易方达天天理财货币市场基金 2016年年度报告摘要

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:二〇一七年三月三十一日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月27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。安永华明会计师事务所(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2016年1月1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	36,691,262,432.80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

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	010-66105799
	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	010-66105798

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	2016年			2015年			2014年		
	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	533,540,697.11	1,017,474,076.10	101,338,711.34	1,122,031,287.37	273,146,855.41	77,280,029.17	550,874,346.59	115,685,327.66	7,761,819.28
本期利润	533,540,697.11	1,017,474,076.10	101,338,711.34	1,122,031,287.37	273,146,855.41	77,280,029.17	550,874,346.59	115,685,327.66	7,761,819.28
本期净值收益率	2.6160%	2.8630%	2.8733%	3.8913%	4.1410%	4.1514%	5.0788%	5.3296%	5.3401%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末			2015年末			2014年末		
	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A	易方达天天理财货币B	易方达天天理财货币R
期末基金资产净值	16,172,983,746.83	18,900,448,406.16	1,617,830,279.81	29,952,999,999.80	26,906,373,077.62	2,462,964,597.79	29,335,408,923.29	5,576,582,323.74	548,929,672.64
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	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

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
过去三个月	0.6636%	0.0011%	0.0895%	0.0000%	0.5741%	0.0011%
过去六个月	1.2973%	0.0009%	0.1790%	0.0000%	1.1183%	0.0009%
过去一年	2.6160%	0.0010%	0.3565%	0.0000%	2.2595%	0.0010%
过去三年	12.0236%	0.0045%	1.0711%	0.0000%	10.9525%	0.0045%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	15.7665%	0.0043%	1.3684%	0.0000%	14.3981%	0.0043%

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
过去三个月	0.7244%	0.0011%	0.0895%	0.0000%	0.6349%	0.0011%
过去六个月	1.4197%	0.0009%	0.1790%	0.0000%	1.2407%	0.0009%
过去一年	2.8630%	0.0010%	0.3565%	0.0000%	2.5065%	0.0010%
过去三年	12.8318%	0.0045%	1.0711%	0.0000%	11.7607%	0.0045%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.8326%	0.0043%	1.3684%	0.0000%	15.4642%	0.0043%

易方达天天理财货币R:

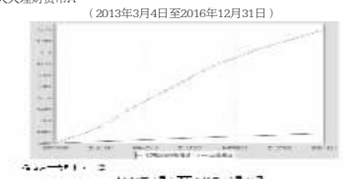
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7270%	0.0011%	0.0895%	0.0000%	0.6375%	0.0011%
过去六个月	1.4248%	0.0009%	0.1790%	0.0000%	1.2458%	0.0009%
过去一年	2.8733%	0.0010%	0.3565%	0.0000%	2.5168%	0.0010%
过去三年	12.8656%	0.0045%	1.0711%	0.0000%	11.7945%	0.0045%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	16.8776%	0.0043%	1.3684%	0.0000%	15.5092%	0.0043%

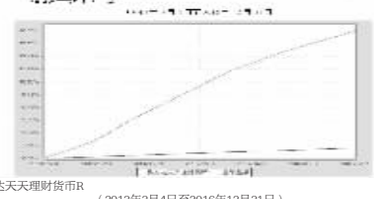
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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
(2013年3月4日至2016年12月31日)

易方达天天理财货币A

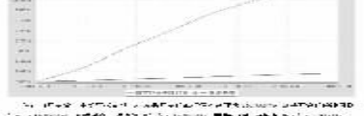
(2013年3月4日至2016年12月31日)

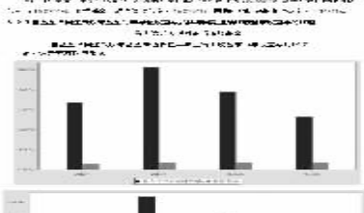


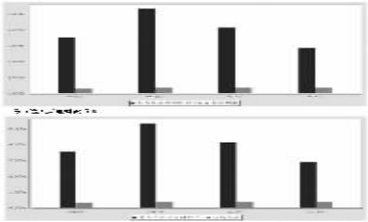


易方达天天理财货币B

(2013年3月4日至2016年12月31日)

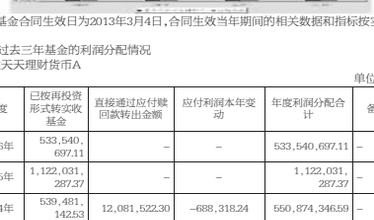






易方达天天理财货币R

(2013年3月4日至2016年12月31日)



注:本基金合同生效日为2013年3月4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

易方达天天理财货币A

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
2016年	533,540,697.11	-	-	533,540,697.11	-
2015年	1,122,031,287.37	-	-	1,122,031,287.37	-
2014年	539,481,142.53	12,081,522.30	-688,318.24	550,874,346.59	-
合计	2,195,053,127.01	12,081,522.30	-688,318.24	2,206,446,331.07	-

易方达天天理财货币B

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
2016年	1,017,474,076.10	-	-	1,017,474,076.10	-
2015年	273,146,855.41	-	-	273,146,855.41	-
2014年	113,969,570.18	2,006,734.91	-290,977.43	115,685,327.66	-
合计	1,404,590,501.69	2,006,734.91	-290,977.43	1,406,306,259.17	-

易方达天天理财货币R

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
2016年	101,338,711.34	-	-	101,338,711.34	-
2015年	77,280,029.17	-	-	77,280,029.17	-
2014年	7,761,919.73	-	-100.45	7,761,819.28	-
合计	186,380,660.24	-	-100.45	186,380,559.79	-

§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,旗下设有北京、广州、上海、成都、大连、南京等六个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。2012年10月,易方达获得管理保险委托资产业务资格。2016年12月,易方达获得基本养老保险基金证券投资管理机构资格。截至2016年12月31日,公司旗下管理的各类资产总规模10491亿元,其中公募基金规模4283亿元,公募基金规模排名连续12年保持在行业前五名,服务客户超过5000万户,公司净资产66亿元,在国内资产管理行业具有领先的市场地位和综合实力。

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		
石大铎	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	-	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。
梁莹	本基金的基金经理助理、易方达财富快钱货币市场基金的基金经理、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、易方达天天理财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	2015-02-17	-	6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"离任日期"为公告确定的解聘日期,石大铎的"任职日期"为基金合同生效之日,刘朝阳、梁莹的"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,贯穿投资授权、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2016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(国公募、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29次,其中26次为旗下指数及量化组合因投资策略需要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

2016年全年国内生产总值(GDP)增长6.7%。具体来看,一季度经济出现较多积极因素,进入二、三季度之后,增长略显乏力,但微观数据下半年开始逐渐走强,并从四季度的主要经济指标中逐步反映出来。投资方面,一季度投资数据受十三五开年计划的影响较为强劲,但经济增长动力依然内生乏力。受到制造业投资的拖累,以及地产投资持续维持在低位的影响,二季度投资数据大幅下滑。三季度制造业投资企稳,随后在基建投资的持续发力下,四季度投资数据整体呈现出较为强劲的企稳迹象。受到2016年初以来房地产去库存政策的影响,地产销售数据出现了较大幅度的上涨,在9月30日之后,十六个重点城市依次推出了相应的地产调整政策,调控城市的销售金额和销量大幅下滑。但是全年房地产投资保持了相对平稳的走势,受销售的波动影响较小。全年来看,通胀比较温和。中上游价格则呈现大幅上涨的态势,但是对下游传导较弱。

2016年全年债券市场出现了较大幅度震荡,无风险收益方面,由于一季度的经济预期较好和信用事件冲击,债券市场收益率4月份出现了快速上行。权威人士讲话之后,债市情绪更是大幅转向。此后英国退欧事件引发避险情绪及货币宽松预期上升,伴随6月未配置需求开始释放,推动收益率再度明显下行,中长端利率债收益率一度快速下行。四季度经济复苏预期增强伴随着海外利率上升造成的冲击,11月以来银行间市场流动性不断收紧,导致货币市场利率持续攀升。在债市收益率上升的背景下,由于资产端收缩传导的链条较长,去杠杆过程带来的市场调整剧烈程度超出预期,货币市场、债券市场利率均出现大幅上行。12月下旬在汇率贬值压力减轻,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。

报告期内,本基金的运作仍以保证资产的流动性为首要任务,在前三季度保持了中性偏长的剩余期限,积极参与债券投资;四季度主动降低了组合的剩余期限、债券仓位,提高了逆回购和存款资产的配置比例,把握了年末的配置和交易机会。全年运作平稳,保证了组合的流动性和安全性,也为投资者获取了较好的收益率。

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2.6160%;B类基金份额净值收益率为2.8630%;R类基金份额净值收益率为2.8733%;同期业绩比较基准收益率为0.3565%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着债券市场利率的快速上行,站在当前节点我们对于2017年的债券市场可以更加乐观。从基本面上来看,当前支撑经济稳定的主要动力是基建和房地产投资。基建投资依赖于稳增长的意愿,中央经济工作会议中对于稳增长的表态明显弱化,这意味着2017年基建投资难以出现显著增长,甚至存在一定的退出风险。房地产投资在短期之内由于补库存需要仍然可以保持稳定,但是考虑到房地产新政和利率抬升对于房地产销售的系统性抑制,2017年下半年可能将会看到房地产库存的堆积和投资的下滑,届时将会再次对经济产生较大的拖累。此外过去两年实体经济明显受益于低利率和宽松的融资环境,当前货币边际收紧导致广谱利率的抬升对于制造业投资的抑制作用也将在未来一年逐步显现,这也会对经济产生一定的负面影响。另一方面通胀相对温和,由于居民收入的持续下滑,工业品价格的上涨很难对通胀产生明显的传导,而如果下半年经济下滑,通缩压力将会再次显现。基于对经济增长和通胀的判断,我们认为货币政策可能会在一到两个季度内保持偏紧态势,利率可能会处于高位震荡,但是随着经济和通胀的回落,货币宽松的窗口有望再次打开,利率将重回下行趋势。不确定性仍然在于美国经济的回暖力度,这将会对货币政策和利率下行的节奏产生较大的扰动和影响。综上来看,短期内债券市场仍然处于震荡格局,但是全年来看利率仍存在较大的下行压力,考虑到国内外环境存在一定的不确定性,债券市场波动也会显著放大。

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,保持灵活的剩余期限和债券仓位,同时紧跟央行的政策变化和操作节奏,灵活应对由于去杠杆、人民币汇率波动等因素带来的货币市场扰动,把握短期波段带来的投资机会。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、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2016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

安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2016年12月31日的资产负债表、2016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:易方达天天理财货币市场基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:		
银行存款	22,073,680,409.06	23,481,646,145.01
结算备付金	-	-
存出保证金	176.99	827.19
交易性金融资产	9,094,007,585.53	39,177,957,789.40
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	9,094,007,585.53	39,177,957,789.40
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	7,389,727,131.29	1,646,700,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	175,635,583.86	464,154,301.06
应收股利	-	-
应收申购款	465,372,699.69	2,415,123,162.69
递延所得税资产	-	-
其他资产	30,000.00	52,950.90
资产总计	39,198,453,586.41	67,185,635,176.25
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 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	2,396,124,209.93	7,649,892,312.35
应付证券清算款	-	120,532,753.97
应付赎回款	91,063,139.73	68,763,099.01
应付管理人报酬	11,400,080.42	12,636,727.13
应付托管费	3,454,569.82	3,829,311.23
应付销售服务费	3,781,624.75	5,290,066.92
应付交易费用	326,857.12	449,637.02
应交税费	-	-
应付利息	597,025.98	1,447,033.15
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	443,645.86	456,560.26
负债合计	2,507,191,153.61	7,863,297,501.04
所有者权益:		
实收基金	36,691,262,432.80	59,322,337,675.21
未分配利润	-	-
所有者权益合计	36,691,262,432.80	59,322,337,675.21
负债和所有者权益总计	39,198,453,586.41	67,185,635,176.25

注:报告截止日2016年12月31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;基金份额总额36,691,262,432.80份,下属分级基金的份额总额分别为:A类基金份额总额16,172,983,746.83份,B类基金份额总额18,900,448,406.16份,R类基金份额总额1,617,830,279.81份。

7.2 利润表

会计主体:易方达天天理财货币市场基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一.收入	2,110,571,896.76	1,824,042,090.38
1.利息收入	2,197,098,462.97	1,739,087,633.42
其中:存款利息收入	1,216,183,902.19	884,013,524.97
债券利息收入	904,185,860.41	827,109,460.82
资产支持证券利息收入	-	1,876,151.95
买入返售金融资产收入	76,728,700.37	26,088,495.68
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-86,526,566.21	84,930,237.78
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-86,526,566.21	84,930,237.78
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)	-	24,219.18
减:二、费用	458,218,412.21	351,583,918.43
1. 管理人报酬	199,928,972.25	127,155,231.79
2. 托管费	60,584,536.96	38,531,888.41
3. 销售服务费	55,147,950.46	74,048,790.19
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	141,865,393.35	111,234,890.09
其中:卖出回购金融资产支出	141,865,393.35	111,234,890.09
6. 其他费用	691,559.19	613,117.95
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,652,353,484.55	1,472,458,171.95
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,652,353,484.55	1,472,458,171.95

7.3 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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	59,322,337,675.21	-	59,322,337,675.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,652,353,484.55	1,652,353,484.55
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)	-22,631,075,242.41	-	-22,631,075,242.41
其中:1.基金申购款	231,658,110,035.76	-	231,658,110,035.76
2.基金赎回款	-254,289,185,278.17	-	-254,289,185,278.17
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)	-	-1,652,353,484.55	-1,652,353,484.55
五.期末所有者权益(基金净值)	36,691,262,432.80	-	36,691,262,432.80
项目	上年度可比期间 2015年1月1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)	35,460,920,919.67	-	35,460,920,919.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,472,458,171.95	1,472,458,171.95
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)	23,861,416,755.54	-	23,861,416,755.54
其中:1.基金申购款	306,724,886,230.99	-	306,724,886,230.99
2.基金赎回款	-282,863,469,475.45	-	-282,863,469,475.45
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)	-	-1,472,458,171.95	-1,472,458,171.95
五.期末所有者权益(基金净值)	59,322,337,675.21	-	59,322,337,675.21

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。

7.4.2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《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>估值业务及会计核算有关事项的通知》、《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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 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。

7.4.5差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

7.4.6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。

股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

(2)营业税、增值税、企业所得税

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。

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,免征营业税。

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。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免征增值税;存款利息收入不征收增值税;质押式买入返售金融商品及持有政策性金融债券的利息收入免征增值税;买断式买入返售金融商品、同业存单以及持有金融债券的利息收入免征增值税。

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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

(3)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。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所