

## 易方达龙宝货币市场基金

### 【2017】第一季度报告

基金管理人：易方达基金管理有限公司  
基金托管人：华夏银行股份有限公司  
报告送出日期：二〇一七年四月二十一日

**1 重要提示**

基金管理人及董事会有责任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责任。

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年4月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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预示其未来表现。投资者有风险，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。

本报告财务数据未经审计。

本报告自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况			
基金名称	易方达龙宝货币		
基金代码	000789		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014年01月21日		
报告期末基金总份额	1,390,101,484.25份		
投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的基础上，力争取得高于业绩比较基准的投资回报。		
投资策略	本基金通过投资组合进行分散管理，在控制风险的前提下，力争取得高于业绩比较基准的投资回报。		
业绩比较基准	中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）		
风险收益特征	本基金为货币市场基金，本基金的风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	华夏银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	易方达龙宝货币A	易方达龙宝货币B	
下属分级基金的代码	000789	000790	
报告期末A类基金份额的净值	1.381,483.527709	28,440,336.604	

#### § 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标			
单位：人民币元			
主要财务指标			
1.本期已实现收益	9,114,520.28	易方达龙宝货币A	289,017.20
2.本期利润	9,114,520.28	易方达龙宝货币A	289,017.20
3.本期基金净值增长	1,381,483.527709	易方达龙宝货币A	28,440,336.604

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

2.本基金利润为已实现利润总额。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.3 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.4 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.5 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.6 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.7 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.8 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.9 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.10 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.11 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.12 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.13 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.14 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.15 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.16 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.17 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.18 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.19 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.20 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.21 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.22 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.23 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.24 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.25 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.26 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.27 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.28 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.29 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.30 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.31 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.32 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.33 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.34 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

##### 3.2.35 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达龙宝货币A			
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率
过去三个月	0.00%	0.00%	0.00%

#### § 5 投资组合情况

5.1 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	287,357,846.31	21.40
其中：债券		287,357,846.31	21.40
资产支持证券		-	-
2	买入返售金融资产	130,000,326.04	7.91
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	975,443,365.29	70.11
4	其他资产	8,140,764.03	0.59
5	合计	1,391,279,166.38	100.00

5.2 报告期末债券投资组合情况			
序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期末债券投资组合余额	2.86	
其中：买断式回购融资		-	
2	报告期末债券投资组合余额	2.86	
其中：买断式回购融资		-	

注：上表报告期末债券投资组合余额占基金总资产净值的比例与报告期末每个交易日债券投资组合占基金总资产净值的比例略有不同。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本基金资产净值未超过基金资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均久期情况

5.3.1 投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

项目			
报告期末投资组合平均久期	7.4		
报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值	103		
报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值	49		

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值

报告期末投资组合平均久期与报告期末基金资产净值