易方达增金宝货币市场基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:浙商银行股份有限公司
送出日期:二〇一六年三月二十五日

§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。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 为本基金出具了标准无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月20日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	易方达增金宝货币
基金主代码	001010
交易代码	001010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月20日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	浙商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,105,863,970.00份
基金合同存续期	不定期

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	本基金将对基金资产组合进行积极管理,在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	朱巍
	联系电话	020-85102688	0571-87659806
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		400 881 8088	95527
传真		020-85104666	0571-87659965

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
本期已实现收益	254,663,956.34
本期利润	254,663,956.34
本期净值收益率	4.0030%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末基金资产净值	9,105,863,970.00
期末基金份额净值	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.本基金合同于2015年1月20日生效,合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

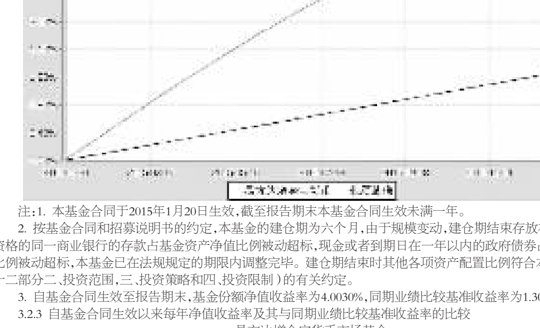
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8731%	0.0033%	0.3456%	0.0000%	0.5275%	0.0033%
过去六个月	1.7880%	0.0025%	0.6924%	0.0000%	1.0956%	0.0025%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.0030%	0.0030%	1.3059%	0.0000%	2.6971%	0.0030%

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

易方达增金宝货币市场基金

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

(2015年1月20日至2015年12月31日)



注:1. 本基金合同于2015年1月20日生效,截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2. 按基金合同和招募说明书的约定,本基金的建仓期为六个月,由于规模变动,建仓期结束存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款占基金资产净值比例被动超标,现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值比例被动超标,本基金已在法规规定的期限内调整完毕。建仓期结束时其他各项资产配置比例符合本基金合同(第十二部分二、投资范围,三、投资策略和四、投资限制)的有关约定。

3. 自基金合同生效至报告期末,基金份额净值收益率为4.0030%,同期业绩比较基准收益率为1.3059%。

3.2.3 自基金合同生效以来每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达增金宝货币市场基金

自基金合同生效以来基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

注:本基金合同生效日为2015年1月20日,合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日	254,663,956.34	-	-	254,663,956.34	-
合计	254,663,956.34	-	-	254,663,956.34	-

§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,旗下设有北京、广州、上海、成都、南京、大连分公司和易方达国际控股有限公司、易方达资产管理有限公司等子公司。易方达秉承"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增长"的经营理念,以严格的管理、规范的运作和良好的投资业绩,赢得市场认可。2004年10月,易方达取得全国社会保障基金投资管理人资格。2005年8月,易方达获得企业年金基金投资管理人资格。2007年12月,易方达获得合格境内机构投资者(QDII)资格。2008年2月,易方达获得从事特定客户资产管理业务资格。截至2015年12月31日,易方达旗下共管理88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,资产管理总规模8269.58亿元。

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		
梁莹	本基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达现金增利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、易方达龙宝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助理、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	2015-01-20	-	5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。

注:1.此处的"任职日期"为基金合同生效之日,"离任日期"为公告确定的解聘日期。

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。

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公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《公平交易制度》,内容主要包括公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的实现措施和交易执行程序、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合,围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易(含银行间市场)等投资管理活动,贯穿授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。公平交易的原则包括:集中交易原则、机制公平原则、公平协调原则、及时评估反馈原则。

公平交易的实现措施和执行程序主要包括:通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会;投资人员应公平对待其管理的不同投资组合,控制其所管理不同组合对同一证券的同日同向交易价差;建立集中交易制度,交易系统具备公平交易功能,对于满足公平交易执行条件的同向指令,系统将自动启用公平交易功能,按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行;根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制,通过系统与人工控制相结合的方式,力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待;建立事中和事后的同向交易、异常交易监控分析机制,对于发现的异常问题进行提示,并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间(纯被动指数组合和量化投资组合除外)确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易,投资人员须提供充分的投资决策依据,并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制,并借助相关技术系统,使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况,持续督促公平交易制度的落实执行,并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好。

公司利用统计分析的方法和工具,按照不同的时间窗口(包括当日内、3日内、5日内),对我司旗下所有投资组合2015年度的同向交易价差情况进行了分析,包括旗下各大类资产组合之间(即公募、社保、年金、专户四大类业务之间)的同向交易价差、各组合与其他所有组合之间的同向交易价差、以及旗下任意两个组合之间的同向交易价差。根据对样本个数、平均溢价率是否为0的T检验显著程度、平均溢价率以及溢价率分布概率、同向交易价差对投资组合的业绩影响等因素的综合分析,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3异常交易行为的专项说明

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。

本报告期内,本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11次,其中8次为旗下指数及量化组合因投资策略需要而和其他组合发生反向交易,3次为不同基金经理管理的组合间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。

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

2015年国内经济增长总体保持了平稳态势,全年国内生产总值按同比价格计算比上年增长6.9%。全年全国规模以上工业增加值按可比价格计算比上年增长6.1%,其中新产业增长较快,全年高技术产业增加值比上年增长10.2%,占规模以上工业比重为11.8%,比上年提高1.2个百分点。2015年全年固定资产投资增速继续回落,相比上年名义增长10.0%,扣除价格因素实际增长12.0%,实际增速比上年回落2.9个百分点。全年社会消费品零售总额比上年名义增长10.7%,扣除价格因素实际增长10.6%。全年进出口总额比上年下降7.0%,其中出口总额下降1.8%,进口总额下降13.2%。全年居民消费价格比上年上涨1.4%。工业生产者出厂价格比上年下降5.2%。全年货币信贷平稳增长,M2年末余额比上年末增长13.3%。2015年国内经济结构继续优化升级,体现在产业结构继续优化、区域结构协调性增强以及节能降耗继续取得进展。2015年是经济发展进入新常态的一年,也是金融领域改革继续深入推进的一年。这一年利率市场化改革基本完成,在中国人民银行完善人民币中间价报价机制后人民币成功地加入SDR,新股发行注册制也有望在不久的将来启动。2015年也是资本市场剧烈动荡的一年,波澜壮阔的A股牛市戛然而止、人民币汇率贬值预期增加、外汇储备开始下降。中国人民银行在2015年5次下调金融机构人民币贷款和存款基准利率、5次下调金融机构人民币存款准备金率,在宽松的货币政策下,国内债券市场延续了牛市的格局。尽管收益率曲线平坦化下行,但行业信用利差伴随着债券违约事件有所扩大。2015年全年货币市场利率维持低位,货币市场基金行业规模继续增长,年末全市场货币基金总规模4.58万亿元,较2014年末同比增长109%。随着规模的增长,货币市场基金的资产配置结构也发生了深刻的变化,大额可转让同业存单的配置比例逐渐增加。报告期内,基金的运作仍以保证资产的流动性为首要任务,在三、四季度提高了大额可转让同业存单的配置比例,全年维持组合剩余期限在中性偏高的水平,获得了较好的资本利得收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内基金份额净值收益率为4.0030%;同期业绩比较基准收益率为1.3059%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年,美联储大概率将开启加息进程,尽管最终加息的次数和频率将取决于美国经济数据的表现,但美国就业情况的显著改善相比于全球经济的疲弱情况使得美元指数仍将继续走强。处于转型期的中国,经济发展长期向好的基本面没有改变,经济的增长已经从"三期叠加"走向"新常态"。去年底召开的中央经济工作会议强调要着力推进的供给侧结构性改革,将开启中国经济持续健康发展的新进程。在推进供给侧改革的过程中,宏观政策的重点和力度都将有所调整,根据权威人士的解读,"稳健的货币政策要灵活适度,主要体现在为结构性改革营造适宜的货币金融环境,降低融资成本,既要防止顺周期紧缩,也绝不要随便放水,而是针对金融市场的变化进行预调微调,保持流动性合理充裕和社会融资总量适度增长。"在人民币国际化的历史背景下,短期内人民银行的工作重心将是稳住人民币汇率。蒙代尔不可能三角理论已经显出巨大的威力,我们不认为短期利率在未来将延续2015年持续下行的走势,市场利率波动的频率和区间都将增大。尽管人民银行面临着资本自由流动、货币政策独立性和汇率稳定性的艰难选择,我们仍判断2016年不会发生区域性、系统性的金融风险。相对于市场走势和波动的研判,我们更加关注的是,中国货币政策的传导机制正愈发有效、中国资本市场多层次多主体参与者的结构正愈发健全、金融资产的定价正变得愈发高效合理。尽管全球资本市场的走势在可见的未来仍诡谲难测,但一次次危机过后我国金融监管制度在不断完善、监管水平在不断提升;市场化竞争的大浪淘沙,使得我国一批有竞争力的金融机构在一次次危机后脱颖而出。这是改革时代的主题,是我国资本市场的希望。道路曲折不改前途光明,我们对中国经济的未来和转型的成功充满信心。新的《货币市场基金监督管理办法》于2016年2月1日施行,新规对于货币市场基金资产配置的分散化、资产的流动性提出了更高的监管要求,这与我们所一直坚持的管理理念完全相同。

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高的流动性,适当降低组合剩余期限,同时紧跟央行的政策指向和操作节奏,加强波段操作,合理应对由于人民币汇率阶段性贬值等因素带来的货币市场扰动,把握短期波动带来的投资机会。

基金管理人将坚持规范运作、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、固定收益总部、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及中证指数有限公司签署服务协议,由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所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《易方达增金宝货币市场基金基金合同》,本基金每日将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

本报告期内,本基金托管人在对易方达增金宝货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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

本报告期内,易方达增金宝货币市场基金的管理人易方达基金管理有限公司在易方达增金宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上,严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达增金宝货币市场基金2015年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 审计了2015年12月31日的资产负债表、2015年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,并出具了标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:易方达增金宝货币市场基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日
资产:	
银行存款	2,674,939,934.73
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	8,002,815,904.12
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	8,002,815,904.12
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	178,300,467.45
应收证券清算款	-
应收利息	118,424,068.55
应收股利	-
应收申购款	429,061.80
递延所得税资产	-
其他资产	19,140.00
资产总计	10,974,928,576.65
负债和所有者权益	**本期末 2015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	1,542,085,609.87
应付证券清算款	318,947,833.54
应付赎回款	2,146,210.63
应付管理人报酬	2,369,622.54
应付托管费	718,067.45
应付销售服务费	1,795,168.62
应付交易费用	254,437.61
应交税费	-
应付利息	408,656.39
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	339,000.00
负债合计	1,869,064,606.65
所有者权益:	
实收基金	9,105,863,970.00
未分配利润	-
所有者权益合计	9,105,863,970.00
负债和所有者权益总计	10,974,928,576.65

注:1.本基金合同生效日为2015年1月20日,2015年度实际报告期间为2015年1月20日至2015年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

2.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额9,105,863,970.00份。

7.2 利润表

会计主体:易方达增金宝货币市场基金

本报告期:2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一、收入	319,638,952.95
1.利息收入	299,091,114.39
其中:存款利息收入	154,089,867.24
债券利息收入	142,023,875.74
资产支持证券利息收入	559,456.13
买入返售金融资产收入	2,417,915.28
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	20,547,838.56
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	20,547,838.56
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)	-
减:二、费用	64,974,996.61
1. 管理人报酬	21,594,390.54
2. 托管费	6,543,754.70
3. 销售服务费	16,359,386.82
4. 交易费用	-
5. 利息支出	20,117,389.54
其中:卖出回购金融资产支出	20,117,389.54
6. 其他费用	360,075.01
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	254,663,956.34
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	254,663,956.34

注:本基金合同生效日为2015年1月20日,2015年度实际报告期间为2015年1月20日至2015年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达增金宝货币市场基金

本报告期:2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31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)	200,104,152.00	-	200,104,152.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	254,663,956.34	254,663,956.34
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)	8,905,759,818.00	-	8,905,759,818.00
其中:1.基金申购款	119,537,697,948.22	-	119,537,697,948.22
2.基金赎回款	-110,631,938,130.22	-	-110,631,938,130.22
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)	-	-254,663,956.34	-254,663,956.34
五、期末所有者权益(基金净值)	9,105,863,970.00	-	9,105,863,970.00

注:本基金合同生效日为2015年1月20日,2015年度实际报告期间为2015年1月20日至2015年12月31日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,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:张优造,会计机构负责人:陈荣

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

易方达增金宝货币市场基金(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[2015]52号《关于准予易方达增金宝货币市场基金注册的批复》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《易方达增金宝货币市场基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达增金宝货币市场基金基金合同》于2015年1月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,104,152.00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,基金托管人为浙商银行股份有限公司。

本基金募集期间为2015年1月19日至2015年1月19日,募集金额总额为200,104,152.00元人民币,经安永华明(2015)验字第60468000_G01号验资报告予以审验。

7.4.2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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达增金宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止,惟本会计年度期间为2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,即债券投资按票面利率或日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2) 该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3) 该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按摊余成本和实际利率计算确定的利息扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小则按直线法计算。

7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金每份基金份额享有同等分配权;

(2)本基金收益分配方式为红利再投资,免收再投资的费用;

(3)本基金根据每日基金收益情况,以基金已实现收益为基准,为投资人每日计算当日收益并分配(该收益将会计确认为实收基金,参与下一日的收益分配)。通常情况下,本基金的收益支付方式为按月支付,对于可支持按日支付的销售机构,本基金的收益支付方式经基金管理人和销售机构双方协商一致后可以按日支付。不论何种支付方式,当日收益均参与下一日的收益分配,不影响基金份额持有人实际获得的投资收益。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位,小数点后第3 位按去尾原则处理,因去尾形成的余额进行再次分配,直到分完为止;

(4)本基金根据每日收益情况,将当日收益全部分配,若当日已实现收益大于零时,为投资人记正收益;若当日已实现收益小于零时,为投资人记负收益;若当日已实现收益等于零时,当日投资人不记收益;

(5)本基金每日进行收益计算并分配时,收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式,投资人可通过赎回基金份额获得现金收益;若投资人在收益支付时,其累计收益为正值,则为投资人增加相应的基金份额,其累计收益为负值,则缩减投资人基金份额;

(6)当日申购的基金份额自下一个工作日起,享有基金的收益分配权益;当日赎回的基金份额自下一个工作日起,不享有基金的收益分配权益;

(7)在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下,基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式,不需召开基金份额持有人大会审议;

(8)法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7关联方关系

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
浙商银行股份有限公司(以下简称"浙商银行")	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
广东粤财信托有限公司(以下简称"粤财信托")	基金管理人股东
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	21,594,390.54
其中:支付销售机构的客户维护费	6,231,093.42

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.33%÷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

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,543,754.70

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3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 2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
易方达基金管理有限公司	624,302.28
浙商银行	15,735,084.54
广发证券	-
合计	16,359,386.82

注:本基金的年销售服务费率为0.25%,具体如下:

H=E×年销售服务费率÷当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付,由基金管理人代收,基金管理人收到后支付给基金销售机构,专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.3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 2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31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
浙商银行	80,269,726.56	-	-	-	33,181,034,000.00	2,440,942.48

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2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

无。

7.4.8.5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 2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	874,939,934.73	89,046,547.13

注:本基金的银行存款由基金托管人浙商银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.8.6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	基金在承销期内买入(本期 2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日)	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券	071501003	15招商CP003	分销	500,000	49,987,500.00

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1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。

7.4.9.2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。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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1,542,085,609.87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
111509243	15浦发CD243	2016-01-04	98.50	3,000,000	295,513,541.86
111510315	15兴业CD315	2016-01-04	99.27	2,000,000	198,534,030.06
111517166	15光大CD166	2016-01-04	99.25	4,000,000	397,006,120.35
111510319	15兴业CD319	2016-01-05	99.22	756,000	75,008,612.73
111510373	15兴业CD373	2016-01-05	98.90	2,000,000	197,803,296.34
111517161	15光大CD161	2016-01-05	99.34	1,000,000	99,339,249.15
111519057	15恒丰银行CD057	2016-01-05	99.08	2,000,000	198,162,148.98
111519100	15恒丰银行CD100	2016-01-05	96.87	1,000,000	96,870,957.19
合计				15,756,000	1,558,237,956.66

注:期末估值总额=期末估值单价(保留小数点后无限位)×数量。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8投资组合报告

8.1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	8,002,815,904.12	72.92
	其中:债券	8,002,815,904.12	72.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	178,300,467.45	1.62
	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	2,674,939,934.73	24.37
4	其他各项资产	118,872,270.35	1.08
5	合计	10,974,928,576.65	100.00

8.2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	13.60	
	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	1,542,085,609.87	16.94
	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%。

8.3基金投资组合平均剩余期限

8.3.1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	106
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	121
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	8

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2015-04-28	121	在建仓期内调仓遭遇市场变化	发生日后1个交易日

注:本基金合同约定"本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天"。

8.3.2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	25.46	20.44
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.18	-
2	30天(含)—60天	9.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.21	-
3	60天(含)—90天	28.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	42.45	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	13.65	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	119.22	20.44

8.4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	419,667,691.54	4.61
2	央行票据	-	-
3	金融债券	348,862,801.44	3.83
	其中:政策性金融债	348,862,801.44	3.83
4	企业债券	180,894,959.89	1.99
5	企业短期融资券	3,909,031,095.92	42.93
6	中期票据	635,797,264.86	6.98
7	同业存单	2,508,562,090.47	27.55
8	其他	-	-
9	合计	8,002,815,904.12	87.89
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	308,793,082.11	3.39

8.5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

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	111510387	15兴业CD387	5,000,000	499,155,712.58	5.48
2	159907	15贴现国债07	4,000,000	399,661,611.54	4.39
3	111517166	15光大CD166	4,000,000	397,006,120.35	4.36
4	111509243	15浦发CD243	3,000,000	295,513,541.86	3.25
5	011541002	15鞍钢SCP002	2,000,000	199,796,723.12	2.19
6	150214	15国开14	2,000,000	198,896,942.34	2.18
7	111510315	15兴业CD315	2,000,000	198,534,030.06	2.18
8	111519057	15恒丰银行CD057	2,000,000	198,162,148.98	2.18
9	111510373	15兴业CD373	2,000,000	197,803,296.34	2.17
10	098088	09中铝业债2	1,800,000	180,894,959.89	1.99

8.6"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	137
报告期内偏离度的最高值	0.4645%
报告期内偏离度的最低值	-0.0300%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2348%

8.7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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1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。

8.8.2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。

8.8.3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。

8.8.4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	-
3	应收利息	118,424,068.55
4	应收申购款	429,061.80
5	其他应收款	19,140.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	118,872,270.35

§9基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
630,698	14,437.76	0.00	0.00%	9,105,863,970.00	100.00%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	12,685,484.40	0.1393%

9.3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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§10开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2015年1月20日)基金份额总额	200,104,152.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	119,537,697,948.22
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	110,631,938,130.22
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
基金合同生效日起至报告期期末期末基金份额总额	9,105,863,970.00

注:本基金合同生效日为2015年01月20日。

§11重大事件揭示

11.1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。

11.2 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

2015年6月2日,本基金管理人完成公司法定代表人变更的工商登记工作,公司法定代表人正式变更为现任总经理刘晓艳。

本报告期内托管人的专门基金托管部门负责人变更为丁文忠副总经理。

11.3 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。

11.4 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。

11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)提供审计服务,本报告年度的审计费用为60,000.00元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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	
申万宏源	2	-	-	-	-	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增申万宏源证券有限公司两个交易单元。

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。

11.7.2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
申万宏源	-	-	760,000,000.00	100.00%	-	-

11.8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

二〇一六年三月二十五日