

**易方达天天理财货币市场基金**  
**2013 年半年度报告**  
**2013 年 6 月 30 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**  
**报告送出日期：二〇一三年八月二十八日**

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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 2013 年 8 月 21 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 3 月 4 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
<b>5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	14
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 .....	15
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 .....	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表 .....	15
6.2 利润表 .....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	18
<b>7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37
7.2 债券回购融资情况 .....	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	38
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	39
7.5 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 .....	40
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 .....	40
7.8 投资组合报告附注 .....	40
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>42</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>43</b>

10.1	基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4	基金投资策略的改变.....	43
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8	偏离度绝对值超过 0.5% 的情况.....	44
10.9	其他重大事件.....	44
<b>11</b>	<b>备查文件目录.....</b>	<b>46</b>
11.1	备查文件目录.....	46
11.2	存放地点.....	46
11.3	查阅方式.....	47

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达天天理财货币市场基金		
基金简称	易方达天天理财货币		
基金主代码	000009		
交易代码	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	375,696,952.32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	299,623,816.66份	75,466,997.86份	606,137.80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 $\times(1 - \text{利息税税率})$ 。
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	赵会军
	联系电话	020-38797888	010—66105799
	电子邮箱	csc@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400 881 8088	95588	
传真	020—38799488	010—66105798	
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中 路 3 号 4004-8 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
办公地址	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	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	510620	100140	
法定代表人	叶俊英	姜建清	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人 互联网网址	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40 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（2013 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2013 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
本期已实现收益	11,427,457.70	3,840,305.80	6,962.97

本期利润	11,427,457.70	3,840,305.80	6,962.97
本期净值收益率	1.0769%	1.1569%	1.1605%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2013 年 6 月 30 日)</b>		
	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	299,623,816.66	75,466,997.86	606,137.80
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2013 年 6 月 30 日)</b>		
	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
累计净值收益率	1.0769%	1.1569%	1.1605%

注：1.上述基金业绩指标不包括持有人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，由于货币市场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。

3.本基金利润分配是按月结转份额。

4. 本基金合同于2013年3月4日生效，合同生效当年期间的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

#### 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	0.2714%	0.0016%	0.0292%	0.0000%	0.2422%	0.0016%
过去三个月	0.8208%	0.0046%	0.0885%	0.0000%	0.7323%	0.0046%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.0769%	0.0041%	0.1157%	0.0000%	0.9612%	0.0041%

## 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	0.2915%	0.0016%	0.0292%	0.0000%	0.2623%	0.0016%
过去三个月	0.8815%	0.0046%	0.0885%	0.0000%	0.7930%	0.0046%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.1569%	0.0040%	0.1157%	0.0000%	1.0412%	0.0040%

## 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	0.2924%	0.0016%	0.0292%	0.0000%	0.2632%	0.0016%
过去三个月	0.8841%	0.0046%	0.0885%	0.0000%	0.7956%	0.0046%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.1605%	0.0040%	0.1157%	0.0000%	1.0448%	0.0040%

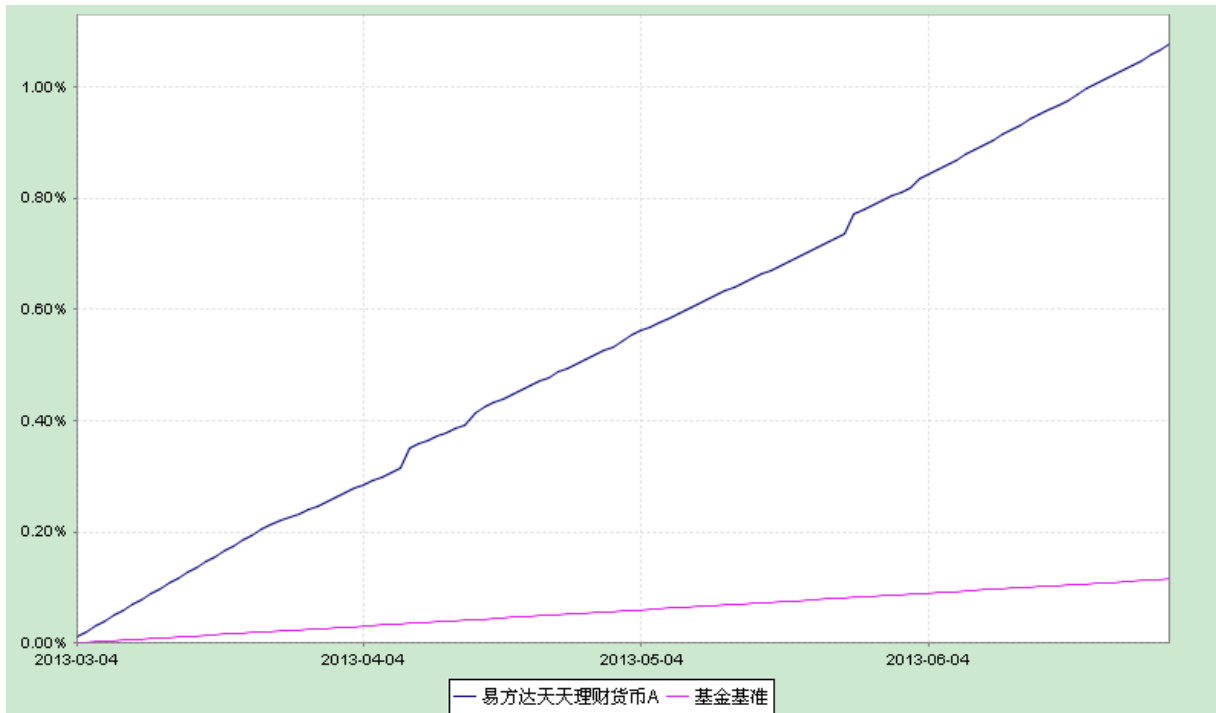
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

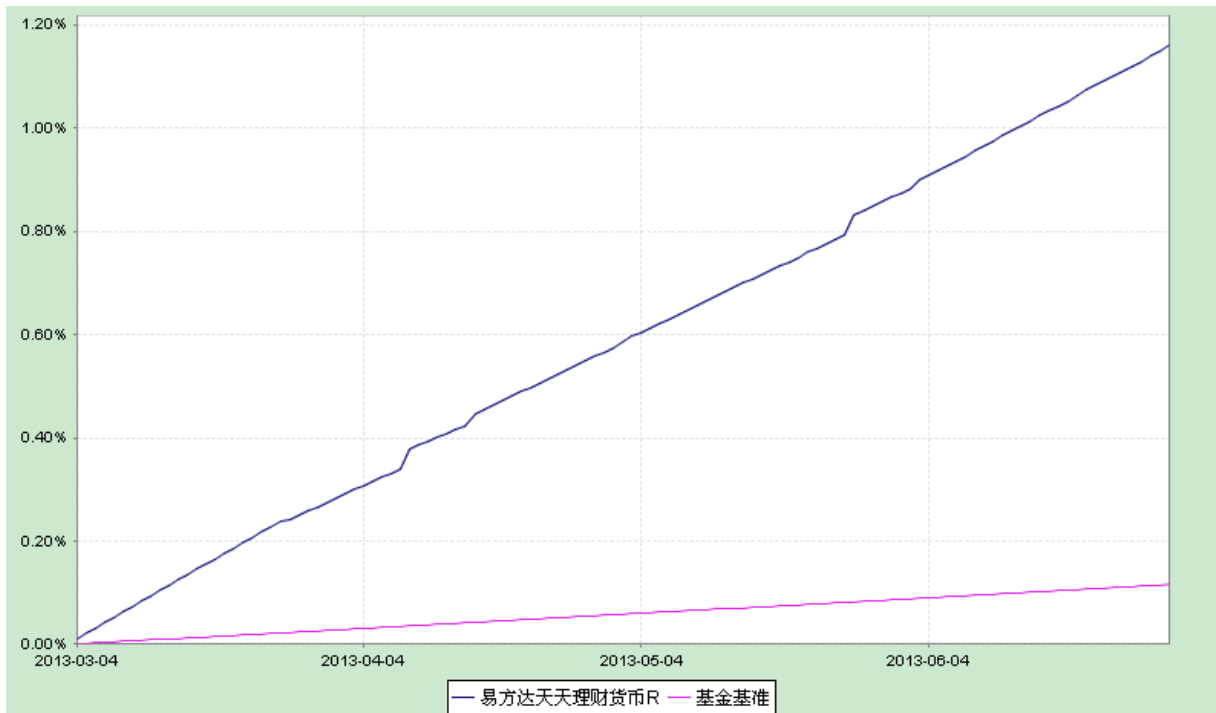


(2013 年 3 月 4 日至 2013 年 6 月 30 日)

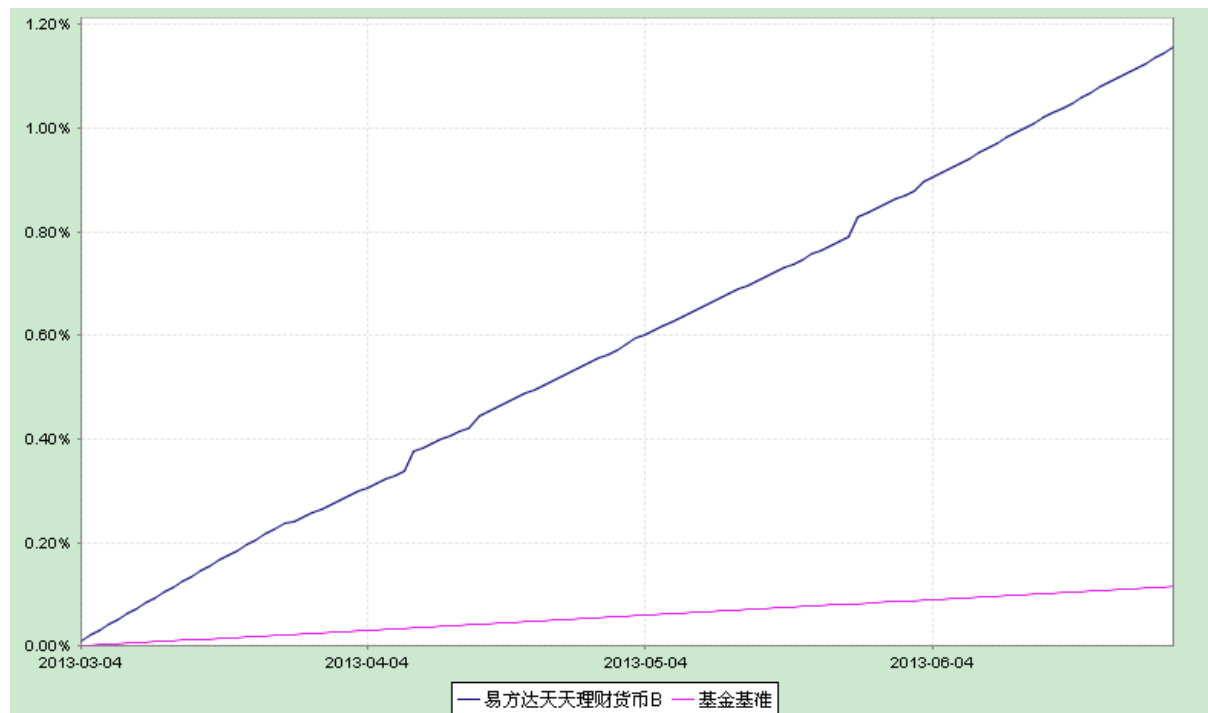
### 1、易方达天天理财货币 A



### 2、易方达天天理财货币 B



### 3、易方达天天理财货币 R



注：1.本基金合同于2013年3月4日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.基金合同中关于基金投资比例的约定：

(1) 本基金在向交易对手银行进行询价的基础上，选取利率报价较高的银行进行存款投资，在投资过程中注重对交易对手信用风险的评估和选择。当银行存款投资具有较高投资价值时，本基金存款投资比例上限最高可达100%。

(2) 本基金投资于同一公司发行的短期企业债券及短期融资券的比例，合计不得超过基金资产净值的10%；

(3) 本基金与由基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

(4) 本基金存放在具有基金托管资格的同一家商业银行的存款，不得超过基金资产净值的30%；存放在不具有基金托管资格的同一家商业银行的存款，不得超过基金资产净值的5%；

(5) 在全国银行间债券市场债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，在全国银行间同业市场的债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；

(6) 本基金投资于定期存款（不包括有存款期限，但根据协议可以提前支取且没有利息损失的银行存款）的比例不得超过基金资产净值的30%；

(7) 本基金持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%；

(8) 本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

(9) 除发生巨额赎回的情形外，本基金债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%；因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的，基金管理人

应当在5个交易日内进行调整；、

(10) 中国证监会规定的其他比例限制；

(11) 因基金规模或市场变化导致本基金投资组合不符合以上比例限制的，基金管理人应在10个交易日内进行调整，以达到上述标准。法律法规另有规定时，从其规定。

3.本基金的建仓期为六个月，本报告期本基金处于建仓期内。

4.自基金合同生效至报告期末，A级基金的基金份额净值收益率为1.0769%，同期业绩比较基准收益率为0.1157%；B级基金的基金份额净值收益率为1.1569%，同期业绩比较基准收益率为0.1157%；R级基金的基金份额净值收益率为1.1605%，同期业绩比较基准收益率为0.1157%。

## 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。截至2013年6月30日，公司的股东为广东粤财信托有限公司、广发证券股份有限公司、盈峰投资控股集团有限公司、广东省广晟资产经营有限公司和广州市广永国有资产经营有限公司。公司现有全国社保基金投资管理人、企业年金投资管理人、QDII和特定资产管理业务资格。

自成立以来，易方达基金管理有限公司秉承“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的增长”的经营理念，努力以规范的运作、良好的业绩和优质的服务，为投资者创造最佳的回报。

截至2013年6月30日，易方达基金管理有限公司共管理1只封闭式基金、44只开放式基金。封闭式基金有科瑞证券投资基金；开放式基金有易方达平稳增长证券投资基金、易方达策略成长证券投资基金、易方达50指数证券投资基金、易方达积极成长证券投资基金、易方达货币市场基金、易方达稳健收益债券型证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数基金、易方达价值精选股票型证券投资基金、易方达策略成长二号混合型证券投资基金、易方达价值成长混合型证券投资基金、易方达科讯股票型证券投资基金、易方达增强回报债券型证券投资基金、易方达中小盘股票型证券投资基金、易方达科汇灵活配置混合型证券投资基金、易方达科翔股票型证券投资基金、易方达行业领先企业股票型证券投资基金、易方达沪深300指数证券投资基金、易方达深证100交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达亚洲精选股票型证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金、易方达上证中盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、易方达岁丰添利债券型证券投资基金、易方达医疗保健行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金（LOF）、易方达安心回报债券型证券投资基金、易方达资源行业股票型证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金、易方达创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达双债增强债券型证券投资基金、易方达纯债债券型证券投资基金、易方达标普全球高端消费品指数增强型证券投资基金、易方达永旭添利定期开放债券型证券投资基金、易方达恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、易方达恒生中国企业交易

型开放式指数证券投资基金联接基金、易方达中小板指数分级证券投资基金、易方达中债新综合债券指数发起式证券投资基金（LOF）、易方达月月利理财债券型证券投资基金、易方达双月利理财债券型证券投资基金、易方达天天理财货币市场基金、易方达沪深 300 交易型开放式指数发起式证券投资基金、易方达保证金收益货币市场基金、易方达信用债债券型证券投资基金、易方达沪深 300 量化增强证券投资基金。同时，公司还管理着多个全国社保基金、企业年金基金和特定客户资产管理投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达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	2013-03-04	-	4 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。

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合规守信情况的说明

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，通过投资交易系统内的公平交易模块，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% 的交易共有 4 次，为纯被动指数基金或量化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 管理人对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

2013 年上半年，中国经济增长持续减速。消费、贸易顺差数据的低迷反映出内需较弱的状况没有发生改变。固定资产投资增速在上半年持续走低，工业品出产价格指数在二季度甚至有加速下跌的趋势，国内经济的弱势可见一斑。与此同时，货币政策并未有放松的迹象。在 4 月以来外汇占款持续下降的背景下，央行在 5 月重启央票发行，社会融资总量在 5、6 月份连续两个月大幅收缩。央行坚定的态度、特殊时点因素、美国 QE 的退出等多种因素叠加导致市场在半年末发生了罕见的“钱荒”现象，债券收益率由此结束了年初以来震荡下行的趋势。在此期间我们关注到经济基本面偏弱、政策面偏紧的现象，认识到政府的态度日渐明确，“经济发展必须依靠转型升级，政策要以转变经济发展方式为主线”，因此在操作上更加谨慎。随着资金面在二季度开始紧张后，我们降低了组合的久期，维持较低的杠杆，把保持组合的流动性作为主要的管理目标，并在 6 月末大规模赎回的冲击中保证了基金的安全运作。

报告期内本基金以存款作为主要配置，继续保持适中的组合平均剩余期限，根据市场情况均衡投资存款、逆回购、金融债和短期融资券，在保持较高流动性的同时为投资者提供了较高的投资收益。

#### 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 1.0769%；B 类基金份额净值收益率为 1.1569%；R 类基金份额净值收益率为 1.1605%；同期业绩比较基准收益率为 0.1157%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国内经济下行的风险仍然较高。在经济增速没有落到政府容忍线下之前，我们预期政策还是会保持信贷和社会融资偏紧的态度，很难在总量政策上出现转向，更多的还是在几个行业

采取一些结构性的措施。但李克强总理近期提出的“下限论”、“稳增长可以为调结构创造有效空间和条件”，对于平滑经济波动而言是必要的。因此，我们相信下半年经济可以稳住，经济运行区间不会滑出“下限”。债券市场将继续受到来自基本面的支撑，但是通胀在三季度反弹的概率较大，同时资金面在央行紧缩的态度下也存在着不确定性。总体而言，面对着目前较为平坦的收益率曲线，我们仍将保持组合较短的久期。

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适中的组合期限。基金投资类属配置将以存款、回购、金融债和信用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、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签署服务协议，由其按约定提供银行间同业市场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实现的基金净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合规守信、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2013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：2013年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2013年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	152,445,325.26
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	230,757,306.96
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		230,757,306.96
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	6.4.7.5	4,470,112.18

应收股利		-
应收申购款		4,637,444.60
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>392,310,189.00</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2013 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		14,999,872.50
应付证券清算款		-
应付赎回款		606,134.00
应付管理人报酬		192,844.08
应付托管费		58,437.60
应付销售服务费		103,879.64
应付交易费用	6.4.7.7	36,146.08
应交税费		-
应付利息		6,230.24
应付利润		479,914.83
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	129,777.71
<b>负债合计</b>		<b>16,613,236.68</b>
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	6.4.7.9	375,696,952.32
未分配利润	6.4.7.10	-
<b>所有者权益合计</b>		<b>375,696,952.32</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>392,310,189.00</b>

注：1.本基金合同生效日为2013年3月4日，2013年半年度实际报告期间为2013年3月4日至2013年6月30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2013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；基金份额总额375,696,952.32份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额299,623,816.66份，B类基金份额总额75,466,997.86份，R类基金份额总额606,137.80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：2013 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2013 年 3 月 4 日（基 金合同生效日）至 2013 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>18,747,817.67</b>
1.利息收入		18,052,126.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,772,060.54
债券利息收入		3,099,246.69
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		180,818.86
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		695,691.40
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.12	695,691.40
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）	6.4.7.13	0.18
<b>减：二、费用</b>		<b>3,473,091.20</b>
1. 管理人报酬		1,468,961.35
2. 托管费		445,139.70
3. 销售服务费		855,380.41
4. 交易费用	6.4.7.14	-
5. 利息支出		545,890.10
其中：卖出回购金融资产支出		545,890.10
6. 其他费用	6.4.7.15	157,719.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>15,274,726.47</b>

减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>15,274,726.47</b>

注：本基金合同生效日为2013年3月4日，2013年半年度实际报告期间为2013年3月4日至2013年6月30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。

### 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：2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日

单位：人民币元

项目	本期		
	2013年3月4日（基金合同生效日）至2013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）	3,860,179,631.65	-	3,860,179,631.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,274,726.47	15,274,726.47
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）	-3,484,482,679.33	-	-3,484,482,679.33
其中：1.基金申购款	1,647,313,804.83	-	1,647,313,804.83
2.基金赎回款	-5,131,796,484.16	-	-5,131,796,484.16
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）	-	-15,274,726.47	-15,274,726.47
五、期末所有者权益（基金净值）	375,696,952.32	-	375,696,952.32

注：本基金合同生效日为2013年3月4日，2013年半年度实际报告期间为2013年3月4日至2013年6月30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 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：叶俊英，主管会计工作负责人：张优造，会计机构负责人：陈荣

### 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,注册登记机构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。

本基金募集期间为2013年2月21日至2013年2月28日,募集金额总额为3,860,179,631.65元人民币,其中:有效净认购金额为人民币3,859,580,952.65元,有效认购资金在募集期内产生的银行利息共计人民币598,679.00元,经安永华明(2013)验字第60468000\_G04号验资报告予以审验。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、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>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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。

#### 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2013年6月30日的财务状况以及2013年3月4日(基金合同生效日)至2013年6月30日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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。

##### 6.4.4.1 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,惟本会计年度为2013年3月4日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

##### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成一个单位的金融资产（负债），并形成其他单位的金融负债（资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

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、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。本基金目前持有的债券投资划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；其他金融资产划分为应收款项。

##### (2) 金融负债分类

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。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金的金融资产在初始确认时以公允价值计量。本基金对所持有的债券投资以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内，本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

本基金的金融负债于初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

##### (1) 债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于成交日确认为债券投资。

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，对于贴息债券，该等利息应作为债券投资成本；

卖出银行间同业市场交易的债券，于成交日确认债券投资收益。

出售债券的成本按移动加权平均法结转。

##### (2) 回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购）以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用摊余成本法，其接近于公允价值。估值对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益或损失。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；

本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### (1) 银行存款

基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际利率逐日计提利息；

##### (2) 债券投资

基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

##### (3) 回购协议

A.基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在回购期内逐日计提利息；

B.基金持有的买断式回购以成本列示，所产生的利息在回购期内逐日计提。回购期满，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值；

（4）其他

A.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价格估值；

B.为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当“影子定价”确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度的绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合。其中，对于偏离度的绝对值达到或超过 0.5% 的情形，基金管理人应编制并披露临时报告；

C.如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。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。

#### 6.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知(2006)22 号文《关于货币市场基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

(2)债券利息收入按实际持有期内逐日计提。附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

(3)买入返售金融资产收入，按融出资金应付或实际支付的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(4)债券投资收益于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

(5)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 6.4.4.9 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值乘以 0.33%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值乘以 0.1%的年费率逐日计提；

(3)A 级基金份额按前一日 A 级基金份额资产净值的 0.25%的年费率逐日计提基金销售服务费，B 级基金份额按前一日 B 级基金份额资产净值的 0.01%的年费率逐日计提基金销售服务费；R 级基金份额按前一日 R 级基金份额资产净值的 0%的年费率逐日计提基金销售服务费

(4)卖出回购金融资产支出，按融入资金应收或实际收到的总额及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(5)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 6.4.4.10 基金的收益分配政策

(1)本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

(2)“每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付收益。投资者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，因去尾形成的余额自动合并入下一日收益中进行分配；

(3)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，为投资者记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资者记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资者不记收益；

(4)本基金每日进行收益计算并分配，每月累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式。若投资者在每月累计收益支付时，累计收益为正值，则为投资者增加相应的基金份额，其累计收益为负值，则缩减投资者基金份额。投资者可通过赎回基金份额获得收益；

(5)基金份额持有人在全部赎回其持有的本基金某类基金份额余额时，基金管理人自动将该基金份额持有人的该类基金份额未付收益一并结算并与赎回款一起支付给该基金份额持有人；基金份额持有人部分赎回其持有的某类基金份额时，当该类基金份额未付收益为正时，未付收益不进行支付；当该类基金份额未付收益为负时，其剩余的该类基金份额需足以弥补其当前未付收益为负时的损益，否则将自动按比例结转当前未付收益,再进行赎回款项结算；

(6)当日申购成功的基金份额自下一个工作日起享有基金的收益分配权益；当日赎回成功的基金份额自下一工作日起，不享有基金的收益分配权益；

(7)本基金同类每份基金份额享有同等收益分配权；

(8)在不影响基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可在中国证监会允许的条件下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

(9)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 6.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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。

##### 6.4.5.2 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。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，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、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对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；

##### 6.4.6.2 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《财政部国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》，自 2008 年 10 月 9 日起暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
活期存款	2,445,325.26
定期存款	150,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	50,000,000.00

存款期限 3 个月-1 年	100,000,000.00
其他存款	-
合计	152,445,325.26

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	230,757,306.96	230,014,000.00	-743,306.96	-0.1978
	合计	230,757,306.96	230,014,000.00	-743,306.96	-0.1978

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,468.39
应收定期存款利息	1,164,028.00
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	3,304,615.79
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-



合计	4,470,112.18
----	--------------

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	36,146.08
合计	36,146.08

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2013年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,238.31
预提费用	127,639.40
其他应付款	900.00
合计	129,777.71

**6.4.7.9 实收基金****易方达天天理财货币 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,017,838,433.09	3,017,838,433.09
本期申购	950,606,707.02	950,606,707.02
本期赎回（以“-”号填列）	-3,668,821,323.45	-3,668,821,323.45
本期末	299,623,816.66	299,623,816.66

**易方达天天理财货币 B**

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	841,741,198.56	841,741,198.56
本期申购	696,700,960.01	696,700,960.01
本期赎回（以“-”号填列）	-1,462,975,160.71	-1,462,975,160.71
本期末	75,466,997.86	75,466,997.86

### 易方达天天理财货币 R

金额单位：人民币元

项目	本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	600,000.00	600,000.00
本期申购	6,137.80	6,137.80
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	606,137.80	606,137.80

注：（1）本基金合同于2013年3月4日生效，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。

（2）本基金自2013年3月26日起开始办理申购赎回、转换业务。

（3）表内各级基金的申购金额和赎回金额均包含红利再投资，分级调整的基金份额以及基金转入和转出的份额。

### 6.4.7.10 未分配利润

#### 易方达天天理财货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	11,427,457.70	-	11,427,457.70
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-11,427,457.70	-	-11,427,457.70
本期末	-	-	-

**易方达天天理财货币 B**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,840,305.80	-	3,840,305.80
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,840,305.80	-	-3,840,305.80
本期末	-	-	-

**易方达天天理财货币 R**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,962.97	-	6,962.97
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-6,962.97	-	-6,962.97
本期末	-	-	-

注：本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配，每月以红利再投资方式集中支付累计收益，即按份额面值1.00元转为基金份额。

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日
活期存款利息收入	9,708.16
定期存款利息收入	14,759,299.88
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	632.40
其他	2,420.10

合计	14,772,060.54
----	---------------

#### 6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至 2013年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,682,771,800.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,661,839,431.78
减：应收利息总额	20,236,676.87
债券投资收益	695,691.40

#### 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	0.18
合计	0.18

#### 6.4.7.14 交易费用

本基金所进行的交易，交易费用均入成本，本报告期内本基金未产生交易费用。

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日
----	-------------------------------------

审计费用	39,273.57
信息披露费	88,365.83
银行汇划费	29,180.24
其他	900.00
合计	157,719.64

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,468,961.35
其中：支付销售机构的客户维护费	1,090,579.48

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：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	445,139.70

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：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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。

##### 6.4.10.2.3 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 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013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	合计
易方达基金管理有 限公司	25,271.68	1,176.65	-	26,448.33
中国工商银行	767,683.79	8,089.54	-	775,773.33
合计	792,955.47	9,266.19	-	802,221.66

本基金A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：

$H = E \times \text{销售服务费率} \div \text{当年天数}$

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。

#### 6.4.10.3 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

本期 2013年3月4日（基金合同生效日）至2013年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	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	10,001,224.66	40,862,02 7.40	-	-	60,000,000.00	7,709.45

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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

无。

**易方达天天理财货币 B**

无。

**易方达天天理财货币 R**

无。

**6.4.10.5 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 2013年3月4日（基金合同生效日）至 2013年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	52,445,325.26	2,047,847.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

易方达天天理财货币 A

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
4,258,728.05	6,796,248.84	372,480.81	11,427,457.70	-

易方达天天理财货币B

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
1,423,514.32	2,310,182.63	106,608.85	3,840,305.80	-

易方达天天理财货币R

单位：人民币元

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	本期利润分配 合计	备注
6,137.80	0.00	825.17	6,962.97	-



**6.4.12 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 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。

**6.4.12.2 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。

**6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2013 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 14,999,872.50 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
120228	12国开28	2013-07-01	100.00	150,000	14,999,869.99
合计		-	-	150,000	14,999,869.99

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2013 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。

**6.4.13 金融工具风险及管理****6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察部、集中交易室、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为货币市场基金，预期风险和预期收益均低于股票型基金、混合型基金及债券型基金，属证券投资基金中的较低风险收益品种。日常经营活动中本基金面临的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险，本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡，以实现“风险和收益相匹配”的风险收

益目标。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金管理人通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。

于 2013 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 27.28%。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日
A-1	102,480,666.42
A-1 以下	0.00
未评级	131,581,256.33
合计	234,061,922.75

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2013 年 6 月 30 日
AAA	0.00
AAA 以下	0.00
未评级	0.00
合计	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括现金，通知存款，一年以内(含一年)的银行定期存款和大额存单，短期融资券，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、中期票据、资产支持证券，期限在一年以内(含一年)的债券回购，剩余期限在一年以内(含一年)中央银行票据以及法律法规或中国证监会允许货币市场基金投资的其他金融工具。期末除 6.4.12 列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	152,445,325. 26	-	-	-	152,445,325.26
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	230,757,306. 96	-	-	-	230,757,306.96
衍生金融资产	-	-	-	-	-

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	4,470,112.18	4,470,112.18
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	303,100.00	-	-	4,334,344.60	4,637,444.60
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	383,505,732.22	-	-	8,804,456.78	392,310,189.00
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	14,999,872.50	-	-	-	14,999,872.50
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	606,134.00	606,134.00
应付管理人报酬	-	-	-	192,844.08	192,844.08
应付托管费	-	-	-	58,437.60	58,437.60
应付销售服务费	-	-	-	103,879.64	103,879.64
应付交易费用	-	-	-	36,146.08	36,146.08
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	6,230.24	6,230.24
应付利润	-	-	-	479,914.83	479,914.83
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	129,777.71	129,777.71

负债总计	14,999,872.50	-	-	1,613,364.18	16,613,236.68
利率敏感度缺口	368,505,859.72	-	-	7,191,092.60	375,696,952.32

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2013 年 6 月 30 日
	1.市场利率下降25个基点	546,763.83
	2.市场利率上升25个基点	-544,002.33

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具，不投资股票、权证等其他交易性金融资产，于本期末，无重大其他市场价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 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	230,757,306.96	58.82
	其中：债券	230,757,306.96	58.82
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	152,445,325.26	38.86
4	其他各项资产	9,107,556.78	2.32
5	合计	392,310,189.00	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	6.16	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额 (元)	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	14,999,872.50	3.99
	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	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说明

报告期内投资组合平均剩余期限无超过 180 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 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	19.28	3.99
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	29.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	18.70	-
3	60 天(含)—90 天	31.97	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	10.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	10.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
6	合计	101.99	3.99

## 7.4 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	130,357,556.70	34.70
	其中：政策性金融债	130,357,556.70	34.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	100,399,750.26	26.72
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	230,757,306.96	61.42
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	70,245,224.12	18.70

**7.5 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	100230	10 国开 30	700,000	70,245,224.12	18.70
2	041264034	12 青岛城投 CP001	400,000	40,226,789.94	10.71
3	110206	11 国开 06	400,000	40,112,505.93	10.68
4	041252042	12 万宝 CP001	200,000	20,119,255.86	5.36
5	041365001	13 瑞水泥 CP001	200,000	20,040,712.61	5.33
6	120228	12 国开 28	200,000	19,999,826.65	5.32
7	041364005	13 科伦 CP001	100,000	10,012,605.37	2.67
8	041358036	13 长信科技 CP001	100,000	10,000,386.48	2.66

注：1.本报告期末本基金投资12青岛城投CP001占基金资产净值比例超过10%，属于被动超标，已在规定时限内调整。

2.本基金本报告期末仅持有以上债券。

**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(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0803%
报告期内偏离度的最低值	-0.2206%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0428%

**7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

**7.8 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。

**7.8.2** 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。

**7.8.3** 科伦药业于 2013 年 5 月 21 日公告，收到中国证监会《调查通知书》，因科伦药业涉嫌信息披露违法违规，证监会决定对科伦药业立案调查。公司未披露立案调查信息披露违法违规具体内容，可能仍为“收购崇州君健塑胶有限公司股权信息披露违法违规”的事件。

公司主要业务为大容量注射液，近年来的玻璃瓶和塑瓶市场占有率在全国始终排列第一，直立式软袋为公司专利产品，在全球范围内首创，市场对公司业务需求稳定。2012 年君健塑胶总资产 5.2 亿，总收入 8.8 亿，占公司比例分别为 3.5% 和 15%。如果证监会立案调查原因的确是君健塑胶的问题，从数据上看对公司的影响有限。评级机构中诚信国际公告称对此事表示关注，未调整评级。我们也将对此事继续保持关注。

除科伦药业外，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。

#### 7.8.4 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	4,470,112.18
4	应收申购款	4,637,444.60
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,107,556.78

## 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	6,130	48,878.27	253,766.81	0.08%	299,370,049.85	99.92%

财货币A						
易方达天天理财货币B	11	6,860,636.17	30,338,083.10	40.20%	45,128,914.76	59.80%
易方达天天理财货币R	2	303,068.90	606,137.80	100.00%	0.00	0.00%
合计	6,143	61,158.55	31,197,987.71	8.30%	344,498,964.61	91.70%

## 8.2 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	26,004.75	0.0087%
	易方达天天理财货币 B	0.00	0%
	易方达天天理财货币 R	0.00	0%
	合计	26,004.75	0.0069%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

## 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
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
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	950,606,707.02	696,700,960.01	6,137.80
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	3,668,821,323.45	1,462,975,160.71	-
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额	299,623,816.66	75,466,997.86	606,137.80

总额			
----	--	--	--

注：本基金合同生效日为2013年03月04日。

## 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

本报告期内本基金管理人、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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增长城证券有限责任公司、中国中投证券有限责任公司、国信证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司各一个交易单元，新增中信建投证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司各两个交

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		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
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	95,200,000.00	100.00%	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

#### 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。

#### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达天天理财货币市场基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-05

2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为代销机构及在广东顺德农村商业银行股份有限公司推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-20
3	易方达基金管理有限公司关于易方达天天理财货币市场基金开放日常定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-21
4	易方达基金管理有限公司关于易方达天天理财货币市场基金开放日常申购、赎回、转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-21
5	易方达基金管理有限公司关于增加新时代证券为易方达天天理财货币市场基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-21
6	易方达天天理财货币市场基金清明节前两个工作日暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-03-28
7	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加中金公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-04-15
8	易方达天天理财货币市场基金五一节前两个工作日暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-04-23
9	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加珠海华润银行为代销机构及在珠海华润银行推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-04-25
10	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加华鑫证券为代销机构、在华鑫证券推出定期定额申购业务及参加华鑫证券自助式交易系统申购与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-04-26
11	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加开源证券为代销机构及在开源证券推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-04-26
12	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加泛华普益为代销机构、在泛华普益推出定期定额申购业务及参加泛华普	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-05-31

	益申购与定期定额申购费率优惠活动的公告		
13	易方达天天理财货币市场基金端午节前两个工作日暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-06-04
14	易方达基金管理有限公司关于调整广发银行借记卡基金网上直销申购费率以及网上直销转换费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-06-14
15	易方达基金管理有限公司关于易方达天天理财货币市场基金A类基金份额在顺德农村商业银行推出定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-06-14
16	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加好买基金为代销机构、在好买基金推出定期定额申购业务及参加好买基金电子交易系统申购与定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-06-18
17	易方达基金管理有限公司关于运用公司固有资金申购旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-06-26
18	易方达基金管理有限公司关于成立易方达资产管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-06-29
19	易方达基金管理有限公司关于运用公司固有资金申购旗下开放式基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2013-06-29

## 11 备查文件目录

### 11.1 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；
- 6.基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 11.3 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

二〇一三年八月二十八日