易方达岁丰添利债券型证券投资基金

【2016】第四季度报告

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
报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达岁丰添利债券(LOF)
场内简称	易基岁丰
基金主代码	161115
交易代码	161115
基金运作方式	契约型,本基金合同生效后三年内(含三年)封闭运作,在深圳证券交易所上市交易。封闭期结束后,本基金转为上市开放式基金(LOF)。
基金合同生效日	2010年11月9日
报告期末基金份额总额	4,032,034,967.26份
投资目标	本基金通过主要投资债券品种,力争为基金持有人提供持续稳定的高于业绩比较基准的收益,实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金基于对以下因素的判断,进行基金资产在非货币类固定收益品种(国债、央行票据等)、信用类固定收益品种(含可转换债券)、新股(含增发)中购之间的配置:1)基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析,预期固定收益品种的投资收益和风险;2)基于对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析,考察其对固定收益市场信用利差的影响;3)基于可转换债券发行公司的基本面,债券利率水平、票息率及溢息频率、信用风险等固定收益因素,以及期权定价模型,对可转换债券进行定价分析并制定相关投资策略;4)基于对新股(含增发股)发行频率、中签率、上市后的平均涨幅等的分析,预测新股(含增发股)中购的收益率以及风险。
业绩比较基准	三年期银行定期存款收益率+1.2%
风险收益特征	本基金为债券型基金,理论上其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金、股票型基金,高于货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	32,062,613.75
2.本期利润	-119,321,054.78
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0385
4.期末基金资产净值	7,033,977,536.94
5.期末基金份额净值	1.745

注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或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.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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

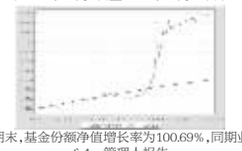
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.36%	0.11%	0.99%	0.01%	-2.35%	0.10%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达岁丰添利债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年11月9日至2016年12月31日)



注:自基金合同生效至报告期末,基金份额净值增长率为100.69%,同期业绩比较基准收益率为31.90%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张凯	本基金的基金经理、易方达稳鑫债券型证券投资基金的基金经理、易方达双债增强债券型证券投资基金的基金经理、易方达聚盈分级债券型发起式证券投资基金的基金经理、易方达恒久添利1年定期开放债券型证券投资基金的基金经理、易方达高等级信用债债券型证券投资基金的基金经理、固定收益基金投资部总经理助理	2015-06-13	-	10年	硕士研究生。曾任泰康人寿保险公司资产管理中心固定收益部研究员、投资经理,新华资产管理公司固定收益部高级投资经理。易方达基金管理有限公司固定收益部投资经理。

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。

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,本基金运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

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12次,皆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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度,在国内外多重因素影响之下国内债券市场出现了深度调整。国外方面,11月初美国大选后,新一任总统宣布大规模基建和减税措施后通胀预期上升,推动美国国债利率上升和美元的快速升值。人民币汇率在此影响下被动贬值,资金加速流出。而国内货币政策转向防范地产泡沫和抑制金融杠杆,并未对外汇流出及时对冲,导致国内流动性趋紧,短期利率快速上升。国内方面,三季度以来基本面也出现边际好转态势,前期支撑经济的主要动力基建投资仍然保持稳定。尽管房地产销售下滑,但是由于库存较低,房地产投资和新开工数据反而有所上升。持续下滑的制造业投资数据也在四季度出现了边际回暖迹象,大宗商品价格的持续上涨带来的补库存需求也对经济产生正面提振作用。另一方面,中央经济工作会议提出货币政策稳健中性、着力防控资产泡沫的要求,加剧了市场对于货币政策转向的担忧。此外,从市场结构来看,过去两年债券市场的上涨吸引了大量资金进入,产生较大的配置压力,期限利差和信用利差都相对较低,交易较为拥挤,因此在出现外部流动性冲击后市场回调较为明显。12月下旬汇率贬值压力减轻,央行投放流动性后市场情绪出现缓解,短期收益率和长期收益率出现快速下行,信用债调整较为缓慢,信用利差扩大。

权益方面,四季度以来由于国内经济基本面持续改善,在大宗商品价格大幅上涨以及保险资金频繁举牌带动下,股票市场出现一波明显上涨。但是进入12月由于国内流动性冲击以及保险资金监管的影响,权益市场也出现了快速回调。整体来看,四季度权益市场宽幅震荡,并无明显趋势。

本基金在四季度的债券投资继续维持相对合理的久期和组合杠杆,减持部分久期较长和资质相对较差的品种,以获取持有期收益为主要目标,维持组合流动性,并时刻关注信用风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.745元,本报告期份额净值增长率为-1.36%,同期业绩比较基准收益率为0.99%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	10,387,539.50	0.14
	其中:股票	10,387,539.50	0.14
2	固定收益投资	7,216,225,027.88	98.28
	其中:债券	7,216,225,027.88	98.28
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	19,867,796.67	0.27
7	其他资产	96,378,073.73	1.31
8	合计	7,342,858,427.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	10,387,539.50	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,387,539.50	0.15

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002583	海能达	460,460	5,342,337.00	0.08
2	002572	索菲亚	94,250	5,045,202.50	0.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	370,953,000.00	5.27
	其中:政策性金融债	370,953,000.00	5.27
4	企业债券	2,152,149,006.28	30.60
5	企业短期融资券	2,696,328,000.00	38.33
6	中期票据	1,985,855,000.00	28.23
7	可转债(可交换债)	10,924,022.60	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,216,225,027.88	102.59

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	011698774	16陕延投ZCP006	4,000,000	396,760,000.00	5.64
2	011698730	16中色ZCP002	3,000,000	298,350,000.00	4.24
3	101684100	16保利地产MTN001	3,000,000	289,020,000.00	4.11
4	136813	16中电02	3,000,000	285,270,000.00	4.06
5	140238	14国开08	2,100,000	211,260,000.00	3.00

5.6 报告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。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	86,671.90
2	应收证券清算款	2,059,779.49
3	应收股利	-
4	应收利息	94,220,069.64
5	应收申购款	11,562.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,378,073.73

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	7,128,989.00	0.10
2	110035	白云转债	2,491,200.00	0.04
3	110032	三一转债	1,105,200.00	0.02

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002583	海能达	5,342,337.00	0.08	非公开发行流通受限
2	002572	索菲亚	5,045,202.50	0.07	非公开发行流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	131,909,134.73
报告期基金总申购份额	3,970,958,362.02
减:报告期基金总赎回份额	70,832,529.50
报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	4,032,034,967.26

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达岁丰添利债券型证券投资基金募集的文件;

2.《易方达岁丰添利债券型证券投资基金基金合同》;

3.《易方达岁丰添利债券型证券投资基金托管协议》;

4.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一七年一月二十日

易方达天天理财货币市场基金

【2016】第四季度报告

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
报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	36,691,282,432.86份
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。
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
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
下属分级基金的交易代码	000009 / 000010 / 000013
报告期末下属分级基金的份额总额	16,172,983,746.83份 / 18,900,448,406.16份 / 1,617,830,279.81份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日-2016年12月31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
1.本期已实现收益	115,866,990.93	211,585,269.63	23,297,868.31
2.本期利润	115,866,990.93	211,585,269.63	23,297,868.31
3.期末基金资产净值	16,172,983,746.83	18,900,448,406.16	1,617,830,279.81

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 本报告期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

易方达天天理财货币A

阶段	净值收益率①	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	0.6636%	0.0011%	0.0895%	0.0000%	0.5741%	0.0011%

易方达天天理财货币B

阶段	净值收益率①	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	0.7244%	0.0011%	0.0895%	0.0000%	0.6349%	0.0011%

易方达天天理财货币R

阶段	净值收益率①	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	0.7270%	0.0011%	0.0895%	0.0000%	0.6375%	0.0011%

3.2.2自基金合同生效以来基金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

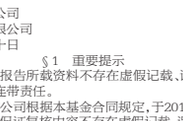
易方达天天理财货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

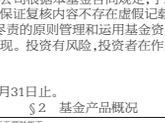
(2013年3月4日至2016年12月31日)

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



注:自基金合同生效至报告期末,A类基金份额净值收益率为15.7665%,B类基金份额净值收益率为16.8326%,R类基金份额净值收益率为16.8776%,同期业绩比较基准收益率为1.3684%。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、易方达财富快钱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、易方达鑫鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理助理	2013-03-04	-	7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、易方达财富快钱货币市场基金的基金经理、现金管理部总经理	2016-03-29	-	9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。

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 公平交易专项说明

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12次,皆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。

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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度,在国内外多重因素影响之下国内债券市场出现了深度调整。11月初美国大选结束,在新一任总统宣布大规模基建和减税措施后,通胀预期的迅速上升推动美国国债利率迅速上升、美元快速升值。人民币汇率在此影响下被动贬值,资金加速流出。中央经济工作会议提出货币政策要保持稳健中性,着力防控资产泡沫。在此背景之下国内货币政策并未对外汇流出进行及时对冲,这导致国内流动性趋紧,短期利率快速上升。三季度以来,我国经济基本面在边际上出现了好转的态势,前期支持经济的主要动力基建投资仍然保持稳定。尽管房地产销售量下滑,但是由于库存较低,房地产投资和新开工数据反而有所上升。持续下滑的制造业投资数据也在四季度出现了回暖,大宗商品价格持续上涨带来的补库存需求也对经济产生正面提振作用。一方面是市场对于货币政策转向的担忧有所加剧,另一方面由于过去两年债券市场的牛市吸引了大量资金进入,机构配置压力较大,债券资产的期限利差和信用利差都相对较低。交易较为拥挤的债券市场在出现外部流动性冲击后发生了较为剧烈的调整,货币市场利率快速飙升。12月下旬,人民币汇率贬值压力减轻,市场情绪在央行投放流动性后出现缓解,短期和长期收益率均出现快速下行。年末货币市场利率飙升,短期内给全市场货币类基金的投资运作带来了一定的压力,但本基金在运作的过程中,始终严格控制组合久期,并在货币市场巨幅调整之前进行了降低久期的调仓操作,在年末保持了大量的现金到期用于再投资,在四季度保持了组合的高流动性和高安全性,也为投资者创造了较好的投资收益。

报告期内本基金以同业存单、银行存款、逆回购为主要配置资产,降低了同业存单、短期融资券的配置比例,保持了组合中等的平均剩余期限,并维持了较低的杠杆率。在保持收益率稳定的同时为投资者提供了较高的流动性。

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0.6636%;B类基金份额净值收益率为0.7316%;同期业绩比较基准收益率为0.3456%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	9,094,007,585.53	23.20
	其中:债券	9,094,007,585.53	23.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,389,727,131.29	18.85
	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	22,073,680.40906	56.31
4	其他资产	641,038,460.54	1.64
5	合计	39,198,453,585.41	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	9.25	
	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	2,386,124,209.93	6.53
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期未投资组合平均剩余期限	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

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。

5.3.2 报告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	28.26	6.53
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	10.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.81	-
3	60天(含)-90天	14.50	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	22.54	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天(含)	28.74	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.09	6.53

5.4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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,950,184,385.15	8.04
	其中:政策性金融债	2,950,184,385.15	8.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	368,474,339.00	1.00
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,775,348,862.38	15.74
8	其他	-	-
9	合计	9,094,007,585.53	24.79
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	298,926,122.54	0.81

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111609501	16浦发CD501	20,000,000	1,950,172,923.07	5.32
2	160401	16农发01	14,100,000	1,409,979,633.46	3.84
3	111609294	16浦发CD294	10,000,000	984,166,279.12	2.68
4	111609600	16浦发CD600	7,000,000	683,370,236.63	1.86
5	160414	16农发14	6,700,000	670,631,749.43	1.83
6	111608256	16中信CD256	5,000,000	493,287,588.14	1.34
7	150315	15进出15	3,000,000	298,926,122.54	0.81
8	041659011	16永煤CP001	3,000,000	298,298,008.06	0.81
9	111610331	16兴业CD331	3,000,000	297,076,160.36	0.81
10	111613106	16浙商CD106	3,000,000	296,206,000.12	0.80

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1081%
报告期内偏离度的最低值	-0.0161%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0691%

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。

5.8报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1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。

5.9.216浦发CD501(代码:111609501)、16浦发CD294(代码:111609294)、16浦发CD500(代码:111609500)为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。2016年6月17日,针对浦发银行在天猫上以虚假价格进行促销的行为,上海市物价局给予警告并处人民币5000元罚款的行政处罚。

本基金投资16浦发CD501、16浦发CD294、16浦发CD500的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除16浦发CD501、16浦发CD294、16浦发CD500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。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	176,993
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	175,635,583.86
4	应收申购款	465,372,699.69
5	其他应收款	30,000.00
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	641,038,460.54

§6 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
报告期期初基金份额总额	17,697,464,936.76	33,026,169,949.90	2,898,500,806.16
报告期基金总申购份额	21,644,086,962.48	22,465,594,277.17	5,667,292,538.36
报告期基金总赎回份额	23,168,568,152.40	36,591,315,820.91	6,947,963,064.71
报告期期末基金份额总额	16,172,983,746.83	18,900,448,406.16	1,617,830,279.81

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2016-10-14	60,000,000.00	60,000,000.00	-
2	红利再投资	2016-10-31	1,961,439.86	1,961,439.86	-
3	申购	2016-11-07	180,000,000.00	180,000,000.00	-
4	红利再投资	2016-11-30	2,182,247.85	2,182,247.85	-
5	赎回	2016-12-09	-60,000,000.00	-60,000,000.00	-
6	赎回	2016-12-20	-200,000,000.00	-200,000,000.00	-
7	赎回	2016-12-27	-30,000,000.00	-30,000,000.00	-
8	红利再投资	2016-12-30	2,242,899.45	2,242,899.45	-
合计			-43,613,412.84	-43,613,412.84	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会核准易方达天天理财货币市场基金募集的文件;

2.《易方达天天理财货币市场基金基金合同》;

3.《易方达天天理财货币市场基金托管协议》;

4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇一七年一月二十日

易方达天天增利货币市场基金

【2016】第四季度报告

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
报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2017年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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