05%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

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

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31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              |
| 中国建设银行                           | -      | -                  | -     | -    | 100,097,582.0<br>00.00 | 14,755,90<br>9.59 |
| 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31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              |
| 中国建设银行                           | -      | 487,670,03<br>0.05 | -     | -    | 170,218,903,0<br>00.00 | 12,736,96<br>7.41 |

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2021年1月1日至2021年12月31日 |                |                | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年12月31日 |                |                |
|----|-----------------------------|----------------|----------------|----------------------------------|----------------|----------------|
|    | 易方达现金增<br>利货币A              | 易方达现金增<br>利货币B | 易方达现金增<br>利货币C | 易方达现金增<br>利货币A                   | 易方达现金增<br>利货币B | 易方达现金增<br>利货币C |
|    |                             |                |                |                                  |                |                |

|                     |   |                      |   |   |                      |   |
|---------------------|---|----------------------|---|---|----------------------|---|
| 报告期初持有的基金份额         | - | 1,382,765,35<br>6.94 | - | - | 904,589,775.<br>03   | - |
| 报告期内申购/买入总份额        | - | 2,167,298,61<br>8.35 | - | - | 878,175,581.<br>91   | - |
| 报告期内因拆分变动份额         | - | -                    | - | - | -                    | - |
| 减：报告期内赎回/卖出总份额      | - | 1,400,000,00<br>0.00 | - | - | 400,000,000.<br>00   | - |
| 报告期末持有的基金份额         | - | 2,150,063,97<br>5.29 | - | - | 1,382,765,35<br>6.94 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | - | 1.1963%              | - | - | 1.3805%              | - |

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达现金增利货币 A

无。

易方达现金增利货币 B

份额单位：份

| 关联方名称               | 本期末<br>2021年12月31日 |                          | 上年度末<br>2020年12月31日 |                          |
|---------------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|                     | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 易方达私募基金管理（上海）有限公司   | 27,636,988.73      | 0.0154%                  | -                   | -                        |
| 易方达资产管理有<br>限公司     | 219,653,524.80     | 0.1222%                  | 136,445,326.11      | 0.1362%                  |
| 广东易方达源臻投<br>资管理有限公司 | 142,350.80         | 0.0001%                  | -                   | -                        |
| 广东省易方达公益<br>基金会     | 200,032,380.14     | 0.1113%                  | -                   | -                        |
| 广发证券                | 1,863,492,540.51   | 1.0368%                  | 201,102,201.96      | 0.2008%                  |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。

易方达现金增利货币 C

无。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称       | 本期                    |            | 上年度可比期间               |              |
|-------------|-----------------------|------------|-----------------------|--------------|
|             | 2021年1月1日至2021年12月31日 |            | 2020年1月1日至2020年12月31日 |              |
|             | 期末余额                  | 当期利息收入     | 期末余额                  | 当期利息收入       |
| 中国建设银行-活期存款 | 2,906,047.49          | 488,484.09 | 1,940,102.23          | 1,008,510.11 |

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

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

易方达现金增利货币 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 |
|--------------|---------------|----------|--------------|----|
| 8,543,172.41 | -             | -        | 8,543,172.41 | -  |

易方达现金增利货币 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 |
|------------------|---------------|----------|------------------|----|
| 3,990,786,372.27 | -             | -        | 3,990,786,372.27 | -  |

易方达现金增利货币 C

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 |
| 1,152,604.86     | -                 | -            | 1,152,604.86 | -  |

## 7.4.12 期末（2021 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 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 |
| 136803                   | 荟享 089A | 2021-12-09 | 2022-01-18 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 400,000  | 40,000,000.00 | 40,000,000.00 | -  |
| 136885                   | 起航 06 优 | 2021-12-30 | 2022-02-08 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 110,000  | 11,000,000.00 | 11,000,000.00 | -  |
| 136889                   | 链融 54A1 | 2021-12-29 | 2022-01-26 | 新发流通受限 | 100.00 | 100.00 | 300,000  | 30,000,000.00 | 30,000,000.00 | -  |

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

## 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 22,309,978,394.60 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         |
|-----------|---------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 112103040 | 21 农业银行 CD040 | 2022-01-04 | 99.23  | 4,600,000 | 456,437,851.95 |
| 112103041 | 21 农业银行 CD041 | 2022-01-04 | 99.23  | 1,435,000 | 142,399,082.38 |
| 112103052 | 21 农业银行 CD052 | 2022-01-04 | 98.55  | 1,087,000 | 107,126,493.24 |
| 112103064 | 21 农业银行       | 2022-01-04 | 98.71  | 5,435,000 | 536,515,247.20 |

|           |                  |            |       |            |                  |
|-----------|------------------|------------|-------|------------|------------------|
|           | CD064            |            |       |            |                  |
| 112103068 | 21 农业银行<br>CD068 | 2022-01-04 | 98.14 | 1,000,000  | 98,136,475.85    |
| 112103101 | 21 农业银行<br>CD101 | 2022-01-04 | 98.53 | 3,261,000  | 321,321,876.37   |
| 112104024 | 21 中国银行<br>CD024 | 2022-01-04 | 99.26 | 7,495,000  | 743,976,919.88   |
| 112104035 | 21 中国银行<br>CD035 | 2022-01-04 | 98.42 | 1,000,000  | 98,417,492.27    |
| 112106144 | 21 交通银行<br>CD144 | 2022-01-04 | 98.71 | 1,000,000  | 98,706,316.58    |
| 112106149 | 21 交通银行<br>CD149 | 2022-01-04 | 98.56 | 2,000,000  | 197,118,908.42   |
| 112106202 | 21 交通银行<br>CD202 | 2022-01-04 | 98.58 | 2,000,000  | 197,165,963.39   |
| 112107124 | 21 招商银行<br>CD124 | 2022-01-04 | 97.75 | 1,000,000  | 97,749,908.82    |
| 112108085 | 21 中信银行<br>CD085 | 2022-01-04 | 99.26 | 4,239,000  | 420,759,792.92   |
| 112108088 | 21 中信银行<br>CD088 | 2022-01-04 | 99.16 | 1,000,000  | 99,162,167.40    |
| 112108106 | 21 中信银行<br>CD106 | 2022-01-04 | 98.48 | 1,065,000  | 104,878,517.04   |
| 112108126 | 21 中信银行<br>CD126 | 2022-01-04 | 98.62 | 1,000,000  | 98,621,202.15    |
| 112108128 | 21 中信银行<br>CD128 | 2022-01-04 | 98.59 | 1,530,000  | 150,837,012.99   |
| 112108129 | 21 中信银行<br>CD129 | 2022-01-04 | 98.58 | 1,000,000  | 98,579,021.28    |
| 112108173 | 21 中信银行<br>CD173 | 2022-01-04 | 97.49 | 3,200,000  | 311,952,242.70   |
| 112109141 | 21 浦发银行<br>CD141 | 2022-01-04 | 99.31 | 1,544,000  | 153,330,908.85   |
| 112109167 | 21 浦发银行<br>CD167 | 2022-01-04 | 98.76 | 1,000,000  | 98,755,514.86    |
| 112109173 | 21 浦发银行<br>CD173 | 2022-01-04 | 99.08 | 11,631,000 | 1,152,398,209.16 |
| 112110180 | 21 兴业银行<br>CD180 | 2022-01-04 | 98.72 | 1,000,000  | 98,718,062.59    |
| 112110186 | 21 兴业银行<br>CD186 | 2022-01-04 | 98.75 | 500,000    | 49,374,435.20    |
| 112110305 | 21 兴业银行<br>CD305 | 2022-01-04 | 98.49 | 1,000,000  | 98,492,869.94    |
| 112111111 | 21 平安银行          | 2022-01-04 | 99.26 | 2,500,000  | 248,142,296.74   |

|           |                      |            |        |            |                  |
|-----------|----------------------|------------|--------|------------|------------------|
|           | CD111                |            |        |            |                  |
| 112113204 | 21 浙商银行<br>CD204     | 2022-01-04 | 99.17  | 9,500,000  | 942,141,705.67   |
| 112113213 | 21 浙商银行<br>CD213     | 2022-01-04 | 98.82  | 6,290,000  | 621,551,627.50   |
| 112113236 | 21 浙商银行<br>CD236     | 2022-01-04 | 98.54  | 5,632,000  | 554,990,695.20   |
| 112114182 | 21 江苏银行<br>CD182     | 2022-01-04 | 97.31  | 5,000,000  | 486,574,202.78   |
| 112117120 | 21 光大银行<br>CD120     | 2022-01-04 | 98.60  | 2,827,000  | 278,743,921.28   |
| 112117125 | 21 光大银行<br>CD125     | 2022-01-04 | 97.70  | 2,174,000  | 212,406,615.65   |
| 112117144 | 21 光大银行<br>CD144     | 2022-01-04 | 98.30  | 1,000,000  | 98,301,912.47    |
| 112117217 | 21 光大银行<br>CD217     | 2022-01-04 | 97.37  | 9,882,000  | 962,173,942.78   |
| 112118096 | 21 华夏银行<br>CD096     | 2022-01-04 | 99.22  | 747,000    | 74,119,346.70    |
| 112118331 | 21 华夏银行<br>CD331     | 2022-01-04 | 98.71  | 10,000,000 | 987,137,596.58   |
| 112171279 | 21 广东顺德<br>农商行 CD140 | 2022-01-04 | 99.21  | 8,000,000  | 793,643,180.05   |
| 112171351 | 21 成都银行<br>CD263     | 2022-01-04 | 99.21  | 5,000,000  | 496,047,882.43   |
| 112172249 | 21 重庆农村<br>商行 CD265  | 2022-01-04 | 99.14  | 3,000,000  | 297,407,135.51   |
| 112189872 | 21 长沙银行<br>CD216     | 2022-01-04 | 99.41  | 5,000,000  | 497,029,422.46   |
| 150209    | 15 国开 09             | 2022-01-04 | 100.50 | 600,000    | 60,302,469.81    |
| 150304    | 15 进出 04             | 2022-01-04 | 100.10 | 1,448,000  | 144,946,651.27   |
| 170409    | 17 农发 09             | 2022-01-04 | 100.50 | 100,000    | 10,049,909.66    |
| 190202    | 19 国开 02             | 2022-01-04 | 100.03 | 5,332,000  | 533,374,734.86   |
| 190207    | 19 国开 07             | 2022-01-04 | 100.30 | 1,600,000  | 160,476,566.59   |
| 190303    | 19 进出 03             | 2022-01-04 | 100.08 | 4,500,000  | 450,341,131.37   |
| 200302    | 20 进出 02             | 2022-01-04 | 99.92  | 1,200,000  | 119,899,652.56   |
| 210201    | 21 国开 01             | 2022-01-04 | 100.01 | 19,150,000 | 1,915,231,391.44 |
| 210206    | 21 国开 06             | 2022-01-04 | 100.03 | 8,423,000  | 842,589,880.93   |
| 210211    | 21 国开 11             | 2022-01-04 | 99.82  | 7,230,000  | 721,676,974.33   |
| 210301    | 21 进出 01             | 2022-01-04 | 100.04 | 5,666,000  | 566,837,803.06   |
| 210304    | 21 进出 04             | 2022-01-04 | 100.00 | 2,000,000  | 199,991,302.09   |
| 210407    | 21 农发 07             | 2022-01-04 | 99.77  | 437,000    | 43,597,660.93    |
| 219939    | 21 贴现国债<br>39        | 2022-01-04 | 99.69  | 3,600,000  | 358,877,132.59   |



|           |                  |            |        |           |                |
|-----------|------------------|------------|--------|-----------|----------------|
| 219942    | 21 贴现国债<br>42    | 2022-01-04 | 99.59  | 200,000   | 19,918,923.80  |
| 112104027 | 21 中国银行<br>CD027 | 2022-01-05 | 98.78  | 3,000,000 | 296,339,829.44 |
| 112108081 | 21 中信银行<br>CD081 | 2022-01-05 | 99.22  | 1,800,000 | 178,600,524.96 |
| 112108085 | 21 中信银行<br>CD085 | 2022-01-05 | 99.26  | 1,087,000 | 107,894,761.71 |
| 112108128 | 21 中信银行<br>CD128 | 2022-01-05 | 98.59  | 395,000   | 38,941,581.79  |
| 112108131 | 21 中信银行<br>CD131 | 2022-01-05 | 97.89  | 2,000,000 | 195,788,289.82 |
| 112117122 | 21 光大银行<br>CD122 | 2022-01-05 | 98.58  | 2,000,000 | 197,157,901.13 |
| 190207    | 19 国开 07         | 2022-01-05 | 100.30 | 1,900,000 | 190,565,922.83 |
| 210301    | 21 进出 01         | 2022-01-05 | 100.04 | 734,000   | 73,430,806.11  |
| 210401    | 21 农发 01         | 2022-01-05 | 100.04 | 3,100,000 | 310,129,961.85 |
| 210404    | 21 农发 04         | 2022-01-05 | 99.95  | 2,450,000 | 244,870,904.54 |
| 112103036 | 21 农业银行<br>CD036 | 2022-01-06 | 99.37  | 2,174,000 | 216,028,406.30 |
| 112106124 | 21 交通银行<br>CD124 | 2022-01-06 | 99.20  | 1,897,000 | 188,175,071.95 |
| 112106128 | 21 交通银行<br>CD128 | 2022-01-06 | 99.17  | 500,000   | 49,586,723.06  |
| 112106209 | 21 交通银行<br>CD209 | 2022-01-06 | 98.52  | 2,000,000 | 197,046,604.57 |
| 112107080 | 21 招商银行<br>CD080 | 2022-01-06 | 97.96  | 3,000,000 | 293,890,356.96 |
| 112107092 | 21 招商银行<br>CD092 | 2022-01-06 | 98.42  | 500,000   | 49,209,522.46  |
| 112108078 | 21 中信银行<br>CD078 | 2022-01-06 | 99.02  | 1,449,000 | 143,486,313.56 |
| 112111108 | 21 平安银行<br>CD108 | 2022-01-06 | 99.28  | 2,748,000 | 272,830,540.93 |
| 112117071 | 21 光大银行<br>CD071 | 2022-01-06 | 99.32  | 2,000,000 | 198,649,567.59 |
| 112117078 | 21 光大银行<br>CD078 | 2022-01-06 | 99.25  | 2,000,000 | 198,507,644.49 |
| 112107065 | 21 招商银行<br>CD065 | 2022-01-07 | 99.25  | 700,000   | 69,472,792.19  |
| 112107123 | 21 招商银行<br>CD123 | 2022-01-07 | 97.79  | 1,000,000 | 97,785,109.93  |
| 112117102 | 21 光大银行<br>CD102 | 2022-01-07 | 98.39  | 1,011,000 | 99,468,992.79  |

|           |                  |            |       |             |                   |
|-----------|------------------|------------|-------|-------------|-------------------|
| 112117125 | 21 光大银行<br>CD125 | 2022-01-07 | 97.70 | 737,000     | 72,007,210.55     |
| 合计        |                  |            |       | 239,242,000 | 23,709,321,504.03 |

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部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、集中交易部门、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。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 33.14%(2020 年 12 月 31 日：33.89%)。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00               | 770,016,960.08      |
| A-1 以下 | 0.00               | 0.00                |
| 未评级    | 11,378,187,168.54  | 7,832,056,939.14    |
| 合计     | 11,378,187,168.54  | 8,602,073,899.22    |

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。

#### 7.4.13.2.2 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>2021年12月31日 | 上年度末<br>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                |

#### 7.4.13.2.3 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>2021年12月31日 | 上年度末<br>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                |

#### 7.4.13.2.4 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>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 0.00               | 2,006,129,516.06    |

|        |      |                  |
|--------|------|------------------|
| AAA 以下 | 0.00 | 0.00             |
| 未评级    | 0.00 | 0.00             |
| 合计     | 0.00 | 2,006,129,516.06 |

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

#### 7.4.13.2.5 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>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 4,609,342,949.80   | 2,542,524,720.35    |
| AAA 以下 | 0.00               | 0.00                |
| 未评级    | 0.00               | 0.00                |
| 合计     | 4,609,342,949.80   | 2,542,524,720.35    |

#### 7.4.13.2.6 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>2021年12月31日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 53,161,277,659.99  | 26,040,951,032.10   |
| AAA 以下 | 0.00               | 0.00                |
| 未评级    | 0.00               | 0.00                |
| 合计     | 53,161,277,659.99  | 26,040,951,032.10   |

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带

来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

|                            |       |       |       |     |    |
|----------------------------|-------|-------|-------|-----|----|
| 本期末<br>2021 年 12 月<br>31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|----------------------------|-------|-------|-------|-----|----|

|           |                    |   |   |                   |                    |
|-----------|--------------------|---|---|-------------------|--------------------|
| 资产        |                    |   |   |                   |                    |
| 银行存款      | 115,692,906,047.49 | - | - | -                 | 115,692,906,047.49 |
| 结算备付金     | 10,436,199,931.82  | - | - | -                 | 10,436,199,931.82  |
| 存出保证金     | -                  | - | - | -                 | -                  |
| 交易性金融资产   | 68,910,769,239.19  | - | - | -                 | 68,910,769,239.19  |
| 衍生金融资产    | -                  | - | - | -                 | -                  |
| 买入返售金融资产  | 16,827,747,551.67  | - | - | -                 | 16,827,747,551.67  |
| 应收证券清算款   | -                  | - | - | -                 | -                  |
| 应收利息      | -                  | - | - | 1,000,635,157.32  | 1,000,635,157.32   |
| 应收股利      | -                  | - | - | -                 | -                  |
| 应收申购款     | -                  | - | - | 63,661,657.82     | 63,661,657.82      |
| 递延所得税资产   | -                  | - | - | -                 | -                  |
| 其他资产      | -                  | - | - | -                 | -                  |
| 资产总计      | 211,867,622,770.17 | - | - | 1,064,296,815.14  | 212,931,919,585.31 |
| 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 | 22,309,978,394.60  | - | - | -                 | 22,309,978,394.60  |
| 应付证券清算款   | -                  | - | - | 10,113,754,040.13 | 10,113,754,040.13  |
| 应付赎回款     | -                  | - | - | 117,887,487.64    | 117,887,487.64     |
| 应付管理人报酬   | -                  | - | - | 22,324,330.28     | 22,324,330.28      |
| 应付托管费     | -                  | - | - | 7,972,975.10      | 7,972,975.10       |
| 应付销售服务费   | -                  | - | - | 1,687,532.74      | 1,687,532.74       |
| 应付交易费用    | -                  | - | - | 812,968.26        | 812,968.26         |
| 应交税费      | -                  | - | - | 834,778.62        | 834,778.62         |
| 应付利息      | -                  | - | - | 3,214,238.63      | 3,214,238.63       |
| 应付利润      | -                  | - | - | -                 | -                  |

|                             |                    |       |       |                   |                    |
|-----------------------------|--------------------|-------|-------|-------------------|--------------------|
| 递延所得税负债                     | -                  | -     | -     | -                 | -                  |
| 其他负债                        | -                  | -     | -     | 246,100.00        | 246,100.00         |
| 负债总计                        | 22,309,978,394.60  | -     | -     | 10,268,734,451.40 | 32,578,712,846.00  |
| 利率敏感度缺口                     | 189,557,644,375.57 | -     | -     | -9,204,437,636.26 | 180,353,206,739.31 |
| 上年度末<br>2020 年 12 月<br>31 日 | 1 年以内              | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息               | 合计                 |
| 资产                          |                    |       |       |                   |                    |
| 银行存款                        | 51,641,940,102.23  | -     | -     | -                 | 51,641,940,102.23  |
| 结算备付金                       | 97,367,619.05      | -     | -     | -                 | 97,367,619.05      |
| 存出保证金                       | -                  | -     | -     | -                 | -                  |
| 交易性金融资产                     | 39,045,720,327.97  | -     | -     | -                 | 39,045,720,327.97  |
| 衍生金融资产                      | -                  | -     | -     | -                 | -                  |
| 买入返售金融资产                    | 16,804,717,380.98  | -     | -     | -                 | 16,804,717,380.98  |
| 应收证券清算款                     | -                  | -     | -     | 894,855.50        | 894,855.50         |
| 应收利息                        | -                  | -     | -     | 366,057,864.08    | 366,057,864.08     |
| 应收股利                        | -                  | -     | -     | -                 | -                  |
| 应收申购款                       | -                  | -     | -     | 108,431,562.06    | 108,431,562.06     |
| 递延所得税资产                     | -                  | -     | -     | -                 | -                  |
| 其他资产                        | -                  | -     | -     | -                 | -                  |
| 资产总计                        | 107,589,745,430.23 | -     | -     | 475,384,281.64    | 108,065,129,711.87 |
| 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                   | 7,275,889,655.19   | -     | -     | -                 | 7,275,889,655.19   |
| 应付证券清算款                     | -                  | -     | -     | -                 | -                  |

|         |                    |   |   |                |                    |
|---------|--------------------|---|---|----------------|--------------------|
| 应付赎回款   | -                  | - | - | 188,815,896.64 | 188,815,896.64     |
| 应付管理人报酬 | -                  | - | - | 12,297,525.10  | 12,297,525.10      |
| 应付托管费   | -                  | - | - | 4,391,973.26   | 4,391,973.26       |
| 应付销售服务费 | -                  | - | - | 958,498.71     | 958,498.71         |
| 应付交易费用  | -                  | - | - | 582,478.16     | 582,478.16         |
| 应交税费    | -                  | - | - | 558,552.49     | 558,552.49         |
| 应付利息    | -                  | - | - | 2,640,371.63   | 2,640,371.63       |
| 应付利润    | -                  | - | - | -              | -                  |
| 递延所得税负债 | -                  | - | - | -              | -                  |
| 其他负债    | -                  | - | - | 246,000.00     | 246,000.00         |
| 负债总计    | 7,275,889,655.19   | - | - | 210,491,295.99 | 7,486,380,951.18   |
| 利率敏感度缺口 | 100,313,855,775.04 | - | - | 264,892,985.65 | 100,578,748,760.69 |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设            | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                                 |                     |
|---------------|--------------------|---------------------------------|---------------------|
| 分析            | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |                     |
|               |                    | 本期末<br>2021年12月31日              | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|               | 1.市场利率下降25个基点      | 62,242,603.50                   | 33,012,069.87       |
| 2.市场利率上升25个基点 | -62,105,622.73     | -32,946,526.07                  |                     |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金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。

#### 7.4.14 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 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 68,910,769,239.19 元，无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第二层次 39,045,720,327.97 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 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公开募集证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|--------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 68,910,769,239.19  | 32.36         |
|    | 其中：债券             | 64,350,988,435.18  | 30.22         |
|    | 资产支持证券            | 4,559,780,804.01   | 2.14          |
| 2  | 买入返售金融资产          | 16,827,747,551.67  | 7.90          |
|    | 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      | 126,129,105,979.31 | 59.23         |
| 4  | 其他各项资产            | 1,064,296,815.14   | 0.50          |
| 5  | 合计                | 212,931,919,585.31 | 100.00        |

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目           | 占基金资产净值的比例 (%)    |                |
|----|--------------|-------------------|----------------|
| 1  | 报告期内债券回购融资余额 | 5.29              |                |
|    | 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 | 22,309,978,394.60 | 12.37          |
|    | 其中：买断式回购融资   | -                 | -              |

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

## 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

## 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目                | 天数  |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限    | 117 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 117 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 75  |

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限                 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|------------------------|---------------------|---------------------|
| 1  | 30 天以内                 | 24.31               | 17.98               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 6.68                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 26.16               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 27.51               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 32.81               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
|    | 合计                     | 117.47              | 17.98               |

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本 | 占基金资产净值 |
|----|------|------|---------|
|----|------|------|---------|

|    |                      |                   | 比例(%) |
|----|----------------------|-------------------|-------|
| 1  | 国家债券                 | 477,691,033.87    | 0.26  |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -     |
| 3  | 金融债券                 | 9,127,538,409.95  | 5.06  |
|    | 其中：政策性金融债            | 8,727,532,997.22  | 4.84  |
| 4  | 企业债券                 | -                 | -     |
| 5  | 企业短期融资券              | 1,586,298,206.37  | 0.88  |
| 6  | 中期票据                 | -                 | -     |
| 7  | 同业存单                 | 53,159,460,784.99 | 29.48 |
| 8  | 其他                   | -                 | -     |
| 9  | 合计                   | 64,350,988,435.18 | 35.68 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | -                 | -     |

## 8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称          | 债券数量(张)    | 摊余成本             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|---------------|------------|------------------|--------------|
| 1  | 210206    | 21 国开 06      | 26,400,000 | 2,640,908,566.60 | 1.46         |
| 2  | 210201    | 21 国开 01      | 19,150,000 | 1,915,231,391.44 | 1.06         |
| 3  | 112104023 | 21 中国银行 CD023 | 15,000,000 | 1,488,694,430.61 | 0.83         |
| 4  | 112104022 | 21 中国银行 CD022 | 14,500,000 | 1,440,117,038.85 | 0.80         |
| 5  | 112109173 | 21 浦发银行 CD173 | 12,000,000 | 1,188,958,688.84 | 0.66         |
| 6  | 112103060 | 21 农业银行 CD060 | 11,000,000 | 1,086,526,275.83 | 0.60         |
| 7  | 112116183 | 21 上海银行 CD183 | 10,000,000 | 992,542,854.12   | 0.55         |
| 8  | 112172076 | 21 宁波银行 CD296 | 10,000,000 | 991,431,305.85   | 0.55         |
| 9  | 112118331 | 21 华夏银行 CD331 | 10,000,000 | 987,137,596.58   | 0.55         |
| 10 | 112117217 | 21 光大银行 CD217 | 10,000,000 | 973,663,168.16   | 0.54         |

## 8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目                            | 偏离情况    |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 | 0       |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.0925% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0060% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0467% |

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

**报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明**

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

**8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称     | 数量（份）     | 摊余成本（元）        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 179079 | 信花 01A   | 2,200,000 | 220,714,684.40 | 0.12         |
| 2  | 189969 | 明远 02A2  | 1,830,000 | 183,000,000.00 | 0.10         |
| 3  | 189321 | 致远 08A2  | 1,700,000 | 170,000,000.00 | 0.09         |
| 4  | 179673 | 10 欲晓 A2 | 1,500,000 | 150,013,437.21 | 0.08         |
| 5  | 169931 | 东花 20A1  | 1,300,000 | 130,421,661.11 | 0.07         |
| 6  | 136157 | 万科 24 优  | 1,100,000 | 110,034,449.90 | 0.06         |
| 7  | 189285 | GC 致远 A2 | 1,100,000 | 110,000,000.00 | 0.06         |
| 8  | 136037 | 链融 45A1  | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 0.06         |
| 8  | 136229 | 21 瑞链 09 | 1,000,000 | 100,000,000.00 | 0.06         |
| 10 | 136069 | 21 瑞链 08 | 900,000   | 90,000,000.00  | 0.05         |

**8.9 投资组合报告附注****8.9.1 基金计价方法说明**

本基金目前投资工具的估值方法如下：

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

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

（3）基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

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

如有新增事项，按国家最新规定估值。

**8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会**

委员会的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局、国家外汇管理局宁波市分局、中国人民银行宁波市中心支行的处罚。华夏银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额               |
|----|---------|------------------|
| 1  | 存出保证金   | -                |
| 2  | 应收证券清算款 | -                |
| 3  | 应收利息    | 1,000,635,157.32 |
| 4  | 应收申购款   | 63,661,657.82    |
| 5  | 其他应收款   | -                |
| 6  | 待摊费用    | -                |
| 7  | 其他      | -                |
| 8  | 合计      | 1,064,296,815.14 |

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别    | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构          |        |                |        |
|---------|----------|-----------|----------------|--------|----------------|--------|
|         |          |           | 机构投资者          |        | 个人投资者          |        |
|         |          |           | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额           | 占总份额比例 |
| 易方达现金增利 | 199,339  | 2,916.45  | 362,621,546.62 | 62.37% | 218,741,417.94 | 37.63% |

|                 |         |                  |                        |        |                       |             |
|-----------------|---------|------------------|------------------------|--------|-----------------------|-------------|
| 货币 A            |         |                  |                        |        |                       |             |
| 易方达现金增利<br>货币 B | 150,218 | 1,196,448.4<br>2 | 166,847,119,13<br>1.44 | 92.83% | 12,880,970,224<br>.32 | 7.17%       |
| 易方达现金增利<br>货币 C | 1,508   | 29,014.87        | 0.00                   | 0.00%  | 43,754,418.99         | 100.00<br>% |
| 合计              | 351,065 | 513,731.66       | 167,209,740,67<br>8.06 | 92.71% | 13,143,466,061<br>.25 | 7.29%       |

## 9.2 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  | 其他机构  | 3,756,583,320.84 | 2.08%  |
| 2  | 银行类机构 | 3,471,654,089.48 | 1.92%  |
| 3  | 其他机构  | 3,345,371,644.01 | 1.85%  |
| 4  | 其他机构  | 3,080,784,618.24 | 1.71%  |
| 5  | 银行类机构 | 3,069,086,500.68 | 1.70%  |
| 6  | 其他机构  | 3,065,895,455.86 | 1.70%  |
| 7  | 银行类机构 | 3,038,980,835.79 | 1.69%  |
| 8  | 保险类机构 | 3,022,617,367.57 | 1.68%  |
| 9  | 其他机构  | 3,019,899,953.81 | 1.67%  |
| 10 | 银行类机构 | 2,997,360,708.77 | 1.66%  |

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别        | 持有份额总数（份）      | 占基金总份额比例 |
|------------------|-------------|----------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 易方达现金增利货币 A | 262,849.89     | 0.0452%  |
|                  | 易方达现金增利货币 B | 226,076,941.83 | 0.1258%  |
|                  | 易方达现金增利货币 C | 492,909.43     | 1.1265%  |
|                  | 合计          | 226,832,701.15 | 0.1258%  |

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 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 | 易方达现金增利货币 A | 0~10              |
|                                | 易方达现金增利货币 B | >100              |
|                                | 易方达现金增利货币 C | 0                 |
|                                | 合计          | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 易方达现金增利货币 A | 0                 |
|                                | 易方达现金增利货币 B | 10~50             |
|                                | 易方达现金增利货币 C | 0                 |

|  |    |       |
|--|----|-------|
|  | 合计 | 10~50 |
|--|----|-------|

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                | 易方达现金增利货币 A      | 易方达现金增利货币 B        | 易方达现金增利货币 C    |
|-----------------------------------|------------------|--------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015 年 2 月 5 日）<br>基金份额总额 | 1,866,693.89     | 200,000,000.00     | -              |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 373,570,638.32   | 100,166,315,191.54 | 38,862,930.83  |
| 本报告期基金总申购份额                       | 1,346,553,328.61 | 258,274,446,160.64 | 196,386,447.06 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 1,138,761,002.37 | 178,712,671,996.42 | 191,494,958.90 |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | -                | -                  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 581,362,964.56   | 179,728,089,355.76 | 43,754,418.99  |

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 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；2021 年 7 月 17 日发布公告，自 2021 年 7 月 15 日起陈丽园女士不再担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 24 日发布公告，自 2021 年 7 月 24 日起聘任萧楠先生担任公司副总经理级高级管理人员，聘任管勇先生担任公司首席信息官；2021 年 7 月 30 日发布公告，自 2021 年 7 月 30 日起聘任杨冬梅女士担任公司副总经理级高级管理人员。

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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。



### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 7 年聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 117,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 交易单元数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|-------|--------|------|--------------|-----------|------------|----|
|       |        | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 安信证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长江证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方财富  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东方证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 东吴证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 方正证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 光大证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 广发证券  | 3      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国海证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国金证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国盛证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国信证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国元证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 海通证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华创证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华泰证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 华西证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 南京证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 平安证券  | 2      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 太平洋证券 | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |
| 天风证券  | 1      | -    | -            | -         | -          | -  |

|      |   |   |   |   |   |   |
|------|---|---|---|---|---|---|
| 西部证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 信达证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金财富 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为东北证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司,新增交易单元的证券公司为长江证券股份有限公司、平安证券股份有限公司。

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。

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易            |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|-------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 安信证券 | -    | -            | 19,689,200,000.00 | 1.69%          | -    | -            |

|       |                  |        |                    |        |   |   |
|-------|------------------|--------|--------------------|--------|---|---|
| 长城证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 长江证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 东方财富  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 东方证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 东吴证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 方正证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 光大证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 广发证券  | 1,162,774,200.00 | 37.01% | 102,880,734,000.00 | 8.82%  | - | - |
| 国海证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 国金证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 国盛证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 国信证券  | -                | -      | 15,886,500,000.00  | 1.36%  | - | - |
| 国元证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 海通证券  | 140,491,400.00   | 4.47%  | 93,378,800,000.00  | 8.01%  | - | - |
| 华创证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 华泰证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 华西证券  | 10,034,000.00    | 0.32%  | 208,380,200,000.00 | 17.86% | - | - |
| 南京证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 平安证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 申万宏源  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 太平洋证券 | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 天风证券  | 19,938,400.00    | 0.63%  | 91,226,200,000.00  | 7.82%  | - | - |
| 西部证券  | -                | -      | 29,275,700,000.00  | 2.51%  | - | - |
| 西南证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 信达证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 兴业证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 银河证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 招商证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 中金财富  | 1,808,766,680.00 | 57.57% | 507,448,800,000.00 | 43.50% | - | - |
| 中信建投  | -                | -      | 98,290,200,000.00  | 8.43%  | - | - |
| 中信证券  | -                | -      | -                  | -      | - | - |
| 中银国际  | -                | -      | -                  | -      | - | - |

#### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

## 11.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                                | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|-------------------------------------|-----------------------------|------------|
| 1  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 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 | 2021-07-17 |
| 7  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告 | 中国证券报                       | 2021-07-20 |
| 8  | 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 | 2021-07-24 |
| 9  | 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 | 2021-07-24 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司关于南京分公司营业场所变更的公告         | 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 | 2021-07-28 |
| 11 | 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 | 2021-07-30 |
| 12 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告     | 中国证券报                       | 2021-08-28 |
| 13 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告 | 中国证券报                       | 2021-10-27 |
| 14 | 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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2021-12-17 |

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准易方达现金增利货币市场基金募集的文件；
2. 《易方达现金增利货币市场基金基金合同》；
3. 《易方达现金增利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。

### 12.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年三月三十日