易方达天天理财货币市场基金 2018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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:二〇一八年八月二十八日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月24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2018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	易方达天天理财货币			
基金主代码	000009			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2013年3月4日			
基金管理人	易方达基金管理有限公司			
基金托管人	中国工商银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	85,862,395,065.14份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R	易方达天天理财货币C
下属分级基金的交易代码	000009	000010	000013	005122
报告期末下属分级基金的份额总额	48,029,678,957.11份	34,471,743,102.87份	3,049,630,013.98份	311,342,991.18份

注:自2017年10月23日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年10月24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	利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,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。
业绩比较基准	中国人民银行公布的活期存款基准利率的税后收益率,即活期存款基准利率×(1-利息税税率)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,是证券投资基金中的低风险品种。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。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张南	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105798
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-85104666	010-66105799

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(2018年1月1日至2018年6月30日)			
	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R	易方达天天理财货币C
本期已实现收益	907,581,006.42	681,882,567.73	71,861,097.93	3,524,724.96
本期利润	907,581,006.42	681,882,567.73	71,861,097.93	3,524,724.96
本期净值收益率	2.0490%	2.1703%	2.1754%	2.0505%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)			
	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R	易方达天天理财货币C
期末基金资产净值	48,029,678,957.11	34,471,743,102.87	3,049,630,013.98	311,342,991.18
期末基金份额净值	1.0000	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.本基金自成立起至2014年6月4日,利润分配按月结转份额;从2014年6月5日起至今,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. 易方达天天理财货币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	0.3314%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.3022%	0.0002%
过去三个月	1.0103%	0.0003%	0.0885%	0.0000%	0.9218%	0.0003%
过去六个月	2.0490%	0.0003%	0.1761%	0.0000%	1.8729%	0.0003%
过去一年	4.1470%	0.0004%	0.3555%	0.0000%	3.7915%	0.0004%
过去三年	10.6839%	0.0025%	1.0712%	0.0000%	9.6127%	0.0025%
自基金合同生效起至今	22.8776%	0.0037%	1.9079%	0.0000%	20.9697%	0.0037%

2. 易方达天天理财货币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	0.3512%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.3220%	0.0002%
过去三个月	1.0707%	0.0003%	0.0885%	0.0000%	0.9822%	0.0003%
过去六个月	2.1703%	0.0003%	0.1761%	0.0000%	1.9942%	0.0003%
过去一年	4.3969%	0.0004%	0.3555%	0.0000%	4.0414%	0.0004%
过去三年	11.4835%	0.0025%	1.0712%	0.0000%	10.4123%	0.0025%
自基金合同生效起至今	24.4543%	0.0037%	1.9079%	0.0000%	22.5464%	0.0037%

3. 易方达天天理财货币R:

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	0.3521%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.3229%	0.0002%
过去三个月	1.0732%	0.0003%	0.0885%	0.0000%	0.9847%	0.0003%
过去六个月	2.1754%	0.0003%	0.1761%	0.0000%	1.9993%	0.0003%
过去一年	4.4073%	0.0004%	0.3555%	0.0000%	4.0518%	0.0004%
过去三年	11.5169%	0.0025%	1.0712%	0.0000%	10.4457%	0.0025%
自基金合同生效起至今	24.5209%	0.0037%	1.9079%	0.0000%	22.6130%	0.0037%

4. 易方达天天理财货币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	0.3315%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.3023%	0.0002%
过去三个月	1.0107%	0.0003%	0.0885%	0.0000%	0.9222%	0.0003%
过去六个月	2.0505%	0.0003%	0.1761%	0.0000%	1.8744%	0.0003%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	2.8220%	0.0006%	0.2433%	0.0000%	2.5787%	0.0006%

注:自2017年10月23日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年10月24日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

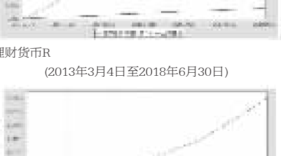
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达天天理财货币市场基金

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

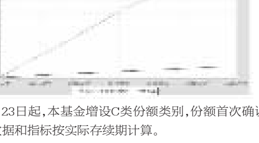
1、易方达天天理财货币A

(2013年3月4日至2018年6月30日)



3、易方达天天理财货币R

(2013年3月4日至2018年6月30日)



注:1.自2017年10月23日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年10月24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22.8776%,B类基金份额净值收益率为24.4543%,R类基金份额净值收益率为24.5209%,同期业绩比较基准收益率为1.9079%。C类基金份额净值收益率为2.8220%,同期业绩比较基准收益率为0.2433%。

§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、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。易方达始终坚持在诚信规范的前提下,通过市场化、专业化的运作,为投资人的资产实现持续稳定的保值增值,成为国内领先的综合性资产管理机构,具有较强的综合实力。易方达是国内为数不多的具有基金公司全部业务牌照的公司之一,拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格,投资业务包括主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资、另类投资等六大板块,为境内外投资者提供个性化、多样化的投资管理服务。截至2018年6月30日,易方达旗下管理的各类资产规模总计1.3万亿元,服务各类客户总数7580万户,公募基金累计分红超过1000亿元。

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		
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、易方达现金增利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、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、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	2013-03-04	-	9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。
刘朝阳	本基金的基金经理、易方达易理财货币市场基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、现金管理部总经理	2016-03-29	-	11年	硕士研究生,曾任南方基金管理有限公司固定收益研究员、交易员、高级策略分析师、基金经理。
梁莹	本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、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、易方达现金增利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、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达财富快线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助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理	2015-02-17	-	8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。
易珎	本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、易方达现金增利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、易方达双月利理财债券型证券投资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	2018-06-20	-	8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.此处的"离任日期"为公告确定的解聘日期,石大怿的"任职日期"为基金合同生效之日,刘朝阳、梁莹、易珎的"任职日期"为公告确定的聘任日期。

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66次,其中64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;2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

2018年一季度,国内债券市场收益率先上后下。1月份,国内经济数据表现良好,市场对于经济走势的乐观预期升温,叠加监管趋严以及权益市场上涨的因素,债券利率不断走高。进入2月初开始,海外资本市场出现了较大幅度的波动,市场风险偏好有所下行。之后在大宗商品库存积累价格下跌、中美贸易摩擦进一步升温,以及融资条件收紧等多重因素刺激下,市场对于未来经济预期转向悲观。此外,货币市场流动性也持续处于宽松状态,债券收益率快速下行,信用利差普遍收窄。2018年二季度债券市场继续回暖,收益率显著下行。4月份,国内经济数据的回落,以及央行的降准操作使得市场资金面维持稳定。加上中美贸易摩擦的不断加剧、叙利亚问题等外部因素令风险资产持续承压,国内债券市场收益率下行显著。5月份,在降准利好兑现、信用债违约事件频发、海外无风险收益率走高、国内经济数据反弹等因素的叠加下,国内债券市场利率出现短期调整。进入6月份,央行半年末时点对市场资金面呵护有加,流动性整体平稳。临近季末,在贸易摩擦及股市下挫带动避险情绪升级的大背景下,债市继续走强,无风险收益率再次大幅回落。上半年货币市场利率呈现稳步下行的趋势,货币市场基金收益率有所下行。

报告期内本基金以同业存单、同业存款作为主要配置资产,维持了中性偏长的剩余期限,保持了一定的杠杆率。本基金抓住了同业存单、同业存款季节性收益率走高的时点,提高了长久期资产的配置比例,在保持较好流动性的同时,为投资者提供了较好的收益。

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2.0490%;B类基金份额净值收益率为2.1703%;R类基金份额净值收益率为2.1754%;C类基金份额净值收益率为2.0505%;同期业绩比较基准收益率为0.1761%。

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,虽然中美贸易战为全球经济都带来了极大的不确定性,但国内自身经济基本面的后续走势,将会是国内债券市场最为核心的驱动变量。2018年上半年在金融去杠杆的监管高压下,非标类资产被压缩使得融资供给收缩,进而融资需求也受到抑制,由此带来经济的下滑和未来的内生需求缩导致社融的不断萎缩和利率的不断下滑。从近期微观经济数据和政策面分析,经济下行风险依然存在。首先,贸易摩擦升级将带来最大的下行风险;其次,强监管叠加去杠杆可能会导致政策收缩过于严厉,信用持续收缩;第三,对冲经济下行压力的政策是否可以取得实质性进展,宽松的货币政策能否引流资金流入实体,目前看效果尚不明显,后续需要密切跟踪经济基本面的走势,以及市场对于悲观预期的修复情况。

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中性偏长的组合期限。基金投资类属配置将以同业存款、同业存单、逆回购、金融债和信用资质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、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、投资风险管理部、监察稽核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,由中央国债登记结算有限责任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《易方达天天理财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

本报告期内,本基金托管人在对易方达天天理财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,易方达天天理财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天天理财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》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的易方达天天理财货币市场基金2018年半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:易方达天天理财货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	43,259,681,823.62	29,724,968,834.61
结算备付金	65,000,909.09	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	36,607,150,600.30	30,585,382,490.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	36,607,150,600.30	30,585,382,490.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	11,757,341,857.18	12,220,566,767.35
应收证券清算款	1,713,627.28	-
应收利息	341,016,315.77	292,908,674.67
应收股利	-	-
应收申购款	548,476,847.81	738,698,998.33
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	30,000.00
资产总计	92,580,381,981.05	73,562,555,764.96
负债和所有者权益	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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	6,428,093,313.58	4,635,206,759.88
应付证券清算款	198,858,930.43	-
应付赎回款	44,538,124.59	165,992,613.57
应付管理人报酬	24,436,913.47	21,824,976.85
应付托管费	7,405,125.28	6,613,629.36
应付销售服务费	10,940,119.14	8,419,790.25
应付交易费用	280,030.99	294,597.18
应交税费	9,292.63	-
应付利息	2,959,817.49	4,129,790.66
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	465,248.31	454,072.73
负债合计	6,717,986,915.91	4,842,936,230.48
所有者权益:		
实收基金	85,862,395,065.14	68,719,619,534.48
未分配利润	-	-
所有者权益合计	85,862,395,065.14	68,719,619,534.48
负债和所有者权益总计	92,580,381,981.05	73,562,555,764.96

注:报告截止日2018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,R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85,862,395,065.14份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额48,029,678,957.11份,B类基金份额总额34,471,743,102.87份,R类基金份额总额3,049,630,013.98份,C类基金份额总额311,342,991.18份。

6.2 利润表

会计主体:易方达天天理财货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	1,969,045,459.35	1,142,413,716.97
1.利息收入	1,970,779,582.30	1,220,820,422.52
其中:存款利息收入	997,698,598.75	681,046,073.25
债券利息收入	729,195,613.42	402,697,532.84
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	243,885,370.13	137,076,816.43
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,734,122.95	-78,406,705.55
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,734,122.95	-78,406,705.55
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	304,196,062.31	191,324,429.70
1. 管理人报酬	131,010,205.69	78,462,693.56
2. 托管费	39,700,062.29	23,776,573.82
3. 销售服务费	57,308,016.83	27,929,847.93
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	75,855,751.95	60,831,370.66
其中:卖出回购金融资产支出	75,855,751.95	60,831,370.66
6. 税金及附加	2,257.61	-
7. 其他费用	319,767.94	323,943.73
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,664,849,397.04	951,089,287.27
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,664,849,397.04	951,089,287.27

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:易方达天天理财货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 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)	68,719,619,534.48	-	68,719,619,534.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,664,849,397.04	1,664,849,397.04
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)	17,142,775,530.66	-	17,142,775,530.66
其中:1.基金申购款	206,840,204,834.69	-	206,840,204,834.69
2.基金赎回款	-189,697,429,304.03	-	-189,697,429,304.03
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)	-	-1,664,849,397.04	-1,664,849,397.04
五、期末所有者权益(基金净值)	85,862,395,065.14	-	85,862,395,065.14
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	36,691,262,432.80	-	36,691,262,432.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	951,089,287.27	951,089,287.27
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)	32,676,783,888.76	-	32,676,783,888.76
其中:1.基金申购款	139,081,946,595.75	-	139,081,946,595.75
2.基金赎回款	-106,405,162,706.99	-	-106,405,162,706.99
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)	-	-951,089,287.27	-951,089,287.27
五、期末所有者权益(基金净值)	69,368,046,321.56	-	69,368,046,321.56

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

易方达天天理财货币市场基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]1634号《关于核准易方达天天理财货币市场基金募集的批复》核准,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《易方达天天理财货币市场基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达天天理财货币市场基金基金合同》于2013年3月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为3,860,179,631.65份基金份额,其中认购资金利息折合598,679.00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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自2017年10月23日起,本基金增设C类份额类别,份额首次确认日为2017年10月24日。

6.4.2会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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〉》及其他中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的相关规定和指引。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

(1)印花税

证券(股票)交易印花税税率为1‰,由出让方缴纳。

(2)增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定,经国务院批准,自2016年5月1日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点,金融业纳入试点范围,由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让,按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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、债券的转让收入免征增值税;国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税;存款利息收入不征收增值税;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46号文《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》的规定,金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定,金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入;

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140号文《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》的规定,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税,资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在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,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,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;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、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股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、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。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%和2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3)企业所得税

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。

(4)个人所得税

个人所得税税率为20%。

基金从上市公司分配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,减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,减按25%计入应纳税所得额;自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

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
中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")	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、基金销售机构
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
广东省易方达教育基金会	基金管理人发起的教育基金会
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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	131,010,205.69	78,462,693.56
其中:支付销售机构的客户维护费	24,206,328.71	13,874,759.59

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。基金管理人和基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月前3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、公休假或不可抗力等,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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	39,700,062.29	23,776,573.82

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的,0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.1%÷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。基金管理人和基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等,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 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				
	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R	易方达天天理财货币C	合计
易方达基金管理有限公司	12,058,944.48	1,434,134.79	-	-	13,493,079.27
中国工商银行	3,872,085.12	18,487.40	-	-	3,890,572.52
广发证券	26,351.92	2,946.20	-	-	29,298.12
合计	15,957,381.52	1,455,568.39	-	-	17,412,949.91

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期发生的基金应支付的销售服务费				
	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R	易方达天天理财货币C	合计
易方达基金管理有限公司	3,961,020.73	1,101,083.65	-	-	5,062,104.38
中国工商银行	2,960,531.73	12,715.59	-	-	2,973,247.32
广发证券	-	-	-	-	-
合计	6,921,552.46	1,113,799.24	-	-	8,035,351.70

注:本基金A类、C类基金份额的销售服务费年费率为0.25%;本基金B类基金份额的销售服务费年费率为0.01%;本基金R类基金份额的销售服务费年费率为0;销售服务费的计算方法如下:

H=E×销售服务费率÷当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

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。基金管理人和基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月前3个工作日内从基金资产中划出,经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等,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 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
中国工商银行	-	-	-	-	7,512,013,000.00	2,808,550.05

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国工商银行	1,099,566,528.57	849,255,215.21	-	-	3,600,819,000.00	1,327,631.90

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

份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日				上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R	易方达天天理财货币C	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R	易方达天天理财货币C
报告期初持有的基金份额	-	43,401,811.50	-	-	-	747,354,072.95	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	254,724,511.47	-	-	-	495,256,443.31	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	290,000,000.00	-	-	-	470,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	8,126,322.97	-	-	-	772,610,516.26	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.02%	-	-	-	2.04%	-	-

注:基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

易方达天天理财货币A

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017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
广发期货有限公司	60,068,655.01	0.13%	-	-
易方达资产管理有限公司	11,002,214.88	0.02%	-	-
广东省易方达教育基金会	1,059,091.84	0.00%	1,037,701.48	0.00%

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及更新的招募说明书的有关规定支付。广发期货有限公司是基金管理人股东广发证券控制的机构。

易方达天天理财货币B

份额单位:份

关联方名称	本期末 2018年6月30日		上年度末 2017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
广发期货有限公司	20,024,277.32	0.06%	-	-
广东省易方达教育基金会	-	-	2,673,481.25	0.01%
广东新三联投资发展有限公司	-	-	193,506,216.62	0.64%
粤财信托	72,594,236.85	0.21%	99,996,411.91	0.33%
广发基金管理有限公司	51,918,128.44	0.15%	50,808,802.08	0.17%

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及更新的招募说明书的有关规定支付。广发期货有限公司、广发基金管理有限公司是基金管理人股东广发证券控制的机构。

易方达天天理财货币R

无。

易方达天天理财货币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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
中国工商银行-活期存款	1,681,823.62	242,840.39	1,629,298.58	65,257.74
中国工商银行-定期存款	-	-	-	7,102,472.21

注:本基金的上述银行存款由基金托管人中国工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。

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(2018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2018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6,428,093,313.58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
111808161	18中信银行CD161	2018-07-02	99.17	5,681,000	563,390,545.58
111820124	18广发银行CD124	2018-07-02	99.17	9,488,000	940,923,507.20
130421	13农发21	2018-07-02	100.34	1,500,000	150,514,187.84
130434	13农发34	2018-07-02	100.88	500,000	50,440,168.89
150315	15进出15	2018-07-02	99.59	2,662,000	265,097,629.91
150317	15进出17	2018-07-02	99.93	200,000	19,986,711.63
160301	16进出01	2018-07-02	99.18	500,000	49,590,812.31
170211	17国开11	2018-07-02	100.16	800,000	80,126,749.65
180306	18进出06	2018-07-02	99.58	500,000	49,787,787.08
180308	18进出08	2018-07-02	99.44	2,000,000	198,872,439.17
170413	17农发13	2018-07-03	99.97	5,589,000	558,712,745.33
180404	18农发04	2018-07-03	100.21	3,647,000	365,464,306.42
180407	18农发07	2018-07-03	99.93	4,000,000	399,734,372.54
111806157	18交通银行CD157	2018-07-04	99.10	613,000	60,749,601.94
111808161	18中信银行CD161	2018-07-04	99.17	3,410,000	338,173,166.77
150315	15进出15	2018-07-04	99.59	338,000	33,660,029.64
170410	17农发10	2018-07-04	99.98	7,800,000	779,831,199.39
170413	17农发13	2018-07-04	99.97	3,311,000	330,989,067.77
180301	18进出01	2018-07-04	100.15	2,600,000	260,394,678.30
180404	18农发04	2018-07-04	100.21	12,153,000	1,217,846,919.63
合计				67,292,000	6,714,286,626.99

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2018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2018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36,607,150,600.30元,无属于第一或第三层次的余额(2017年12月31日:第二层次30,585,382,490.00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2018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(2017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	36,607,150,600.30	39.54
	其中:债券	36,607,150,600.30	39.54
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	11,757,341,857.18	12.70
	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	43,324,682,732.71	46.80
4	其他各项资产	891,206,790.86	0.96
5	合计	92,580,381,981.05	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		6.51
	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	6,428,093,313.58	7.49
	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	110
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

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	11.14	7.72
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	6.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	49.71	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	2.11	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	36.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.79	7.72

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,811,049,805.50	5.60
	其中:政策性金融债	4,811,049,805.50	5.60
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,281,920.88	0.12
6	中期票据	-	-
7	同业存单	31,695,818,873.92	36.91
8	其他	-	-
9	合计	36,607,150,600.30	42.63
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	180404	18农发04	15,800,000	1,583,311,226.05	1.84
2	111808161	18中信银行CD161	11,000,000	1,090,881,183.14	1.27
3	111806142	18交通银行CD142	10,000,000	993,904,417.40	1.16
4	111820124	18广发银行CD124	10,000,000	991,698,468.80	1.15
5	111807132	18招商银行CD132	10,000,000	991,405,284.28	1.15
6	111713098	17浙商银行CD098	10,000,000	990,887,650.43	1.15
7	170413	17农发13	8,900,000	889,701,813.10	1.04
8	111808170	18中信银行CD170	9,000,000	881,431,008.08	1.03
9	111816182	18上海银行CD182	8,000,000	793,047,032.87	0.92
10	111810296	18兴业银行CD296	8,000,000	792,329,773.74	0.92

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	0.1209%
报告期内偏离度的最低值	0.0126%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0420%

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

7.9.2 18中信银行CD161(代码:111808161)、18中信银行CD170(代码:111808170)为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。2017年11月29日,中国保监会针对中信银行股份有限公司信用卡中心存在电话销售欺骗投保人的违法行为,处以人民币12万元行政罚款。

18上海银行CD182(代码:111816182)为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。2017年7月19日,上海银监局针对2015年,经上海银行批准,辖属天津分行在他行撤销远期购买承诺的情况下,继续持有某信托受益权,未按规定严格审查基础资产投向,信托资金违规用于异地融资平台的违法违规事实,责令上海银行改正,并处以人民币50万元行政处罚。2018年1月4日,上海银监局针对2015年上海银行对底层资产为非标准化债权资产的投资授前尽职调查严重不审慎,部分理财资金用于增资和缴交土地出让金,与合同约定用途不一致的违法违规事实,责令上海银行改正,并处以人民币50万元行政处罚。

18招商银行CD132(代码:111807132)为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。2018年2月12日,中国银监会针对招商银行股份有限公司的如下事由罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。

18兴业银行CD296(代码:111810296)为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。2018年3月26日,中国人民银行福州中心支行针对兴业银行股份有限公司违反国库管理规定的违法行为,给予警告并处罚款5万元人民币。2018年4月19日,中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行股份有限公司的如下事由罚款5870万元:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

18广发银行CD124 (代码:111820124)为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。2017年11月17日,中国银监会针对广发银行的如下事由给予警告,没收违法所得人民币17553.79万元,并处3倍罚款人民币52661.37万元,对其他违规行为罚款人民币2000万元,罚没合计人民币72215.16万元:(一)出具与事实不符的金融票证;(二)未尽职审查保理业务贸易背景真实性;(三)内控管理严重违反审慎经营规则;(四)劳务派遣用工管理不到位;(五)对押品评估费用管理不到位;(六)未向监管部门报告风险信息;(七)未向监管部门报告重要信息系统突发事件;(八)会计核算管理薄弱;(九)信息系统与业务流程控制未按规定执行;(十)流动资金贷款用途监督不到位,未尽职审查银行承兑汇票贸易背景真实性;(十一)以流动资金贷款科目向房地产开发企业发放贷款;(十二)报送监管数据不真实。2018年5月31日,中国保监会广东监管局针对广发银行股份有限公司信用卡中心电销工作人员使用不实表述向投保人促销、电销工作人员未告知保险合同重要情况的违法违规事实,责令改正并处以人民币合计46万元行政处罚。

本基金投资18中信银行CD161、18中信银行CD170、18上海银行CD182、18招商银行CD132、18兴业银行CD296、18广发银行CD124的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除18中信银行CD161、18中信银行CD170、18上海银行CD182、18招商银行CD132、18兴业银行CD296、18广发银行CD124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	1,713,627.28
3	应收利息	341,016,315.77
4	应收申购款	548,476,847.81
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	891,206,790.86

§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
易方达天天理财货币A	3,116,861	15,409.63	1,612,871,653.45	3.36%	46,416,807,303.66	96.64%
易方达天天理财货币B	625	55,154,788.96	32,540,247,292.45	94.40%	1,931,495,810.42	5.60%
易方达天天理财货币R	387	7,880,180.91	2,991,248,922.39	98.09%	58,381,091.59	1.91%
易方达天天理财货币C	12,725	24,467.03	0.00	0.00%	311,342,991.18	100.00%
合计	3,130,598	27,426.84	37,144,367,868.29	43.26%	48,718,027,196.85	56.74%

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	银行类机构	2,091,771,114.73	2.44%
2	银行类机构	1,349,439,669.83	1.57%
3	银行类机构	1,228,941,729.94	1.43%
4	银行类机构	937,952,727.97	1.09%
5	基金类机构	901,667,272.23	1.05%
6	信托类机构	768,067,027.25	0.89%
7	银行类机构	714,190,499.81	0.83%
8	银行类机构	710,032,646.91	0.83%
9	其他机构	708,852,529.69	0.83%
10	银行类机构	704,790,560.79	0.82%

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	易方达天天理财货币A	9,094,318.36	0.0189%
	易方达天天理财货币B	0.00	0.0000%
	易方达天天理财货币R	0.00	0.0000%
	易方达天天理财货币C	0.00	0.0000%
	合计	9,094,318.36	0.0106%

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	易方达天天理财货币A	10~50
	易方达天天理财货币B	0
	易方达天天理财货币R	0
	易方达天天理财货币C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达天天理财货币A	0~10
	易方达天天理财货币B	0
	易方达天天理财货币R	0
	易方达天天理财货币C	0
	合计	0~10

§9开放式基金份额变动

单位:份

项目	易方达天天理财货币A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R	易方达天天理财货币C
基金合同生效日(2013年3月4日)基金份额总额	3,017,838,433.09	841,741,198.56	600,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	36,160,184,301.22	30,249,045,508.55	2,287,844,823.16	22,544,901.55
本报告期基金总申购份额	160,195,366,661.88	40,352,832,310.63	5,406,102,913.86	886,227,713.73
减:本报告期基金总赎回份额	148,325,872,005.99	36,130,134,716.31	4,644,317,723.04	597,429,624.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	48,029,678,957.11	34,471,743,102.87	3,049,630,013.98	311,342,991.18

§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

本基金管理人于2018年6月8日发布公告,自2018年6月8日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官(副总经理级),聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官(副总经理级)。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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	
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-

注:a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增国盛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
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	45,706,600,000.00	100.00%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

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

二〇一八年八月二十八日