易方达货币市场基金

2013 半年度 报告摘要

2013年6月30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
送出日期:二〇一三年八月二十八日

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2013年8月21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2013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	
交易代码	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	13,222,584,298.80份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	易方达货币A	易方达货币B
下属分级基金的交易代码	110006	110016
报告期末下属分级基金的份额总额	6,522,321,899.22份	6,700,262,399.58份

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	唐州徽
	联系电话	020-38797888	95566
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400 881 8088	95566
传真		020-38799488	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(2013年1月1日至2013年6月30日)	
	易方达货币A	易方达货币B
本期已实现收益	255,843,448.10	673,811,103.42
本期利润	255,843,448.10	673,811,103.42
本期净值收益率	1.7952%	1.9171%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
	易方达货币A	易方达货币B
期末基金资产净值	6,522,321,899.22	6,700,262,399.58
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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. 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,由于货币市场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。

4. 本基金利润分配是按月结转份额。

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	0.2870%	0.0011%	0.0288%	0.0000%	0.2582%	0.0011%
过去三个月	0.8711%	0.0026%	0.0873%	0.0000%	0.7838%	0.0026%
过去六个月	1.7952%	0.0027%	0.1736%	0.0000%	1.6216%	0.0027%
过去一年	3.7282%	0.0029%	0.3502%	0.0000%	3.3780%	0.0029%
过去三年	11.3922%	0.0046%	1.2437%	0.0002%	10.1485%	0.0044%
自基金合同生效起至今	26.6735%	0.0060%	11.8618%	0.0034%	14.8117%	0.0026%

2. 易方达货币B:

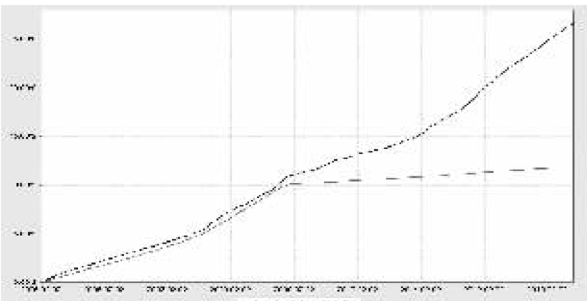
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.3070%	0.0011%	0.0288%	0.0000%	0.2782%	0.0011%
过去三个月	0.9316%	0.0026%	0.0873%	0.0000%	0.8443%	0.0026%
过去六个月	1.9171%	0.0027%	0.1736%	0.0000%	1.7435%	0.0027%
过去一年	3.9766%	0.0029%	0.3502%	0.0000%	3.6264%	0.0029%
过去三年	12.1940%	0.0046%	1.2437%	0.0002%	10.9503%	0.0044%
自基金合同生效起至今	24.8739%	0.0064%	9.2382%	0.0037%	15.6357%	0.0027%

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

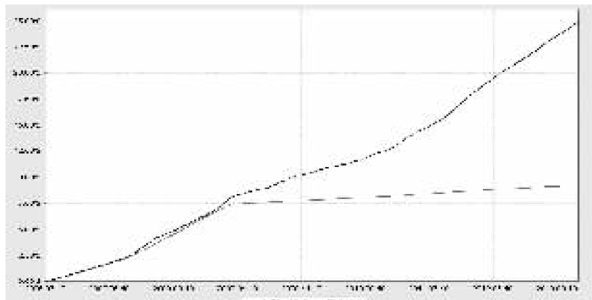
1、易方达货币A

(2005年2月2日至2013年6月30日)



2、易方达货币B

(2006年7月19日至2013年6月30日)



注:1. 基金合同中关于基金投资比例的约定:

(1) 投资于同一公司发行的短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(2) 存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(3) 在全国银行间债券市场债券正回购的资金余额不得超过基金资产净值的20%;

(4) 本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(5) 本基金投资组合的平均剩余期限,不得超过180天;

(6) 中国证监会、中国人民银行的其他限制规定。

因基金规模或市场变化等原因导致投资组合超出上述约定的规定,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合有关限制规定。

2. A级基金自基金合同生效至报告期末的基金份额净值收益率为26.6735%,同期业绩比较基准收益率为11.8618%;B级基金自基金分级至报告期末的基金份额净值收益率为24.8739%,同期业绩比较基准收益率为9.2382%。

3. 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))"。

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成立于2001年4月17日,注册资本1.2亿元。截至2013年6月30日,公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、盈峰投资控股集团有限公司、广东省广晟资产经营有限公司和广州市广永国有资产经营有限公司。公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII 和特定资产管理业务资格。

自成立以来,易方达基金管理有限公司秉承"取信于市场,取信于社会"的宗旨,坚持"在诚信规范的前提下,通过专业化运作和团队合作实现持续稳健的增长"的经营理念,努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务,为投资者创造最佳的回报。

截至2013年6月30日,易方达基金管理有限公司共管理1只封闭式基金、44只开放式基金。封闭式基金有科瑞证券投资基金;开放式基金有易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达50指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型证券投资基金、易方达策略成长二号混合型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达科讯股票型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达中小盘股票型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达行业领先企业股票型证券投资基金、易方达沪深300指数证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达亚洲精选股票型证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、易方达岁丰添利债券型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达双债增强债券型证券投资基金、易方达纯债债券型证券投资基金、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达中小板指数分级证券投资基金、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金(LOF)、易方达月月利理财债券型证券投资基金、易方达双月利理财债券型证券投资基金、易方达天天理财货币市场基金、易方达沪深300交易型开放式指数发起式证券投资基金、易方达保证金收益货币市场基金、易方达信用债债券型证券投资基金、易方达沪深300量化增强证券投资基金。同时,公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

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		
王晓晨	本基金的基金经理、易方达增强回报债券型证券投资基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、兼任易方达资产管理(香港)有限公司基金经理	2013-04-22	-	10年	硕士研究生,曾任易方达基金管理有限公司集中交易室债券交易员、债券交易主管。
石大怿	本基金的基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达天天理财货币市场基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理	2013-04-22	-	4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。
马喜德	本基金的基金经理、易方达纯债债券型证券投资基金的基金经理、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理	2008-07-01	2013-04-22	9年	博士研究生,曾任中国工商银行总行资金营运部人民币交易处投资经理、金融市场部固定收益处高级投资经理,易方达基金管理有限公司固定收益部投资经理、易方达稳健收益债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总经理助理、固定收益投资部副总经理。

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。

3.根据相关公告,2013年4月20日至2013年4月21日由王晓晨、石大怿代为履行易方达货币市场基金的基金经理职责。

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%的交易共有4次,为纯被动指数基金或量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

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

2013年上半年,中国经济增长持续减速。消费、贸易顺差数据的低迷反映出内需较弱的状况没有发生改变。固定资产投资增速在上半年持续走低,工业品出产价格指数在二季度甚至有加速下跌的趋势,国内经济的弱势可见一斑。与此同时,货币政策并未有放松的迹象。在4月以来外汇占款持续下降的背景下,央行在5月重启央票发行,社会融资总量在5、6月份连续两个月大幅收缩。央行坚定的态度、特殊时点因素、美国QE的退出等多种因素叠加导致市场在半年末发生了罕见的"钱荒"现象,债券收益率由此结束了年初以来震荡下行的趋势。在此期间我们关注到经济基本面偏弱、政策面偏紧的现象,认识到政府的态度日渐明确,"经济发展必须依靠转型升级,政策要以转变经济发展方式为主线",因此在操作上更加谨慎。随着资金面在二季度开始紧张后,我们降低了组合的久期,维持较低的杠杆,把保持组合的流动性作为主要的管理目标,并在6月末大规模赎回的冲击中保证了基金的安全运作。

报告期内本基金以存款作为主要配置,继续保持适中的组合平均剩余期限,根据市场情况均衡投资存款、逆回购、金融债和短期融资券,在保持较高流动性的同时为投资者提供了较高的投资收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

A级基金份额本报告期净值收益率为 1.7952%,同期比较基准收益率为0.1736%;B级基金份额本报告期净值收益率为1.9171% ,同期比较基准收益率为0.1736% 。基金的业绩比较基准为活期存款的税后利率。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,国内经济下行的风险仍然较高。在经济增速没有落到政府容忍线下之前,我们预期政策还是会保持信贷和社会融资偏紧的态度,很难在总量政策上出现转向,更多的还是在几个行业采取一些结构性的措施。但李克强总理近期提出的"下限论"、"稳增长可以为调结构创造有效空间和条件",对于平滑经济波动而言是必要的。因此,我们相信下半年经济可以稳住,经济运行区间不会滑出"下限"。债券市场将继续受到来自基本面的支撑,但是通胀在三季度反弹的概率较大,同时资金面在央行紧缩的态度下也存在着不确定性。总体而言,面对着目前较为平坦的收益率曲线,我们仍将保持组合较短的久期。

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,公司营运总监担任估值委员会主席,研究部、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签署服务协议,由其按约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

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》,本基金每日将各级基金份额实现的基金净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")在对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、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核。

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、净值收益表现、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:2013年6月30日

单位:人民币元

资 产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	8,921,719,736.41	58,647,969,001.66
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	5,603,428,723.75	11,476,710,487.12
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	5,591,428,723.75	11,476,710,487.12
资产支持证券投资	12,000,000.00	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	529,916,754.87	-
应收证券清算款	211,394,685.40	100,186,794.52
应收利息	110,665,998.21	346,604,697.66
应收股利	-	-
应收申购款	70,011,887.54	9,674,746.09
递延所得税资产	-	-
其他资产	147,500.00	62,500.00
资产总计	15,447,285,286.18	70,581,208,227.05
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	2,106,797,501.60	2,283,896,085.75
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	82,245,205.69	24,492,906.44
应付管理人报酬	7,635,810.76	14,925,560.54
应付托管费	2,313,882.07	4,522,897.11
应付销售服务费	2,064,310.14	4,077,418.54
应付交易费用	401,200.22	527,002.82
应交税费	315,450.00	315,450.00
应付利息	1,319,568.34	288,270.53
应付利润	21,184,053.08	119,171,449.77
递延所得税负债	-	-
其他负债	424,005.48	867,088.91
负债合计	2,224,700,987.38	2,453,084,130.41
所有者权益:		
实收基金	13,222,584,298.80	68,128,124,096.64
未分配利润	-	-
所有者权益合计	13,222,584,298.80	68,128,124,096.64
负债和所有者权益总计	15,447,285,286.18	70,581,208,227.05

注:报告截止日2013年6月30日,A级基金基金份额净值1.0000元,B级基金基金份额净值1.0000元;基金份额总额13,222,584,298.80份,下属分级基金的份额总额分别为:A级基金6,522,321,899.22份,B级基金6,700,262,399.58份。

6.2 利润表

会计主体:易方达货币市场基金
本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项 目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	1,118,270,843.71	934,415,471.82
1.利息收入	1,196,185,385.15	898,284,138.35
其中:存款利息收入	912,214,430.37	807,165,251.14
债券利息收入	282,193,208.22	88,234,776.55
资产支持证券利息收入	36,690.41	-
买入返售金融资产收入	1,741,056.15	2,884,110.66
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-77,944,696.86	36,131,333.47
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-77,944,696.86	36,131,333.47
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)	30,155.42	-
减:二、费用	188,616,292.19	142,081,576.58
1.管理人报酬	81,380,620.27	56,884,057.80
2.托管费	24,660,793.98	17,237,593.24
3.销售服务费	19,452,200.95	16,228,392.11
4.交易费用	-	-
5.利息支出	62,765,295.14	51,353,508.74
其中:卖出回购金融资产支出	62,765,295.14	51,353,508.74
6.其他费用	357,381.85	378,024.69
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	929,654,551.52	792,333,895.24
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	929,654,551.52	792,333,895.24

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:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	68,128,124,096.64	-	68,128,124,096.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	929,654,551.52	929,654,551.52
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)	-54,905,539,797.84	-	-54,905,539,797.84
其中:1.基金申购款	153,101,813,726.87	-	153,101,813,726.87
2.基金赎回款	-208,007,353,524.71	-	-208,007,353,524.71
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)	-	-929,654,551.52	-929,654,551.52
五、期末所有者权益(基金净值)	13,222,584,298.80	-	13,222,584,298.80
项目	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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)	20,326,666,699.65	-	20,326,666,699.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	792,333,895.24	792,333,895.24
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)	9,341,654,386.46	-	9,341,654,386.46
其中:1.基金申购款	145,520,630,813.83	-	145,520,630,813.83
2.基金赎回款	-136,178,976,427.37	-	-136,178,976,427.37
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)	-	-792,333,895.24	-792,333,895.24
五、期末所有者权益(基金净值)	29,668,321,086.11	-	29,668,321,086.11

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:

基金管理公司负责人:叶俊英,主管会计工作负责人:张优造,会计机构负责人:陈荣

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,基金注册登记机构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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

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于2013年6月30日的财务状况以及2013年半年度的经营成果和净值变动情况。

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

6.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自2004年1月1日起,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、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对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;

6.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税 [2008]132号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》,自2008年10月9日起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
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	81,380,620.27	56,884,057.80
其中:支付销售机构的客户维护费	10,114,393.40	9,482,497.42

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 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,660,793.98	17,237,593.24

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 2013年1月1日至2013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	合计
易方达基金管理有限公司	2,148,924.78	1,387,290.01	3,536,214.79
中国银行	4,414,666.19	68,105.55	4,482,771.74
广发证券	644,755.81	3,872.25	648,628.06
合计	7,208,346.78	1,459,267.81	8,667,614.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	合计
易方达基金管理有限公司	1,491,513.97	774,770.94	2,266,284.91
中国银行	4,090,389.64	93,869.46	4,184,259.10
广发证券	503,061.00	12,299.03	515,360.03
合计	6,084,964.61	880,939.43	6,965,904.04

注:本基金A级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级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。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 2013年1月1日至2013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
中国银行	100,733,934.25	2,125,978,280.42	-	-	7,699,600,000.00	1,197,393.85
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国银行	72,492,948.81	291,514,214.94	-	-	15,475,450,000.00	5,490,696.55

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

易方达货币A

份额单位:份

关联方名称	易方达货币A本期末 2013年6月30日		易方达货币A上年度末 2012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
易方达教育基金会	700,000.00	0.01%	-	-

易方达货币B

份额单位:份

关联方名称	易方达货币B本期末 2013年6月30日		易方达货币B上年度末 2012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
广发证券	-	-	2,301,372,605.97	5.96%

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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
中国银行	1,001,719,736.41	23,719,805.79	18,991,790.45	102,758.36

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,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

金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2013年1月1日至2013年6月30日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券、中国银行	071301001	13招商CP001	分销	2,600,000	259,935,000.00
中国银行	071303002	13中信CP002	分销	5,000,000	499,875,000.00
中国银行	011311003	13大唐集SCP003	分销	1,000,000	100,000,000.00
中国银行	011311001	13大唐集SCP001	分销	500,000	50,000,000.00
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日 基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2013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暂时停牌等流通受限股票。

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2013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2,106,797,501.60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
130210	13国开10	2013-07-01	99.51	11,600,000	1,154,343,998.61
130306	13进出06	2013-07-01	99.48	6,200,000	616,775,288.53
130210	13国开10	2013-07-03	99.51	2,100,000	208,976,068.71
130306	13进出06	2013-07-05	99.48	1,200,000	119,375,862.30
041261032	12金元CP001	2013-07-22	99.86	300,000	29,957,129.47
130210	13国开10	2013-07-22	99.51	200,000	19,902,482.73
合计	-	-	-	21,600,000	2,149,330,830.35

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2013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

无。

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	5,603,428,723.75	36.27
	其中:债券	5,591,428,723.75	36.20
	资产支持证券	12,000,000.00	0.08
2	买入返售金融资产	529,916,754.87	3.43
	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	8,921,719,736.41	57.76
4	其他各项资产	392,220,071.15	2.54
5	合计	15,447,285,286.18	100.00

注:在报告期内,根据流动性管理的需要,本基金提前支取了部分可提前支取且没有利息损失的存款。

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	7.91	
	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	2,106,797,501.60	15.93
	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

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????????	47
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	102
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限无超过180天的情况。

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	51.14	15.93
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	11.35	-
2	30天(含)—60天	33.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.65	-
3	60天(含)—90天	16.33	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	12.08	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	2.20	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
6	合计	115.46	15.93

7.4 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	4,475,824,702.89	33.85
	其中:政策性金融债	4,345,841,399.96	32.87
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,115,604,020.86	8.44
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	5,591,428,723.75	42.29
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	1,719,092,502.99	13.00

7.5 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	130210	13国开10	22,100,000	2,199,224,342.18	16.63
2	130306	13进出06	12,800,000	1,273,342,531.15	9.63
3	130214	13国开14	2,500,000	247,994,567.96	1.88
4	130211	13国开11	2,200,000	218,452,839.62	1.65
5	041252047	12中铝CP002	2,000,000	198,772,081.48	1.50
6	110206	11国开06	1,800,000	179,529,986.83	1.36
7	130215	13国开15	1,800,000	178,000,019.90	1.35
8	071311002	13国信CP002	1,100,000	109,987,562.83	0.83
9	041260084	12大装备CP002	1,000,000	99,954,044.96	0.76
10	041358003	13广汇汽车CP001	900,000	89,575,216.62	0.68

7.6 "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	0.2304%
报告期内偏离度的最低值	0.0432%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1532%

7.7 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	119029	澜沧江1	120,000	12,000,000.00	0.09

注:本基金本报告期末仅持有以上资产支持证券。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2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。

7.8.3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。

7.8.4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	211,394,685.40
3	应收利息	110,665,998.21
4	应收申购款	70,011,887.54
5	其他应收款	147,500.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	392,220,071.15

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
易方达货币A	85,532	76,255.93	833,695,400.42	12.78%	5,688,626,498.80	87.22%
易方达货币B	134	50,001,958.21	6,046,048,516.08	90.24%	654,213,883.50	9.76%
合计	85,666	154,350.43	6,879,743,916.50	52.03%	6,342,840,382.30	47.97%

8.2 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	7,032,620.02	0.1078%
	易方达货币B	0.00	0%
	合计	7,032,620.02	0.0532%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为10万份至50万份(含);本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为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
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	29,485,944,565.04	38,642,179,531.60
本报告期基金总申购份额	31,609,042,710.34	121,492,771,016.53
减:本报告期基金总赎回份额	54,572,665,376.16	153,434,688,148.55
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	6,522,321,899.22	6,700,262,399.58

注: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

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

2013年3月17日,根据国家金融工作需要,肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。中国银行股份有限公司已于2013年3月17日公告上述事项。

2013年6月1日,中国银行股份有限公司发布公告,自2013年5月31日起,田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

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		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	
国泰君安	1	-	-	40,000.00	100.00%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增平安证券有限责任公司一个交易单元。

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
国泰君安	-	-	751,100,000.00	100.00%	-	-
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。

易方达基金管理有限公司
二〇一三年八月二十八日