# 易方达货币市场基金E类基金份额上市交易公告书

**易方达基金管理有限公司**
**二〇一四年十二月三日**

一、重要声明与提示

易方达货币市场基金（以下简称“本基金”）E类基金份额上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“《基金法》”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，易方达基金管理有限公司（以下简称“本公司”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）保证本报告书中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对本基金E类基金份额上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅刊登在中国证监会指定信息披露媒体和易方达基金管理有限公司网站（www.efunds.com.cn）上的《易方达货币市场基金更新的招募说明书》（以下简称“《更新的招募说明书》”）。

二、基金概览

1. 基金名称：易方达货币市场基金。
2. 本基金E类基金份额二级市场交易简称：易货币。
3. 本基金E类基金份额二级市场交易代码：511800。
4. 本基金E类基金份额申购、赎回简称：货币申赎。
5. 本基金E类基金份额申购、赎回代码：511801。
6. 2014年12月1日本基金E类基金份额总额：2,009,926份。
7. 2014年12月1日本基金E类基金份额净值：100元。
7. 本次上市交易份额：本基金E类基金份额2,009,926份(截至2014年12月1日)。
8. 上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
9. 上市交易日期：2014年12月8日。
10. 基金管理人：易方达基金管理有限公司。
11. 基金托管人：中国银行股份有限公司。
12. 上市推荐人：无。
13. 目前，本基金E类基金份额的申购、赎回代办券商（以下简称“一级交易商”）如下：

广发证券、长城证券、东方证券、东海证券、东吴证券、方正证券、海通证券、华宝证券、华龙证券、华鑫证券、齐鲁证券、申银万国证券、新时代证券、信达证券。

基金管理人可根据实际情况变更申购赎回代办券商并予以公告。

三、基金的募集与上市交易

（一）本基金募集情况

1. 本基金募集申请的核准机构和核准文号：2004年12月28日中国证监会证监基金字[2004]217号文。
2. 基金运作方式：契约型开放式。
3. 基金合同期限：不定期。
4. 发售方式：场外认购。
5. 发售日期：2005年1月4日到2005年1月25日。
6. 发售价格：1.00元人民币。
7. 发售期限：发售16个工作日。
8. 发售机构：

（1）代销机构

中国银行、华夏证券（已被“中信建投证券”合并）、东方证券、东吴证券、银河证券、长城证券、平安证券、华泰证券、海通证券、长江证券、国信证券、广发证券、国泰君安证券、大鹏证券（已被“长江证券”合并）、财富证券、广东证券（已被“安信证券”接管）、天同证券（已被“齐鲁证券”合并）、兴业证券、湘财证券、天和证券（已被“财通证券”合并）、华安证券、招商证券、西北证券（已被“南京证券”合并）、国联证券。

（2）直销机构

易方达基金管理有限公司。

（二）基金合同生效

本基金根据中国证监会证监基金字[2004]217号文批准，在2005年1月4日向全社会公开募集，截至2005年1月25日，募集工作已经顺利结束。经安永华明会计师事务所验资，本次募集的有效净认购金额为3,621,657,540.01元人民币，有效净认购金额产生的利息共计561,675.03元人民币。本次有效净认购资金已于2005年1月27日划入本基金在基金托管人中国银行开立的基金托管专户。

本次募集有效认购总户数为23,390户，按照每份基金份额1.00元人民币计算，募集期间含本息共募集3,622,219,215.04份基金份额。

本基金于2005年2月2日得到中国证监会书面确认，基金备案手续办理完毕。根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《易方达货币市场基金合同》(以下简称“《基金合同》”)的有关规定，本基金的募集情况已符合基金合同生效的条件，基金合同于2005年2月2日正式生效。自基金合同生效之日起，基金管理人正式开始管理本基金。按照有关法律规定，本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费由基金管理人承担。

（三）本基金E类基金份额上市交易的主要内容

1.基金上市交易的核准机构和核准文号：上海证券交易所自律监管决定书[2014]655号
2.上市交易日期：2014年12月8日
3.上市交易的证券交易所：上海证券交易所
4.二级市场交易简称：易货币
5.二级市场交易代码：511800

投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金E类基金份额的二级市场交易。

6.申购、赎回简称：货币申赎
7.申购、赎回代码：511801

投资者应当在本基金指定的一级交易商办理E类基金份额申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金E类基金份额的申购和赎回业务。

目前，本基金E类基金份额的一级交易商包括广发证券、长城证券、东方证券、东海证券、东吴证券、方正证券、海通证券、华宝证券、华龙证券、华鑫证券、齐鲁证券、申银万国证券、新时代证券、信达证券。

本公司可根据情况变更申购赎回代办机构，并及时公告。

8.本次上市交易份额：本基金E类基金份额2,009,926份(截至2014年12月1日)。

9. 未上市交易份额的流通规定：本基金包括场内份额与场外份额，本次上市的基金份额全部为场内份额，即E类基金份额。本基金E类基金份额上市交易后，所有的E类基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额；本基金A类、B类基金份额不上市交易。

投资者T日申购、T+1确认成功的E类基金份额，T+2日起份额可在二级市场卖出。例如：2014年11月24日至2014年12月4日申购并确认成功的E类基金份额于2014年12月8日起可卖出；2014年12月5日申购并确认成功的E类基金份额于2014年12月9日起可卖出，以此类推。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

（一）持有人户数

截至2014年12月1日，本基金E类基金份额持有人户数为54户，平均每户持有的基金份额为37,220.85份。

（二）持有人结构

截至2014年12月1日，本基金E类基金份额投资者持有基金份额2,009,926份。其中，机构投资者持有的E类基金份额为2,009,075份，占E类基金总份额的99.96%；个人投资者持有的E类基金份额为851份，占E类基金总份额的0.04%。

（三）前十名基金份额持有人的情况：

截至2014年12月1日，本基金E类基金份额前十名基金份额持有人的情况如下表。

| 序号 | 持有人名称(全称) | 持有基金份额(份) | 占E类总份额比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 广发信德投资管理有限公司 | 2,008,075 | 99.91 |
| 2 | 广发证券股份有限公司 | 1,000 | 0.05 |
| 3 | 顾志忠 | 548 | 0.03 |
| 4 | 吴晓敏 | 102 | 0.01 |
| 5 | 刘维玮 | 100 | 0.00 |
| 6 | 林锦燕 | 30 | 0.00 |
| 7 | 李紫燕 | 10 | 0.00 |
| 8 | 黄莹 | 10 | 0.00 |
| 9 | 马岩 | 2 | 0.00 |
| 10 | 郑金玉 | 2 | 0.00 |
| 11 | 张国学 | 2 | 0.00 |
| 12 | 张佳富 | 2 | 0.00 |
| 13 | 苑芳 | 2 | 0.00 |

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的持有人信息编制。

五、基金主要当事人简介

（一）基金管理人

1. 名称：易方达基金管理有限公司
2. 法定代表人：叶俊英
3. 总裁：刘晓艳
4. 注册资本：壹亿贰仟万元人民币
5. 注册地址：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-8室
6. 设立批准文号：证监基金字[2001]4号
7. 工商登记注册的法人营业执照文号：440000000002868
8. 经营范围：基金募集、基金销售；资产管理；经中国证监会批准的其他业务。
9. 股权结构：广东粤财信托有限公司，持有股份25%；广发证券股份有限公司，持有股份25%；盈峰投资控股集团有限公司，持有股份25%；广东省广晟资产经营有限公司，持有股份16.67%；广州市广永国有资产经营有限公司，持有股份8.33%。
10. 内部组织结构及职能：

自成立以来，公司不断致力于健全公司治理结构，严格按照法律法规和中国证监会的规定和要求，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，保持公司规范运作，维护基金份额持有人的利益。

公司下设二十七个部门：权益投资总部、固定收益总部、现金管理部、指数与量化投资部、研究部、集中交易室、投资发展部、投资风险管理部、养老金部、客户服务与销售支持部、渠道营销部、互联网金融部、北京分公司、上海分公司、广州分公司、成都分公司、南京分公司、机构客户部、系统研发部、技术运营部、核算部、注册登记部、宣传策划部、综合管理部、人力资源部、监察部、北京办事处。

各部门的主要职责概述如下：

权益投资总部下设公募基金投资部和专户投资部，公募基金投资部负责公募基金资产的日常管理和运作，专户投资部负责权益类社保基金及其他受托资产的投资管理工作。

固定收益总部下设固定收益机构投资部、固定收益基金投资部、固定收益研究部和固定收益交易室，四个部门分别负责固定收益类公募、专户、年金的投资、研究及交易工作。

现金管理部主要负责货币类以及短期理财类基金的投资管理工作。

指数与量化投资部主要负责指数基金以及量化策略基金的投资管理及相关工作。

研究部的主要工作职责是对宏观经济、行业、上市公司以及可转债、基金等投资品种进行研究。

集中交易室负责执行基金经理和投资经理下达的投资指令及特殊投资业务的具体操作，保存交易记录，备份交易数据。

投资发展部负责公司新业务的规划管理及新金融产品的设计、开发；为市场营销工作提供专业支持。

投资风险管理部负责投资风险管理、投资绩效评估，负责投资研究系统建设相关的工作，以及与投资研究跨部门流程相关的支持性工作。

养老金部负责养老金业务规划、市场开发与营销、客户服务等职能。

渠道营销部主要负责各类基金代销机构的合作开发及总部层面的维护工作，营销策划方案的制订、推动，营销效果及客群的数据挖掘、分析。

客户服务与销售支持部主要负责公司销售支持工作，为渠道、机构客户、电子商务业务的客户和大客户提供服务支持。

互联网金融部负责开发基于互联网的交易模式和服务模式，建设相应系统并持续改进用户体验，开展互联网金融业务的营销策划、方案制作、方案实施及对外的合作洽谈，为互联网上的客户提供服务。

北京分公司负责组织实施以北京为中心的华北和西北地区的销售工作。

上海分公司负责组织实施以上海为中心的华东地区及西南、东北部分地区的销售工作。

广州分公司负责组织实施以广州为中心的华南地区的销售工作。

成都分公司负责组织实施以四川省为中心的销售工作。

南京分公司负责组织以江苏省为中心的销售工作。

机构客户部负责公司机构客户的销售和服务工作。

系统研发部负责公司信息系统的需求管理、规划设计、项目管理、开发测试、以及上线运营后的应用支持工作。

技术运营部负责公司IT基础设施的规划与建设，公司日常运营的技术支持与服务，保障公司信息系统安全可靠高效运行。

核算部负责公司管理资产的会计核算、估值、信息披露工作，负责开放式基金募集期、开放期销售款项的集中结算工作，以及各银行账户的管理工作。

注册登记部主要工作是进行开放式基金、特定多个客户资产管理计划和养老金产品的注册登记业务。

宣传策划部负责制作宣传材料，传播公司信息，管理媒体关系，管理广告投放及维护公司网站等。

综合管理部负责公司股东会、董事会、监事会联络及日常工作，负责公司财务会计、行政保卫和文书档案等工作。

人力资源部负责拟订公司人力资源战略并付诸实施，具体负责公司的招聘、培训、薪酬福利、绩效考核、人事管理等工作。

监察部负责独立地对公司各业务环节合法合规运作的情况进行检查监督，协助并督促各部门履行内控职责，确保公司各项经营活动稳健合规，实现公司经营目标。

北京办事处负责与在京监管部门的日常联系工作。

11. 人员情况

截止到2014年10月31日，本公司有员工462人，278人具有硕士及以上学历，其中22人具有博士学历。92%的公司员工具有基金从业资格。

12. 信息披露负责人：张南

电话：020-85102688

13. 基金管理业务介绍

截至2014年9月30日，本公司旗下共管理59只开放式基金、1只封闭式基金和多个全国社保基金资产组合、企业年金及特定客户资产管理业务，公募基金资产管理规模1637.26亿元。

14. 本基金基金经理

石大怿先生，经济学硕士，曾任南方基金管理有限公司交易管理部交易员、易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、固定收益部基金经理助理。现任易方达基金管理有限公司易方达月月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达天天理财货币市场基金基金经理、易方达货币市场基金基金经理、易方达保证金收益货币市场基金基金经理、易方达易理财货币市场基金基金经理、易方达财富快钱货币市场基金基金经理、易方达天天增利货币市场基金基金经理、易方达龙宝货币市场基金基金经理。

（二）基金托管人

1. 基本情况

名称：中国银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码：100818
法定代表人：田国立
成立时间：1983年10月31日
基金托管资格批准文号：中国证监会证监基字【1998】24号
注册资本：人民币贰仟柒百玖拾叁亿陆仟肆佰陆拾万陆仟叁佰叁拾元整
存续期间：持续经营
托管业务部总经理：李爱华
托管部门信息披露联系人：王永民
客服电话：95566

2. 主要人员情况

中国银行托管业务部设立于1998年，现有员工110余人，大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验，且具有海外工作、学习或培训经历，60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务，中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行，中国银行拥有证券投资基金、基金（一对多、一对一）、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构银行间债券、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管产品体系。在国内，中国银行是首家开展绩效评估、风险管理等增值服务，为各类客户提供个性化的托管增值服务，是国内领先的大型中资托管银行。

3. 基金托管业务经营情况

截至2014年6月30日，中国银行已托管276只证券投资基金，其中境内基金251只，QDII基金25只，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

（三）上市推荐人

无

（四）一级交易商

(1) 广发证券
注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）
办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、41、42、43楼
法定代表人：孙树明
联系人：黄岚
客户服务电话：95575
开放式基金业务传真：020-87555305
网址：www.gf.com.cn

(2) 长城证券
注册地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人：黄耀华
联系人：刘阳
联系电话：0755-83516289
客户服务电话：0755-33680000、400-6666-888
传真：0755-83515567
网址：www.cgws.com

(3) 东方证券
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层、23层、25层-29层
法定代表人：潘鑫军
联系人：胡月茹
联系电话：021-63325888
客户服务电话：95503
传真：021-63326729
网址：www.dfzq.com.cn

(4) 东海证券
注册地址：江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层
办公地址：上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人：朱科敏
联系人：梁旭
联系电话：021-20333333
客户服务电话：95531；400-888-8588
传真：021-50498825
网址：www.longone.com.cn

(5) 东吴证券
注册地址：苏州工业园区星阳街5号
办公地址：苏州工业园区星阳街5号
法定代表人：范力
联系人：方晓丹
联系电话：0512-65581136
客户服务电话：4008601555
传真：0512-65588021
网址：www.dwzq.com.cn

(6) 方正证券
注册地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人：雷杰
联系人：徐锦福
联系电话：010-68546765
客户服务电话：95571
传真：010-68546792
网址：www.foundersc.com

(7) 海通证券
注册地址：上海市广东路689号
办公地址：上海市广东路689号
法定代表人：王开国
联系人：金芸、李笑鸣
联系电话：021-23219000
客户服务电话：95553、400-8888-001
传真：021-23219100
网址：www.htsec.com

(8) 华宝证券
注册地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼
法定代表人：陈林
联系人：刘闻川
联系电话：021-68778790
客户服务电话：400-820-9898
传真：021-68777992
网址：www.cnhbstock.com

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

(10) 华鑫证券
注册地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01（b）单元
办公地址：上海市肇嘉浜路750号
法定代表人：俞洋
联系人：陈敏
联系电话：021-64316642
客户服务电话：021-32109999；029-68918888；4001099918
传真：021-54653529
网址：www.cfsc.com.cn

(11) 齐鲁证券
注册地址：山东省济南市经七路86号
法定代表人：李玮
联系人：吴阳
联系电话：0531-68889155
客户服务电话：95538
传真：0531-68889185
网址：www.qlzq.com.cn

(12) 申银万国证券
注册地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址：上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场40层
法定代表人：储晓明
联系人：曹晔
联系电话：021-33389888
客户服务电话：95523、4008895523
传真：021-33388214
网址：www.sywg.com

(13) 新时代证券
注册地址：北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层
办公地址：北京市海淀区北三环西路99号西海国际中心1号楼15层
法定代表人：刘汝军
联系人：孙恺
联系电话：010-83561149
客户服务电话：400-698-9898
开放式基金业务传真：010-83561094
网址：www.xsdzq.cn

(14) 信达证券
注册地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人：张志刚
联系人：唐静
联系电话：010-63081000
客户服务电话：400-800-8899
传真：010-63080978
网址：www.cindasc.com

（五）基金验资机构

会计师事务所：安永华明会计师事务所
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城
法定代表人：葛明
联系电话：010-65246688
传真电话：010-85188298
经办注册会计师：葛明、金馨
联系人：罗国基

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况

（一）基金募集期间费用

本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

（二）基金上市前重要财务事项

本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。

（三）基金资产负债表

本基金截至2014年12月1日的资产负债表如下：

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

| 资 产 | 本期末(2014年12月1日) |
|---|---|
| 资 产： | |
| 银行存款 | 20,520,710,304.73 |
| 结算备付金 | 200,936,600.00 |
| 存出保证金 | - |
| 交易性金融资产 | 16,451,706,754.16 |
| 其中：股票投资 | - |
| 债券投资 | 16,451,706,754.16 |
| 基金投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 衍生金融资产 | - |
| 买入返售金融资产 | 1,545,102,687.65 |
| 应收证券清算款 | - |
| 应收利息 | 438,829,801.04 |
| 应收股利 | - |
| 应收申购款 | 598,848,359.09 |
| 其他资产 | 412,500.00 |
| 资产总计 | 39,756,547,006.67 |
| 负债和所有者权益 | 本期末(2014年12月1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 | 4,568,733,220.89 |
| 应付证券清算款 | - |
| 应付赎回款 | 16,874,743.02 |
| 应付管理人报酬 | 310,735.54 |
| 应付托管费 | 94,162.28 |
| 应付销售服务费 | 35,796.39 |
| 应付交易费用 | 215,150.33 |
| 应交税费 | 315,450.00 |
| 应付利息 | 4,063,186.13 |
| 应付利润 | 3,926,988.80 |
| 递延所得税负债 | - |
| 其他负债 | 598,001.23 |
| 负债合计 | 4,595,167,434.61 |
| 所有者权益： | |
| 实收基金 | 35,161,379,572.06 |
| 未分配利润 | - |
| 所有者权益合计 | 35,161,379,572.06 |
| 负债和所有者权益总计 | 39,756,547,006.67 |

八、基金投资组合

本投资组合报告有关数据的期间为2014 年7 月1 日至2014 年12月1日。

(一) 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 16,451,706,754.16 | 41.38 |
| | 其中：债券 | 16,451,706,754.16 | 41.38 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,545,102,687.65 | 3.89 |
| | 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 | 20,721,646,904.73 | 52.12 |
| 4 | 其他资产 | 1,038,090,660.13 | 2.61 |
| 5 | 合计 | 39,756,547,006.67 | 100.00 |

注：在报告期内，根据流动性管理的需要，本基金提前支取且没有利息损失的存款。

(二) 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例(%) | |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 6.86 | |
| | 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 | 4,568,733,220.89 | 12.99 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

(三) 基金投资组合平均剩余期限

1. 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|---|---|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 86 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 137 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 71 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限无超过180天的情况。

2.报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例(%) | 各期限负债占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 54.54 | 12.99 |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.56 | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 5.47 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 2.45 | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 3.18 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | 0.37 | - |
| 4 | 90天(含)—180天 | 27.07 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 180天(含)—397天(含) | 19.86 | - |
| | 其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 110.12 | 12.99 |

(四) 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 5,070,594,005.77 | 14.42 |
| | 其中：政策性金融债 | 4,740,629,441.38 | 13.48 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 11,351,249,755.31 | 32.28 |
| 6 | 中期票据 | 29,862,993.08 | 0.08 |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 16,451,706,754.16 | 46.79 |
| 9 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | 1,190,151,767.57 | 3.38 |

(五) 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 130306 | 13进出06 | 7,800,000 | 764,336,682.45 | 2.17 |
| 2 | 140430 | 14农发30 | 6,500,000 | 650,787,961.82 | 1.85 |
| 3 | 041453047 | 14武钢CP001 | 5,000,000 | 501,386,157.73 | 1.43 |
| 4 | 140207 | 14国开07 | 4,800,000 | 480,132,784.63 | 1.37 |
| 5 | 041453031 | 14兖州煤业CP001 | 4,700,000 | 471,209,618.39 | 1.34 |
| 6 | 041451037 | 14酒钢CP001 | 4,400,000 | 439,527,090.04 | 1.25 |
| 7 | 041463015 | 14首钢CP001 | 4,000,000 | 400,282,105.32 | 1.14 |
| 8 | 140317 | 14进出17 | 3,600,000 | 359,936,061.17 | 1.02 |
| 9 | 140204 | 14国开04 | 3,300,000 | 329,489,604.16 | 0.94 |
| 10 | 041455033 | 14汉城投CP002 | 3,000,000 | 302,140,394.56 | 0.86 |

(六) “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 | 72 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.4272% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.1700% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.2820% |

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

截至2014年12月1日，本基金未持有资产支持证券。

(八) 投资组合报告附注

1.基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

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

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

（3）基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

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

如有新增事项，按国家最新规定估值。

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

3.本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

4.其他各项资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 438,829,801.04 |
| 4 | 应收申购款 | 598,848,359.09 |
| 5 | 其他应收款 | 412,500.00 |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,038,090,660.13 |

九、重大事件揭示

根据《关于易方达货币市场基金增设场内份额、修改收益分配原则并修订基金合同部分条款的公告》，本基金管理人于2014年11月21日对易方达货币市场基金增设场内份额（即E类基金份额），并修改基金收益分配原则，同时对《基金合同》进行相应修改。修改后的《基金合同》自2014年11月21日起生效，自2014年11月24日起接受投资者对E类基金份额的申购和赎回。本基金E类基金份额自增设至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

本基金自2005年2月2日成立以来的相关公告参见本公司网站（www.efunds.com.cn）。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他法律法规、基金合同的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

严格遵守《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

根据《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他证券法律法规、基金合同的规定，将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，并在限期内，随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。

基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

（一）中国证监会核准易方达货币市场基金募集的文件；
（二）《易方达货币市场基金基金合同》；
（三）《易方达货币市场基金更新的招募说明书》；
（四）《易方达货币市场基金托管协议》；
（五）法律意见书；
（六）基金管理人业务资格批件和营业执照；
（七）基金托管人业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处。

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和更新的招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

**易方达基金管理有限公司**
**二〇一四年十二月三日**

**附件：**

## 基金合同内容摘要

（一）基金管理人的权利与义务

1. 基金管理人的权利

（1）自本基金合同生效之日起，基金管理人根据基金合同的规定，独立运用并管理基金资产；

（2）根据基金合同的规定获得基金管理费；

（3）在符合有关法律法规和基金合同的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的相关费率结构和收费方式；

（4）根据基金合同规定销售基金份额，并收取基金申购费、赎回费及其他法律法规规定的费用；

（5）担任基金的注册登记机构并获得基金合同规定的注册登记费用；选择和更换注册登记代理机构，并对其注册登记代理行为进行必要的监督；

（6）根据有关法律法规和基金合同的规定，决定开展认购、赎回、基金转换等业务；

（7）在基金存续期内，根据有关法律法规和基金合同的规定，决定拒绝和暂停受理基金份额的申购、赎回和转换申请；

（8）依据基金合同的规定，决定基金收益的分配方案；

（9）提议召开基金份额持有人大会；

（10）在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

（11）依据基金合同及有关法律规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了本基金合同或国家有关法律规定对基金资产或基金份额持有人利益造成重大损失的，应呈报中国证监会和中国银监会，并有权提议召开基金份额持有人大会，由基金份额持有人大会表决更换基金托管人，或采取其它必要措施保护基金投资者的利益；

（12）选择、更换基金代销机构，对基金代销机构行为进行必要的监督和检查；如果基金管理人认为基金代销机构的作为或不作为违反了法律法规、基金合同或基金销售代理协议，基金管理人应行使法律法规、基金合同或基金销售代理协议赋予、给予、规定的基金管理人的任何及所有权利和救济措施，以保护基金资产的安全和基金投资者的利益；

（13）以基金资产负担因处理基金事务所支出的其他费用以及对第三人所负的债务，若基金管理人以其自有财产先行支付的，对基金资产有优先受偿的权利；

（14）按照《基金法》、《运作办法》，代表基金份额持有人利益对其所投资的企业依法行使诉讼权利或行使因投资于其他证券产生的权利；

（15）本基金合同终止时，组建或参加清算小组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；

（16）法律、法规、本基金合同以及依据本基金合同制定的其他法律文件所规定的其他权利。

2. 基金管理人的义务

（1）基金管理人将遵守《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，为基金份额持有人的最大利益处理基金事务；自基金合同生效之日起，基金管理人保证恪尽职守，依照诚实信用、勤勉尽责的原则，谨慎、有效管理和运用基金财产；

（2）设置相应的部门并配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

（3）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购、赎回和其它业务或委托其它机构代理这些业务；

（4）设置相应的部门并配备足够的专业人员办理基金的注册与过户登记工作或委托其它机构代理该项业务；

（5）建立健全内部控制制度，监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的固有财产相互独立，确保分别管理、分别计帐；保证本基金与基金管理人管理的其他基金之间在资产运作、财务管理等方面相互独立，确保分别管理、分别计帐。

（6）除依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三方谋取利益，基金管理人违反此义务，利用基金资产为自己及任何第三方谋取利益，所得利益归于基金资产，造成基金资产损失的，承担赔偿责任；

基金管理人不得将基金财产转为其自有财产，违背此款规定的，将承担相应的责任，包括但不限于恢复基金资产的原状、承担赔偿责任；

（7）除依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定外，基金管理人不得委托第三人管理、运作基金财产；

（8）接受基金托管人依据法律法规、本基金合同和《托管协议》对基金管理人履行本基金合同和托管协议的情况进行的监督；

（9）采取适当合理的措施使计算开放式基金资产净值的方法符合基金合同等法律文件的规定；

（10）按规定计算基金资产净值，并公告基金收益；

（11）按照法律和本基金合同的规定受理认、申购和赎回申请，及时、足额支付赎回款项；

（12）严格按照《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定，编制中期和年度基金报告，履行信息披露及报告义务；

（13）保守基金的商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等；除法律法规、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露，但因遵守和服从司法机构、中国证监会或其他监管机构的判决、裁决、决定、命令而作出的披露不应视为基金管理人违反本基金合同规定的保密义务；

（14）依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会，并执行生效的基金份额持有人大会决议；

（15）组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

（16）基金管理人因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其过错责任不因其退任而免除；

（17）监督基金托管人按法律法规和合同规定履行自己的义务，基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿，但除法律法规另有规定外，不连带承担基金托管人的责任；

（18）依据基金合同的约定确定基金收益分配方案，并及时向基金份额持有人分配基金收益；

（19）进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

（20）保存基金财产管理业务活动的记录、帐册、报表和其他相关资料15年以上；

（21）当基金管理人将其义务委托第三方处理时，应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任；但因第三方过错导致基金财产或基金份额持有人的利益受到损失，而基金管理人首先承担了