易方达天天理财货币市场基金

2016 年年度报告

2016 年 12 月 31 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

送出日期：二〇一七年三月三十一日

§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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
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
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§4 管理人报告 13
4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 19
§5 托管人报告 19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 19
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 19
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 19
§6 审计报告 19
6.1 管理层对财务报表的责任 19
6.2 注册会计师的责任 20
6.3 审计意见 20
§7 年度财务报表 20
7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 23
7.4 报表附注 25
§8 投资组合报告 50
8.1 期末基金资产组合情况 50
8.2 债券回购融资情况 51
8.3 基金投资组合平均剩余期限 51
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 52
8.6 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 53

8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 53
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明 53
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明 53
8.8 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 53
8.9 投资组合报告附注 53
§9 基金份额持有人信息 54
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 54
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 55
9.3 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 55
§10 开放式基金份额变动 55
§11 重大事件揭示 56
11.1 基金份额持有人大会决议 56
11.2 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 56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
11.4 基金投资策略的改变 56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 56
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 58
11.9 其他重大事件 58
§12 备查文件目录 62
12.1 备查文件目录 62
12.2 存放地点 62
12.3 查阅方式 62

§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		
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
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		刘晓艳	易会满

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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 40-43 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	易方达天天理	易方达天天理	易方达天天理	易方达天天理	易方达天天理	易方达天天理	易方达天天理	易方达天天理

	财货币A	财货币B	财货币R	财货币A	财货币B	财货币R	财货币A	财货币B	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
3.1.3 累计期末指标	**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
累计净值收益率	15.7665%	16.8326%	16.8776%	12.8152%	13.5807%	13.6131%	8.5897%	9.0643%	9.0846%

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

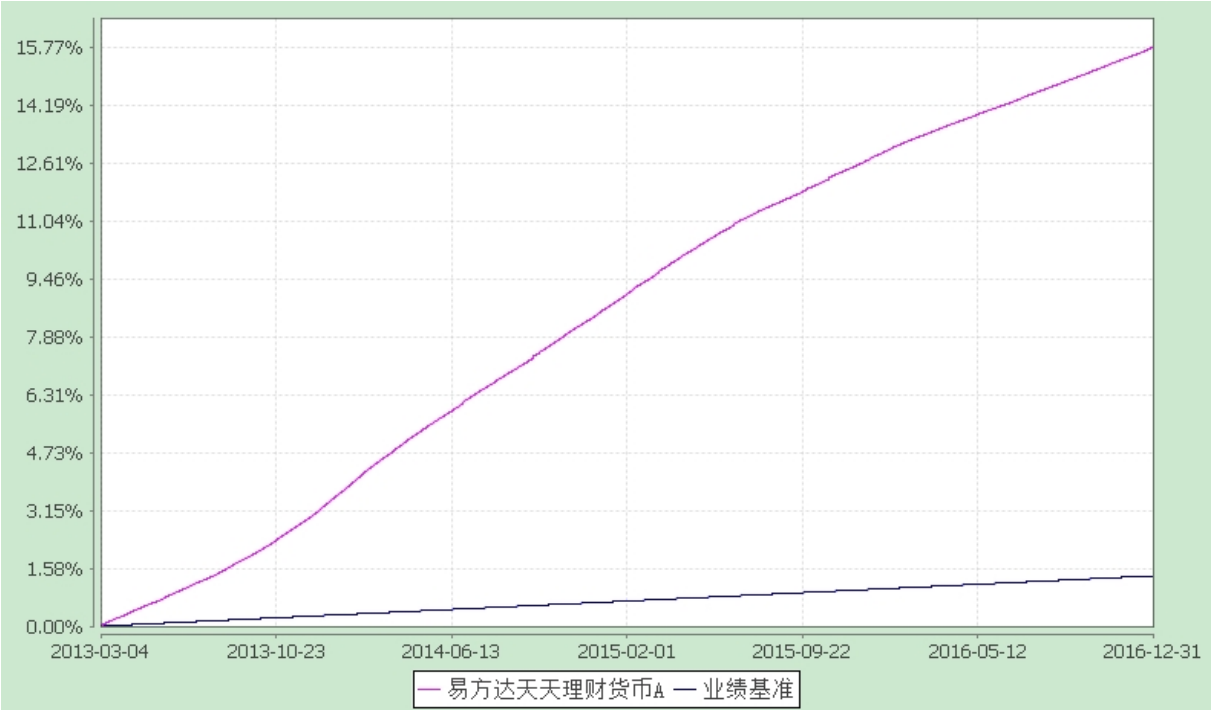
易方达天天理财货币市场基金

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）

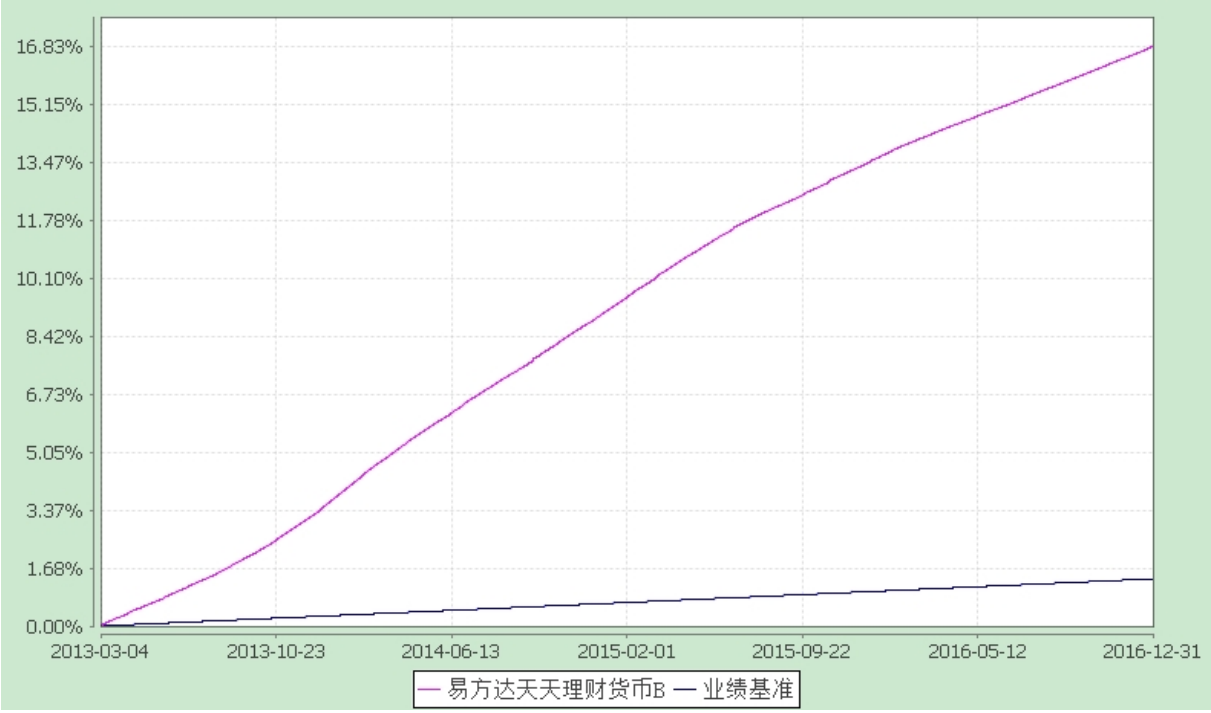
易方达天天理财货币 A

（2013 年 3 月 4 日至 2016 年 12 月 31 日）



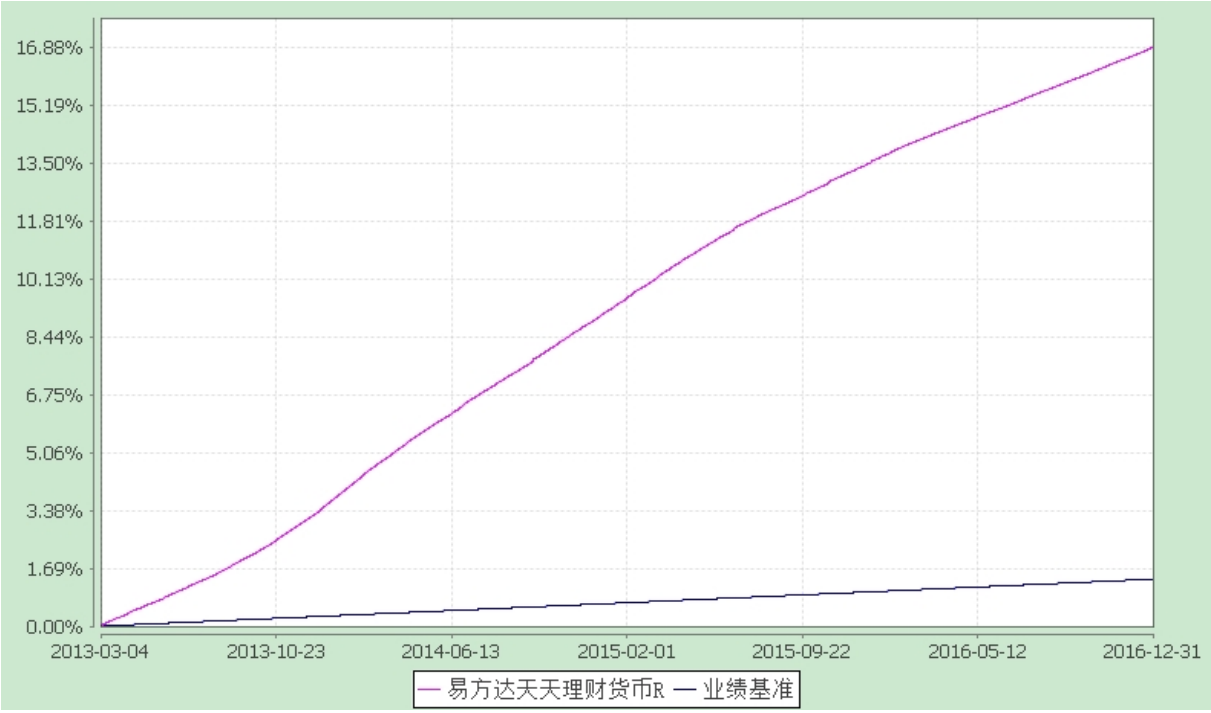
易方达天天理财货币 B

（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）



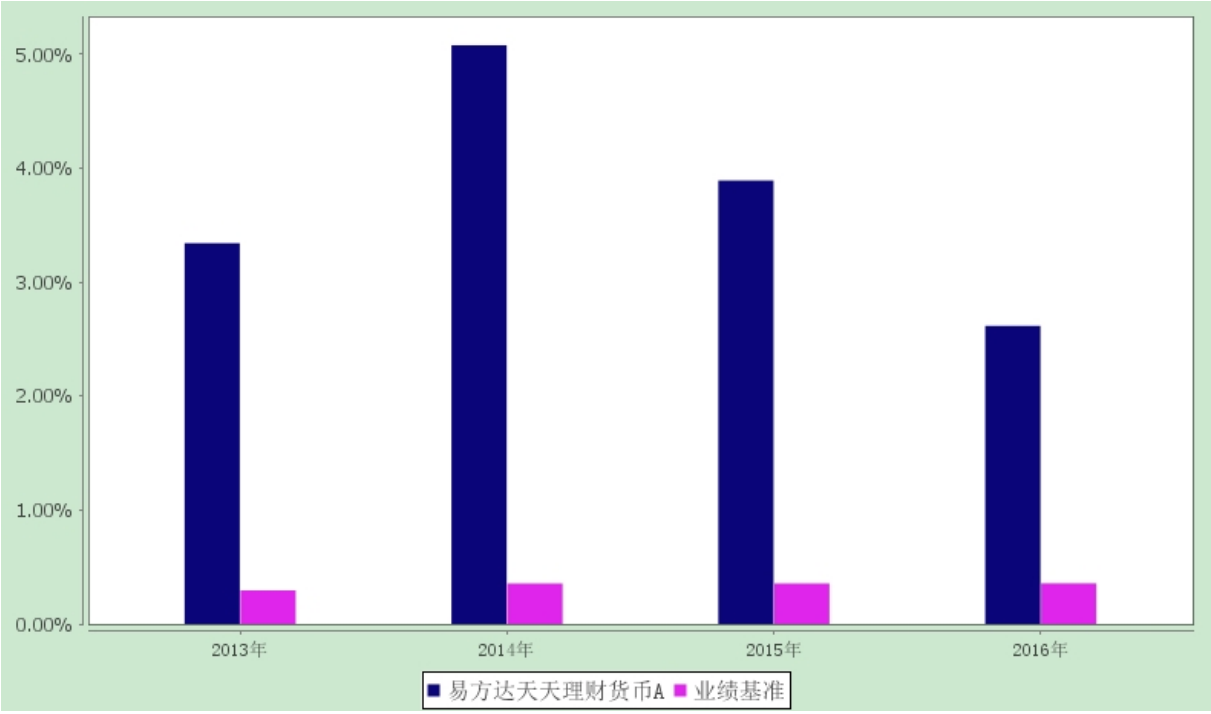
注：自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值收益率为 15.7665%，B 类基金份额净值收益率为 16.8326%，R 类基金份额净值收益率为 16.8776%，同期业绩比较基准收益率为 1.3684%。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

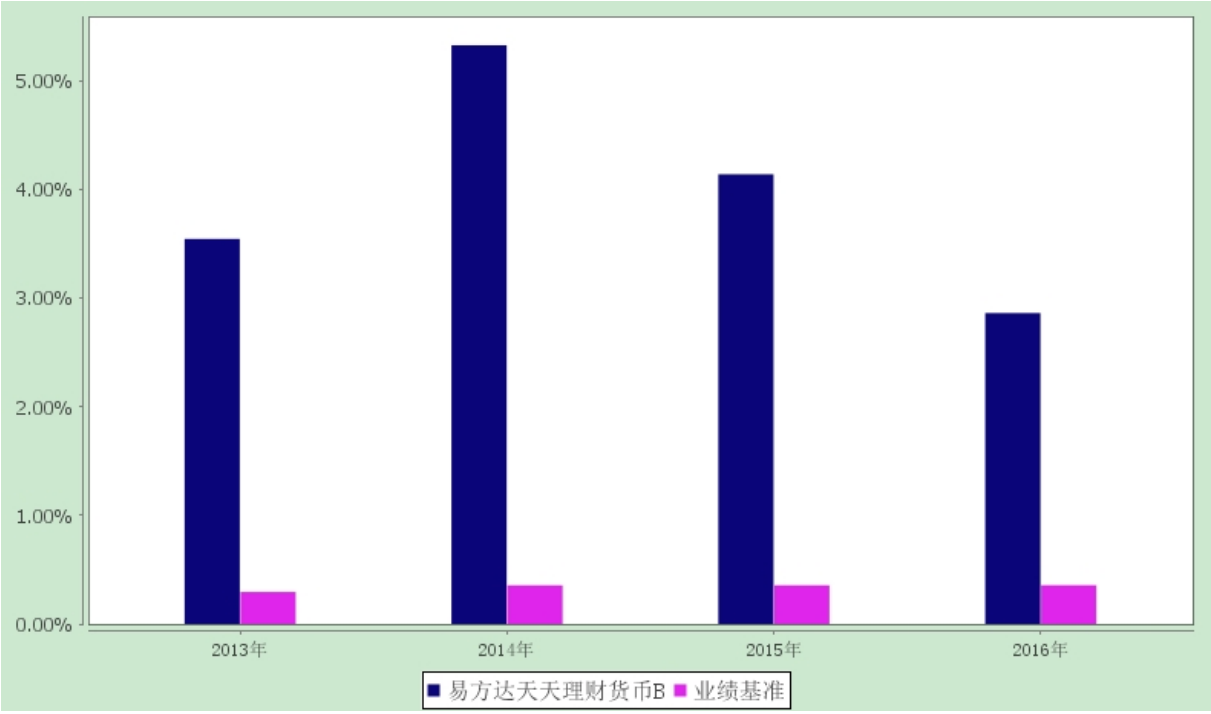
易方达天天理财货币市场基金

自基金合同生效以来基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

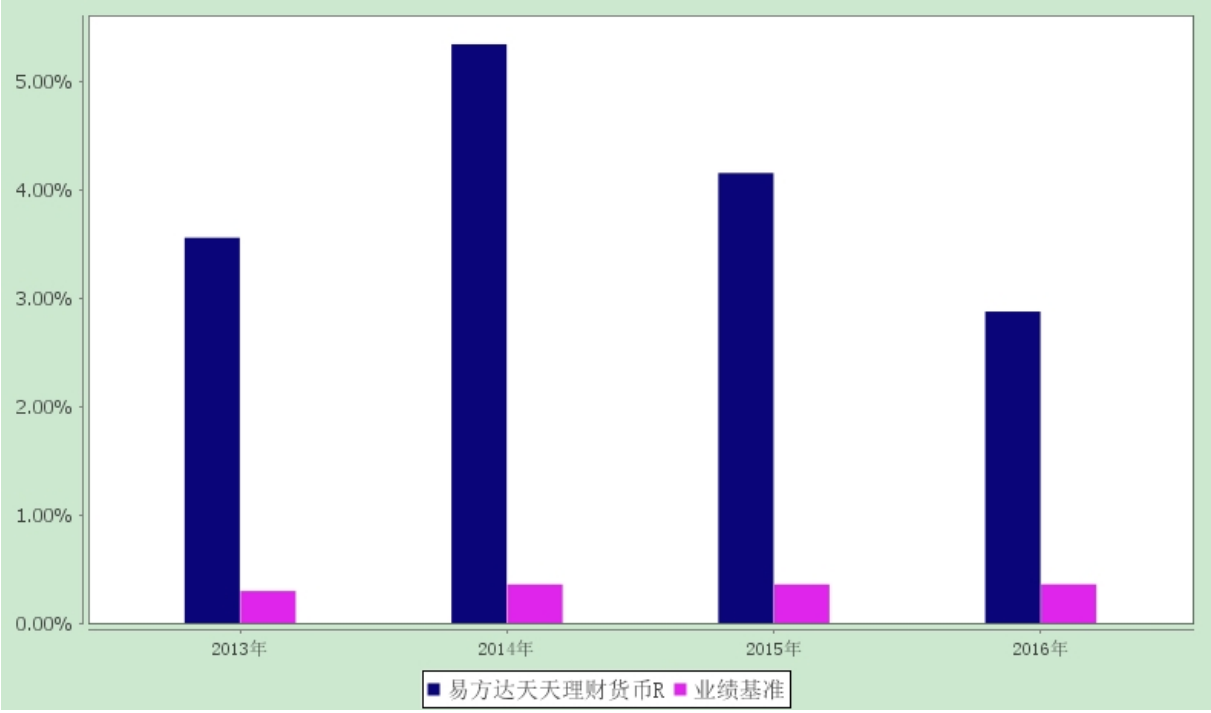
易方达天天理财货币 A



易方达天天理财货币 B



易方达天天理财货币 R



注：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

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	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、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达	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。

	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				
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	-	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、易方达财富快线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、易方达易理财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，石大怿的“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（即公募、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 月末配置需求开始释放，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人根据法规、市场、监管要求的变化和业务发展的实际需要，继续重点围绕严守合规底线、履行合规义务、防控内幕交易等进一步完善公司内控，持续强化制度的完善及对制度执行情况的监督检查，有效保证了旗下基金管理运作及公司各项业务的合法合规和稳健有序。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

（1）结合新法规的实施、新的监管要求和公司业务发展实际，不断推动相关制度流程的建立、健全和完善，及时贯彻落实新法规及新的监管要求，适应公司产品与业务创新发展的需要，保持公司良好的内控环境。

（2）严守合规底线、管好合规风险是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，持续开展对投资管理人员及全体员工的合规培训教育，促进公司合规文化建设；不断完善相关机制流程，重点规范和监控公平交易、异常交易、关联交易，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，完善信息隔离和利益冲突管理制度机制。

（3）继续坚持“保规范、防风险”的思路，紧密跟踪监管政策动向、资本市场变化以及业务

发展的实际需要，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，积极配合各类新产品、新业务、新投资工具、新投资策略的推出和应用，重点加强了对高风险品种和业务的投资合规风险评估及相关控制措施的研究与落实，加强对投资、研究、交易等业务运作的日常合规检查和反馈提示，有效确保了旗下基金资产严格按照法律法规、基金合同和公司制度的要求稳健、规范运作。

（4）对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及 IT 治理、反洗钱等方面开展了一系列专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司的规章制度为依据，推动公司合规、内控体系的健全完善。

（5）积极参与新产品设计、新业务拓展工作，就相关的合规、风控问题提供意见和建议。

（6）督促落实销售适当性管理制度，推动完善销售规范及客户投诉处理机制流程，保障投资者合法权益。

（7）深入贯彻“风险为本”的监管精神，持续完善制度流程，探索建立风险识别、评估、预警和控制一体化的洗钱风险防控体系，推动提升客户身份识别工作水平，强化可疑交易监测分析，做好反洗钱宣传培训、系统研发、内部审计、信息报送等各项工作。

（8）紧跟法规、市场变化和业务发展，持续优化完善信息披露管理工作机制，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保信息披露真实、完整、准确、及时、规范。

（9）不断促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，使合规监控与监察稽核的独立性、规范性、针对性与有效性得到提升。

2016 年，公司获得 ISAE3402（《国际鉴证业务准则 3402 号》）无保留意见的控制设计合理性及运行有效性的报告，鉴证日期区间为 2014 年 7 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。同时，公司通过了 GIPS（全球投资业绩标准）验证，获得 GIPS 验证报告，验证日期区间为 2001 年 9 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日。通过开展上述外部审计鉴证及验证项目，促进公司进一步夯实运营及内控基础，提升核心竞争力。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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(2017)审字第 60468000_G19 号

易方达天天理财货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的易方达天天理财货币市场基金的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是基金管理人易方达基金管理有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价基金管理人选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达天天理财货币市场基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）注册会计师　赵雅　李明明

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2017-03-24

§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	附注号	本期末	上年度末

		2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	22,073,680,409.05	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,389,727,131.29	1,646,700,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	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	**附注号**	**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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	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	7.4.7.9	36,691,262,432.80	59,322,337,675.21
未分配利润	7.4.7.10	-	-
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	附注号	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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	-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“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	-	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	7.4.7.14	-	-
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	7.4.7.15	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。

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。

7.4.4.1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。

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产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及应收款项。

本基金目前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主要为债券投资。

本基金目前持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、结算备付金、买入返售金融资产和各类应收款项等。

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债，主要包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额。取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目；应收款项和其他金融负债等相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格(附注 7.4.4.5)，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认。

7.4.4.5 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”。当基金资产净值与影子价格产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

C.如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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；

(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。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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)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（该收益将会计确认为实收基金，参与下一日的收益分配），定期集中支付收益。通常情况下，本基金的收益支付方式为按月支付，对于可支持按日支付的销售机构，本基金的收益支付方式经基金管理人和销售机构双方协商一致后可以按日支付。不论何种支付方式，当日收益均参与下一日的收益分配，不影响基金份额持有人实际获得的投资收益。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，因去尾形成的余额再次分配，直到分完为止；

(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，定期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。若投资者在定期累计收益支付时，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。

7.4.4.11 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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

7.4.7重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	3,680,409.05	1,646,145.01
定期存款	22,070,000,000.00	23,480,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	4,089,000,000.00	7,550,000,000.00
存款期限 3 个月-1 年	15,681,000,000.00	15,930,000,000.00
存款期限 1 个月以内	2,300,000,000.00	-
其他存款	-	-
合计	22,073,680,409.05	23,481,646,145.01

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 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	9,094,007,585.53	9,119,054,000.00	25,046,414.47	0.0683
	合计	9,094,007,585.53	9,119,054,000.00	25,046,414.47	0.0683
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 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	39,177,957,789.40	39,271,856,600.00	93,898,810.60	0.1583
	合计	39,177,957,789.40	39,271,856,600.00	93,898,810.60	0.1583

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	7,389,727,131.29	-
合计	7,389,727,131.29	-
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,646,700,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	1,646,700,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	32,358.61	23,269.58
应收定期存款利息	79,480,850.82	82,988,205.45
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	86,458,746.04	377,875,715.10
应收买入返售证券利息	9,663,628.29	3,267,110.53
应收申购款利息	-	-
其他	0.10	0.40
合计	175,635,583.86	464,154,301.06

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
其他应收款	30,000.00	52,950.90
待摊费用	-	-
合计	30,000.00	52,950.90

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	326,857.12	449,637.02
合计	326,857.12	449,637.02

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,645.86	27,560.26
预提费用	439,000.00	429,000.00
合计	443,645.86	456,560.26

7.4.7.9 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 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	29,952,999,999.80	29,952,999,999.80
本期申购	98,705,974,332.00	98,705,974,332.00
本期赎回（以“-”号填列）	-112,485,990,584.97	-112,485,990,584.97

本期末	16,172,983,746.83	16,172,983,746.83

易方达天天理财货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	26,906,373,077.62	26,906,373,077.62
本期申购	117,802,782,710.21	117,802,782,710.21
本期赎回（以“-”号填列）	-125,808,707,381.67	-125,808,707,381.67
本期末	18,900,448,406.16	18,900,448,406.16

易方达天天理财货币 R

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,462,964,597.79	2,462,964,597.79
本期申购	15,149,352,993.55	15,149,352,993.55
本期赎回（以“-”号填列）	-15,994,487,311.53	-15,994,487,311.53
本期末	1,617,830,279.81	1,617,830,279.81

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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
上年度末	-	-	-
本期利润	533,540,697.11	-	533,540,697.11
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	-533,540,697.11	-	-533,540,697.11
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
上年度末	-	-	-
本期利润	1,017,474,076.10	-	1,017,474,076.10
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	-1,017,474,076.10	-	-1,017,474,076.10
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
上年度末	-	-	-
本期利润	101,338,711.34	-	101,338,711.34
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	-101,338,711.34	-	-101,338,711.34
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	189,757.50	189,753.96

定期存款利息收入	1,215,994,058.86	883,431,688.66
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	13,720.50
其他	85.83	378,361.85
合计	1,216,183,902.19	884,013,524.97

7.4.7.12 债券投资收益——买卖债券差价收入

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
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	131,569,140,447.28	95,802,103,871.52
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	130,519,187,679.01	94,629,052,453.85
减：应收利息总额	1,136,479,334.48	1,088,121,179.89
买卖债券差价收入	-86,526,566.21	84,930,237.78

7.4.7.13 股利收益

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

7.4.7.14 其他收入

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
基金赎回费收入	-	-
其他	-	24,219.18
合计	-	24,219.18

7.4.7.15 交易费用

本基金所进行的交易，交易费用均入成本，本报告期及上年度可比期间未产生交易费用。

7.4.7.16 其他费用

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

审计费用	130,000.00	120,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	223,934.19	154,418.10
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,625.00	2,699.85
合计	691,559.19	613,117.95

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

2017 年 1 月 6 日财政部、国家税务总局颁布了《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，就其于 2016 年 12 月 21 日颁布的《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》(财税[2016]140 号)中关于“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”的规定做出补充通知，要求 2017 年 7 月 1 日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9关联方关系

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
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
盈峰投资控股集团有限公司	基金管理人股东
广东省广晟资产经营有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	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	基金管理人的子公司
上海莳乾投资中心（有限合伙）	基金管理人投资并由易方达资产管理有限公司的子公司易方达海外投资（深圳）有限公司管理的有限合伙企业

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。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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。

7.4.10.2关联方报酬

7.4.10.2.1基金管理费

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
当期发生的基金应支付的管理费	199,928,972.25	127,155,231.79
其中：支付销售机构的客户维护费	28,250,515.92	46,172,048.68

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。

7.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31

	日	日
当期发生的基金应支付的托管费	60,584,536.96	38,531,888.41

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。

7.4.10.2.3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 2016年1月1日至2016年12月31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	8,454,106.68	3,538,001.40	-	11,992,108.08
中国工商银行	6,446,392.09	23,117.91	-	6,469,510.00
广发证券	-	-	-	-
合计	14,900,498.77	3,561,119.31	-	18,461,618.08
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	10,252,626.94	562,114.01	-	10,814,740.95
中国工商银行	11,276,085.64	54,863.02	-	11,330,948.66
广发证券	-	-	-	-
合计	21,528,712.58	616,977.03	-	22,145,689.61

注：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×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。

7.4.10.3 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 2016年1月1日至2016年12月31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	1,500,371,466.41	595,772,706.01	-	-	228,633,030,000.00	25,375,662.26
上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	1,239,721,774.14	670,701,814.05	-	-	178,678,552,000.00	15,269,635.92

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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		
	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
报告期初持有	-	738,938,034.68	-	-	-	-

的基金份额						
报告期间申购/买入总份额	-	1,248,416,038.27	-	-	1,739,123,725.89	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	1,240,000,000.00	-	-	1,000,185,691.21	-
报告期末持有的基金份额	-	747,354,072.95	-	-	738,938,034.68	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.95%	-	-	2.75%	-

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。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015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
广东省易方达教育基金会	1,356,413.83	0.01%	206,195.66	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。

易方达天天理财货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015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
广东省易方达教育基金会	2,564,506.70	0.01%	15,001,186.94	0.06%
上海蓟乾投资中心（有限合伙）	121,931,411.93	0.65%	-	-
广发证券	-	-	4,021,112,691.85	14.94%

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。

易方达天天理财货币 R

无。

7.4.10.5 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 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	
	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	3,680,409.05	189,757.50	1,646,145.01	149,164,365.21

注：本基金的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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间					

2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中国工商银行	011570003	15 赣高速 SCP003	分销	1,000,000	100,000,000.00
中国工商银行	011592002	15 电科院 SCP002	分销	700,000	70,000,000.00
中国工商银行	011599153	15 山钢 SCP004	分销	2,000,000	200,000,000.00
中国工商银行	041553017	15 兖州煤业 CP001	分销	2,300,000	230,000,000.00

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

1、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
533,540,697.11	-	-	533,540,697.11	-

2、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
1,017,474,076.10	-	-	1,017,474,076.10	-

3、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
101,338,711.34	-	-	101,338,711.	-

			34	

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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。

7.4.12.2 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股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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 2,396,124,209.93 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
140401	14 农发 01	2017-01-03	100.14	1,712,000	171,443,520.96
150315	15 进出 15	2017-01-03	99.64	3,000,000	298,926,122.54
160401	16 农发 01	2017-01-03	100.00	3,000,000	299,995,645.42
160414	16 农发 14	2017-01-03	100.09	3,400,000	340,320,589.26
160401	16 农发 01	2017-01-04	100.00	11,100,000	1,109,983,888.04
160414	16 农发 14	2017-01-04	100.09	3,300,000	330,311,160.17
111612251	16 北京银行 CD251	2017-01-05	97.87	516,000	50,498,362.15
041653026	16 河钢 CP002	2017-01-06	99.54	505,000	50,266,495.18
合计				26,533,000	2,651,745,783.72

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行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 2016 年 12 月 31 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 16.78%(2015 年 12 月 31 日：60.94%)。

7.4.13.2.1 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
A-1	380,724,661.29	9,289,735,372.85
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	8,799,741,670.28	29,792,122,609.11
合计	9,180,466,331.57	39,081,857,981.96

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、央票及未有第三方机构评级的短期融资券、同业存单。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
AAA	0.00	473,975,522.54
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	473,975,522.54

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大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.3 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 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2016 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	22,073,680,409.05	-	-	-	22,073,680,409.05
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	176.99	-	-	-	176.99
交易性金融资产	9,094,007,585.53	-	-	-	9,094,007,585.53
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	7,389,727,131.29	-	-	-	7,389,727,131.29
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	175,635,583.86	175,635,583.86
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	465,372,699.69	465,372,699.69
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	30,000.00	30,000.00
资产总计	38,557,415,302.86	-	-	641,038,283.55	39,198,453,586.41
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	-	-	-	2,396,124,209.93
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	91,063,139.73	91,063,139.73
应付管理人报酬	-	-	-	11,400,080.42	11,400,080.42
应付托管费	-	-	-	3,454,569.82	3,454,569.82
应付销售服务费	-	-	-	3,781,624.75	3,781,624.75
应付交易费用	-	-	-	326,857.12	326,857.12
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	597,025.98	597,025.98

应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	443,645.86	443,645.86
负债总计	2,396,124,209.93	-	-	111,066,943.68	2,507,191,153.61
利率敏感度缺口	36,161,291,092.93	-	-	529,971,339.87	36,691,262,432.80
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	23,481,646,145.01	-	-	-	23,481,646,145.01
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	827.19	-	-	-	827.19
交易性金融资产	39,177,957,789.40	-	-	-	39,177,957,789.40
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	1,646,700,000.00	-	-	-	1,646,700,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	464,154,301.06	464,154,301.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,415,123,162.69	2,415,123,162.69
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	52,950.90	52,950.90
资产总计	64,306,304,761.60	-	-	2,879,330,414.65	67,185,635,176.25
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	7,649,892,312.35	-	-	-	7,649,892,312.35
应付证券清	-	-	-	120,532,753.97	120,532,753.97

算款					
应付赎回款	-	-	-	68,763,099.01	68,763,099.01
应付管理人报酬	-	-	-	12,636,727.13	12,636,727.13
应付托管费	-	-	-	3,829,311.23	3,829,311.23
应付销售服务费	-	-	-	5,290,066.92	5,290,066.92
应付交易费用	-	-	-	449,637.02	449,637.02
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	1,447,033.15	1,447,033.15
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	456,560.26	456,560.26
负债总计	7,649,892,312.35	-	-	213,405,188.69	7,863,297,501.04
利率敏感度缺口	56,656,412,449.25	-	-	2,665,925,225.96	59,322,337,675.21

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。

7.4.13.4.1.2 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 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	8,825,427.88	36,815,137.32
	2.市场利率上升 25 个基点	-8,802,453.22	-36,719,100.68

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

7.4.14 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 2016 年 12 月 31 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 9,094,007,585.53 元，无属于第一或第三层次的余额(2015 年 12 月 31 日：第二层次 39,177,957,789.40 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 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	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	22,073,680,409.05	56.31
4	其他各项资产	641,038,460.54	1.64
5	合计	39,198,453,586.41	100.00

8.2 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	10.49	
	其中：买断式回购融资	0.03	
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	2,396,124,209.93	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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

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。

8.3.2 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	28.85	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		105.09	6.53

8.4 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。

8.5 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	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	368,474,338.00	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

8.6 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	111609501	16 浦发 CD501	20,000,000	1,950,172,923.07	5.32
2	160401	16 农发 01	14,100,000	1,409,979,533.46	3.84
3	111609294	16 浦发 CD294	10,000,000	984,166,279.12	2.68
4	111609500	16 浦发 CD500	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	298,798,008.05	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	295,205,000.12	0.80

8.7 “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	0.1848%
报告期内偏离度的最低值	-0.0161%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0942%

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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.216 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。

8.9.3 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	176.99
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

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	2,459,395	6,576.00	27,512,937.66	0.17%	16,145,470,809.17	99.83%
易方达天天理财货币 B	248	76,211,485.51	18,254,346,010.90	96.58%	646,102,395.26	3.42%
易方达天天理财货币 R	220	7,353,774.00	1,617,830,279.81	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,459,863	14,915.98	19,899,689,228.37	54.24%	16,791,573,204.43	45.76%

9.2 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	50,138,724.44	0.3100%
	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%
	合计	50,138,724.44	0.1367%

9.3 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	易方达天天理财货币 A	>100
	易方达天天理财货币 B	0

持有本开放式基金	易方达天天理财货币 R	0
	合计	>100
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
	合计	0~10

§10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	600,000.00
本报告期期初基金份额总额	29,952,999,999.80	26,906,373,077.62	2,462,964,597.79
本报告期基金总申购份额	98,705,974,332.00	117,802,782,710.21	15,149,352,993.55
减：本报告期基金总赎回份额	112,485,990,584.97	125,808,707,381.67	15,994,487,311.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本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

§11重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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 2016 年 4 月 30 日发布公告，自 2016 年 4 月 30 日起聘任詹余引先生担任公司董事长，叶俊英先生不再担任公司董事长，肖坚先生不再担任公司副总经理；于 2016 年 8 月 27 日发布公告，自 2016 年 8 月 27 日起聘任吴欣荣先生担任公司副总经理。

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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 4 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 130,000.00 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增东北证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、中信证券股份有限公司各一个交易单元。

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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	1,500,000,000.00	100.00%	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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。

11.9 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	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加东海期货为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-11
2	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放	中国证券报、上海证券	2016-01-28

	式基金增加中经北证为销售机构、参加中经北证申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
3	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证金牛为销售机构、参加中证金牛申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
4	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-01-28
5	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加德州银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-02
6	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加富济财富为销售机构、参加富济财富申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-08
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青岛农商银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-09
8	易方达基金管理有限公司关于在大同证券推出旗下部分开放式基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-10
9	易方达基金管理有限公司关于新增盛京银行为易方达天天理财货币市场基金销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-21
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厦门银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-21
11	易方达天天理财货币市场基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-03-29
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宁波银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-08
13	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加浙江泰隆商业银行为销售机构、参加浙江泰隆商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-08
14	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正达广为销售机构、参加中正达广申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-21
15	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加锦州银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2016-04-22

		理人网站	
16	关于易方达基金管理有限公司从业人员在易方达资产管理有限公司兼职情况变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
17	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
18	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-04-30
19	易方达基金管理有限公司关于网上直销支付宝基金支付业务下线的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-05
20	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加云南红塔银行为销售机构、参加云南红塔银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-09
21	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加徽商期货为销售机构、参加徽商期货申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-18
22	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金参加盈米财富转换费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加奕丰金融为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-20
24	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原银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-24
25	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加川财证券为销售机构、参加川财证券申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-27
26	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加大连银行为销售机构、参加大连银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-05-31
27	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加鼎信汇金为销售机构、参加鼎信汇金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-01
28	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加余杭农村商业银行为销售机构、参加余杭农村商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-23

29	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加龙江银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30
30	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加青海银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-06-30
31	易方达基金管理有限公司关于在陆金所资管开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加陆金所资管定期定额投资费率优惠活动的的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-01
32	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加苏宁基金为销售机构、参加苏宁基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-07
33	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加德清农商银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-08
34	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加昆山农村商业银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-15
35	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加九台农商银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-21
36	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加植信基金为销售机构、参加植信基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-22
37	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加嘉兴银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-28
38	易方达基金管理有限公司关于在新浪仓石开通旗下部分开放式基金定期定额投资业务、参加新浪仓石定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-07-29
39	易方达天天理财货币市场基金调整申购、转换转入等业务限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-08-04
40	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加途牛金服为销售机构、参加途牛金服申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-08-05
41	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加万得投顾为销售机构、参加万得投顾申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-08-12
42	易方达基金管理有限公司关于旗下货币市场基金修订基金合同、托管协议部分条款的公	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管	2016-08-20

	告	理人网站	
43	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-08-27
44	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加东证期货为销售机构、参加东证期货申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-01
45	易方达基金管理有限公司关于调整旗下部分开放式基金申购、转换转入及定期定额投资的金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-01
46	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西证券为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-05
47	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加金百临为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-06
48	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加武汉农村商业银行为销售机构、参加武汉农村商业银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-20
49	易方达天天理财货币市场基金 A 类份额、B 类份额国庆节前两个工作日在非直销销售机构暂停大额申购、大额转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-09-26
50	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加富阳农商银行为销售机构、参加富阳农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-10-14
51	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加慈溪农村商业银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-10-17
52	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加弘业期货为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-11-04
53	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加瑞安农商银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-11-09
54	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加汇成基金为销售机构、参加汇成基金申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-11-21
55	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加萧山农商银行为销售机构、参加萧山农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-07

56	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加宁夏银行为销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-23
57	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加佛山农商银行为销售机构、参加佛山农商银行申购与定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2016-12-26

§12备查文件目录

12.1 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。

12.2 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。

12.3 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

二〇一七年三月三十一日