

# 易方达天天理财货币基金

## 2014半年度报告摘要

易方达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：二〇一四年八月二十七日

### 1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、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。

基金管理人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2014年8月21日编制了本报告期内财务数据、净值表现、利润分配情况、投资组合报告等内容，保证报告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预示其未来表现，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，应阅读半年度报告全文。

本报告期内无诉讼、仲裁事项及行政处罚事项。

### 2 基金简介

基金名称	易方达天天理财货币
基金代码	000009
基金运作方式	契约型开放式
基金存续期限	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
基金合同生效日期	8,802,332,304.00
基金合同存续期	不定期
下属分级基金名称	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
下属分级基金的代码	000009 000010 000013
报告期末下属分级基金的资产总额	8,033,888,857.53 767,804,668.27 638,778.60

### 3 基金产品说明

投资目标	有效控制投资风险和保持较高流动性的基础上，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，通过短期金融工具积极投资，在有效控制投资风险和保持较高流动性的基础上，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，即活期存款基准利率×(1-利息税率)
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种。本基金的风险收益特征为低风险、低收益、低波动、低回撤。

### 4 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	魏臻	姜宝义
信息 披露 负责人	魏臻	姜宝义
联系电话	020-38797888	010-66105799
电子邮箱	cs@efunds.com.cn	cs@icbc.com.cn
客户服务电话	400 881 8088	95588
传真	020-38794868	010-66105798

### 5 信息披露方式

披露基金半年度报告正文支付管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市徐汇区江西路33号东方财富广场43楼

### 6 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标和基金净值表现	报告期末(2014年6月30日)	报告期末(2014年6月30日)	报告期末(2014年6月30日)
3.1.1 期间数据和指标	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
本期已实现收益	170,899,829.05	50,649,997.31	17,449.83
本期公允价值变动收益	170,899,829.05	50,649,997.31	17,449.83
本期净收益	2,628.01	2,801.34	2,808.51
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	报告期末(2014年6月30日)	报告期末(2014年6月30日)
期末基金资产净值	8,033,888,857.53	767,804,668.27	638,778.60
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.本基金收益分配是按月结转的。			
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	基金份额净值收益率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③
过去一个月	0.4131%	0.0087%	0.0022%
过去三个月	1.2320%	0.0053%	0.0088%
过去六个月	2.6803%	0.0042%	0.1760%
过去一年	4.9825%	0.0037%	0.3549%
过去三年	0.4131%	0.0087%	0.0022%
自基金合同生效起至今	6.4188%	0.0042%	0.4707%
2. 易方达天天理财货币B：			
阶段	基金份额净值收益率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③
过去一个月	0.4331%	0.0087%	0.0022%
过去三个月	1.2922%	0.0053%	0.0088%
过去六个月	2.8043%	0.0042%	0.1760%
过去一年	5.2314%	0.0037%	0.3549%
过去三年	0.4331%	0.0087%	0.0022%
自基金合同生效起至今	6.4480%	0.0042%	0.4707%
3. 易方达天天理财货币R：			
阶段	基金份额净值收益率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③
过去一个月	0.4330%	0.0087%	0.0022%
过去三个月	1.2947%	0.0053%	0.0088%
过去六个月	2.8068%	0.0042%	0.1760%
过去一年	5.2428%	0.0037%	0.3549%
过去三年	0.4330%	0.0087%	0.0022%
自基金合同生效起至今	6.4631%	0.0042%	0.4707%

### 7 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 8 基金托管人

注：1.本基金托管人中国工商银行股份有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 9 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 10 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 11 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 12 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 13 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 14 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 15 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 16 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 17 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 18 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 19 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 20 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 21 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 22 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 23 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 24 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 25 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 26 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 27 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 28 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 29 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 30 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 31 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 32 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 33 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 34 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 35 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 36 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 37 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 38 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 39 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 40 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 41 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 42 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 43 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 44 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 45 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 46 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 47 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 48 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

### 49 基金管理人及基金托管人

注：1.本基金管理人易方达基金管理有限公司，在报告期内不存在违法违规行为，不存在被中国证监会采取行政监管措施或受到行政处罚的情况。

报告期末的基金资产净值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	105
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

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”，本报告期内，本基金投资组合平均剩余期限未超过120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(%)	各期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	34.55	10.61
2	30天(含)—60天	—	—
3	60天(含)—90天	19.78	—
4	90天(含)—180天	11.64	—
5	180天(含)—397天(含)	25.14	—
6	合计	107.92	10.61

7.4期末按投资组合品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国债	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	939,367,655.14	10.67
4	企业债券	889,169,142.28	10.10
5	企业短期融资券	3,479,336,861.83	39.53
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	4,418,504,516.97	50.20
9	报告期内投资组合平均剩余期限	70,181,048.48	0.80

7.5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

序号	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	140416	141616	218,117,997.09	2.48
2	090306	090306	1,000,000,000.00	11.26
3	01141504	141504	1,600,000,000.00	18.12
4	130236	130236	1,500,000,000.00	16.96
5	04140809	140809	1,500,000,000.00	16.96
6	140207	140207	1,400,000,000.00	15.61
7	04140207	140207	1,200,000,000.00	13.57
8	01141002	140202	1,200,000,000.00	13.57
9	04140304	140304	1,000,000,000.00	11.26
10	04140306	130306	1,000,000,000.00	11.26

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%—0.50%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	-0.3628%
报告期内偏离度的最低值	-0.0271%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0952%

7.7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

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	140905	140905	500,000	500,000,000.00	0.57

7.8 投资组合报告附注

7.8.1基金计价方法说明

本基金目前投资品种的估值方法如下：

(1) 基金持有的债券(含资产支持证券)按实际支付价款(含交易费用)确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及公允价值。每日计提利息。

(2) 基金持有的股票、权证、资产支持证券等，按实际利率在持有期间逐日计提利息；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) 基金持有的银行理财产品按公允价值列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如确定按摊余成本法列示的银行理财产品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价值估值。

如新增事项，按国家最新规定估值。

7.8.2基金资产报告期内不存在剩余期限小于397天或剩余存续期超过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0%的情况。

7.8.3基金资产报告期内无十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、处罚的情况。

7.8.4期末其他各项资产构成

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	639,788,542.48
4	应收申购款	130,571,747.79
5	其他应收款	126,197,784.49
6	预付款项	—
7	其他	—
8	合计	896,558,074.76

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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占比比例(%)
1	140316	14渣出16	2,200,000	218,117,997.09	2.48
2	090306	09渣出06	1,900,000	190,427,665.78	2.16
3	011415004	14中银业SCP004	1,600,000	160,067,782.69	1.82