

# 易方达天天理财货币市场基金

## 2018 年年度报告

2018 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：二〇一九年三月二十八日

## § 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 2019 年 3 月 26 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 2018 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.....	6
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.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	8
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	14
§ 4	管理人报告.....	15
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	19
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
§ 5	托管人报告.....	22
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
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.....	22
§ 6	审计报告.....	22
6.1	审计意见.....	22
6.2	形成审计意见的基础.....	23
6.3	其他信息.....	23
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任.....	23
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任.....	23
§ 7	年度财务报表.....	24
7.1	资产负债表.....	24
7.2	利润表.....	26
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	28
7.4	报表附注.....	29
§ 8	投资组合报告.....	58
8.1	期末基金资产组合情况.....	58
8.2	债券回购融资情况.....	58
8.3	基金投资组合平均剩余期限.....	58
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.....	59

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	59
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 .....	60
8.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	60
	报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明 .....	61
	报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明 .....	61
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 .....	61
8.9	投资组合报告附注 .....	61
§ 9	基金份额持有人信息 .....	63
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2	期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	64
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
9.4	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 .....	64
§ 10	开放式基金份额变动 .....	65
§ 11	重大事件揭示 .....	65
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
11.4	基金投资策略的改变 .....	66
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	66
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 .....	66
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	67
11.9	其他重大事件 .....	67
§ 12	备查文件目录 .....	70
12.1	备查文件目录 .....	70
12.2	存放地点 .....	70
12.3	查阅方式 .....	70

## § 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	70,828,152,651.50 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	易方达天天理 财货币 C
下属分级基金的交易代码	000009	000010	000013	005122
报告期末下属分级基金的份 额	34,517,941,05 1.57 份	33,261,533,88 8.74 份	2,846,952,360. 72 份	201,725,350.4 7 份

注：自 2017 年 10 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 10 月 24 日。

### 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	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华路 6号105室-42891（集中办公 区）	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	<a href="http://www.efunds.com.cn">http://www.efunds.com.cn</a>
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	2018 年				2017 年				2016 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 C	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 C	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 C
本期已实现收益	1,664,044,526.69	1,425,949,400.27	157,022,297.70	7,203,662.11	1,147,921,379.31	1,296,706,596.79	140,314,013.34	30,530.45	533,540,697.11	1,017,474,076.10	101,338,711.34	-
本期利润	1,664,044,526.69	1,425,949,400.27	157,022,297.70	7,203,662.11	1,147,921,379.31	1,296,706,596.79	140,314,013.34	30,530.45	533,540,697.11	1,017,474,076.10	101,338,711.34	-
本期净值收益率	3.7124%	3.9616%	3.9720%	3.7138%	4.0115%	4.2608%	4.2713%	0.7560%	2.6160%	2.8630%	2.8733%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末				2017 年末				2016 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 C	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 C	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 C
期末基金资产净值	34,517,941,051.57	33,261,533,888.74	2,846,952,360.72	201,725,350.47	36,160,184,301.22	30,249,045,508.55	2,287,844,823.16	22,544,901.55	16,172,983,746.83	18,900,448,406.16	1,617,830,279.81	-
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	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	2018 年末				2017 年末				2016 年末			
	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	易方达天天理财货币	易方达天天理财货币	易方达天天理财货币	易方达天天理财货币	易方达天天理财货币	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	易方达天天理财货币

	币 A			币 C	币 A	币 B	币 R	币 C			天 理 财 货 币 R	币 C
累计净值收 益率	24.8 805 %	26.6363 %	26.7105 %	4.497 9%	20.41 05%	21.81 06%	21.86 98%	0.756 0%	15.7665 %	16.8326 %	16.8 776 %	-

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.自 2017 年 10 月 23 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2017 年 10 月 24 日,增设当期的相关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

##### 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	0.7424%	0.0002%	0.0895%	0.0000%	0.6529%	0.0002%
过去六个月	1.6300%	0.0009%	0.1790%	0.0000%	1.4510%	0.0009%
过去一年	3.7124%	0.0014%	0.3555%	0.0000%	3.3569%	0.0014%
过去三年	10.6947%	0.0020%	1.0712%	0.0000%	9.6235%	0.0020%
过去五年	20.8429%	0.0036%	1.7910%	0.0000%	19.0519%	0.0036%
自基金合同生 效起至今	24.8805%	0.0036%	2.0904%	0.0000%	22.7901%	0.0036%

##### 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	0.8036%	0.0002%	0.0895%	0.0000%	0.7141%	0.0002%
过去六个月	1.7533%	0.0009%	0.1790%	0.0000%	1.5743%	0.0009%
过去一年	3.9616%	0.0014%	0.3555%	0.0000%	3.6061%	0.0014%
过去三年	11.4945%	0.0020%	1.0712%	0.0000%	10.4233%	0.0020%
过去五年	22.2998%	0.0036%	1.7910%	0.0000%	20.5088%	0.0036%



自基金合同生效起至今	26.6363%	0.0036%	2.0904%	0.0000%	24.5459%	0.0036%
------------	----------	---------	---------	---------	----------	---------

**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	0.8061%	0.0002%	0.0895%	0.0000%	0.7166%	0.0002%
过去六个月	1.7584%	0.0009%	0.1790%	0.0000%	1.5794%	0.0009%
过去一年	3.9720%	0.0014%	0.3555%	0.0000%	3.6165%	0.0014%
过去三年	11.5280%	0.0020%	1.0712%	0.0000%	10.4568%	0.0020%
过去五年	22.3609%	0.0036%	1.7910%	0.0000%	20.5699%	0.0036%
自基金合同生效起至今	26.7105%	0.0036%	2.0904%	0.0000%	24.6201%	0.0036%

**易方达天天理财货币 C:**

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	0.7426%	0.0002%	0.0895%	0.0000%	0.6531%	0.0002%
过去六个月	1.6299%	0.0009%	0.1790%	0.0000%	1.4509%	0.0009%
过去一年	3.7138%	0.0014%	0.3555%	0.0000%	3.3583%	0.0014%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.4979%	0.0014%	0.4228%	0.0000%	4.0751%	0.0014%

注：自 2017 年 10 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 10 月 24 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

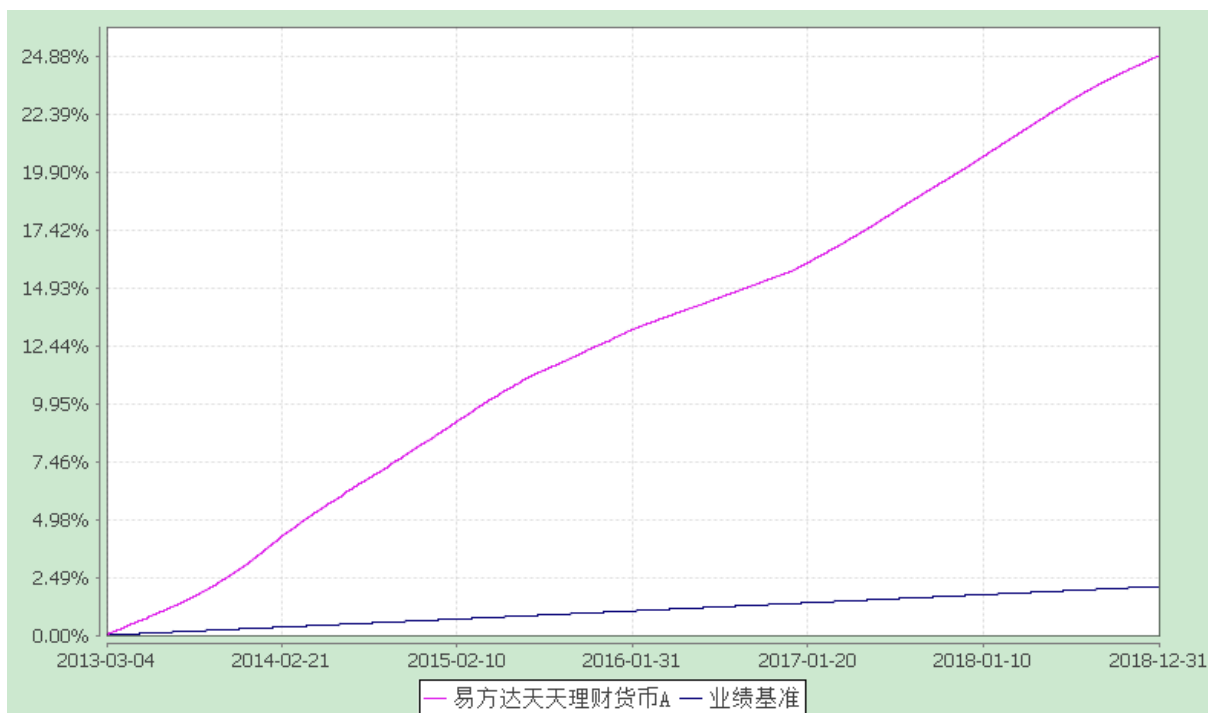
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 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

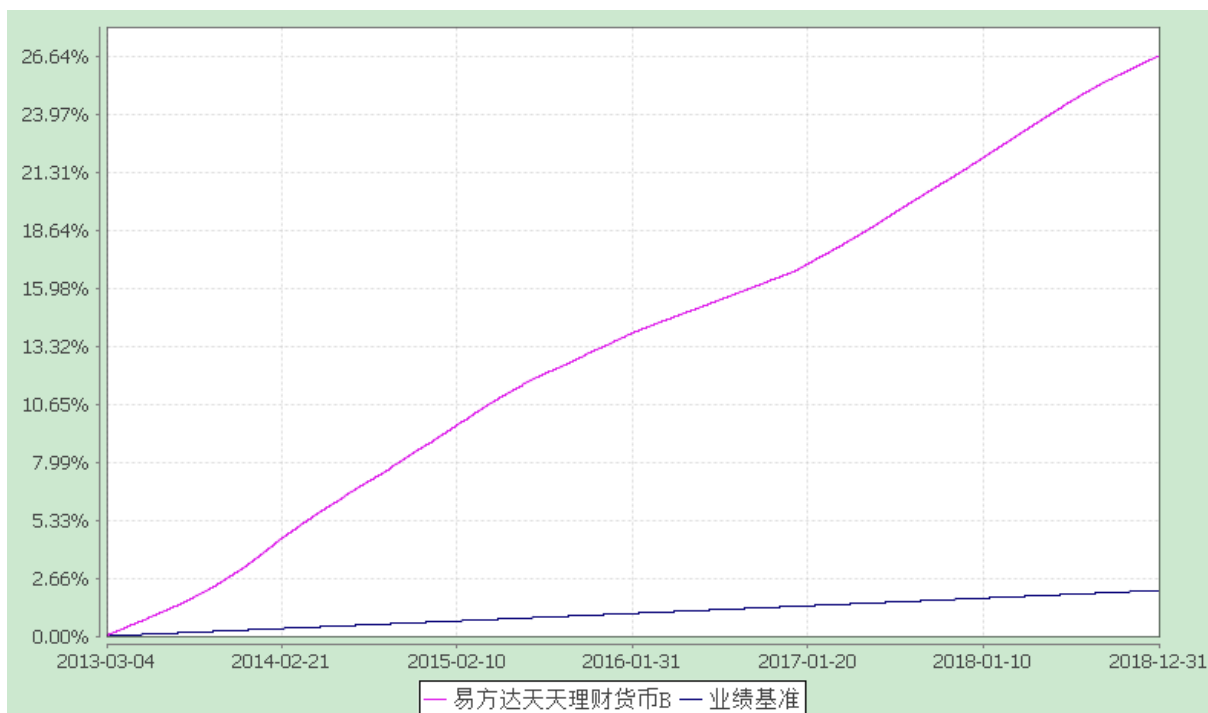
#### 易方达天天理财货币 A

(2013 年 3 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日)



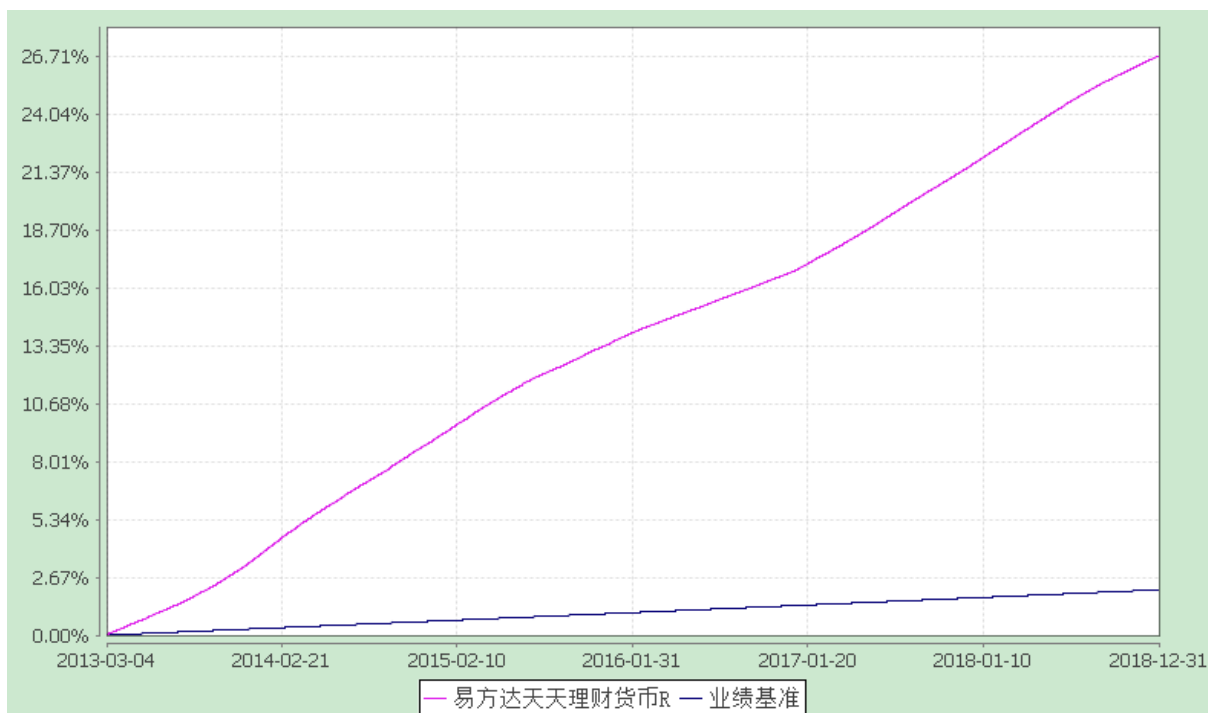
易方达天天理财货币 B

(2013 年 3 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日)



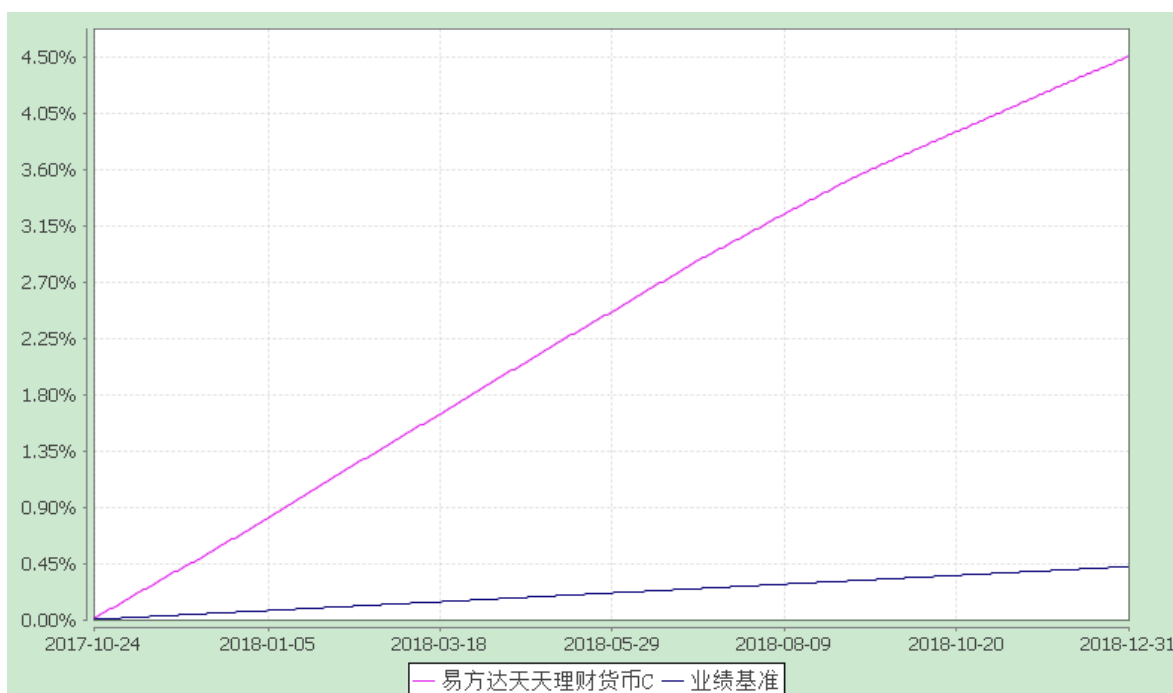
易方达天天理财货币 R

(2013 年 3 月 4 日至 2018 年 12 月 31 日)



易方达天天理财货币 C

(2017 年 10 月 24 日至 2018 年 12 月 31 日)



注：1.自 2017 年 10 月 23 日起，本基金增设 C 类份额类别，份额首次确认日为 2017 年 10 月 24 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

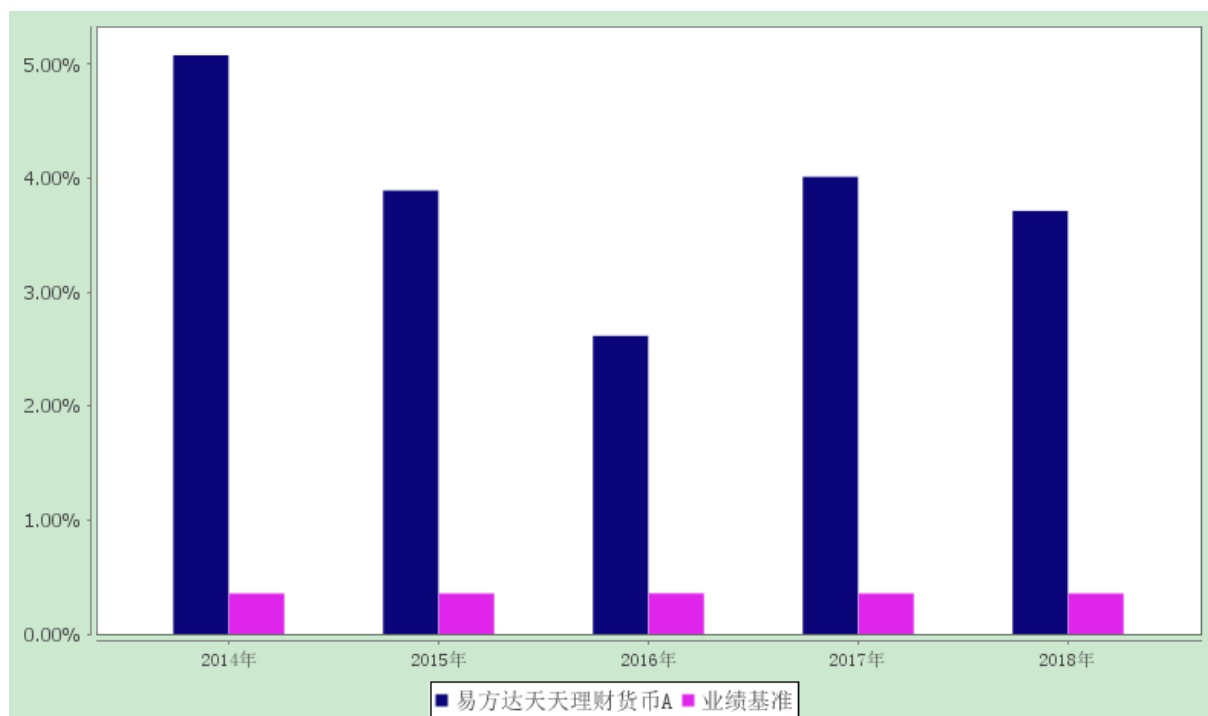
2.自基金合同生效至报告期末，A 类基金份额净值收益率为 24.8805%，B 类基金份额净值收益率为 26.6363%，R 类基金份额净值收益率为 26.7105%，同期业绩比较基准收益率为 2.0904%。C 类基金份额净值收益率为 4.4979%，同期业绩比较基准收益率为 0.4228%。

### 3.2.3 过去五年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

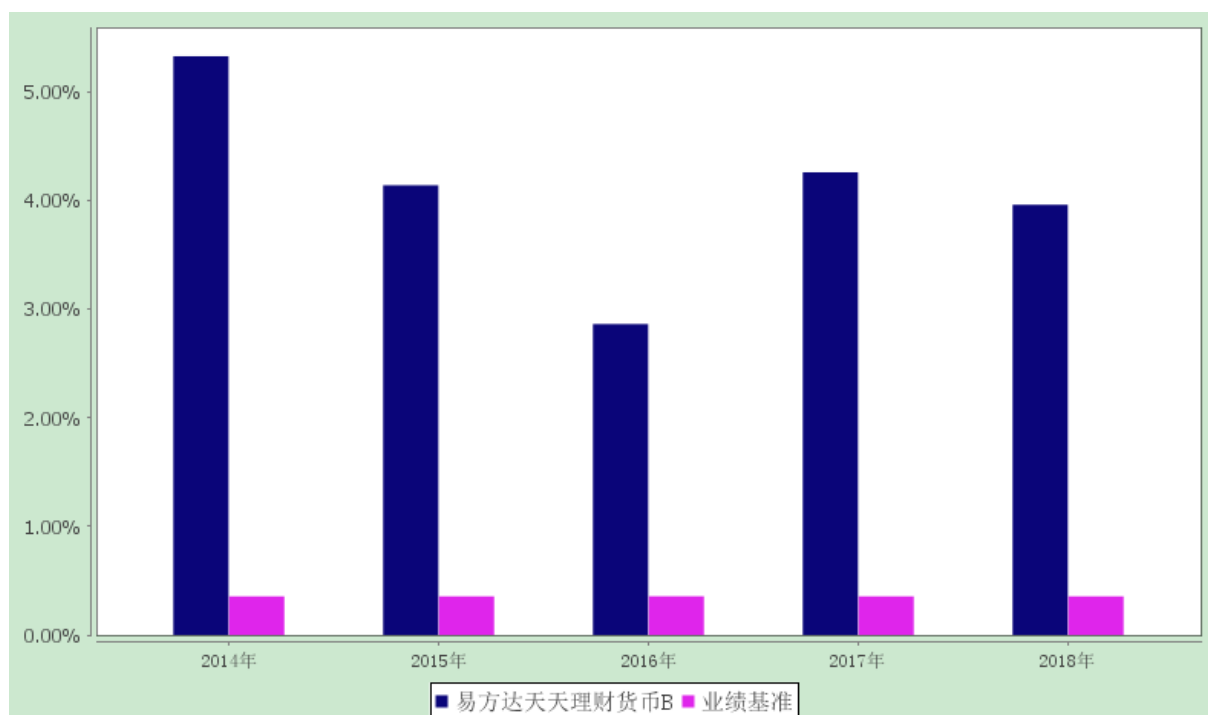
易方达天天理财货币市场基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

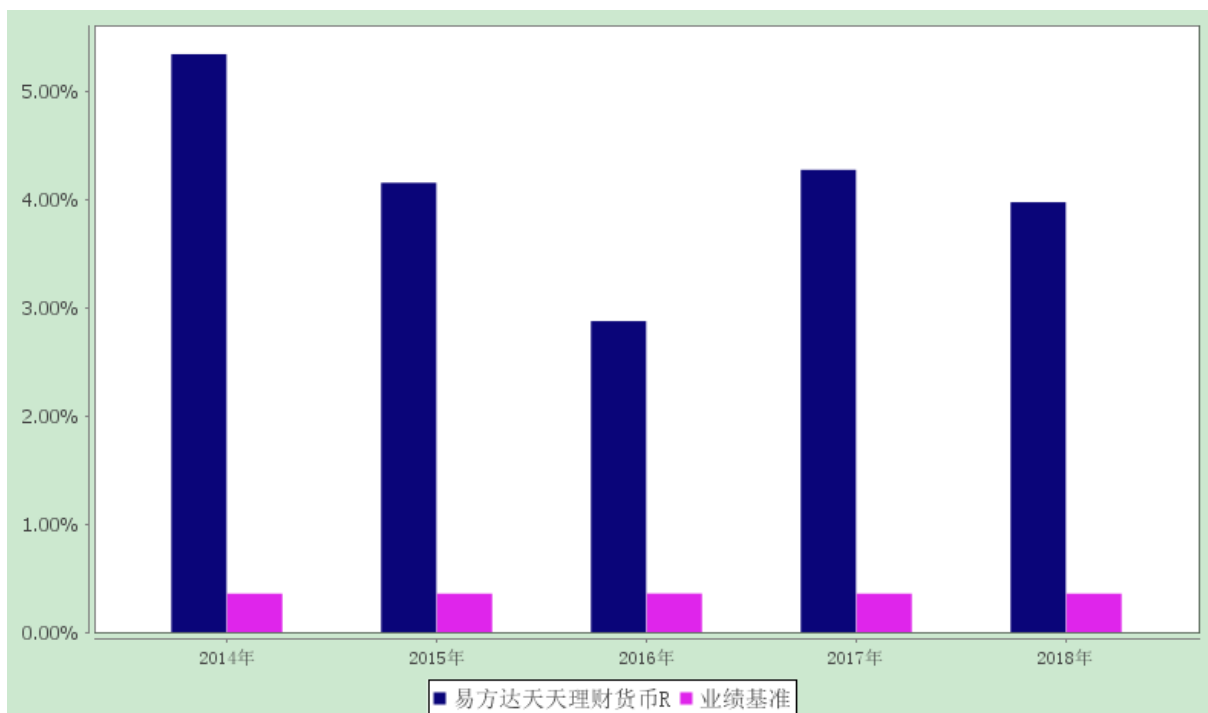
易方达天天理财货币 A



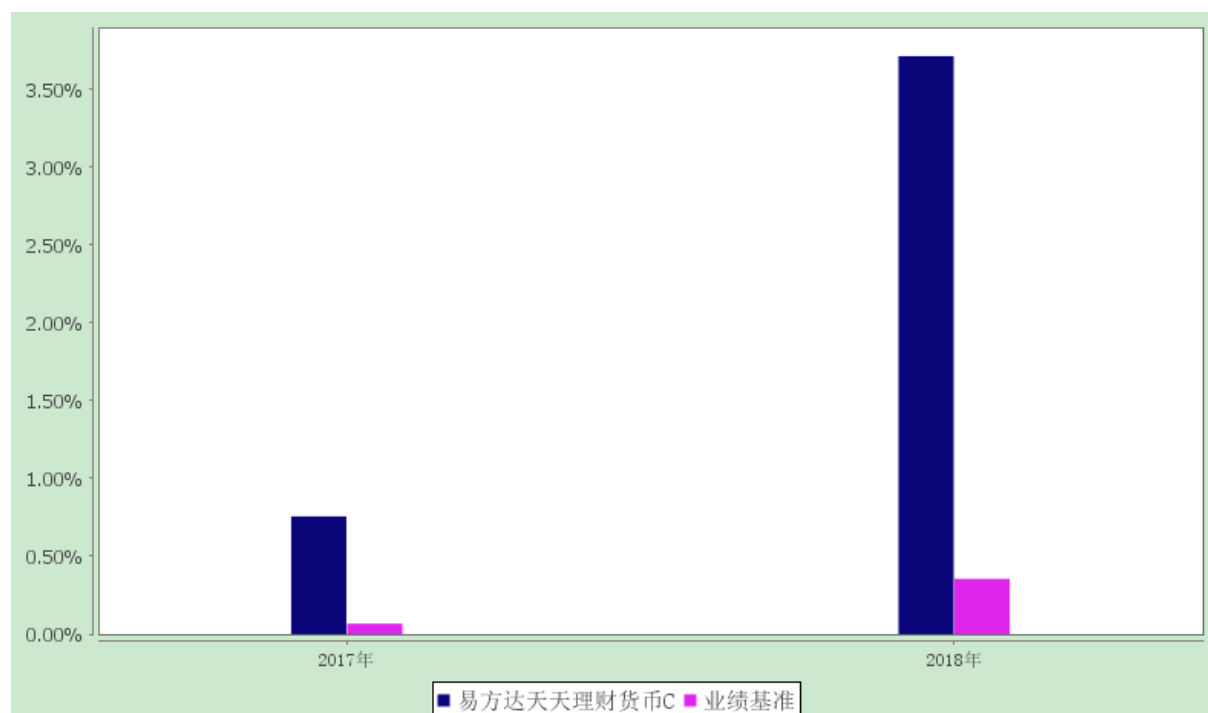
易方达天天理财货币 B



易方达天天理财货币 R



易方达天天理财货币 C



注：自 2017 年 10 月 23 日起,本基金增设 C 类份额类别,份额首次确认日为 2017 年 10 月 24 日,增设当期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
2018 年	1,664,044,52 6.69	-	-	1,664,044,526.69	-
2017 年	1,147,921,37 9.31	-	-	1,147,921,379.31	-
2016 年	533,540,697. 11	-	-	533,540,697.11	-
合计	3,345,506,60 3.11	-	-	3,345,506,603.11	-

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
2018 年	1,425,949,40 0.27	-	-	1,425,949,400.27	-
2017 年	1,296,706,59 6.79	-	-	1,296,706,596.79	-
2016 年	1,017,474,07 6.10	-	-	1,017,474,076.10	-
合计	3,740,130,07 3.16	-	-	3,740,130,073.16	-

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
2018 年	157,022,297. 70	-	-	157,022,297.70	-
2017 年	140,314,013. 34	-	-	140,314,013.34	-

2016 年	101,338,711.34	-	-	101,338,711.34	-
合计	398,675,022.38	-	-	398,675,022.38	-

易方达天天理财货币 C

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
2018 年	7,203,662.11	-	-	7,203,662.11	-
2017 年 10 月 23 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日	30,530.45	-	-	30,530.45	-
合计	7,234,192.56	-	-	7,234,192.56	-

## § 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，总部设在广州，在北京、上海、香港、深圳等地设有分公司或子公司，并全资拥有易方达资产管理有限公司与易方达国际控股有限公司两家子公司。易方达始终坚持在诚信规范的前提下，通过市场化、专业化的运作，为境内外投资者提供专业的资产管理解决方案，成为国内领先的综合性资产管理机构。易方达拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、QFII、RQFII、QDIE、QFLP、基本养老保险基金投资等业务资格，是国内基金行业为数不多的“全牌照”公司之一，在主动权益、固定收益、指数量化、海外投资、多资产投资等领域全面布局。截至 2018 年 12 月 31 日，易方达总资产管理规模超过 1.2 万亿元，服务近 8000 万客户，自成立以来仅公募基金累计分红达 1150 亿元。

#### 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		
石大恽	本基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、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、易方达天天发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、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、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、易方达恒安定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理助理	2013-03-04	-	9 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、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、现金管理部总经理	2016-03-29	-	11 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、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、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	2015-02-17	-	8 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、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理。



	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、易方达财富快线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 琢	本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、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达天天发货币市场基金的基金经理助理、易方达现金增利货币市场基金的基金经理助理、易方达增金宝货币市场基金的基金经理助理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理助理、易方达天天增利货币市场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助理、易方达易理财货币市场基金的基金经理助理、易方达保证金收益货币市场基金的基金经理助理、易方达双月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达月月利理财债券型证券投资基金的基金经理助理	2018-06-20	-	8 年	硕士研究生，曾任汇添富基金管理有限公司债券交易员，易方达基金管理有限公司高级债券交易员。

注：1.此处的“离任日期”为公告确定的解聘日期，石大恽的“任职日期”为基金合同生效之日，刘朝阳、梁莹、易琢的“任职日期”为公告确定的聘任日期。

2.证券从业的含义遵从《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 and 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 2018 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 131 次，其中 127 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，4 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

2018 年我国宏观经济面临较大的下行压力。上半年经济走势相对平稳，工业增加值等指标在上半年仍然维持在较高的水平。尽管基建投资数据有所回落，但从其他分项上看，制造业投资及房地产投资的表现仍然良好，尤其是房地产开发投资同比增速达到 9.7%。下半年国内经济运行面临的不确定性有所增加。工业增加值增速由 2018 年 4-5 月的 7% 左右下降至 6-6.1%，四季度则进一步回落至 6% 以下。随着基建投资的不断下滑，固定资产投资增速整体也进一步下行。下半年中美贸易争端开始逐步升级，欧洲经济复苏节奏持续放缓，这些外部因素使得国内市场避险情绪不断增强。资管新规等一系列金融监管政策的影响使得信用收缩趋势显著，委托贷款和信托贷款数据的下降速度均有所加快，社会融资总量同比增速下滑。货币政策在全年维持放松，央行数次下调了存款准备金率，银行间市场资金面整体保持充裕。特别是一季度过后，市场回购利率呈现快速下行的态势并带动债券市场走牛。资金面的宽松叠加市场对于经济前景的担忧，全年债券市场收益率中枢显著下行，短端的回落幅度相对更大，收益率曲线形态陡峭化。货币市场利率在二季度迅速下行后维持区间震荡的走势，货币市场基金的收益全年持续缓慢下行。

报告期内，基金的运作在保证资产的流动性的前提下，尽量为投资者提供较好的收益。全年来看，本基金维持了较长的剩余期限，和适中的杠杆，抓住了季节性资金利率阶段性走高的机会，加强了中长期存款和存单的投资，同时加强了回购交易的波段操作。

##### 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 3.7124%；B 类基金份额净值收益率为 3.9616%；R 类基金份额净值收益率为 3.9720%；C 类基金份额净值收益率为 3.7138%；同期业绩比较基准收益率为 0.3555%。

#### 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，我国经济增长仍然面临着不确定性。控制地方政府债务、防止违法违规举债等要求抑制了地方政府的融资能力，在去杠杆大背景下表外融资增速也在持续下滑，这两个因素共同导致基建投资难以明显回升。地产调控政策的延续性使得房地产行业的销售投资也面临压力。历史表明房地产行业的周期性特征较为明显，从 2015 年一季度开始，本轮行业景气周期持续时间已经较长，随着棚改货币化政策的逐渐退出，三四线城市将面临着较大的销售压力。消费的扩张也受制于融资

约束，汽车销售数据的滑坡仍未见到复苏迹象。最后，全球经济增速放缓以及中美贸易摩擦的不确定性等外部因素使得出口数据也难有起色。

在国内经济基本面偏弱以及货币政策维持宽松的背景下，国内债券市场短期面临的风险较小。但是收益率已经下行至接近 2016 年的水平，考虑到目前宏观经济的健康程度实际上好于 2016 年，我们认为国内债券市场收益率难以突破 2016 年的低点。我们将重点关注信用扩张的指标，如果社会融资总量同比增速在上半年逐渐企稳甚至回升或者房地产融资及地方政府债务出现实质性扩张，那么债券市场收益率的拐点可能会出现。对于货币市场基金的运作而言，由于收益率曲线在短端较为平坦，并且各期限利率接近公开市场各政策性利率，我们将逐渐关注利率波动的风险。防范利率风险、保证组合的流动性是我们未来主要的管理目标。

本基金将坚持货币市场基金作为现金管理工具的定位，在保持投资组合较高流动性的前提下，尽量提高组合的收益率。本基金将保持适中的剩余期限和适度的杠杆，并在货币市场工具的投资中把握波段操作的机会。基金管理人将坚持规范运作、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、防控重大风险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，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本年度，主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》等新法规、相关监管要求以及公司业务发展实际，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和监管要求，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、防控重大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。

(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，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控和提示，认真贯彻落实流动性风险管理规定、债券交易业务新规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示，有效确保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) 有计划、有重点地对投研交易、销售宣传、客户服务、人员规范、运营及 IT 治理、反洗钱等业务领域开展例行或专项监察检查，坚持以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，不断查缺补漏、防微杜渐，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，就相关问题提供合规咨询、合规审查意见和建议。

(6) 持续督促落实投资者适当性管理法规，不断推动投资者适当性管理制度、相关销售流程规范及系统的修订、更新，持续检讨完善客户投诉处理机制流程，切实保障投资者合法权益。

(7) 深入践行“风险为本”的工作方法，落实反洗钱最新法规和监管要求，夯实反洗钱工作基础，加强客户身份识别，建立受益所有人识别机制，开展洗钱风险评估，完善洗钱风险控制措施，做好反洗钱宣传培训、系统支持、内部审计、信息报送等各项工作。

(8) 紧跟法规、监管要求、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、准确、完整、及时、规范。

(9) 进一步深入落实《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》，不断完善合规管控框架和机制，促进监察稽核自身工具手段和流程的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

截至 2018 年末，公司已通过 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 2017 年 12 月 31 日。通过开展 GIPS 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，不断提高监察稽核工作的规范性和有效性，努力防范和控制重大风险，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、中国证券投资基金业协会相关指引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，公司首席运营官担任估值委员会主席，主动权益板块、固定收益板块、指数量化板块、投资风险管理部、监察与合规管理总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，具备投资、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债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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 2018 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(2019)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：

#### 6.1 审计意见

我们审计了易方达天天理财货币市场基金的财务报表，包括 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达天天理财货币市场基金的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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达天天理财货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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 其他信息

易方达天天理财货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达天天理财货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达天天理财货币市场基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)了解与审计相关的内部控制，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。

(3)评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对易方达天天理财货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达天天理财货币市场基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

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

2019 年 3 月 25 日

## § 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：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元



资 产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资 产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	37,140,966,137.51	29,724,968,834.61
结算备付金		87,034,545.45	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	32,761,240,620.14	30,585,382,490.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		32,678,240,620.14	30,585,382,490.00
资产支持证券投资		83,000,000.00	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	7,334,655,046.80	12,220,566,767.35
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	420,815,951.34	292,908,674.67
应收股利		-	-
应收申购款		305,254,409.05	738,698,998.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	30,000.00
<b>资产总计</b>		<b>78,049,966,710.29</b>	<b>73,562,555,764.96</b>
<b>负 债 和 所 有 者 权 益</b>			
	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
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		7,020,521,754.45	4,635,206,759.88
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		155,598,741.54	165,992,613.57

应付管理人报酬		23,617,513.82	21,824,976.85
应付托管费		7,156,822.36	6,613,629.36
应付销售服务费		8,347,440.54	8,419,790.25
应付交易费用	7.4.7.7	393,396.86	294,597.18
应交税费		288,884.98	-
应付利息		5,538,404.19	4,129,790.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	351,100.05	454,072.73
<b>负债合计</b>		<b>7,221,814,058.79</b>	<b>4,842,936,230.48</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	70,828,152,651.50	68,719,619,534.48
未分配利润	7.4.7.10	-	-
<b>所有者权益合计</b>		<b>70,828,152,651.50</b>	<b>68,719,619,534.48</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>78,049,966,710.29</b>	<b>73,562,555,764.96</b>

注：报告截止日 2018 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，C 类基金份额净值 1.0000 元；基金份额总额 70,828,152,651.50 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 34,517,941,051.57 份，B 类基金份额总额 33,261,533,888.74 份，R 类基金份额总额 2,846,952,360.72 份，C 类基金份额总额 201,725,350.47 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>3,902,030,647.26</b>	<b>3,068,577,020.84</b>
1.利息收入		3,914,477,158.35	3,154,142,982.84
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,886,365,859.23	1,604,718,309.88

债券利息收入		1,571,792,443.77	1,194,805,546.11
资产支持证券利息收入		124,829.50	-
买入返售金融资产收入		456,194,025.85	354,619,126.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-12,446,511.09	-89,255,406.44
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-12,446,511.09	-89,255,406.44
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资收益		-	-
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）	7.4.7.13	-	3,689,444.44
<b>减：二、费用</b>		<b>647,810,760.49</b>	<b>483,604,500.95</b>
1. 管理人报酬		288,008,686.70	208,046,518.70
2. 托管费		87,275,359.52	63,044,399.66
3. 销售服务费		118,200,206.18	75,259,545.48
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		153,571,145.36	136,589,225.38
其中：卖出回购金融资产支出		153,571,145.36	136,589,225.38
6. 税金及附加		120,793.42	-
7. 其他费用	7.4.7.15	634,569.31	664,811.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>3,254,219,886.77</b>	<b>2,584,972,519.89</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>3,254,219,886.77</b>	<b>2,584,972,519.89</b>

## 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	68,719,619,534.48	-	68,719,619,534.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,254,219,886.77	3,254,219,886.77
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）	2,108,533,117.02	-	2,108,533,117.02
其中：1.基金申购款	335,377,648,046.41	-	335,377,648,046.41
2.基金赎回款	-333,269,114,929.39	-	-333,269,114,929.39
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）	-	-3,254,219,886.77	-3,254,219,886.77
五、期末所有者权益（基金净值）	70,828,152,651.50	-	70,828,152,651.50
项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	36,691,262,432.80	-	36,691,262,432.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,584,972,519.89	2,584,972,519.89
三、本期基金份额交易产生	32,028,357,101.68	-	32,028,357,101.68

的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	306,143,399,923.58	-	306,143,399,923.58
2.基金赎回款	-274,115,042,821.90	-	-274,115,042,821.90
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）	-	-2,584,972,519.89	-2,584,972,519.89
五、期末所有者权益（基金净值）	68,719,619,534.48	-	68,719,619,534.48

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：陈荣，会计机构负责人：邱毅华

## 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。自2017年10月23日起，本基金增设C类份额类别，份额首次确认日为2017年10月24日。

### 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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>》及其他中国证监会和中国证券投资

基金业协会发布的相关规定和指引。

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。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

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

#### 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。

### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。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以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价

(2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票, 为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### (3) 企业所得税

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。

### (4) 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。

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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
活期存款	3,966,137.51	1,968,834.61
定期存款	37,137,000,000.00	29,723,000,000.00
其中: 存款期限 1 个月以内	-	780,000,000.00
存款期限 1-3 个月	5,397,000,000.00	2,748,000,000.00
存款期限 3 个月以上	31,740,000,000.00	26,195,000,000.00
其他存款	-	-
合计	37,140,966,137.51	29,724,968,834.61

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2018 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	32,678,240,620.14	32,757,305,000.00	79,064,379.86	0.1116
	合计	32,678,240,620.14	32,757,305,000.00	79,064,379.86	0.1116
资产支持证券		83,000,000.00	83,000,000.00	-	-
合计		32,761,240,620.14	32,840,305,000.00	79,064,379.86	0.1116
项目		上年度末 2017 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	30,585,382,490.00	30,555,274,000.00	-30,108,490.00	-0.0438
	合计	30,585,382,490.00	30,555,274,000.00	-30,108,490.00	-0.0438
资产支持证券		-	-	-	-
合计		30,585,382,490.00	30,555,274,000.00	-30,108,490.00	-0.0438

#### 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 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中； 买断式逆回购
交易所市场	51,600,000.00	-
银行间市场	7,283,055,046.80	-
合计	7,334,655,046.80	-
项目	上年度末 2017 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	12,220,566,767.35	-

合计	12,220,566,767.35	-
----	-------------------	---

#### 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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	50,755.40	40,640.11
应收定期存款利息	243,536,890.16	179,077,041.51
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	39,165.50	-
应收债券利息	162,090,958.55	51,133,932.16
应收资产支持证券利息	128,574.25	-
应收买入返售证券利息	14,969,607.48	62,657,060.89
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	420,815,951.34	292,908,674.67

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
其他应收款	-	30,000.00
待摊费用	-	-
合计	-	30,000.00

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017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	393,396.86	294,597.18
合计	393,396.86	294,597.18

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	12,100.05	15,072.73
预提费用	339,000.00	439,000.00
合计	351,100.05	454,072.73

## 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	
	2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,160,184,301.22	36,160,184,301.22
本期申购	243,770,684,113.37	243,770,684,113.37
本期赎回（以“-”号填列）	-245,412,927,363.02	-245,412,927,363.02
本期末	34,517,941,051.57	34,517,941,051.57

易方达天天理财货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,249,045,508.55	30,249,045,508.55
本期申购	78,468,662,998.04	78,468,662,998.04
本期赎回（以“-”号填列）	-75,456,174,617.85	-75,456,174,617.85
本期末	33,261,533,888.74	33,261,533,888.74

易方达天天理财货币 R

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,287,844,823.16	2,287,844,823.16
本期申购	11,843,138,964.58	11,843,138,964.58
本期赎回（以“-”号填列）	-11,284,031,427.02	-11,284,031,427.02
本期末	2,846,952,360.72	2,846,952,360.72

易方达天天理财货币 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,544,901.55	22,544,901.55
本期申购	1,295,161,970.42	1,295,161,970.42
本期赎回（以“-”号填列）	-1,115,981,521.50	-1,115,981,521.50
本期末	201,725,350.47	201,725,350.47

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	1,664,044,526.69	-	1,664,044,526.69
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	-1,664,044,526.69	-	-1,664,044,526.69
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	1,425,949,400.27	-	1,425,949,400.27
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	-1,425,949,400.27	-	-1,425,949,400.27
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	157,022,297.70	-	157,022,297.70
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	-157,022,297.70	-	-157,022,297.70
本期末	-	-	-

## 易方达天天理财货币 C

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	7,203,662.11	-	7,203,662.11
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	-7,203,662.11	-	-7,203,662.11
本期末	-	-	-

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	519,519.58	183,480.14
定期存款利息收入	1,884,633,968.17	1,604,518,704.28
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,212,371.48	16,125.00
其他	-	0.46
合计	1,886,365,859.23	1,604,718,309.88

## 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	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	102,019,150,859.40	113,873,482,090.70
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	101,830,807,352.95	113,805,457,191.66
减：应收利息总额	200,790,017.54	157,280,305.48
买卖债券差价收入	-12,446,511.09	-89,255,406.44

## 7.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	3,689,444.44
合计	-	3,689,444.44

#### 7.4.7.14 交易费用

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

#### 7.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	130,000.00	130,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	165,146.84	195,393.88
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	3,422.47	3,417.85
合计	634,569.31	664,811.73

#### 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

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 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、基金销售机构
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
广东新三板投资发展有限公司	基金管理人子公司控制的公司

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 2018年1月1日至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	288,008,686.70	208,046,518.70
其中：支付销售机构的客户 维护费	48,160,955.58	35,667,455.45

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。

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31 日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31 日
当期发生的基金应支付的托 管费	87,275,359.52	63,044,399.66

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。

#### 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 2018年1月1日至2018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	易方达天天理财货币 C	合计
易方达基金管理有限公司	28,776,829.77	3,431,270.92	-	-	32,208,100.69
中国工商银行	7,440,298.63	38,563.82	-	-	7,478,862.45
广发证券	59,810.50	5,862.77	-	-	65,673.27
合计	36,276,938.90	3,475,697.51	-	-	39,752,636.41
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	易方达天天理财货币 C	合计
易方达基金管理有限公司	10,832,539.03	2,803,672.22	-	-	13,636,211.25
中国工商银行	7,263,044.50	38,490.75	-	-	7,301,535.25
广发证券	18,548.13	4,322.14	-	-	22,870.27
合计	18,114,131.66	2,846,485.11	-	-	20,960,616.77

注：本基金 A 类、C 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。

#### 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 2018年1月1日至2018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	-	-	-	-	128,686,945.00	17,758,675.41
上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	1,499,332,696.24	2,047,044,190.64	-	-	15,982,504.00	5,362,276.31

#### 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 2018年1月1日至2018年12月31日				上年度可比期间 2017年1月1日至2017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C	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C

报告期初持有的基金份额	-	43,401,811.50	-	-	-	747,354,072.95	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	1,897,861,265.92	-	-	-	916,047,738.55	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	420,000,000.00	-	-	-	1,620,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	1,521,263,077.42	-	-	-	43,401,811.50	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	4.57%	-	-	-	0.14%	-	-

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 2018年12月31日		上年度末 2017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	965,591.62	0.00%	1,037,701.48	0.00%
易方达资产管理有 限公司	2,868,451.54	0.01%	-	-

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 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	持有的	持有的基金份额	持有的	持有的基金份额

	基金份额	占基金总份额的 比例	基金份额	占基金总份额的 比例
广东省易方达教育基金会	-	-	2,673,481.25	0.01%
广东新三联投资发展有限公司	-	-	193,506,216.62	0.64%
粤财信托	-	-	99,996,411.91	0.33%
广发基金管理有限公司	70,860,174.97	0.21%	50,808,802.08	0.17%
广发证券资产管理(广东)有限公司	224,193,524.92	0.67%	-	-
广发证券	607,728,982.70	1.83%	-	-
广发期货有限公司	269,390,205.71	0.81%	-	-

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。广发基金管理有限公司、广发期货有限公司、广发证券资产管理（广东）有限公司是基金管理人股东广发证券控制的机构。

易方达天天理财货币 R

无。

易方达天天理财货币 C

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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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-活期存款	3,966,137.51	519,519.58	1,968,834.61	183,480.14
中国工商银行-定期存款	-	-	-	7,102,472.21

注：本基金的上述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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

## 7.4.10.7.1 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
1,664,044,526.69	-	-	1,664,044,526.69	-

## 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
1,425,949,400.27	-	-	1,425,949,400.27	-

## 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
157,022,297.70	-	-	157,022,297.70	-

## 4、易方达天天理财货币 C

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
7,203,662.11	-	-	7,203,662.11	-

## 7.4.12 期末（2018 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

金额单位：人民币元



7.4.12.1.1 受限证券类别：资产支持证券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
139352	链融02A1	2018-12-10	2019-01-15	新发流通受限	100.00	100.00	230,000	23,000,000.00	23,000,000.00	-
139355	万科32A1	2018-12-13	2019-01-18	新发流通受限	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-
139381	链融03A1	2018-12-20	2019-01-30	新发流通受限	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	-

#### 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 2018 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 7,020,521,754.45 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
041800304	18 陕煤化 CP002	2019-01-02	100.00	1,500,000	150,002,556.40
111809224	18 浦发银行 CD224	2019-01-02	97.84	5,358,000	524,239,343.29
180301	18 进出 01	2019-01-02	100.01	266,000	26,601,901.56
180305	18 进出 05	2019-01-02	100.06	4,569,000	457,167,247.43
180404	18 农发 04	2019-01-02	100.08	11,731,000	1,174,007,394.71
180407	18 农发 07	2019-01-02	100.21	9,400,000	941,971,964.17
189949	18 贴现国债 49	2019-01-02	99.83	2,000,000	199,661,078.05
111804036	18 中国银行 CD036	2019-01-03	99.47	6,959,000	692,192,942.27
111809224	18 浦发银行 CD224	2019-01-03	97.84	1,406,000	137,566,352.49
111816156	18 上海银行 CD156	2019-01-03	99.47	1,340,000	133,283,184.20

011801544	18 中信股 SCP001	2019-01-04	100.00	1,500,000	150,001,788.70
011801685	18 华能水电 SCP007	2019-01-04	100.00	500,000	50,000,181.13
011801689	18 津渤海 SCP006	2019-01-04	100.00	1,500,000	150,001,264.28
111804036	18 中国银行 CD036	2019-01-04	99.47	2,041,000	203,012,759.76
111809224	18 浦发银行 CD224	2019-01-04	97.84	7,236,000	707,987,287.80
120312	12 进出 12	2019-01-04	100.36	500,000	50,179,727.72
160301	16 进出 01	2019-01-04	99.82	500,000	49,908,905.41
180301	18 进出 01	2019-01-04	100.01	2,334,000	233,416,685.11
180305	18 进出 05	2019-01-08	100.06	3,000,000	300,175,474.34
180305	18 进出 05	2019-01-09	100.06	3,031,000	303,277,287.58
180404	18 农发 04	2019-01-09	100.08	6,969,000	697,439,053.25
合计				73,640,000	7,332,094,379.65

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 2018 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 2018 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 40.05%(2017 年 12 月 31 日：39.30%)。

##### 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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	508,157,070.48	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	31,920,264,529.79	30,636,516,422.16
合计	32,428,421,600.27	30,636,516,422.16

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 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

## 7.4.13.2.4 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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	495,038,552.67	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	495,038,552.67	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。

## 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	83,128,574.25	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	83,128,574.25	0.00

## 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
AAA	25,560,124,472.62	26,514,803,277.39
AAA 以下	0.00	492,032,006.98

未评级	0.00	0.00
合计	25,560,124,472.62	27,006,835,284.37

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

于 2018 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，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。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 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 2018 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	37,140,966,137.51	-	-	-	37,140,966,137.51

结算备付金	87,034,545.45	-	-	87,034,545.45
存出保证金	-	-	-	-
交易性金融资产	32,761,240,620.14	-	-	32,761,240,620.14
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	7,334,655,046.80	-	-	7,334,655,046.80
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	420,815,951.34	420,815,951.34
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	305,254,409.05	305,254,409.05
递延所得税资产	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	77,323,896,349.90	-	726,070,360.39	78,049,966,710.29
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	7,020,521,754.45	-	-	7,020,521,754.45
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	155,598,741.54	155,598,741.54
应付管理人报酬	-	-	23,617,513.82	23,617,513.82
应付托管费	-	-	7,156,822.36	7,156,822.36
应付销售服务费	-	-	8,347,440.54	8,347,440.54
应付交易费用	-	-	393,396.86	393,396.86
应交税费	-	-	288,884.98	288,884.98
应付利息	-	-	5,538,404.19	5,538,404.19
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	351,100.05	351,100.05

负债总计	7,020,521,754.45	-	-	201,292,304.34	7,221,814,058.79
利率敏感度缺口	70,303,374,595.45	-	-	524,778,056.05	70,828,152,651.50
上年度末 2017 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	29,724,968,834.61	-	-	-	29,724,968,834.61
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	30,585,382,490.00	-	-	-	30,585,382,490.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	12,220,566,767.35	-	-	-	12,220,566,767.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	292,908,674.67	292,908,674.67
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	738,698,998.33	738,698,998.33
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	30,000.00	30,000.00
资产总计	72,530,918,091.96	-	-	1,031,637,673.00	73,562,555,764.96
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	4,635,206,759.88	-	-	-	4,635,206,759.88
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	165,992,613.57	165,992,613.57
应付管理人报酬	-	-	-	21,824,976.85	21,824,976.85

应付托管费	-	-	-	6,613,629.36	6,613,629.36
应付销售服务费	-	-	-	8,419,790.25	8,419,790.25
应付交易费用	-	-	-	294,597.18	294,597.18
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	4,129,790.66	4,129,790.66
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	454,072.73	454,072.73
负债总计	4,635,206,759.88	-	-	207,729,470.60	4,842,936,230.48
利率敏感度缺口	67,895,711,332.08	-	-	823,908,202.40	68,719,619,534.48

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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	1.市场利率下降25个基点	27,448,737.39	25,990,070.70
2.市场利率上升25个基点	-27,389,604.39	-25,935,675.47	

#### 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。

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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-	-
假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	-	-	

#### 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。

#### 7.4.14 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 2018 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 32,761,240,620.14 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 30,585,382,490.00 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 2018 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(2017 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	32,761,240,620.14	41.97
	其中：债券	32,678,240,620.14	41.87
	资产支持证券	83,000,000.00	0.11
2	买入返售金融资产	7,334,655,046.80	9.40
	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	37,228,000,682.96	47.70
4	其他各项资产	726,070,360.39	0.93
5	合计	78,049,966,710.29	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	6.59	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	7,020,521,754.45	9.91
	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	114
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	50

#### 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	10.08	9.91
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	15.06	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	37.45	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.68	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	37.90	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	109.17	9.91

#### 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	199,661,078.05	0.28
2	央行票据	-	-
3	金融债券	4,234,145,641.28	5.98
	其中：政策性金融债	4,234,145,641.28	5.98
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,281,812,502.56	3.22
6	中期票据	402,722,258.96	0.57
7	同业存单	25,559,899,139.29	36.09
8	其他	-	-
9	合计	32,678,240,620.14	46.14
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 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	180404	18 农发 04	18,700,000	1,871,446,447.96	2.64
2	111809224	18 浦发银行 CD224	14,000,000	1,369,792,983.58	1.93
3	180305	18 进出 05	10,600,000	1,060,620,009.35	1.50
4	111807218	18 招商银行 CD218	10,000,000	994,979,263.12	1.40
5	111803138	18 农业银行 CD138	10,000,000	994,672,718.87	1.40
6	180407	18 农发 07	9,400,000	941,971,964.17	1.33
7	111804036	18 中国银行 CD036	9,000,000	895,205,702.03	1.26
8	111803139	18 农业银行 CD139	8,000,000	795,788,110.76	1.12
9	111806199	18 交通银行 CD199	8,000,000	795,763,596.14	1.12
10	111804069	18 中国银行 CD069	7,800,000	763,902,809.65	1.08

#### 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	0.2198%
报告期内偏离度的最低值	0.0126%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0794%

**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**

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	139355	万科 32A1	300,000	30,000,000.00	0.04
1	139381	链融 03A1	300,000	30,000,000.00	0.04
3	139352	链融 02A1	230,000	23,000,000.00	0.03

**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。

**8.9.218 浦发银行 CD224（代码：111809224）为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。**

根据上海浦东发展银行股份有限公司董事会 2018 年 1 月 19 日发布的《关于成都分行处罚事项的公告》，银监会四川监管局对成都分行内控管理严重失效、授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，并执行罚款 46,175 万元人民币。2018 年 2 月 12 日，中国银监会针对浦发银行的如下事由罚款 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元：

（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；（三）通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；（四）理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；（五）提供不实说明材料、不配合调查取证；（六）以贷转存，虚增存贷款；（七）票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；（八）国内信用证业务贸易背景审查不严；（九）贷款管理严

重缺失，导致大额不良贷款；（十）违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；（十一）票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；（十二）对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；（十三）以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；（十四）投资多款同业理财产品未尽职审查，涉及金额较大；（十五）修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；（十六）为非保本理财产品出具保本承诺函；（十七）向关系人发放信用贷款；（十八）向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；（十九）收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。2018 年 3 月 19 日，上海银监局针对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心 2016 年至 2017 年部分信用卡现金分期资金被用于证券交易，2015 年至 2017 年部分信用卡分期资金被用于非消费领域，严重违反审慎经营规则的违法违规事实，责令改正，罚没合计人民币 1751651.7 元。2018 年 7 月 26 日，中国人民银行针对上海浦东发展银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易的违法违规事实，罚款人民币 170 万元。

18 招商银行 CD218（代码：111807218）为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 2 月 12 日，中国银监会针对招商银行的如下事由罚款 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；（三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；（四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；（五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；（六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；（七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（八）高管人员在获得任职资格核准前履职；（九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；（十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；（十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；（十二）非真实转让信贷资产；（十三）违规向典当行发放贷款；（十四）违规向关系人发放信用贷款。2018 年 7 月 5 日，深圳保监局针对招商银行股份有限公司电话销售欺骗投保人罚款 30 万元。

18 交通银行 CD199（代码：111806199）为易方达天天理财货币市场基金的前十大持仓证券。2018 年 7 月 26 日，中国人民银行针对交通银行未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户，罚款人民币 130 万元。2018 年 11 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司关于以下违规事实：（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露

不合规；（九）现场检查配合不力，处以罚款 690 万元人民币。2018 年 11 月 9 日，中国银行保险监督管理委员会对交通银行股份有限公司并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位的违规事实，处以罚款 50 万元人民币。

本基金投资 18 浦发银行 CD224、18 招商银行 CD218、18 交通银行 CD199 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 18 浦发银行 CD224、18 招商银行 CD218、18 交通银行 CD199 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	420,815,951.34
4	应收申购款	305,254,409.05
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	726,070,360.39

## § 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	3,109,261	11,101.65	1,635,712,635.	4.74%	32,882,228,416	95.26%

货币 A			45		.12	
易方达天天理财 货币 B	613	54,260,251. 04	32,241,144,477 .32	96.93%	1,020,389,411. 42	3.07%
易方达天天理财 货币 R	376	7,571,681.8 1	2,846,952,360. 72	100.00%	0.00	0.00%
易方达天天理财 货币 C	13,056	15,450.78	0.00	0.00%	201,725,350.47	100.00 %
合计	3,123,306	22,677.30	36,723,809,473 .49	51.85%	34,104,343,178 .01	48.15%

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	2,128,433,863.28	3.01%
2	银行类机构	1,714,848,769.32	2.42%
3	基金类机构	1,521,797,894.06	2.15%
4	银行类机构	1,250,481,553.93	1.77%
5	银行类机构	1,008,498,225.11	1.42%
6	其他机构	917,470,913.57	1.30%
7	其他机构	836,008,265.20	1.18%
8	银行类机构	801,702,127.46	1.13%
9	信托类机构	781,529,039.46	1.10%
10	银行类机构	726,708,211.01	1.03%

### 9.3 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	9,884,036.64	0.0286%
	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%
	易方达天天理财货币 C	0.00	0.0000%
	合计	9,884,036.64	0.0140%

### 9.4 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持有本开放式基金	易方达天天理财货币 A	>100
	易方达天天理财货币 B	0
	易方达天天理财货币 R	0
	易方达天天理财货币 C	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
	易方达天天理财货币 C	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	易方达天天理财货币 C
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	36,160,184,301.22	30,249,045,508.55	2,287,844,823.16	22,544,901.55
本报告期基金总申购份额	243,771,008,878.78	78,468,662,998.04	11,843,138,964.58	1,295,161,970.42
减：本报告期基金总赎回份额	245,413,252,128.43	75,456,174,617.85	11,284,031,427.02	1,115,981,521.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	34,517,941,051.57	33,261,533,888.74	2,846,952,360.72	201,725,350.47

### § 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 2018 年 6 月 8 日发布公告，自 2018 年 6 月 8 日起聘任陈荣女士担任公司首席运营官（副总经理级），聘任汪兰英女士担任公司首席大类资产配置官（副总经理级）。

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 6 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	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金减少长江证券股份有限公司一个交易单元,新增国盛证券有限责任公司一个交易单元。

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;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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	203,285,000,000.00	100.00%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
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	中国证券报、上海证券	2018-01-10

	式基金增加通华财富为销售机构、参加通华财富申购费率优惠活动的公告	报、证券时报及基金管理人网站	
2	易方达基金管理有限公司关于增加厦门国际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	2018-01-11
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云湾投资为销售机构、参加云湾投资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	2018-01-17
4	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加张家港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	2018-01-22
5	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	2018-01-23
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民族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	2018-01-26
7	易方达天天理财货币市场基金 A 类基金份额、B 类基金份额在本公司官方网站暂停机构客户申购、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	2018-02-14
8	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	2018-03-22
9	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修订基金合同、托管协议部分条款的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-22
10	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-23
11	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-03-29
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西安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	2018-04-09
13	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、证券日报及基金管理人网站	2018-06-08
14	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-20
15	易方达基金管理有限公司关于调整网上直销系统以及直销中心货币基金“T+0 赎回提现业务”限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-22

16	易方达基金管理有限公司关于调整交通银行货币基金“T+0 赎回提现业务”限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-26
17	易方达基金管理有限公司关于暂停浙江金观诚基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-28
18	易方达基金管理有限公司关于新增微众银行为易方达天天理财货币市场基金 C 类基金份额销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-06-29
19	易方达天天理财货币市场基金 A 类份额在非直销销售机构及网上直销系统暂停大额申购、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	2018-07-05
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烟台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	2018-07-19
21	易方达天天理财货币市场基金 A 类基金份额调整大额申购、大额转换转入业务金额限制及 C 类基金份额暂停大额申购、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	2018-08-06
22	易方达天天理财货币市场基金调整大额申购、大额转换转入业务金额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-08-20
23	易方达基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金在中金公司开通定期定额投资业务、参加中金公司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	2018-08-31
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嘉实财富为销售机构、参加嘉实财富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	2018-09-07
25	关于易方达基金管理有限公司北京直销中心办公地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报及基金管理人网站	2018-09-10
26	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 类基金份额在本公司网上直销系统恢复大额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-09-14
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民商基金为销售机构、参加民商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	2018-09-17
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首创证券为销售机构、参加首创证券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	2018-10-10
29	易方达基金管理有限公司关于增加广东华兴银行为易方达天天理财货币市场基金 A 类基金份额销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站	2018-11-13

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天津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	2018-11-20
31	易方达基金管理有限公司关于在交通银行暂停易方达天天理财货币市场基金 A 类基金份额“T+0 赎回提现业务”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	2018-11-23
32	易方达基金管理有限公司关于在部分电子交易直销自助前台系统暂停货币基金“T+0 赎回提现业务”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	2018-11-28
33	易方达基金管理有限公司关于在南洋商业银行暂停易方达天天理财货币市场基金 A 类基金份额“T+0 赎回提现业务”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	2018-11-28
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百度百盈为销售机构、参加百度百盈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	2018-12-13

## § 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。

二〇一九年三月二十八日