易方达货币市场基金 2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十八日

§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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30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	30,153,017,196.73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年12月8日		
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份额总额	1,405,470,528.95份	27,956,450,542.26份	791,096,125.52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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦43楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)		
	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E
本期已实现收益	24,939,276.34	834,846,998.47	15,954,474.85
本期利润	24,939,276.34	834,846,998.47	15,954,474.85
本期净值收益率	1.6657%	1.7868%	1.6625%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)		
	易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E
期末基金资产净值	1,405,470,528.95	27,956,450,542.26	791,096,125.52
期末基金份额净值	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。

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

1. 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
过去一个月	0.2881%	0.0033%	0.0288%	0.0000%	0.2593%	0.0033%
过去三个月	0.8409%	0.0030%	0.0873%	0.0000%	0.7536%	0.0030%
过去六个月	1.6657%	0.0027%	0.1737%	0.0000%	1.4920%	0.0027%
过去一年	3.5001%	0.0024%	0.3506%	0.0000%	3.1495%	0.0024%
过去三年	9.1021%	0.0024%	1.0555%	0.0000%	8.0466%	0.0024%
自基金合同生效起至今	50.9840%	0.0068%	13.7768%	0.0031%	37.2072%	0.0037%

2. 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
过去一个月	0.3079%	0.0033%	0.0288%	0.0000%	0.2791%	0.0033%
过去三个月	0.9013%	0.0030%	0.0873%	0.0000%	0.8140%	0.0030%
过去六个月	1.7868%	0.0027%	0.1737%	0.0000%	1.6131%	0.0027%
过去一年	3.7490%	0.0024%	0.3506%	0.0000%	3.3984%	0.0024%
过去三年	9.8913%	0.0024%	1.0555%	0.0000%	8.8358%	0.0024%
自基金合同生效起至今	50.6361%	0.0070%	11.1198%	0.0031%	39.5163%	0.0039%

3. 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
过去一个月	0.2874%	0.0033%	0.0288%	0.0000%	0.2586%	0.0033%
过去三个月	0.8392%	0.0030%	0.0873%	0.0000%	0.7519%	0.0030%
过去六个月	1.6625%	0.0027%	0.1737%	0.0000%	1.4888%	0.0027%
过去一年	3.4944%	0.0024%	0.3506%	0.0000%	3.1438%	0.0024%
过去三年	9.0935%	0.0024%	1.0555%	0.0000%	8.0380%	0.0024%
自基金合同生效起至今	11.6270%	0.0040%	1.2650%	0.0000%	10.3620%	0.0040%

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。

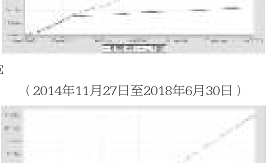
2.自2014年11月21日起,本基金增设E类份额类别,份额申购首次确认日为2014年11月27日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

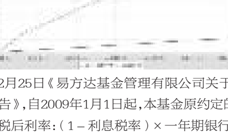
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

1、易方达货币A



3、易方达货币E

(2014年11月27日至2018年6月30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–利息税率)×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×(1–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50.9840%,同期业绩比较基准收益率为13.7768%。B类基金份额净值收益率为50.6361%,同期业绩比较基准收益率为11.1198%。E类基金份额净值收益率为11.6270%,同期业绩比较基准收益率为1.2650%。

§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、成都、大连等地设有分公司,并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下,通过市场化、专业化的运作,为投资人的资产实现持续稳定的保值增值,成为国内领先的综合性资产管理机构,具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一,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,投资业务包括主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资、另类投资等六大板块,为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至2018年6月30日,易方达旗下管理的各类资产规模总计1.3万亿元,服务各类客户总数7580万户,公募基金累计分红超过1000亿元。

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	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
石大怿	本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达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、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	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。
梁莹	本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、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、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理	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。

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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

4.3.2异常交易行为的专项说明

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共66次,其中64次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易;2次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易,有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2018年一季度,国内债券市场收益率先上后下。1月份的国内经济数据表现良好,市场对于经济走势的乐观预期升温,叠加监管趋严以及权益市场上涨的因素,债券利率不断走高。进入2月初开始,海外资本市场出现了较大幅度的波动,市场风险偏好有所下行。之后在大宗商品库存积累价格下跌、中美贸易摩擦进一步升温,以及融资条件收紧等多重因素刺激下,市场对于未来经济预期转向悲观。此外,货币市场流动性也持续处于宽松状态,债券收益率快速下行,信用利差普遍收窄。2018年二季度债券市场继续回暖,收益率显著下行。4月份的国内经济数据回落,央行的降准操作使得市场资金面维持稳定。加之中美贸易摩擦的不断加剧、叙利亚问题等外部因素令风险资产持续承压,国内债券市场收益率下行显著。5月份,在降准利好兑现、信用债违约事件频发、海外无风险收益率走高、国内经济数据反弹等因素的叠加下,国内债券市场利率出现短期调整。进入6月份,央行半年末时点对市场资金面呵护有加,流动性整体平稳。临近季末,在贸易摩擦及股市下挫带动避险情绪升级的大背景下,债市继续走强,无风险收益率再次大幅回落。上半年的货币市场利率呈现下行的趋势,货币市场基金收益率有所下行。

报告期内本基金以存单、存款作为主要配置资产,继续维持较短的剩余期限。本基金抓住了季度末收益率走高的时点,提高了逆回购的配置比例,在保持稳定的投资收益的同时,为投资者提供了较高的流动性。

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1.6657%;B类基金份额净值收益率为1.7868%;E类基金份额净值收益率为1.6625%;同期业绩比较基准收益率为0.1737%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观基本面方面,虽然中美贸易战为全球经济都带来了极大的不确定性,但国内自身经济基本面的后续走势,将会是国内债券市场最为核心的驱动变量。2018年上半年在金融去杠杆的监管高压下,非标类资产被压缩使得融资供给收缩,进而融资需求也受到抑制,由此带来经济的下滑和融资需求的内生萎缩导致社融的不断萎缩和利率的不断下滑。但是,从近期微观经济数据上分析,虽然宏观经济已经开始出现了较大的下行压力,但仍具有一定的韧性,且政策层面特别是财政政策上仍有较大的空间。在金融体系资金面仍处于相对宽松的大背景下,经济失速下行的概率并不大。市场短期的反应和对经济的预期可能过于悲观,后续需要密切跟踪市场对于过度悲观预期的修复情况。

本基金将坚持货币市场基金作为流动性管理工具的定位,继续保持投资组合较好的流动性和适中的组合期限。基金投资类属配置将以存款、回购、金融债和信用资质相对较好的短期融资券为主,追求相对稳定的投资收益。基金管理人始终将基金资产安全和基金收益稳定的重要性置于高收益的追求之上,坚持规范运作、审慎投资,勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会,公司首席运营官担任估值委员会主席,主动权益板块、固定收益板块、投资风险管理部、监察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,具备行业研究、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央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议,由中央国债登记结算有限责任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、基金份额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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:易方达货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	1,526,960,581.89	3,760,440,245.58
结算备付金	2,371,360,000.00	1,012,410,200.00
存出保证金	–	–
交易性金融资产	22,335,421,350.07	11,481,514,581.53
其中:股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	22,335,421,350.07	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	7,906,983,302.35	9,241,440,957.69
应收证券清算款	3,560,356,731.86	2,646,748.57
应收利息	30,320,739.24	51,785,160.29
应收股利	–	–
应收申购款	11,201,844.08	219,062,942.43
递延所得税资产	–	–
其他资产	12,500.00	12,500.00
资产总计	37,742,617,049.49	25,769,313,336.09
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
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	7,555,483,620.73	499,199,131.20
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	969,716.21	1,172,884.83
应付管理人报酬	13,490,001.50	8,390,047.40
应付托管费	4,087,879.22	2,542,438.59
应付销售服务费	858,965.76	825,216.83
应付交易费用	464,067.09	282,140.80
应交税费	315,450.00	315,450.00
应付利息	4,707,380.35	766,706.78
应付利润	8,323,008.69	11,879,450.84
递延所得税负债	–	–
其他负债	899,763.21	826,680.95
负债合计	7,589,599,852.76	526,200,148.22
所有者权益:		
实收基金	30,153,017,196.73	25,243,113,187.87
未分配利润	–	–
所有者权益合计	30,153,017,196.73	25,243,113,187.87
负债和所有者权益总计	37,742,617,049.49	25,769,313,336.09

注: 报告截止日2018年6月30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 30,153,017,196.73份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额1,405,470,528.95份,B类基金份额总额27,956,450,542.26份,E类基金份额总额791,096,125.52份,其中E类份额净值已折算为1元。

6.2 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6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	1,024,118,462.59	793,964,535.22
1.利息收入	1,205,351,346.65	934,848,032.72
其中:存款利息收入	51,401,588.32	309,341,104.26
债券利息收入	633,851,748.45	431,213,513.77
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	520,098,009.88	194,293,414.69
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"–"填列)	-181,232,884.06	-140,883,497.50
其中:股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-181,232,884.06	-140,883,497.50
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	–	–
3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列)	–	–
4.汇兑收益(损失以"–"号填列)	–	–
5.其他收入(损失以"–"号填列)	–	–
减:二、费用	148,377,712.93	120,441,490.83
1. 管理人报酬	83,331,782.08	66,318,747.66
2. 托管费	25,252,055.15	20,096,590.23
3. 销售服务费	5,481,673.50	8,110,890.06
4. 交易费用	–	–
5. 利息支出	33,924,039.44	25,497,885.40
其中:卖出回购金融资产支出	33,924,039.44	25,497,885.40
6. 税金及附加	–	–
7. 其他费用	388,162.76	417,377.48
三、利润总额(亏损总额以"–"号填列)	875,740,749.66	673,523,044.39
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"–"号填列)	875,740,749.66	673,523,044.39

6.3 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6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	–	875,740,749.66	875,740,749.66
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)	4,909,904,008.86	–	4,909,904,008.86
其中:1.基金申购款	232,768,904,370.38	–	232,768,904,370.38
2.基金赎回款	-227,859,000,361.52	–	-227,859,000,361.52
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)	–	-875,740,749.66	-875,740,749.66
五、期末所有者权益(基金净值)	30,153,017,196.73	–	30,153,017,196.73
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	–	673,523,044.39	673,523,044.39
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)	-24,794,330,594.96	–	-24,794,330,594.96
其中:1.基金申购款	200,819,950,495.14	–	200,819,950,495.14
2.基金赎回款	-225,614,281,090.10	–	-225,614,281,090.10
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)	–	-673,523,044.39	-673,523,044.39
五、期末所有者权益(基金净值)	35,305,621,286.32	–	35,305,621,286.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:刘晓艳,主管会计工作负责人:陈荣,会计机构负责人:邱毅华

6.4 报表附注

6.4.1基金基本情况

易方达货币市场基金(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。

6.4.2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。

6.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

6.4.6税项

(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征增值税试点的通知》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。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(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、申赎业务办理机构
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会
广东新三联投资发展有限公司	基金管理人子公司控制的公司
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。

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1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。

6.4.8.1.2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。

6.4.8.1.3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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	83,331,782.08	66,318,747.66
其中:支付销售机构的客户维护费	1,417,622.17	2,453,374.21

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,252,055.15	20,096,590.23

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。

6.4.8.2.3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 2018年1月1日至2018年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费 易方达货币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	431,774.54	2,307,848.59	286,737.23	3,026,360.36
中国银行	245,293.40	878.15	–	246,171.55
广发证券	48,513.55	13,245.32	37,278.48	99,037.35
合计	725,581.49	2,321,972.06	324,015.71	3,371,569.26
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6月30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	640,494.12	1,616,156.38	1,235,773.19	3,492,423.69
中国银行	352,693.90	2,176.64	–	354,870.54
广发证券	126,499.29	16,074.68	185,884.16	328,458.13
合计	1,119,687.31	1,634,407.70	1,421,657.35	4,175,752.36

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。

6.4.8.3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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国银行	595,944,000.45	–	–	–	1,104,470,000.00	185,579.58
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 债券交易金额 基金买入	基金卖出	基金逆回购 交易金额	利息收入	基金正回购 交易金额	利息支出
中国银行	29,992,123.80	1,685,389,377.84	–	–	5,063,625,000.00	553,663.32

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1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 2018年1月1日至2018年6月30日 易方达货币A	易方达货币B	易方达货币E	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 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。

6.4.8.4.2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 2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2017年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广东省易方达教育基金会	836,809.00	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 2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末 2017年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券	300,000,000.00	1.07%	–	–
广东新三联投资发展有限公司	182,572,081.85	0.65%	–	–
广东易方达源臻投资管理有限公司	12,199,508.86	0.04%	12,000,000.00	0.05%
广发信德投资管理有限公司	–	–	250,355,299.13	1.10%

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。

6.4.8.5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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国银行-活期存款	26,960,581.89	23,054,160.64	1,001,980,387.40	34,870,263.81
中国银行-定期存款	–	–	1,000,000,000.00	4,120,000.02

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。

6.4.8.6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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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。

6.4.9.2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。

6.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额7,555,483,620.73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
111712285	17北京银行CD285	2018-07-02	99.02	1,000,000	99,020,619.33
111806164	18交通银行CD164	2018-07-02	98.73	1,988,000	196,275,035.03
111809136	18浦发银行CD136	2018-07-02	99.30	9,470,000	940,352,328.94
111815113	18民生银行CD113	2018-07-02	98.67	41,000	4,045,527.23
111818080	18华夏银行CD080	2018-07-02	98.75	4,741,000	468,164,823.67
120227	12国开27	2018-07-02	99.54	2,039,000	202,968,792.06
150315	15进出15	2018-07-02	99.43	70,000	6,959,780.35
111708318	17中信银行CD318	2018-07-03	98.62	1,581,000	155,911,737.47
111712214	17北京银行CD214	2018-07-03	98.63	2,800,000	276,158,889.95
111808172	18中信银行CD172	2018-07-03	97.62	3,000,000	292,845,177.49
111810105	18兴业银行CD105	2018-07-03	98.85	2,000,000	197,707,301.22
111810283	18兴业银行CD283	2018-07-03	96.05	2,000,000	192,092,549.56
111811070	18平安银行CD070	2018-07-03	98.87	2,000,000	197,735,571.22
111811130	18平安银行CD130	2018-07-03	99.11	10,000,000	991,065,091.21
111812024	18北京银行CD024	2018-07-03	98.24	2,500,000	245,587,894.80
111812053	18北京银行CD053	2018-07-03	99.20	1,915,000	189,971,601.09
130213	13国开13	2018-07-03	98.99	500,000	49,493,976.60
150214	15国开14	2018-07-03	99.97	9,000,000	899,746,834.38
150315	15进出15	2018-07-03	99.43	3,200,000	318,161,387.37
160202	16国开02	2018-07-03	98.95	1,000,000	98,949,604.21
160305	16进出05	2018-07-03	100.39	500,000	50,192,622.16
111706066	17交通银行CD066	2018-07-04	97.98	1,820,000	178,331,299.70
111712229	17北京银行CD229	2018-07-04	98.18	3,440,000	337,731,821.55
111706066	17交通银行CD066	2018-07-05	97.98	1,180,000	115,621,392.12
111803120	18农业银行CD120	2018-07-05	97.26	3,000,000	291,793,589.53
111806067	18交通银行CD067	2018-07-05	98.77	2,000,000	197,532,723.79
111806075	18交通银行CD075	2018-07-05	98.67	1,000,000	98,670,053.88
111807125	18招商银行CD125	2018-07-05	97.39	2,000,000	194,789,264.70
120227	12国开27	2018-07-05	99.54	561,000	55,843,792.22
150315	15进出15	2018-07-05	99.43	1,250,000	124,281,791.94
111806164	18交通银行CD164	2018-07-06	98.73	3,100,000	306,062,680.38
合计				80,696,000	7,974,065,555.15

注:期末估值总额=期末估值单价(保留小数点后无限位)×数量。

6.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0,无抵押债券。

6.4.10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6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为22,335,421,350.07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6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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。

§7投资组合报告

7.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	22,335,421,350.07	59.18
	其中:债券	22,335,421,350.07	59.18
	资产支持证券	–	–
2	买入返售金融资产	7,906,983,302.35	20.95
	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	3,898,320,581.89	10.33
4	其他各项资产	3,601,891,815.18	9.54
5	合计	37,742,617,049.49	100.00

7.2债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		5.60
	其中:买断式回购融资		–
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	7,555,483,620.73	25.06
	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

7.3基金投资组合平均剩余期限

7.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
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。

7.3.2期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	54.60	25.06
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	19.34	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.16	–
3	60天(含)—90天	17.78	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	8.51	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	24.79	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	125.03	25.06

7.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过240天。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	–	–
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,834,437,702.68	6.08
	其中:政策性金融债	1,834,437,702.68	6.08
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	同业存单	20,500,983,647.39	67.99
8	其他	–	–
9	合计	22,335,421,350.07	74.07
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	49,493,976.60	0.16

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111809136	18浦发银行CD136	12,000,000	1,191,576,340.79	3.95
2	111811130	18平安银行CD130	10,000,000	991,065,091.21	3.29
3	111806164	18交通银行CD164	10,000,000	987,298,968.98	3.27
4	150214	15国开14	9,000,000	899,746,834.38	2.98
5	111818080	18华夏银行CD080	9,000,000	888,733,054.85	2.95
6	111805124	18建设银行CD124	7,000,000	681,383,114.82	2.26
7	111812053	18北京银行CD053	6,000,000	595,211,282.79	1.97
8	111812056	18北京银行CD056	6,000,000	594,478,993.78	1.97
9	111812070	18北京银行CD070	6,000,000	594,263,631.34	1.97
10	111812061	18北京银行CD061	6,000,000	594,238,819.50	1.97

7.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	61
报告期内偏离度的最高值	0.4573%
报告期内偏离度的最低值	0.1387%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2607%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下:

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

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

(3)基金持有的银行存款以本金列示,按实际协议利率逐日计提利息。

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

如有新增事项,按国家最新规定估值。

7.9.218北京银行CD053(代码:111812053)、18北京银行CD056(代码:111812056)、18北京银行CD070(代码:111812070)、18北京银行CD061(代码:111812061)为易方达货币市场基金的前十大持仓证券。2017年8月8日,北京银监局针对北京银行未经核准提前授权部分人员实际履行高管人员职责,责令北京银行改正,并对其给予100万元罚款的行政处罚。

18浦发银行CD136(代码:111809136)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》,四川银监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,中国银监会针对上海浦东发展银行股份有限公司的如下事由罚款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。

18平安银行CD130(代码:111811130)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。

本基金投资18北京银行CD053、18北京银行CD056、18北京银行CD070、18北京银行CD061、18浦发银行CD136、18平安银行CD130的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除18北京银行CD053、18北京银行CD056、18北京银行CD070、18北京银行CD061、18浦发银行CD136、18平安银行CD130外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	3,560,356,731.86
3	应收利息	30,320,739.24
4	应收申购款	11,201,844.08
5	其他应收款	12,500.00
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	3,601,891,815.18

§8基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
易方达货币A	122,270	11,494.81	310,240,491.57	22.07%	1,095,230,037.38	77.93%
易方达货币B	115	243,099,569.93	25,678,226,800.32	91.85%	2,278,223,741.94	8.15%
易方达货币E	2,546	310,721.18	407,568,859.77	51.52%	383,527,265.75	48.48%
合计	124,931	241,357.37	26,396,036,151.66	87.54%	3,756,981,045.07	12.46%

8.2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)	2,020,789.00	25.56%
2	中国建设银行股份有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	249,290.00	3.15%
3	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	193,383.00	2.45%
4	中信建投(国际)金融控股有限公司-客户资产	171,189.00	2.17%
5	红塔烟草(集团)有限责任公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	163,109.00	2.06%
6	田建伟	153,622.00	1.94%
7	田玲娜	119,790.00	1.52%
8	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	109,144.00	1.38%
9	华夏基金华益1号股票型养老金产品-中国建设银行股份有限公司	86,832.00	1.10%
10	中银国际证券股份有限公司	84,092.00	1.06%

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。

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	银行类机构	7,190,298,276.57	23.85%
2	银行类机构	3,066,604,440.62	10.17%
3	银行类机构	1,957,569,711.57	6.49%
4	保险类机构	1,926,431,290.68	6.39%
5	银行类机构	1,815,289,081.44	6.02%
6	保险类机构	1,083,196,397.57	3.59%
7	银行类机构	1,049,227,250.66	3.48%
8	基金类机构	1,004,005,026.41	3.33%
9	银行类机构	701,680,175.25	2.33%
10	银行类机构	700,141,123.34	2.32%

8.4期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	易方达货币A	278,264.32	0.0198%
	易方达货币B	0.00	0.0000%
	易方达货币E	0.00	0.0000%
	合计	278,264.32	0.0009%

8.5期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9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)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	5,598,255,467.37	226,755,276,649.93	415,372,253.08
减:本报告期基金总赎回份额	5,846,300,158.16	221,517,334,452.76	495,365,750.60
本报告期基金拆分变动份额	–	–	–
本报告期期末基金份额总额	1,405,470,528.95	27,956,450,542.26	791,096,125.52

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

§10重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于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)。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国泰君安	1	–	–	40,000.00	100.00%	–
申万宏源	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,无新增交易单元。

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

1) 经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;

2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安	–	–	1,836,357,300,000.00	100.00%	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–

10.8偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§11影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年01月01日~2018年01月03日,2018年06月28日~2018年06月30日	6,080,449,935.85	1,109,848,340.72	–	7,190,298,276.57	23.85%

产品特有风险

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。

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
二〇一八年八月二十八日