

# 易方达货币市场基金

## 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年三月二十八日

## §1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

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

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                     |                     |                     |                  |
|---------------------|---------------------|---------------------|------------------|
| 基金简称                | 易方达货币               |                     |                  |
| 基金主代码               | 110006              |                     |                  |
| 基金运作方式              | 契约型开放式              |                     |                  |
| 基金合同生效日             | 2005 年 2 月 2 日      |                     |                  |
| 基金管理人               | 易方达基金管理有限公司         |                     |                  |
| 基金托管人               | 中国银行股份有限公司          |                     |                  |
| 报告期末基金份额总额          | 28,585,173,556.87 份 |                     |                  |
| 基金合同存续期             | 不定期                 |                     |                  |
| 基金份额上市的证券交易所        | 上海证券交易所             |                     |                  |
| 上市日期                | 2014-12-08          |                     |                  |
| 下属分级基金的基金简称         | 易方达货币 A             | 易方达货币 B             | 易方达货币 E          |
| 下属分级基金场内简称          | -                   | -                   | 易货币              |
| 下属分级基金的交易代码         | 110006              | 110016              | 511800           |
| 报告期末下属分级基金的<br>份额总额 | 1,426,343,170.67 份  | 26,491,015,422.64 份 | 667,814,963.56 份 |

注：1.易方达货币市场基金 E 类基金份额上市交易。

2.自 2014 年 11 月 21 日起，易方达货币市场基金增设 E 类份额类别，基金份额面值为 100 元，本表所列 E 类份额数据面值已折算为 1 元。

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                       |
|--------|-------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 在确保本金安全和高流动性的前提下，追求超过基准的回报。                           |
| 投资策略   | 在保持安全性和流动性的前提下尽可能提升组合的收益。                             |
| 业绩比较基准 | 税后活期存款利率(即活期存款利率×(1－利息税率))                            |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。 |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

|    |       |       |
|----|-------|-------|
| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|----|-------|-------|

|             |             |                       |                      |
|-------------|-------------|-----------------------|----------------------|
| 名称          | 易方达基金管理有限公司 |                       | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名          | 张南                    | 王永民                  |
|             | 联系电话        | 020-85102688          | 010-66594896         |
|             | 电子邮箱        | service@efunds.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话      |             | 400 881 8088          | 95566                |
| 传真          |             | 020-85104666          | 010-66594942         |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                 |
|---------------------|-----------------------------------------------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | <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                              |

## § 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<br>和指标 | 2018 年               |                           |                    | 2017 年               |                           |                    | 2016 年               |                           |                      |
|-------------------|----------------------|---------------------------|--------------------|----------------------|---------------------------|--------------------|----------------------|---------------------------|----------------------|
|                   | 易方达<br>货币 A          | 易方达<br>货币 B               | 易方达<br>货币 E        | 易方达<br>货币 A          | 易方达<br>货币 B               | 易方达<br>货币 E        | 易方达<br>货币 A          | 易方达<br>货币 B               | 易方达<br>货币 E          |
| 本期已实现收<br>益       | 43,413,2<br>81.80    | 1,860,10<br>1,942.37      | 25,753,0<br>64.59  | 70,966,2<br>28.78    | 1,268,77<br>9,574.30      | 69,928,2<br>12.11  | 75,437,3<br>31.58    | 1,599,02<br>9,600.72      | 365,634,<br>588.45   |
| 本期利润              | 43,413,2<br>81.80    | 1,860,10<br>1,942.37      | 25,753,0<br>64.59  | 70,966,2<br>28.78    | 1,268,77<br>9,574.30      | 69,928,2<br>12.11  | 75,437,3<br>31.58    | 1,599,02<br>9,600.72      | 365,634,<br>588.45   |
| 本期净值收益<br>率       | 3.0007<br>%          | 3.2482<br>%               | 2.9932<br>%        | 3.4559<br>%          | 3.7051<br>%               | 3.4520<br>%        | 2.4393<br>%          | 2.6859<br>%               | 2.4373<br>%          |
| 3.1.2 期末数据<br>和指标 | 2018 年末              |                           |                    | 2017 年末              |                           |                    | 2016 年末              |                           |                      |
|                   | 易方达货<br>币 A          | 易方达货<br>币 B               | 易方达货<br>币 E        | 易方达货<br>币 A          | 易方达货<br>币 B               | 易方达货<br>币 E        | 易方达货<br>币 A          | 易方达货<br>币 B               | 易方达货<br>币 E          |
| 期末基金资产<br>净值      | 1,426,34<br>3,170.67 | 26,491,0<br>15,422.6<br>4 | 667,814,<br>963.56 | 1,653,51<br>5,219.74 | 22,718,5<br>08,345.0<br>9 | 871,089,<br>623.04 | 4,018,34<br>5,718.21 | 51,533,0<br>39,311.7<br>8 | 4,548,56<br>6,851.29 |
| 期末基金份额<br>净值      | 1.0000               | 1.0000                    | 1.0000             | 1.0000               | 1.0000                    | 1.0000             | 1.0000               | 1.0000                    | 1.0000               |

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金自成立起至 2014 年 11 月 20 日，利润分配是按月结转份额；自 2014 年 11 月 21 日起至今，利润分配是按日结转份额。

3.根据《关于易方达货币市场基金实施基金份额分级的公告》，本基金于 2006 年 7 月 18 日实施分级，分级后本基金设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额，升级后的 B 级基金份额从 2006 年 7 月 19 日起享受 B 级基金收益。

4.相关财务指标中的“累计净值收益率”，A 级基金按分级前后延续计算，即本基金分级前的数据全部纳入 A 级基金进行核算；B 级基金自 2006 年 7 月 19 日开始计算。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 易方达货币 A:

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③      | ②—④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.6557%  | 0.0019%     | 0.0883%    | 0.0000%       | 0.5674%  | 0.0019% |
| 过去六个月      | 1.3131%  | 0.0020%     | 0.1766%    | 0.0000%       | 1.1365%  | 0.0020% |
| 过去一年       | 3.0007%  | 0.0026%     | 0.3506%    | 0.0000%       | 2.6501%  | 0.0026% |
| 过去三年       | 9.1595%  | 0.0024%     | 1.0555%    | 0.0000%       | 8.1040%  | 0.0024% |
| 过去五年       | 17.9984% | 0.0077%     | 1.7649%    | 0.0000%       | 16.2335% | 0.0077% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.9665% | 0.0067%     | 13.9777%   | 0.0030%       | 38.9888% | 0.0037% |

##### 易方达货币 B:

| 阶段         | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③      | ②—④     |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月      | 0.7166%  | 0.0019%     | 0.0883%    | 0.0000%       | 0.6283%  | 0.0019% |
| 过去六个月      | 1.4357%  | 0.0020%     | 0.1766%    | 0.0000%       | 1.2591%  | 0.0020% |
| 过去一年       | 3.2482%  | 0.0026%     | 0.3506%    | 0.0000%       | 2.8976%  | 0.0026% |
| 过去三年       | 9.9496%  | 0.0024%     | 1.0555%    | 0.0000%       | 8.8941%  | 0.0024% |
| 过去五年       | 19.4239% | 0.0077%     | 1.7649%    | 0.0000%       | 17.6590% | 0.0077% |
| 自基金合同生效起至今 | 52.7987% | 0.0069%     | 11.3161%   | 0.0031%       | 41.4826% | 0.0038% |

##### 易方达货币 E:

| 阶段    | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③     | ②—④     |
|-------|----------|-------------|------------|---------------|---------|---------|
| 过去三个月 | 0.6535%  | 0.0019%     | 0.0883%    | 0.0000%       | 0.5652% | 0.0019% |

|            |          |         |         |         |          |         |
|------------|----------|---------|---------|---------|----------|---------|
| 过去六个月      | 1.3089%  | 0.0020% | 0.1766% | 0.0000% | 1.1323%  | 0.0020% |
| 过去一年       | 2.9932%  | 0.0026% | 0.3506% | 0.0000% | 2.6426%  | 0.0026% |
| 过去三年       | 9.1456%  | 0.0024% | 1.0555% | 0.0000% | 8.0901%  | 0.0024% |
| 过去五年       | -        | -       | -       | -       | -        | -       |
| 自基金合同生效起至今 | 13.0881% | 0.0039% | 1.4439% | 0.0000% | 11.6442% | 0.0039% |

注：1.根据《关于易方达货币市场基金实施基金份额分级的公告》，本基金于 2006 年 7 月 18 日实施分级，分级后本基金设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额，升级后的 B 级基金份额从 2006 年 7 月 19 日起享受 B 级基金收益。

2.自 2014 年 11 月 21 日起，本基金增设 E 类份额类别，份额申购首次确认日为 2014 年 11 月 27 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

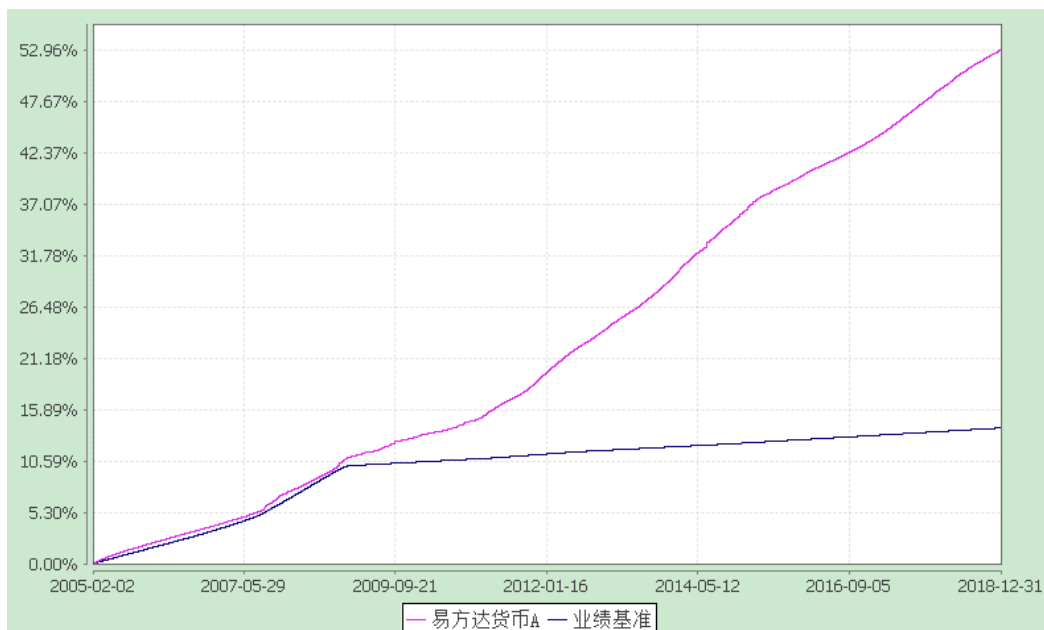
### 3. 2. 2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 易方达货币市场基金

#### 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

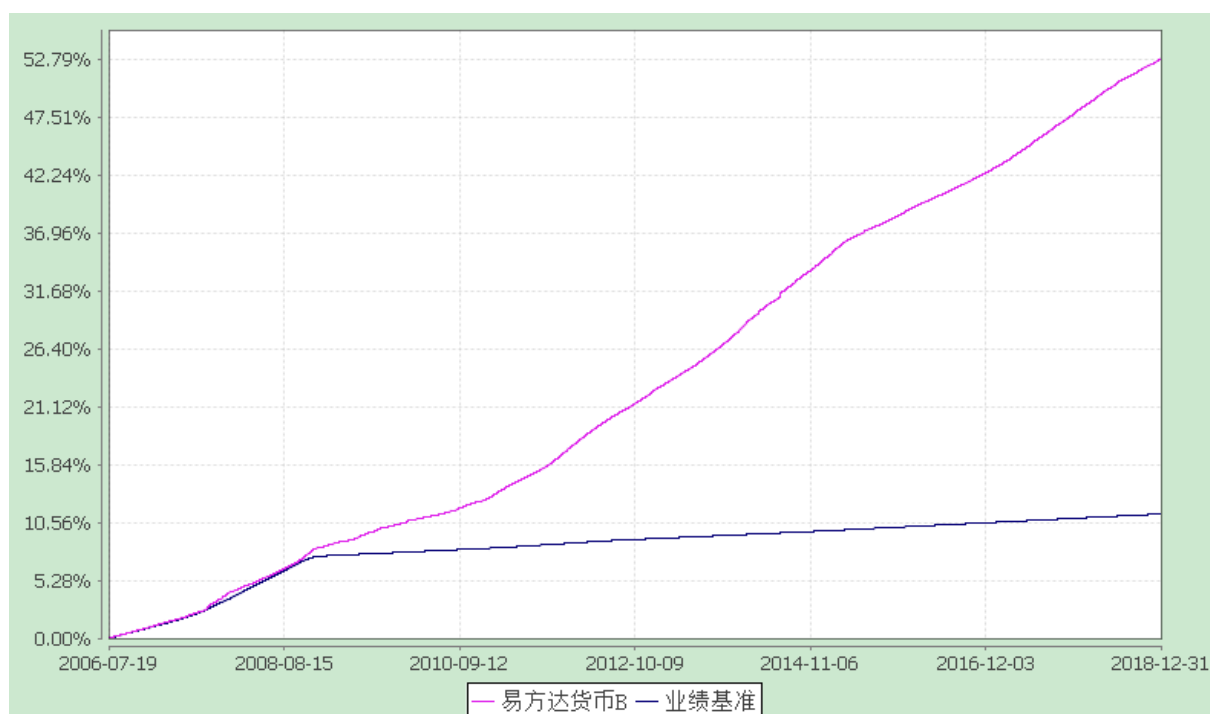
##### 易方达货币 A

(2005 年 2 月 2 日至 2018 年 12 月 31 日)



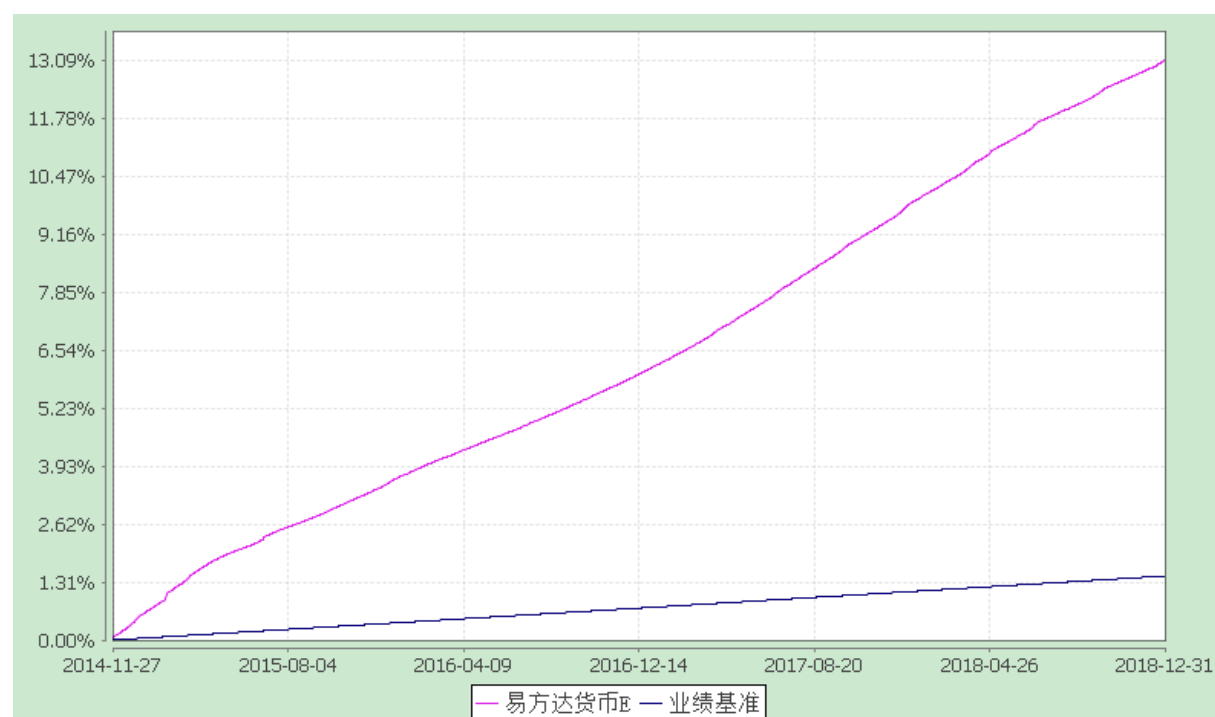
##### 易方达货币 B

(2006 年 7 月 19 日至 2018 年 12 月 31 日)



易方达货币 E

(2014 年 11 月 27 日至 2018 年 12 月 31 日)



注：1.根据 2008 年 12 月 25 日《易方达基金管理有限公司关于变更易方达货币市场基金业绩比较基准的公告》，自 2009 年 1 月 1 日起，本基金原约定的业绩比较基准“一年期银行定期储蓄存款的税后利率： $(1 - \text{利息税率}) \times \text{一年期银行定期储蓄存款利率}$ ”，变更为：“税后活期存款利率(即活期存款利率 $\times (1 - \text{利息税率})$ )”。

2.根据《关于易方达货币市场基金实施基金份额分级的公告》，本基金于 2006 年 7 月 18 日实

施分级，分级后本基金设两级基金份额：A 级基金份额和 B 级基金份额，升级后的 B 级基金份额从 2006 年 7 月 19 日起享受 B 级基金收益。

3.自 2014 年 11 月 21 日起，本基金增设 E 类份额类别，份额申购首次确认日为 2014 年 11 月 27 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

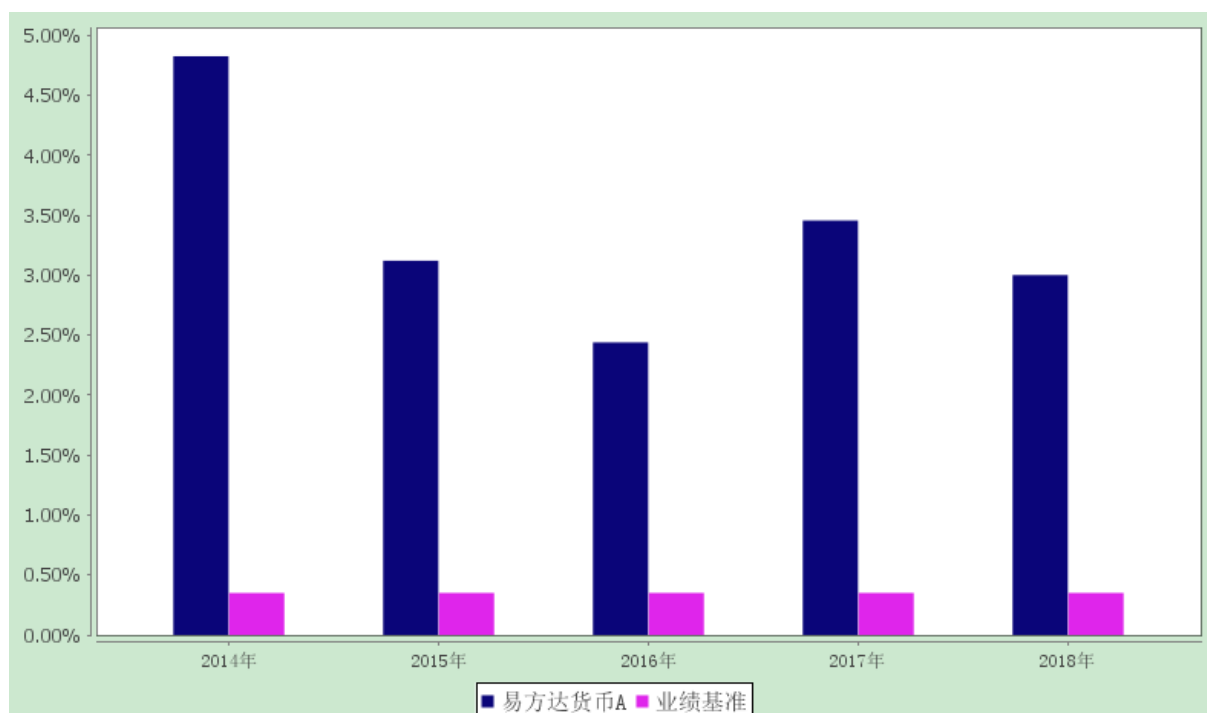
4.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值收益率为 52.9665%，同期业绩比较基准收益率为 13.9777%。B 类基金份额净值收益率为 52.7987%，同期业绩比较基准收益率为 11.3161%。E 类基金份额净值收益率为 13.0881%，同期业绩比较基准收益率为 1.4439%。

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

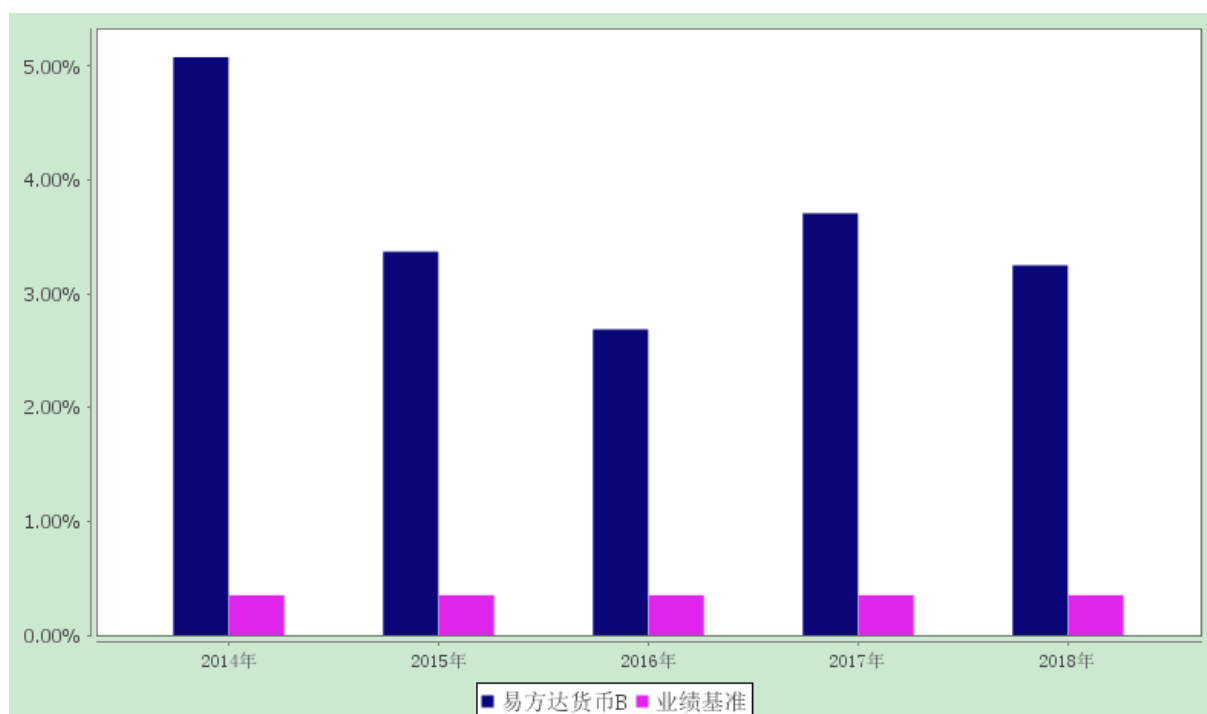
#### 易方达货币市场基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

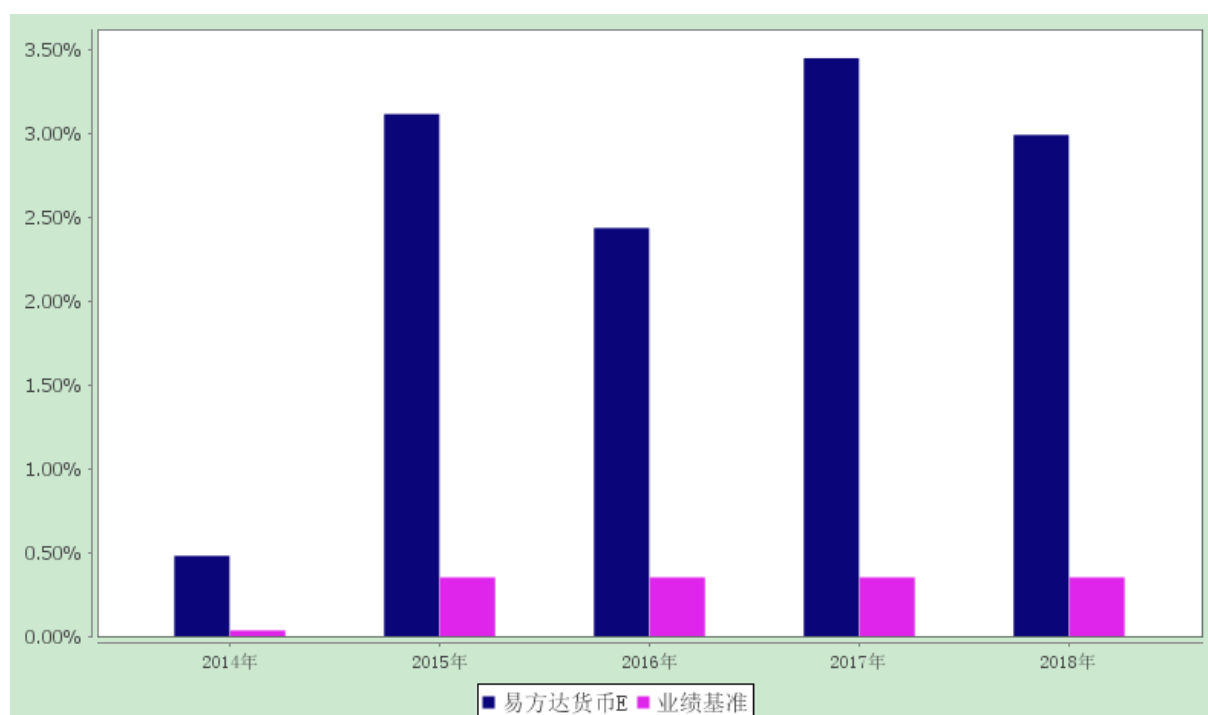
#### 易方达货币 A



#### 易方达货币 B



易方达货币 E



注：自 2014 年 11 月 21 日起，本基金增设 E 类份额类别，份额申购首次确认日为 2014 年 11 月 27 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

易方达货币 A

单位：人民币元

| 年度     | 已按再投资<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 |
|--------|----------------------|-------------------|-------------|----------------|----|
| 2018 年 | 43,520,958.7<br>5    | -                 | -107,676.95 | 43,413,281.80  | -  |
| 2017 年 | 71,059,847.7<br>4    | -                 | -93,618.96  | 70,966,228.78  | -  |
| 2016 年 | 75,124,185.4<br>7    | -                 | 313,146.11  | 75,437,331.58  | -  |
| 合计     | 189,704,991.<br>96   | -                 | 111,850.20  | 189,816,842.16 | -  |

易方达货币 B

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 |
|--------|----------------------|-------------------|--------------|------------------|----|
| 2018 年 | 1,858,234,93<br>0.04 | -                 | 1,867,012.33 | 1,860,101,942.37 | -  |
| 2017 年 | 1,269,500,01<br>7.58 | -                 | -720,443.28  | 1,268,779,574.30 | -  |
| 2016 年 | 1,598,548,15<br>2.10 | -                 | 481,448.62   | 1,599,029,600.72 | -  |
| 合计     | 4,726,283,09<br>9.72 | -                 | 1,628,017.67 | 4,727,911,117.39 | -  |

易方达货币 E

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 |
|--------|----------------------|-------------------|---------------|----------------|----|
| 2018 年 | 25,847,538.1<br>0    | -                 | -94,473.51    | 25,753,064.59  | -  |
| 2017 年 | 70,488,496.3<br>1    | -                 | -560,284.20   | 69,928,212.11  | -  |
| 2016 年 | 368,547,735.<br>95   | -                 | -2,913,147.50 | 365,634,588.45 | -  |

|    |              |   |               |                |   |
|----|--------------|---|---------------|----------------|---|
| 合计 | 464,883,770. |   |               |                |   |
|    | 36           | - | -3,567,905.21 | 461,315,865.15 | - |

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，易方达基金管理有限公司（简称“易方达”）成立于 2001 年 4 月 17 日，总部设在广州，在北京、上海、香港、深圳等地设有分公司或子公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格，是国内基金行业为数不多的“全牌照”公司之一，在主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资等领域全面布局。截至 2018 年 12 月 31 日，易方达总资产管理规模超过 1.2 万亿元，服务近 8000 万客户，自成立以来仅公募基金累计分红达 1150 亿元。

#### 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<br>(助理) 期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                            |
|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------|----------|----------------|---------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                                                                                       | 任职<br>日期                 | 离任<br>日期 |                |                                                               |
| 石大恽 | 本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达天天发货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资 | 2013-04-22               | -        | 9 年            | 硕士研究生，曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。 |

|    |                                                                                                                                                                                                                                                                   |            |   |     |                                                                                  |
|----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|-----|----------------------------------------------------------------------------------|
|    | 基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理、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                                                                                                                      |            |   |     |                                                                                  |
| 梁莹 | 本基金的基金经理助理、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达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 | 2015-02-17 | - | 8 年 | 硕士研究生，曾任招商证券股份有限公司债券销售交易部交易员，易方达基金管理有限公司固定收益交易员、固定收益基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理。 |
| 易□ | 本基金的基金经理助理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达天天发货币市场基金的基金经理助理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理助理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理助理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理助理、易方达天天增利货币市场基金的基金经理助理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理、易方达双月利理   | 2018-06-20 | - | 8 年 | 硕士研究生，曾任汇添富基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司高级债券交易员。                                     |

|  |                       |  |  |  |  |
|--|-----------------------|--|--|--|--|
|  | 财债券型证券投资基金的基金经理<br>助理 |  |  |  |  |
|--|-----------------------|--|--|--|--|

注：1.此处的“任职日期”和“离任日期”分别为公告确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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》等法规制定了《公平交易制度》，内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括：集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

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

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

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，并借助相关技术系统，使投资和交易人

员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具，按照不同的时间窗口（包括当日内、3 日内、5 日内），对我司旗下所有投资组合 2018 年度的同向交易价差情况进行了分析，包括旗下各大类资产组合之间（即公募、社保、年金、专户四大类业务之间）的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为 0 的 T 检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 131 次，其中 127 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，4 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年我国宏观经济面临较大的下行压力。上半年经济走势相对平稳，工业增加值等指标在上半年仍然维持在较高的水平。尽管基建投资数据有所回落，但从其他分项上看，制造业投资及房地产投资的表现仍然良好，尤其是房地产开发投资同比增速达到 9.7%。下半年国内经济运行面临的不确定性有所增加。工业增加值增速由 2018 年 4-5 月的 7% 左右下降至 6-6.1%，四季度则进一步回落至 6% 以下。随着基建投资的不断下滑，固定资产投资增速整体也进一步下行。中美贸易争端在下半年开始逐步升级，欧洲经济复苏节奏持续放缓，这些外部因素使得国内市场避险情绪不断增强。资管新规等一系列金融监管政策的影响使得信用收缩趋势显著，委托贷款和信托贷款数据的下降速度均有所加快，社会融资总量同比增速下滑。货币政策在全年维持放松，央行数次下调了存款准备金率，银行间市场资金面整体保持充裕。特别是一季度过后，市场回购利率呈现快速下行的态势并带动债券市场走牛。资金面的宽松叠加市场对于经济前景的担忧，全年债券市场收益率中枢显著下行，短端的回落幅度相对更大，收益率曲线形态陡峭化。货币市场利率在二季度迅速下行后维持平稳的走势，货币市场基金的收益全年缓慢下行。

报告期内，本基金的运作仍以保证资产的流动性为首要任务，降低了组合的剩余期限，并提高了现金资产的配置比例。本基金抓住年末市场资金利率阶段性走高的机会，提高了短期回购的配置比例，提高了组合的收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内 A 类基金份额净值收益率为 3.0007%；B 类基金份额净值收益率为 3.2482%；E 类基金份额净值收益率为 2.9932%；同期业绩比较基准收益率为 0.3506%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我国经济增长仍然面临着不确定性。控制地方政府债务、防止违法违规举债等要求抑制了地方政府的融资能力，在去杠杆大背景下表外融资增速也在持续下滑，这两个因素共同导致基建投资难以明显回升。地产调控政策的延续性使得房地产行业的销售投资也面临压力。历史表明房地产行业的周期性特征较为明显，从 2015 年一季度开始，本轮行业景气周期持续时间已经较长，随着棚改货币化政策的逐渐退出，三四线城市将面临着较大的销售压力。消费的扩张也受制于融资约束，汽车销售数据的滑坡仍未见到复苏迹象。最后，全球经济增速放缓以及中美贸易摩擦的不确定性等外部因素使得出口数据也难有起色。

在国内经济基本面偏弱以及货币政策维持宽松的背景下，国内债券市场短期面临的风险较小。但是收益率已经下行至接近 2016 年的水平，考虑到目前宏观经济的健康程度实际上好于 2016 年，我们认为国内债券市场收益率难以突破 2016 年的低点。我们将重点关注信用扩张的指标，如果社会融资总量同比增速在上半年逐渐企稳甚至回升或者房地产融资及地方政府债务出现实质性扩张，那么债券市场收益率的拐点可能会出现。对于货币市场基金的运作而言，由于收益率曲线在短端较为平坦，我们将更加关注利率波动的风险。防范利率风险、保证组合的流动性是我们未来主要的管理目标。

本基金将坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位，继续保持投资组合较高的流动性。本基金将保持较低的剩余期限和较高的现金比例，并在货币市场工具的投资中把握波段操作的机会。基金管理人将坚持规范运作、审慎投资，勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总部和核算部指定人员担任委员。估值

委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《易方达货币市场基金基金合同》，本基金每日将各类基金份额的已实现收益全额分配给基金份额持有人。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在易方达货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计了 2018 年 12 月 31 日的资产负债表、2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注，并出具了标准无保留意见的审计报告。

投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：易方达货币市场基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日         |
|-----------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |                                 |                                  |
| 银行存款            | 2,905,091,936.20                | 3,760,440,245.58                 |
| 结算备付金           | 3,005,380,909.09                | 1,012,410,200.00                 |
| 存出保证金           | -                               | -                                |
| 交易性金融资产         | 17,910,414,236.10               | 11,481,514,581.53                |
| 其中：股票投资         | -                               | -                                |
| 基金投资            | -                               | -                                |
| 债券投资            | 17,910,414,236.10               | 11,481,514,581.53                |
| 资产支持证券投资        | -                               | -                                |
| 衍生金融资产          | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产        | 5,027,292,072.31                | 9,241,440,957.69                 |
| 应收证券清算款         | -                               | 2,646,748.57                     |
| 应收利息            | 40,985,417.16                   | 51,785,160.29                    |
| 应收股利            | -                               | -                                |
| 应收申购款           | 270,892,821.69                  | 219,062,942.43                   |
| 递延所得税资产         | -                               | -                                |
| 其他资产            | 12,500.00                       | 12,500.00                        |
| <b>资产总计</b>     | <b>29,160,069,892.55</b>        | <b>25,769,313,336.09</b>         |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>本期末<br/>2018 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2017 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            | -                        | -                        |
| 卖出回购金融资产款         | -                        | 499,199,131.20           |
| 应付证券清算款           | 500,000,000.00           | -                        |
| 应付赎回款             | 33,400,804.20            | 1,172,884.83             |
| 应付管理人报酬           | 19,410,422.59            | 8,390,047.40             |
| 应付托管费             | 5,881,946.19             | 2,542,438.59             |
| 应付销售服务费           | 1,008,847.43             | 825,216.83               |
| 应付交易费用            | 521,919.13               | 282,140.80               |
| 应交税费              | 315,450.00               | 315,450.00               |
| 应付利息              | -                        | 766,706.78               |
| 应付利润              | 13,544,312.71            | 11,879,450.84            |
| 递延所得税负债           | -                        | -                        |
| 其他负债              | 812,633.43               | 826,680.95               |
| <b>负债合计</b>       | <b>574,896,335.68</b>    | <b>526,200,148.22</b>    |
| <b>所有者权益：</b>     |                          |                          |
| 实收基金              | 28,585,173,556.87        | 25,243,113,187.87        |
| 未分配利润             | -                        | -                        |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>28,585,173,556.87</b> | <b>25,243,113,187.87</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>29,160,069,892.55</b> | <b>25,769,313,336.09</b> |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额净值 1.0000 元，E 类基金份额净值 100.0000 元；基金份额总额 28,585,173,556.87 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 1,426,343,170.67 份，B 类基金份额总额 26,491,015,422.64 份，E 类基金份额总额 667,814,963.56 份，其中 E 类份额净值已折算为 1 元。

## 7.2 利润表

会计主体：易方达货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                   | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-----------------------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| <b>一、收入</b>           | <b>2,318,809,647.40</b>                   | <b>1,638,206,222.41</b>                        |
| 1.利息收入                | 2,691,817,134.99                          | 1,890,500,975.17                               |
| 其中：存款利息收入             | 283,607,049.80                            | 433,246,562.83                                 |
| 债券利息收入                | 1,406,225,358.27                          | 871,113,651.05                                 |
| 资产支持证券利息收入            | -                                         | -                                              |
| 买入返售金融资产收入            | 1,001,984,726.92                          | 586,140,761.29                                 |
| 其他利息收入                | -                                         | -                                              |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      | -373,007,487.59                           | -252,335,112.21                                |
| 其中：股票投资收益             | -                                         | -                                              |
| 基金投资收益                | -                                         | -                                              |
| 债券投资收益                | -373,007,487.59                           | -252,335,112.21                                |
| 资产支持证券投资收益            | -                                         | -                                              |
| 贵金属投资收益               | -                                         | -                                              |
| 衍生工具收益                | -                                         | -                                              |
| 股利收益                  | -                                         | -                                              |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | -                                         | -                                              |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     | -                                         | -                                              |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | -                                         | 40,359.45                                      |
| <b>减：二、费用</b>         | <b>389,541,358.64</b>                     | <b>228,532,207.22</b>                          |
| 1. 管理人报酬              | 211,355,385.33                            | 132,184,902.45                                 |
| 2. 托管费                | 64,047,086.32                             | 40,056,031.04                                  |
| 3. 销售服务费              | 11,990,421.09                             | 14,197,528.87                                  |
| 4. 交易费用               | -                                         | -                                              |
| 5. 利息支出               | 101,380,653.21                            | 41,282,992.92                                  |

|                            |                         |                         |
|----------------------------|-------------------------|-------------------------|
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 101,380,653.21          | 41,282,992.92           |
| 6. 税金及附加                   | -                       | -                       |
| 7. 其他费用                    | 767,812.69              | 810,751.94              |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>1,929,268,288.76</b> | <b>1,409,674,015.19</b> |
| 减：所得税费用                    | -                       | -                       |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>1,929,268,288.76</b> | <b>1,409,674,015.19</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：易方达货币市场基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期                               |                   |                     |
|----------------------------------------|----------------------------------|-------------------|---------------------|
|                                        | 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）                        | 25,243,113,187.87                | -                 | 25,243,113,187.87   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 1,929,268,288.76  | 1,929,268,288.76    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | 3,342,060,369.00                 | -                 | 3,342,060,369.00    |
| 其中：1.基金申购款                             | 584,826,480,957.05               | -                 | 584,826,480,957.05  |
| 2.基金赎回款                                | -581,484,420,588.05              | -                 | -581,484,420,588.05 |
| 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） | -                                | -1,929,268,288.76 | -1,929,268,288.76   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 28,585,173,556.87                | -                 | 28,585,173,556.87   |
| 项目                                     | 上年度可比期间                          |                   |                     |

|                                        | 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）                        | 60,099,951,881.28                | -                 | 60,099,951,881.28   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                | 1,409,674,015.19  | 1,409,674,015.19    |
| 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）      | -34,856,838,693.41               | -                 | -34,856,838,693.41  |
| 其中：1.基金申购款                             | 398,789,827,007.23               | -                 | 398,789,827,007.23  |
| 2.基金赎回款                                | -433,646,665,700.64              | -                 | -433,646,665,700.64 |
| 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） | -                                | -1,409,674,015.19 | -1,409,674,015.19   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 25,243,113,187.87                | -                 | 25,243,113,187.87   |

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

易方达货币市场基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监基金字[2004]217 号文件“关于同意易方达货币市场基金设立的批复”批准，向社会公开募集，首次募集规模为 3,622,219,215.04 份基金份额。根据基金部函[2005]26 号《关于易方达货币市场基金备案确认的函》，本基金合同于 2005 年 2 月 2 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）。

本基金于 2006 年 7 月 18 日实施分级，基金分级后，在任何一个开放日，若 A 级基金份额持有人在单个基金帐户保留的基金份额达到或超过 1000 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的 A 级基金份额升级为 B 级基金份额；若 B 级基金份额持有人在单个基金帐户保

留的基金份额低于 1000 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金帐户持有的 B 级基金份额降级为 A 级基金份额。两级基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费并分别公布基金日收益和基金七日收益率。

自 2014 年 11 月 21 日起，本基金增设 E 类份额类别，份额申购首次确认日为 2014 年 11 月 27 日。经上海证券交易所自律监管决定书 [2014] 655 号核准同意，E 类 2,009,926 份基金份额于 2014 年 12 月 8 日在上海交易所上市交易。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额

为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、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股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### (4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                  | 与本基金的关系               |
|------------------------|-----------------------|
| 易方达基金管理有限公司            | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构   |
| 中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”） | 基金托管人、基金销售机构          |
| 广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”) | 基金管理人股东、基金销售机构、申赎代办券商 |
| 广东粤财信托有限公司（以下简称“粤财信托”） | 基金管理人股东               |
| 盈峰投资控股集团有限公司           | 基金管理人股东               |
| 广东省广晟资产经营有限公司          | 基金管理人股东               |
| 广州市广永国有资产经营有限公司        | 基金管理人股东               |
| 广东省易方达教育基金会            | 基金管理人发起的教育基金会         |
| 易方达资产管理有限公司            | 基金管理人的子公司             |
| 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         |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

##### 7.4.8.2 关联方报酬

## 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 211,355,385.33                  | 132,184,902.45                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 6,026,072.49                    | 4,876,219.43                         |

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.33% 的年费率计提。计算方法如下：

每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×0.33%/当年天数

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

## 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月<br>31日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 64,047,086.32                   | 40,056,031.04                        |

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.10%/当年天数

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

## 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各<br>关联方名称 | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |
|--------------------|-----------------------------|
|                    | 当期发生的基金应支付的销售服务费            |

|                | 易方达货币 A               | 易方达货币 B      | 易方达货币 E      | 合计           |
|----------------|-----------------------|--------------|--------------|--------------|
| 易方达基金管理有限公司    | 854,142.05            | 5,874,009.77 | 500,428.21   | 7,228,580.03 |
| 中国银行           | 481,081.95            | 2,127.52     | -            | 483,209.47   |
| 广发证券           | 91,294.36             | 15,972.10    | 64,468.79    | 171,735.25   |
| 合计             | 1,426,518.36          | 5,892,109.39 | 564,897.00   | 7,883,524.75 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间               |              |              |              |
|                | 2017年1月1日至2017年12月31日 |              |              |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |              |              |              |
|                | 易方达货币A                | 易方达货币B       | 易方达货币E       | 合计           |
| 易方达基金管理有限公司    | 1,229,399.18          | 3,293,867.24 | 1,876,586.13 | 6,399,852.55 |
| 中国银行           | 652,531.78            | 2,714.28     | -            | 655,246.06   |
| 广发证券           | 203,116.61            | 35,320.13    | 371,531.28   | 609,968.02   |
| 合计             | 2,085,047.57          | 3,331,901.65 | 2,248,117.41 | 7,665,066.63 |

注：本基金 A 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提；B 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.01% 的年费率计提；E 类基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。各级基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

每日应支付的各级基金销售服务费 = 前一日该级基金份额的基金资产净值 × R ÷ 当年天数

R 为该级基金份额的年销售服务费率

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付给基金销售机构，于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

| 本期                    |                  |      |       |      |                  |            |
|-----------------------|------------------|------|-------|------|------------------|------------|
| 2018年1月1日至2018年12月31日 |                  |      |       |      |                  |            |
| 银行间市场交易的各关联方名称        | 债券交易金额           |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购            |            |
|                       | 基金买入             | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额             | 利息支出       |
| 中国银行                  | 1,483,626,596.50 | -    | -     | -    | 1,104,470,000.00 | 185,579.58 |
| 上年度可比期间               |                  |      |       |      |                  |            |

| 2017年1月1日至2017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         |
| 中国银行                   | 373,200,760.50 | 2,457,522,792.06 | -     | -    | 12,649,045,000.00 | 1,126,591.25 |

#### 7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目                  | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |        |        | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |               |        |
|---------------------|-----------------------------|--------|--------|----------------------------------|---------------|--------|
|                     | 易方达货币A                      | 易方达货币B | 易方达货币E | 易方达货币A                           | 易方达货币B        | 易方达货币E |
| 报告期初持有的基金份额         | -                           | -      | -      | -                                | -             | -      |
| 报告期间申购/买入总份额        | -                           | -      | -      | 110,000.00                       | 10,000,000.00 | -      |
| 报告期间因拆分变动份额         | -                           | -      | -      | -110,000.00                      | 110,000.00    | -      |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额      | -                           | -      | -      | -                                | 10,110,000.00 | -      |
| 报告期末持有的基金份额         | -                           | -      | -      | -                                | -             | -      |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | -                           | -      | -      | -                                | -             | -      |

注：上年度可比期间“报告期间因拆分变动份额”为基金份额升降级引起的份额变动净额。基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

##### 7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

易方达货币 A

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2018年12月31日 |         | 上年度末<br>2017年12月31日 |          |
|-------|--------------------|---------|---------------------|----------|
|       | 持有的                | 持有的基金份额 | 持有的                 | 持有的基金份额占 |

|             | 基金份额       | 占基金总份额的比例 | 基金份额       | 基金总份额的比例 |
|-------------|------------|-----------|------------|----------|
| 广东省易方达教育基金会 | 848,093.10 | 0.06%     | 822,768.24 | 0.05%    |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 易方达货币 B

份额单位：份

| 关联方名称           | 本期末<br>2018年12月31日 |                          | 上年度末<br>2017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 |
| 广东易方达源臻投资管理有限公司 | 12,379,064.09      | 0.05%                    | 12,000,000.00       | 0.05%                    |
| 广发信德投资管理有限公司    | -                  | -                        | 250,355,299.13      | 1.10%                    |
| 易方达资产管理有限公司     | 45,863,683.54      | 0.17%                    | -                   | -                        |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。广发信德投资管理有限公司是基金管理人股东广发证券控制的机构。

#### 易方达货币 E

无。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称     | 本期<br>2018年1月1日至2018年12月31日 |                | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年12月31日 |               |
|-----------|-----------------------------|----------------|----------------------------------|---------------|
|           | 期末余额                        | 当期利息收入         | 期末余额                             | 当期利息收入        |
| 中国银行-活期存款 | 705,091,936.20              | 227,350,177.20 | 440,245.58                       | 43,623,431.24 |
| 中国银行-定期存款 | -                           | -              | -                                | 14,470,000.00 |

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

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

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。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明****7.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有股票。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

**7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项****(1) 公允价值****(a) 金融工具公允价值计量的方法**

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

**(b) 持续的以公允价值计量的金融工具****(i) 各层次金融工具公允价值**

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 17,910,414,236.10 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 11,481,514,581.53 元，无属于第一或第三层次的余额)。

## (ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

## (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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(2017 年 12 月 31 日：同)。

## (d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额                | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1  | 固定收益投资            | 17,910,414,236.10 | 61.42         |
|    | 其中：债券             | 17,910,414,236.10 | 61.42         |
|    | 资产支持证券            | -                 | -             |
| 2  | 买入返售金融资产          | 5,027,292,072.31  | 17.24         |
|    | 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      | 5,910,472,845.29  | 20.27         |
| 4  | 其他各项资产            | 311,890,738.85    | 1.07          |
| 5  | 合计                | 29,160,069,892.55 | 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 | 6.95          |               |
|    | 其中：买断式回购融资   | -             |               |
| 序号 | 项目           | 金额            | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2  | 报告期末债券回购融资余额 | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购融资   | -             | -             |

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

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

| 序号 | 发生日期       | 融资余额占基金资产净值的比例（%） | 原因     | 调整期         |
|----|------------|-------------------|--------|-------------|
| 1  | 2018-06-27 | 36.71             | 遭遇大额赎回 | 发生日后 4 个交易日 |
| 2  | 2018-06-28 | 31.28             | 遭遇大额赎回 | 发生日后 3 个交易日 |
| 3  | 2018-06-29 | 25.06             | 遭遇大额赎回 | 发生日后 2 个交易日 |
| 4  | 2018-07-02 | 35.60             | 遭遇大额赎回 | 发生日后 1 个交易日 |
| 5  | 2018-12-27 | 28.56             | 遭遇大额赎回 | 发生日后 1 个交易日 |

### 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    | 90 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 92 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 28 |

#### 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                 | 38.26              | 1.75               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |

|    |                            |        |      |
|----|----------------------------|--------|------|
| 2  | 30 天（含）—60 天               | 12.90  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 3  | 60 天（含）—90 天               | 5.86   | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 4  | 90 天（含）—120 天              | 5.69   | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）          | 38.21  | -    |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 合计 |                            | 100.92 | 1.75 |

#### 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<br>比例(%) |
|----|----------------------|-------------------|------------------|
| 1  | 国家债券                 | -                 | -                |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -                |
| 3  | 金融债券                 | 991,064,435.77    | 3.47             |
|    | 其中：政策性金融债            | 991,064,435.77    | 3.47             |
| 4  | 企业债券                 | -                 | -                |
| 5  | 企业短期融资券              | -                 | -                |
| 6  | 中期票据                 | -                 | -                |
| 7  | 同业存单                 | 16,919,349,800.33 | 59.19            |
| 8  | 其他                   | -                 | -                |
| 9  | 合计                   | 17,910,414,236.10 | 62.66            |
| 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  | 111813114 | 18 浙商银行 CD114 | 10,000,000 | 984,847,027.16 | 3.45         |
| 2  | 111815437 | 18 民生银行 CD437 | 9,000,000  | 880,666,657.99 | 3.08         |
| 3  | 111803138 | 18 农业银行 CD138 | 8,500,000  | 843,258,916.22 | 2.95         |
| 4  | 111809253 | 18 浦发银行 CD253 | 7,000,000  | 694,622,476.11 | 2.43         |
| 5  | 111810405 | 18 兴业银行 CD405 | 7,000,000  | 686,695,322.85 | 2.40         |
| 6  | 140408    | 14 农发 08      | 6,000,000  | 602,216,134.09 | 2.11         |
| 7  | 111820180 | 18 广发银行 CD180 | 6,000,000  | 594,033,104.50 | 2.08         |
| 8  | 111809246 | 18 浦发银行 CD246 | 5,000,000  | 496,331,637.70 | 1.74         |
| 9  | 111803191 | 18 农业银行 CD191 | 5,000,000  | 486,633,212.75 | 1.70         |
| 10 | 111811105 | 18 平安银行 CD105 | 4,500,000  | 443,298,959.12 | 1.55         |

## 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 | 89      |
| 报告期内偏离度的最高值                   | 0.5040% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.1295% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.2395% |

## 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

| 序号 | 发生日期       | 偏离度     | 原因                | 调整期         |
|----|------------|---------|-------------------|-------------|
| 1  | 2018-07-02 | 0.5040% | 市场收益率下行，致使基金偏离度上升 | 发生日后 1 个交易日 |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

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

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

（3）基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

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

如有新增事项，按国家最新规定估值。

**8.9.218 浦发银行 CD253（代码：111809253）、18 浦发银行 CD246（代码：111809246）**为易方达货币市场基金的前十大持仓证券。根据上海浦东发展银行股份有限公司董事会 2018 年 1 月 19 日发布的《关于成都分行处罚事项的公告》，银监会四川监管局对成都分行内控管理严重失效、授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，并执行罚款 46,175 万元人民币。2018 年 2 月 12 日，中国银监会针对浦发银行的如下事由罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；（三）通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；（四）理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；（五）提供不实说明材料、不配合调查取证；（六）以贷转存，虚增存贷款；（七）票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；（八）国内信用证业务贸易背景审查不严；（九）贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；（十）违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；（十一）票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；（十二）对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；（十三）以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；（十四）投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大；（十五）修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；（十六）为非保本理财产品出具保本承诺函；（十七）向关系人发放信用贷款；（十八）向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；（十九）收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。2018 年 3 月 19 日，上海银监局针对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心 2016 年至 2017 年部分信用卡现金分期资

金被用于证券交易，2015 年至 2017 年部分信用卡分期资金被用于非消费领域，严重违反审慎经营规则的违法违规事实，责令改正，罚没合计人民币 1751651.7 元。2018 年 7 月 26 日，中国人民银行针对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易的违法违规事实，罚款人民币 170 万元。

18 兴业银行 CD405（代码：111810405）为易方达货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 3 月 26 日，中国人民银行福州中心支行针对兴业银行股份有限公司违反国库管理规定的违法行为，给予警告并处罚款 5 万元人民币。2018 年 4 月 19 日，中国银保监会针对兴业银行的如下事由罚款 5870 万元：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。2018 年 10 月 16 日，上海保监局针对兴业银行股份有限公司信用卡中心电话销售欺骗投保人、电话销售向投保人隐瞒与合同有关的重要情况的违法违规行为，责令改正并处 35 万元罚款。

18 浙商银行 CD114（代码：111813114）为易方达货币市场基金的前十大持仓证券。根据 2018 年 8 月 28 日沈阳市城乡建设局披露，浙商银行股份有限公司沈河区浙商银行大厦工程 8—21 层，存在开工前未办理监督手续的违法行为，在 2018 年 8 月被行政执法部门处罚。2018 年 11 月 9 日，中国银保监会针对浙商银行股份有限公司如下违法违规事由罚款 5550 万元：（一）投资同业理财产品未尽职审查；（二）为客户缴交土地出让金提供理财资金融资；（三）投资非保本理财产品违规接受回购承诺；（四）理财产品销售文本使用误导性语言；（五）个人理财资金违规投资；（六）理财产品相互交易，业务风险隔离不到位；（七）为非保本理财产品提供保本承诺。

18 民生银行 CD437（代码：111815437）为易方达货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 11 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对中国民生银行股份有限公司贷款业务严重违反审慎经营规则的违规事实，处以罚款 200 万元人民币。2018 年 11 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对中国民生银行股份有限公司关于以下违规事实：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）同业投资违规接受担保；（三）同业投资、理财资金违规投资房地产，用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资；（四）本行理财产品之间风险隔离不到位；（五）个人理财资金违规投资；（六）票据代理未明示，增信未簿记和计提资本占用；（七）为非保本理财产品提供保本承诺，处以罚款

3160 万元人民币。2018 年 11 月 19 日，中国保险监督管理委员会北京监管局针对中国民生银行股份有限公司存在电话销售保险过程中欺骗投保人的行为，处以罚款 30 万元的行政处罚，并责令改正违法行为。

18 广发银行 CD180（代码：111820180）为易方达货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 5 月 31 日，中国保监会广东监管局针对广发银行股份有限公司信用卡中心电销工作人员使用不实表述向投保人促销、电销工作人员未告知保险合同重要情况的违法违规事实，责令改正并处以人民币 46 万元行政处罚。

18 平安银行 CD105（代码：111811105）为易方达货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 2 月 7 日，大连银监局针对平安银行贷款资金转存款质押开立银行承兑汇票并在他行贴现，贴现资金回流转存款质押重复开立银行承兑汇票的违法事实，对平安银行处以人民币四十万元行政罚款。

2018 年 3 月 14 日，中国人民银行针对平安银行违反清算管理规定、人民币银行结算账户管理相关规定、非金融机构支付服务管理办法相关规定，给予警告，没收违法所得 3,036,061.39 元，并处罚款 10,308,084.15 元，合计处罚金额 13,344,145.54 元。2018 年 6 月 28 日，天津银监局针对平安银行贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款被挪用的违法违规事实，罚款人民币 50 万元。2018 年 7 月 26 日，中国人民银行针对平安银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告的违法行为，罚款人民币 140 万元。

本基金投资 18 浦发银行 CD253、18 浦发银行 CD246、18 兴业银行 CD405、18 浙商银行 CD114、18 民生银行 CD437、18 广发银行 CD180、18 平安银行 CD105 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 18 浦发银行 CD253、18 浦发银行 CD246、18 兴业银行 CD405、18 浙商银行 CD114、18 民生银行 CD437、18 广发银行 CD180、18 平安银行 CD105 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收利息    | 40,985,417.16 |

|   |       |                |
|---|-------|----------------|
| 4 | 应收申购款 | 270,892,821.69 |
| 5 | 其他应收款 | 12,500.00      |
| 6 | 待摊费用  | -              |
| 7 | 其他    | -              |
| 8 | 合计    | 311,890,738.85 |

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别    | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额      | 持有人结构             |        |                  |        |
|---------|----------|----------------|-------------------|--------|------------------|--------|
|         |          |                | 机构投资者             |        | 个人投资者            |        |
|         |          |                | 持有份额              | 占总份额比例 | 持有份额             | 占总份额比例 |
| 易方达货币 A | 118,538  | 12,032.79      | 338,001,107.95    | 23.70% | 1,088,342,062.72 | 76.30% |
| 易方达货币 B | 187      | 141,663,184.08 | 26,026,257,071.77 | 98.25% | 464,758,350.87   | 1.75%  |
| 易方达货币 E | 2,347    | 284,539.82     | 347,434,614.04    | 52.03% | 320,380,349.52   | 47.97% |
| 合计      | 121,072  | 236,100.61     | 26,711,692,793.76 | 93.45% | 1,873,480,763.11 | 6.55%  |

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

易方达货币E

| 序号 | 持有人名称                 | 持有份额（份）      | 占上市总份额比例 |
|----|-----------------------|--------------|----------|
| 1  | 上海君彤鸿璟投资合伙企业（有限合伙）    | 2,046,858.00 | 30.66%   |
| 2  | 中信建投（国际）金融控股有限公司－客户资产 | 173,397.00   | 2.60%    |
| 3  | 红塔烟草（集团）有限责任公司企业年金计划  | 165,213.00   | 2.47%    |

|    |                                   |            |       |
|----|-----------------------------------|------------|-------|
|    | —中国工商银行股份有限公司                     |            |       |
| 4  | 华润深国投信托有限公司—华润信托·恒远盈峰 2 期集合资金信托计划 | 115,392.00 | 1.73% |
| 5  | 中国交通建设集团有限公司企业年金计划—交通银行股份有限公司     | 110,552.00 | 1.66% |
| 6  | 浙江华睿蓝石投资有限公司                      | 104,717.00 | 1.57% |
| 7  | 胡伟群                               | 100,028.00 | 1.50% |
| 8  | 中银国际证券股份有限公司                      | 85,177.00  | 1.28% |
| 9  | 田玲娜                               | 77,761.00  | 1.16% |
| 10 | 李玲                                | 55,161.00  | 0.83% |

注：本表统计的上市基金前十名持有人为场内 E 类份额持有人。

### 9.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

| 序号 | 持有人类别 | 持有份额（份）          | 占总份额比例 |
|----|-------|------------------|--------|
| 1  | 银行类机构 | 3,110,011,175.73 | 10.88% |
| 2  | 银行类机构 | 2,001,599,446.43 | 7.00%  |
| 3  | 银行类机构 | 1,840,983,876.39 | 6.44%  |
| 4  | 银行类机构 | 1,243,811,243.26 | 4.35%  |
| 5  | 银行类机构 | 1,120,105,779.78 | 3.92%  |
| 6  | 基金类机构 | 1,017,341,697.42 | 3.56%  |
| 7  | 银行类机构 | 861,486,991.49   | 3.01%  |
| 8  | 保险类机构 | 700,000,000.00   | 2.45%  |
| 9  | 银行类机构 | 520,622,312.39   | 1.82%  |
| 10 | 银行类机构 | 501,056,506.41   | 1.75%  |

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 份额级别    | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|------------------|---------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 易方达货币 A | 416,504.90 | 0.0292%  |
|                  | 易方达货币 B | 0.00       | 0.0000%  |
|                  | 易方达货币 E | 0.00       | 0.0000%  |
|                  | 合计      | 416,504.90 | 0.0015%  |

## 9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目                             | 份额级别    | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|---------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 易方达货币 A | 0~10              |
|                                | 易方达货币 B | 0                 |
|                                | 易方达货币 E | 0                 |
|                                | 合计      | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 易方达货币 A | 0~10              |
|                                | 易方达货币 B | 0                 |
|                                | 易方达货币 E | 0                 |
|                                | 合计      | 0~10              |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                | 易方达货币 A          | 易方达货币 B            | 易方达货币 E        |
|-----------------------------------|------------------|--------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2005 年 2 月 2 日）<br>基金份额总额 | 3,622,219,215.04 | -                  | -              |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 1,653,515,219.74 | 22,718,508,345.09  | 871,089,623.04 |
| 本报告期基金总申购份额                       | 8,911,284,169.76 | 575,483,036,049.19 | 432,160,738.10 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 9,138,456,218.83 | 571,710,528,971.64 | 635,435,397.58 |
| 本报告期基金拆分变动份额                      | -                | -                  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                      | 1,426,343,170.67 | 26,491,015,422.64  | 667,814,963.56 |

注：A 类和 B 类总申购份额含因份额升降级等原因导致的强制调增份额，总赎回份额含因份额升降级等原因导致的强制调减份额。

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 8 日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官（副总经理级），聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

报告期内，2018 年 8 月，刘连舸先生担任中国银行股份有限公司行长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 14 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 120,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易<br>单元<br>数量 | 股票交易 |              | 应支付该券商的佣金 |            | 备注 |
|------|----------------|------|--------------|-----------|------------|----|
|      |                | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 国泰君安 | 1              | -    | -            | 80,000.00 | 100.00%    | -  |
| 平安证券 | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 申万宏源 | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 国盛证券 | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增国盛证券有限责任公司一个交易单元。

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

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

的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |              | 债券回购交易               |                | 权证交易 |              |
|------|------|--------------|----------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额                 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国泰君安 | -    | -            | 5,056,100,300,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 平安证券 | -    | -            | -                    | -              | -    | -            |
| 申万宏源 | -    | -            | -                    | -              | -    | -            |
| 国盛证券 | -    | -            | -                    | -              | -    | -            |

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

| 项目                    | 发生日期       | 偏离度     | 法定披露报刊           | 法定披露日期     |
|-----------------------|------------|---------|------------------|------------|
| 报告期内偏离度绝对值在 0.5%（含）以上 | 2018-07-02 | 0.5040% | 中国证券报、上海证券报、证券时报 | 2018-07-04 |

注：市场收益率下行致使基金偏离度上升，在发生日后 1 个交易日完成调整。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 |                       |      |      |      | 报告期末持有基金情况 |      |
|-------|----------------|-----------------------|------|------|------|------------|------|
|       | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比 |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |   | 间区间                                                                                                                                                                                                                                                     |                      |                       |                       |                      |       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------|-----------------------|-----------------------|----------------------|-------|
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 1 | 2018 年 01 月 01 日<br>~2018 年 01 月 03 日,<br>2018 年 06 月 28 日<br>~2018 年 07 月 02 日                                                                                                                                                                         | 6,080,449,9<br>35.85 | 3,380,953,0<br>43.35  | 8,217,591,7<br>35.94  | 1,243,811,24<br>3.26 | 4.35% |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | 2 | 2018 年 07 月 05 日,<br>2018 年 09 月 17 日,<br>2018 年 09 月 19 日,<br>2018 年 09 月 28 日<br>~2018 年 10 月 08 日,<br>2018 年 10 月 10 日<br>~2018 年 10 月 11 日,<br>2018 年 10 月 26 日<br>~2018 年 11 月 01 日,<br>2018 年 12 月 13 日,<br>2018 年 12 月 18 日<br>~2018 年 12 月 24 日 | -                    | 21,905,350,<br>478.68 | 21,812,972,<br>706.98 | 92,377,771.7<br>0    | 0.32% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |   |                                                                                                                                                                                                                                                         |                      |                       |                       |                      |       |
| <p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；如个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> |   |                                                                                                                                                                                                                                                         |                      |                       |                       |                      |       |

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

易方达基金管理有限公司

二〇一九年三月二十八日