

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

基金管理人的董事会及董事保证本基金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代表未来表现。投资人认购、申购或赎回本基金时应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	易方达龙宝货币
基金主代码	000079
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年9月30日
报告期末基金份额总额	1,300,107,874.26份

投资目标 在有效控制风险和保持较高流动性的基础上，力争获得高于货币市场基准的收益。

投资策略 本基金在综合分析宏观经济形势、货币政策、资金面、利率期限结构、信用利差、流动性、债券品种供给、投资者情绪等多方面因素的基础上，通过久期配置、期限结构配置、类属配置、券种选择、个券选择、杠杆操作等方法，在有效控制风险和保持较高流动性的基础上，力争获得高于货币市场基准的收益。

业绩比较基准 中国人民币存款基准利率（七天通知存款利率）(税前)

风险特征 特点是低风险、低收益，适合机构投资者，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

报告期末下属分级基金的份额总额

1,301,653,577.00份

269,448,336.46份

报告期末下属分级基金的份额总额

1,301,653,577.00份

269,448,336.46份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

易方达龙宝货币A 1,300,107,874.26份 269,017.29份

易方达龙宝货币B 9,114,524.36份 269,017.29份

3月末基金资产净值 1,301,653,577.00份 269,448,336.46份

注：1)本期实现的经常基金本期利息收入、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和本期利润的金额相加。
2)基金的利润构成是按日计提的。

3)基金净值表现

3.2.1 报告期内基金的净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达龙宝货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.00% 0.34% 0.00% 0.05% 0.00%

易方达龙宝货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0801% 0.0010% 0.2301% 0.0006% 0.0800% 0.0010%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值收益率变动与同期业绩比较基准收益率变动的对比

易方达龙宝货币A 累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年3月12日至2017年3月31日)

易方达龙宝货币A

3.2.3 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的对比

易方达龙宝货币A

累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年3月12日至2017年3月31日)

易方达龙宝货币A

注：1)净值“定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

2)基金管理人报告

3.2.4 报告期内基金的净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达龙宝货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.00% 0.34% 0.00% 0.05% 0.00%

易方达龙宝货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0801% 0.0010% 0.2301% 0.0006% 0.0800% 0.0010%

3.2.5 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的对比

易方达龙宝货币A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年3月12日至2017年3月31日)

易方达龙宝货币A

注：1)净值“定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

2)基金管理人报告

3.2.6 报告期内基金的净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达龙宝货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.00% 0.34% 0.00% 0.05% 0.00%

易方达龙宝货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0801% 0.0010% 0.2301% 0.0006% 0.0800% 0.0010%

3.2.7 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的对比

易方达龙宝货币A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年3月12日至2017年3月31日)

易方达龙宝货币A

注：1)净值“定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

2)基金管理人报告

3.2.8 报告期内基金的净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达龙宝货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.00% 0.34% 0.00% 0.05% 0.00%

易方达龙宝货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0801% 0.0010% 0.2301% 0.0006% 0.0800% 0.0010%

3.2.9 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的对比

易方达龙宝货币A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年3月12日至2017年3月31日)

易方达龙宝货币A

注：1)净值“定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

2)基金管理人报告

3.2.10 报告期内基金的净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达龙宝货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.00% 0.34% 0.00% 0.05% 0.00%

易方达龙宝货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0801% 0.0010% 0.2301% 0.0006% 0.0800% 0.0010%

3.2.11 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的对比

易方达龙宝货币A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年3月12日至2017年3月31日)

易方达龙宝货币A

注：1)净值“定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

2)基金管理人报告

3.2.12 报告期内基金的净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达龙宝货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.00% 0.34% 0.00% 0.05% 0.00%

易方达龙宝货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0801% 0.0010% 0.2301% 0.0006% 0.0800% 0.0010%

3.2.13 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的对比

易方达龙宝货币A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年3月12日至2017年3月31日)

易方达龙宝货币A

注：1)净值“定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

2)基金管理人报告

3.2.14 报告期内基金的净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达龙宝货币A

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.03% 0.00% 0.34% 0.00% 0.05% 0.00%

易方达龙宝货币B

阶段 净值收益率(%) 净值收益率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%) ①-③ ②-④

过去三个月 0.0801% 0.0010% 0.2301% 0.0006% 0.0800% 0.0010%

3.2.15 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动与同期业绩比较基准收益率变动的对比

易方达龙宝货币A

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2014年3月12日至2017年3月31日)

易方达龙宝货币A

注：1)净值“定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

2)基金管理人报告

3.2.16 报告期内基金的净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较