易方达现金增利货币市场基金 2019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:中国建设银行股份有限公司
送出日期:二〇一九年八月二十四日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年8月22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2019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	易方达现金增利货币		
基金主代码	000620		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年2月5日		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	29,902,009,280.43份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C
下属分级基金的交易代码	000620	000621	005097
报告期末下属分级基金的份额总额	458,419,627.91份	29,443,589,352.72份	299.80份

注:自2018年3月8日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2018年3月12日。

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量市场资金面走向、存款银行的信用资质、信用债券的信用评级以及各类资产的收益率水平、流动性特征等,确定各类资产的配置比例,力争获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,预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	田青
	联系电话	020-85102688	010-67595096
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	010-67595096
传真		020-85104666	010-66275853

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(2019年1月1日至2019年6月30日)		
	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C
本期已实现收益	7,488,898.21	442,818,580.90	4.75
本期利润	7,488,898.21	442,818,580.90	4.75
本期净值收益率	1.4662%	1.5871%	1.5866%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)		
	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C
期末基金资产净值	458,419,627.91	29,443,589,352.72	299.80
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.本基金利润分配是按日结转份额。

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. 易方达现金增利货币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	0.2249%	0.0006%	0.1126%	0.0000%	0.1123%	0.0006%
过去三个月	0.6881%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	0.3463%	0.0006%
过去六个月	1.4662%	0.0007%	0.6810%	0.0000%	0.7852%	0.0007%
过去一年	3.2692%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	1.8911%	0.0011%
过去三年	11.7369%	0.0023%	4.1916%	0.0000%	7.5453%	0.0023%
自基金合同生效起至今	16.7861%	0.0063%	6.2114%	0.0000%	10.5747%	0.0063%

2. 易方达现金增利货币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	0.2447%	0.0006%	0.1126%	0.0000%	0.1321%	0.0006%
过去三个月	0.7485%	0.0006%	0.3418%	0.0000%	0.4067%	0.0006%
过去六个月	1.5871%	0.0007%	0.6810%	0.0000%	0.9061%	0.0007%
过去一年	3.5175%	0.0011%	1.3781%	0.0000%	2.1394%	0.0011%
过去三年	12.5423%	0.0023%	4.1916%	0.0000%	8.3507%	0.0023%
自基金合同生效起至今	18.0222%	0.0063%	6.2114%	0.0000%	11.8108%	0.0063%

3. 易方达现金增利货币C:

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	0.2357%	0.0016%	0.1126%	0.0000%	0.1231%	0.0016%
过去三个月	0.7337%	0.0016%	0.3418%	0.0000%	0.3919%	0.0016%
过去六个月	1.5866%	0.0016%	0.6810%	0.0000%	0.9056%	0.0016%
过去一年	3.5096%	0.0015%	1.3781%	0.0000%	2.1315%	0.0015%
过去三年	–	–	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	4.9638%	0.0019%	1.8010%	0.0000%	3.1628%	0.0019%

注:自2018年3月8日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2018年3月12日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

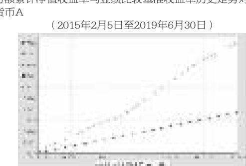
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达现金增利货币市场基金

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

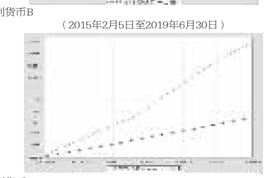
1、易方达现金增利货币A

(2015年2月5日至2019年6月30日)



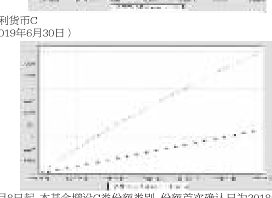
2、易方达现金增利货币B

(2015年2月5日至2019年6月30日)



3、易方达现金增利货币C

(2018年3月12日至2019年6月30日)



注:1.自2018年3月8日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2018年3月12日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

2. 自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为16.7861%,B类基金份额净值收益率为18.0222%,同期业绩比较基准收益率为6.2114%。C类基金份额净值收益率为4.9638%,同期业绩比较基准收益率为1.8010%。

§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、广州、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。易方达始终专注于资产管理业务,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、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、指数投资、量化投资、混合资产投资、海外投资、多资产投资等领域全面布局。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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(自2013年01月15日至2019年05月27日)、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达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(自2016年06月02日至2019年06月27日)、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	2015-02-05	–	10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、固定收益基金经理助理。
梁莹	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(自2014年09月24日至2019年05月27日)、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、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达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、易方达天天理财货币市场基金的基金经理助理	2015-06-19	–	9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。
易璨	本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(自2018年06月20日至2019年05月27日)、易方达安悦超短债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、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达货币市场基金的基金经理助理	2018-06-20	–	9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.对基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,"离任日期"为根据公司决定确定的解聘日期;对此后的非首任基金经理/基金经理助理,"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定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62次,其中61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;1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

2019年上半年,债券市场收益率经历了先下后上再下的过程,经济预期和信用环境变化是核心驱动因素。春节前,受国内货币环境宽松、经济基本面存在下行压力、以及美联储加息受阻等因素影响,国内债市收益率快速下行。2月中旬公布的1月社融超预期回升,债市出现调整。2月社融数据回落,叠加美欧央行释放鸽派信号,3月债市又有所反弹。总体看,一季度债市收益率震荡下行。4月公布的一季度经济数据较好,通胀预期升温,央行重提"把好货币总闸门",市场对货币收紧的担忧上升,债市收益率上行。5月,中美贸易摩擦超预期变化和央行定向降准等因素推动了债市收益率重回下行通道,信用利差收敛。5月下旬,包商事件打破了银行同业刚兑预期,事件持续发酵推动了信用分层加剧,市场风险偏好进一步下降,中低评级和民企信用利差开始明显走阔。6月,经济基本面继续有利于债市,但资金面波动加剧、地方债供给放量等因素对债市产生一定干扰。整体来看,二季度债市收益率呈现出先上后下的走势。

货币市场收益率跟随债市大环境的波动,上半年总体也是震荡下行,并在6月下旬达到了近几年低点。受此影响,货币市场基金收益率继续下行。

操作方面,报告期内基金以同业存单、同业存款、短期逆回购以及资质较好的信用债为主要配置资产,保持了适中的剩余期限和杠杆率。总体来看,组合保持了稳定的投资收益和较好的流动性。

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1.4662%;B类基金份额净值收益率为1.5871%;C类基金份额净值收益率为1.5866%;同期业绩比较基准收益率为0.6810%。

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,虽然中美贸易摩擦作为全球经济带来了极大的不确定性,但国内经济基本面的后续走势将会是债市最核心的驱动变量。当前宏观经济虽呈现出一定的下行压力,但仍具韧性,且政策层面上也仍保留有较大的空间。在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。在此过程中利率下行和核心资产的投资价值将值得重视。展望2019年下半年,全球经济景气度下滑、货币宽松、中外利差较高、境外资金流入增多等,都将有利于债市。

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,并将随着经济基本面和货币政策预期的调整,及时调整组合久期。基金投资类属配置将以同业存款、同业存单、短期逆回购和信用资质较好的信用债为主,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、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《易方达现金增利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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额:易方达现金增利货币A为7,488,898.21元,易方达现金增利货币B为442,818,580.90元,易方达现金增利货币C为4.75元。

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

本托管人复核审查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。

§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:易方达现金增利货币市场基金

报告截止日:2019年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	14,312,522,437.02	11,689,205,794.58
结算备付金	115,514,500.00	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	13,299,663,194.32	13,507,908,804.26
其中:股票投资	–	–
基金投资	–	–
债券投资	12,963,119,360.03	13,507,908,804.26
资产支持证券投资	336,543,834.29	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	5,928,286,874.43	4,084,784,767.18
应收证券清算款	618,711.64	–
应收利息	166,334,264.20	215,207,305.09
应收股利	–	–
应收申购款	580,425,743.95	163,131,954.52
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	34,403,365,725.56	29,660,238,625.63
负债和所有者权益	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018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	4,433,424,479.76	1,380,001,009.99
应付证券清算款	–	–
应付赎回款	61,427,409.94	14,294,707.92
应付管理人报酬	3,380,302.07	3,155,610.51
应付托管费	1,207,250.71	1,127,003.76
应付销售服务费	333,801.31	342,578.28
应付交易费用	226,162.39	160,946.58
应交税费	249,914.44	428,489.92
应付利息	881,272.42	1,262,020.52
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	225,852.09	326,000.00
负债合计	4,501,356,445.13	1,401,098,367.48
所有者权益:		
实收基金	29,902,009,280.43	28,259,140,258.15
未分配利润	–	–
所有者权益合计	29,902,009,280.43	28,259,140,258.15
负债和所有者权益总计	34,403,365,725.56	29,660,238,625.63

注:报告截止日2019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,C类基金份额净值1.0000元;基金份额总额29,902,009,280.43份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额458,419,627.91份,B类基金份额总额29,443,589,352.72份,C类基金份额总额299.80份。

6.2 利润表

会计主体:易方达现金增利货币市场基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
一、收入	496,604,508.17	510,055,432.08
1.利息收入	507,923,704.71	514,171,125.74
其中:存款利息收入	198,129,325.07	259,066,929.39
债券利息收入	215,137,245.17	182,876,761.10
资产支持证券利息收入	2,049,482.38	–
买入返售金融资产收入	92,607,652.09	72,227,435.25
其他利息收入	–	–
2.投资收益(损失以"-"填列)	-11,319,203.29	-4,115,693.66
其中:股票投资收益	–	–
基金投资收益	–	–
债券投资收益	-11,319,203.29	-4,115,693.66
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)	6.75	–
减:二、费用	46,297,024.31	38,936,417.93
1. 管理人报酬	19,879,461.24	14,256,321.67
2. 托管费	7,099,807.60	5,091,543.47
3. 销售服务费	2,030,815.23	1,818,315.63
4. 交易费用	–	–
5. 利息支出	16,874,671.98	17,385,268.98
其中:卖出回购金融资产支出	16,874,671.98	17,385,268.98
6. 税金及附加	222,787.94	125,804.64
7. 其他费用	189,480.32	259,163.54
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	450,307,483.86	471,119,014.15
减:所得税费用	–	–
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	450,307,483.86	471,119,014.15

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达现金增利货币市场基金

本报告期:2019年1月1日至2019年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019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)	28,259,140,258.15	–	28,259,140,258.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	450,307,483.86	450,307,483.86
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)	1,642,869,022.28	–	1,642,869,022.28
其中:1.基金申购款	28,269,894,998.51	–	28,269,894,998.51
2.基金赎回款	-26,627,025,976.23	–	-26,627,025,976.23
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)	–	-450,307,483.86	-450,307,483.86
五、期末所有者权益(基金净值)	29,902,009,280.43	–	29,902,009,280.43
项目	上年度可比期间 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)	14,669,867,528.24	–	14,669,867,528.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	–	471,119,014.15	471,119,014.15
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)	12,621,605,661.81	–	12,621,605,661.81
其中:1.基金申购款	35,110,506,840.95	–	35,110,506,840.95
2.基金赎回款	-22,488,901,179.14	–	-22,488,901,179.14
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)	–	-471,119,014.15	-471,119,014.15
五、期末所有者权益(基金净值)	27,291,473,190.05	–	27,291,473,190.05

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

易方达现金增利货币市场基金(以下简称"本基金")根据中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2014]326号《关于核准易方达现金增利货币市场基金募集的批复》和证券基金机构监管部函[2014]1713号《关于易方达现金增利货币市场基金延期募集备案的回函》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达现金增利货币市场基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达现金增利货币市场基金基金合同》于2015年2月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为201,866,693.89份基金份额,其中认购资金利息折合23.31份基金份额。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

自2018年3月8日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2018年3月12日。

6.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《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)》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达现金增利货币市场基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资产管理产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资产管理产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资产管理产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资产管理产品管理人为增值税纳税人。资产管理产品管理人运营资产管理产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资产管理产品在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,已纳税额从资产管理产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资产管理产品管理人运营资产管理产品提供的贷款服务,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。资产管理产品管理人运营资产管理产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(2) 对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,股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行")	基金托管人
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
易方达资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	19,879,461.24	14,256,321.67
其中:支付销售机构的客户维护费	–	–

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.14%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.14%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,099,807.60	5,091,543.47

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.05%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初5个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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 2019年1月1日至2019年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费			
	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C	合计
易方达基金管理有限公司	636,524.90	1,394,290.33	–	2,030,815.23
合计	636,524.90	1,394,290.33	–	2,030,815.23
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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			
	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C	合计
易方达基金管理有限公司	833,547.45	984,768.18	–	1,818,315.63
合计	833,547.45	984,768.18	–	1,818,315.63

注:本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%,B类基金份额的年销售服务费率为0.01%,C类基金份额的年销售服务费率为0.05%。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同,具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E为前一日该类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提,按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

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 2019年1月1日至2019年6月30日					
	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
中国建设银行	–	–	–	–	18,039,369,000.00	1,577,046.81
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日					
	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
中国建设银行	–	384,495,793.15	–	–	4,749,401,000.00	709,444.81

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

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

易方达现金增利货币A

无。

易方达现金增利货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
易方达资产管理有限公司	30,850,851.67	0.10%	7,976,809.36	0.03%
广发证券	402,058,595.85	1.37%	–	–

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等相关法律文件有关规定支付。

易方达现金增利货币C

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	2,522,437.02	436,083.32	2,627,381.66	66,719.24

注:本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设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(2019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

金额单位:人民币元

6.4.9.1.1受限证券类别:资产支持证券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
139732	永熙优06	2019-06-17	2019-07-02	新发流通受限	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	–
139742	链融12A1	2019-06-17	2019-07-11	新发流通受限	100.00	100.00	50,000	5,000,000.00	5,000,000.00	–
139744	链融12A3	2019-06-17	2019-07-11	新发流通受限	100.00	100.00	130,000	13,000,000.00	13,000,000.00	–
139760	联易融13	2019-06-18	2019-07-09	新发流通受限	100.00	100.00	520,000	52,000,000.00	52,000,000.00	–

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2019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4,433,424,479.76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
090208	09国开08	2019-07-01	99.98	31,000	3,099,459.12
111806269	18交通银行CD269	2019-07-01	98.05	3,000,000	294,144,667.06
111809227	18浦发银行CD227	2019-07-01	99.65	1,000,000	99,650,647.62
111813158	18浙商银行CD158	2019-07-01	98.87	4,000,000	395,469,662.29
111817210	18光大银行CD210	2019-07-01	98.64	1,522,000	150,122,931.49
111903068	19农业银行CD068	2019-07-01	99.39	334,000	33,194,896.62
111904039	19中国银行CD039	2019-07-01	99.38	4,400,000	437,264,270.65
111906043	19交通银行CD043	2019-07-01	98.44	3,000,000	295,316,115.24
111910047	19兴业银行CD047	2019-07-01	98.99	300,000	29,698,089.77
111913015	19浙商银行CD015	2019-07-01	96.92	1,032,000	100,024,286.73
111913041	19浙商银行CD041	2019-07-01	99.35	2,000,000	198,709,198.87
111915158	19民生银行CD158	2019-07-01	99.68	1,700,000	169,464,422.16
160420	16农发20	2019-07-01	100.03	1,500,000	150,043,567.75
170305	17进出05	2019-07-01	100.89	500,000	50,444,515.18
180026	18附息国债26	2019-07-01	99.99	2,200,000	219,984,428.03
180202	18国开02	2019-07-01	101.13	1,000,000	101,127,748.85
180216	18国开16	2019-07-01	100.04	1,000,000	100,038,987.28
180312	18进出12	2019-07-01	100.03	2,100,000	210,056,716.70
180410	18农发10	2019-07-01	100.06	2,700,000	270,166,165.71
190201	19国开01	2019-07-01	99.96	1,000,000	99,956,993.81
190302	19进出02	2019-07-01	100.00	1,500,000	149,999,546.36
190402	19农发02	2019-07-01	99.86	500,000	49,932,251.95
111807208	18招商银行CD208	2019-07-04	98.89	500,000	49,443,829.67
111906034	19交通银行CD034	2019-07-04	99.00	258,000	25,541,195.11
111906172	19交通银行CD172	2019-07-04	99.39	5,500,000	546,620,483.33
111918140	19华夏银行CD140	2019-07-04	99.69	5,000,000	498,450,775.61
合计				47,577,000	4,727,965,852.96

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2019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2019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13,299,663,194.32元,无属于第一或第三层次的余额(2018年12月31日:第二层次13,507,908,804.26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2019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(2018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	13,299,663,194.32	38.66
	其中:债券	12,963,119,360.03	37.68
	资产支持证券	336,543,834.29	0.98
2	买入返售金融资产	5,928,286,874.43	17.23
	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	14,428,036,937.02	41.94
4	其他各项资产	747,378,719.79	2.17
5	合计	34,403,365,725.56	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	5.21	
	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	4,433,424,479.76	14.83
	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%。

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	117
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	65

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	25.13	14.83
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
2	30天(含)—60天	13.69	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
3	60天(含)—90天	26.22	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
4	90天(含)—120天	4.32	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
5	120天(含)—397天(含)	43.20	–
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
	合计	112.56	14.83

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	259,629,958.51	0.87
2	央行票据	–	–
3	金融债券	1,251,739,175.43	4.19
	其中:政策性金融债	1,251,739,175.43	4.19
4	企业债券	117,594,177.17	0.39
5	企业短期融资券	1,478,890,245.92	4.95
6	中期票据	1,130,283,066.82	3.78
7	同业存单	8,724,982,736.18	29.18
8	其他	–	–
9	合计	12,963,119,360.03	43.35
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

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	111906172	19交通银行CD172	5,500,000	546,620,483.33	1.83
2	111909015	19浦发银行CD015	5,500,000	540,979,145.43	1.81
3	111918140	19华夏银行CD140	5,000,000	498,450,775.61	1.67
4	111904039	19中国银行CD039	4,400,000	437,264,270.65	1.46
5	111814233	18江苏银行CD233	4,000,000	398,170,585.81	1.33
6	111813158	18浙商银行CD158	4,000,000	395,469,662.29	1.32
7	111917005	19光大银行CD005	4,000,000	393,088,523.39	1.31
8	111993996	19徽商银行CD023	4,000,000	388,724,874.31	1.30
9	111917028	19光大银行CD028	4,000,000	387,858,163.60	1.30
10	111818217	18华夏银行CD217	3,300,000	328,786,879.37	1.10

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1741%
报告期内偏离度的最低值	0.0629%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1199%

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

金额单位:人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	139466	联易融10	790,000	79,000,000.00	0.26
2	139760	联易融13	520,000	52,000,000.00	0.17
3	139369	万科33A1	390,000	39,150,346.55	0.13
4	156599	19信易01	350,000	35,222,584.33	0.12
5	139416	链融05A1	300,000	30,000,000.00	0.10
5	139732	永熙优06	300,000	30,000,000.00	0.10
7	1989215	19农盈3优先	200,000	20,000,000.00	0.07
8	139744	链融12A3	130,000	13,000,000.00	0.04
9	139412	万科36A1	120,000	12,000,000.00	0.04
10	139318	万科31A1	110,000	11,088,401.91	0.04

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。

7.9.219交通银行CD172(代码:111906172)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。2018年7月26日,中国人民银行针对交通银行未按照规定履行客户身份识别义务、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或者为客户开立匿名账户、假名账户,罚款人民币130万元。2018年10月18日,上海保监局针对交通银行欺骗投保人、向投保人隐瞒与合同有关的重要情况的违法违规事实,责令改正,并处34万元罚款。2018年11月9日,中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司关于以下违规事实:(一)不良信贷资产未洁净转让,理财资金投资本行不良信贷资产收益权;(二)未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产;(三)档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞;(四)理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模;(五)违规向土地储备机构提供融资;(六)信贷资金违规承接本行表外理财资产;(七)理财资金违规投资项目资本金;(八)部分理财产品信息披露不合规;(九)现场检查配合不力,处以罚款690万元人民币。2018年11月9日,中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司并购贷款占并购交易价款比例不合规;并购贷款尽职调查和风险评估不到位的违规事实,处以罚款50万元人民币。

19浦发银行CD015(代码:111909015)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。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。

19光大银行CD005(代码:111917005)、19光大银行CD028(代码:111917028)为易方达现金增利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光大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)以误导方式违规销售理财产品;(三)以修改理财合同文本或误导方式违规销售理财产品;(四)违规以类信贷业务收费或提供质价不符的服务;(五)同业投资违规接受担保;(六)通过同业投资或贷款虚增存款规模,处以没收违法所得100万元,罚款1020万元,合计1120万元。

19徽商银行CD023(代码:111993996)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。2018年7月6日,中国人民银行合肥中心支行针对徽商银行股份有限公司违反收单银行结算账户管理相关法律制度规定的违法违规事实责令限期改正,给予警告,并处10万元罚款。2018年9月10日,安徽银监局针对徽商银行股份有限公司违规批量转让不良资产的违法违规事实罚款45万元。2018年12月26日,中国人民银行合肥中心支行针对徽商银行股份有限公司违反《非金融机构支付服务管理办法》相关规定的违法违规事实,给予警告并处1万元罚款。

18江苏银行CD233(代码:111814233)为易方达现金增利货币市场基金的前十大持仓证券。2019年1月25日,中国银行保险监督管理委员会江苏监管局针对江苏银行股份有限公司未按业务实质准确计量风险资产;理财产品之间未能实现相分离;理财投资非标资产未严格比照自营贷款管理,对授信资金未按约定用途使用监督不力的违法违规事实,对江苏银行股份有限公司处以人民币90万元行政罚款。

18浙商银行CD158(代码:111813158)为易方达现金增利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阳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。

本基金投资19交通银行CD172、19浦发银行CD015、19光大银行CD005、19光大银行CD028、19徽商银行CD023、18江苏银行CD233、18浙商银行CD158的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除19交通银行CD172、19浦发银行CD015、19光大银行CD005、19光大银行CD028、19徽商银行CD023、18江苏银行CD233、18浙商银行CD158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	618,711.64
3	应收利息	166,334,264.20
4	应收申购款	580,425,743.95
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	747,378,719.79

§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		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
易方达现金增利货币A	145,244	3,156.20	1,050,833.48	0.23%	457,368,794.43	99.77%
易方达现金增利货币B	87,877	335,054.56	17,346,972,386.88	58.92%	12,096,616,965.84	41.08%
易方达现金增利货币C	2	149.90	0.00	0.00%	299.80	100.00%
合计	233,123	128,267.09	17,348,023,220.36	58.02%	12,553,986,060.07	41.98%

8.2 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	券商类机构	801,853,528.24	2.68%
2	银行类机构	562,929,222.44	1.88%
3	银行类机构	530,814,605.93	1.78%
4	其他机构	526,761,172.68	1.76%
5	银行类机构	524,839,712.76	1.76%
6	券商类机构	501,676,227.28	1.68%
7	券商类机构	475,566,349.28	1.59%
8	券商类机构	464,207,241.73	1.55%
9	银行类机构	419,819,616.74	1.40%
10	券商类机构	415,208,369.99	1.39%

8.3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	易方达现金增利货币A	551,449.51	0.1203%
	易方达现金增利货币B	289,422,554.21	0.9830%
	易方达现金增利货币C	299.72	99.9733%
	合计	289,974,303.44	0.9697%

8.4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	易方达现金增利货币A	0~10
	易方达现金增利货币B	〉100
	易方达现金增利货币C	0
	合计	〉100
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达现金增利货币A	0~10
	易方达现金增利货币B	10~50
	易方达现金增利货币C	0
	合计	10~50

§9开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达现金增利货币A	易方达现金增利货币B	易方达现金增利货币C
基金合同生效日(2015年2月5日)基金份额总额	1,866,693.89	200,000,000.00	–
本报告期期初基金份额总额	556,037,056.19	27,703,102,901.98	299.98
本报告期基金总申购份额	699,693,292.02	27,570,201,701.74	4.75
减:本报告期基金总赎回份额	797,310,720.30	25,829,715,251.00	4.93
本报告期基金拆分变动份额	–	–	–
本报告期期末基金份额总额	458,419,627.91	29,443,589,352.72	299.80

§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

本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。

托管人中国建设银行2019年6月4日发布公告,聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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,基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受到监管部门稽查或处罚。

报告期内,基金管理人收到中国证券监督管理委员会广东监管局《关于对易方达基金管理有限公司采取责令改正措施的决定》,对公司个别未按规定进行备案报告的事项提出了整改要求。公司已及时完成了整改。

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		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	
安信证券	2	–	–	–	–	–
长城证券	3	–	–	–	–	–
长江证券	1	–	–	–	–	–
东方证券	1	–	–	–	–	–
东吴证券	1	–	–	–	–	–
方正证券	2	–	–	–	–	–
广发证券	4	–	–	–	–	–
广州证券	1	–	–	–	–	–
国海证券	1	–	–	–	–	–
国金证券	1	–	–	–	–	–
国盛证券	1	–	–	–	–	–
国信证券	2	–	–	–	–	–
国元证券	1	–	–	–	–	–
海通证券	2	–	–	–	–	–
华创证券	1	–	–	–	–	–
华泰证券	2	–	–	–	–	–
华西证券	1	–	–	–	–	–
南京证券	1	–	–	–	–	–
平安证券	1	–	–	–	–	–
申万宏源	1	–	–	–	–	–
太平洋证券	1	–	–	–	–	–
天风证券	1	–	–	–	–	–
西部证券	1	–	–	–	–	–
西藏东财	1	–	–	–	–	–
西南证券	1	–	–	–	–	–
信达证券	1	–	–	–	–	–
兴业证券	2	–	–	–	–	–
银河证券	2	–	–	–	–	–
招商证券	1	–	–	–	–	–
中投证券	1	–	–	–	–	–
中信建投	3	–	–	–	–	–
中信证券	3	–	–	–	–	–
中银国际	1	–	–	–	–	–

注:a) 本报告期内本基金减少国泰君安证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司各一个交易单元,新增中信建投证券股份有限公司二个交易单元;新增太平洋证券股份有限公司、西部证券股份有限公司各一个交易单元。

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		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
安信证券	–	–	–	–	–	–
长城证券	–	–	–	–	–	–
长江证券	–	–	–	–	–	–
东方证券	–	–	–	–	–	–
东吴证券	–	–	–	–	–	–
方正证券	–	–	–	–	–	–
广发证券	96,329,700.00	100.00%	137,390,060,000.00	100.00%	–	–
广州证券	–	–	–	–	–	–
国海证券	–	–	–	–	–	–
国金证券	–	–	–	–	–	–
国盛证券	–	–	–	–	–	–
国信证券	–	–	–	–	–	–
国元证券	–	–	–	–	–	–
海通证券	–	–	–	–	–	–
华创证券	–	–	–	–	–	–
华泰证券	–	–	–	–	–	–
华西证券	–	–	–	–	–	–
南京证券	–	–	–	–	–	–
平安证券	–	–	–	–	–	–
申万宏源	–	–	–	–	–	–
太平洋证券	–	–	–	–	–	–
天风证券	–	–	–	–	–	–
西部证券	–	–	–	–	–	–
西藏东财	–	–	–	–	–	–
西南证券	–	–	–	–	–	–
信达证券	–	–	–	–	–	–
兴业证券	–	–	–	–	–	–
银河证券	–	–	–	–	–	–
招商证券	–	–	–	–	–	–
中投证券	–	–	–	–	–	–
中信建投	–	–	–	–	–	–
中信证券	–	–	–	–	–	–
中银国际	–	–	–	–	–	–

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。

易方达基金管理有限公司

二〇一九年八月二十四日