

易方达天天增利货币市场基金

2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 易方达天天增利货币 |
| 基金主代码 | 000704 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 6 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 8,385,980,458.04 份 |
| 投资目标 | 在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金将对基金资产组合进行积极管理，在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，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七天通知存款利率（税后） | |
| 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。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。 | |
| 基金管理人 | 易方达基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 易方达天天增利货币 A | 易方达天天增利货币 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 000704 | 000705 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 8,304,220,961.17 份 | 81,759,496.87 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期(2020 年 4 月 1 日-2020 年 6 月 30 日) | |
|------------|-------------------------------------|---------------|
| | 易方达天天增利货币 A | 易方达天天增利货币 B |
| 1.本期已实现收益 | 29,333,617.06 | 467,971.33 |
| 2.本期利润 | 29,333,617.06 | 467,971.33 |
| 3.期末基金资产净值 | 8,304,220,961.17 | 81,759,496.87 |

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收

益和本期利润的金额相等。

2. 本基金利润分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达天天增利货币 A

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-----------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.4064% | 0.0006% | 0.3418% | 0.0000% | 0.0646% | 0.0006% |
| 过去六个月 | 0.9733% | 0.0012% | 0.6848% | 0.0000% | 0.2885% | 0.0012% |
| 过去一年 | 2.1343% | 0.0010% | 1.3819% | 0.0000% | 0.7524% | 0.0010% |
| 过去三年 | 9.5186% | 0.0027% | 4.1955% | 0.0000% | 5.3231% | 0.0027% |
| 过去五年 | 16.5488% | 0.0030% | 7.0913% | 0.0000% | 9.4575% | 0.0030% |
| 自基金合同生效起至今 | 21.6247% | 0.0034% | 8.5916% | 0.0000% | 13.0331% | 0.0034% |

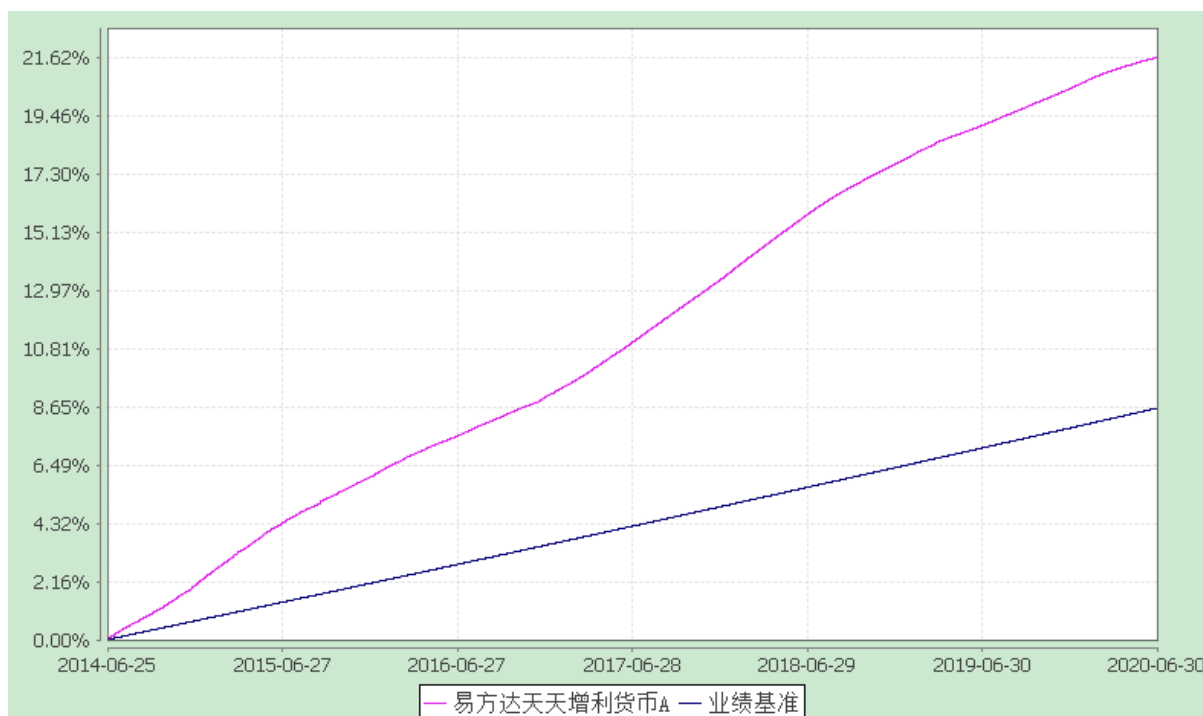
易方达天天增利货币 B

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-----------|------------|---------------|----------|---------|
| 过去三个月 | 0.4662% | 0.0006% | 0.3418% | 0.0000% | 0.1244% | 0.0006% |
| 过去六个月 | 1.0934% | 0.0012% | 0.6848% | 0.0000% | 0.4086% | 0.0012% |
| 过去一年 | 2.3790% | 0.0010% | 1.3819% | 0.0000% | 0.9971% | 0.0010% |
| 过去三年 | 10.3090% | 0.0027% | 4.1955% | 0.0000% | 6.1135% | 0.0027% |
| 过去五年 | 17.9539% | 0.0030% | 7.0913% | 0.0000% | 10.8626% | 0.0030% |
| 自基金合同生效起至今 | 23.3881% | 0.0034% | 8.5916% | 0.0000% | 14.7965% | 0.0034% |

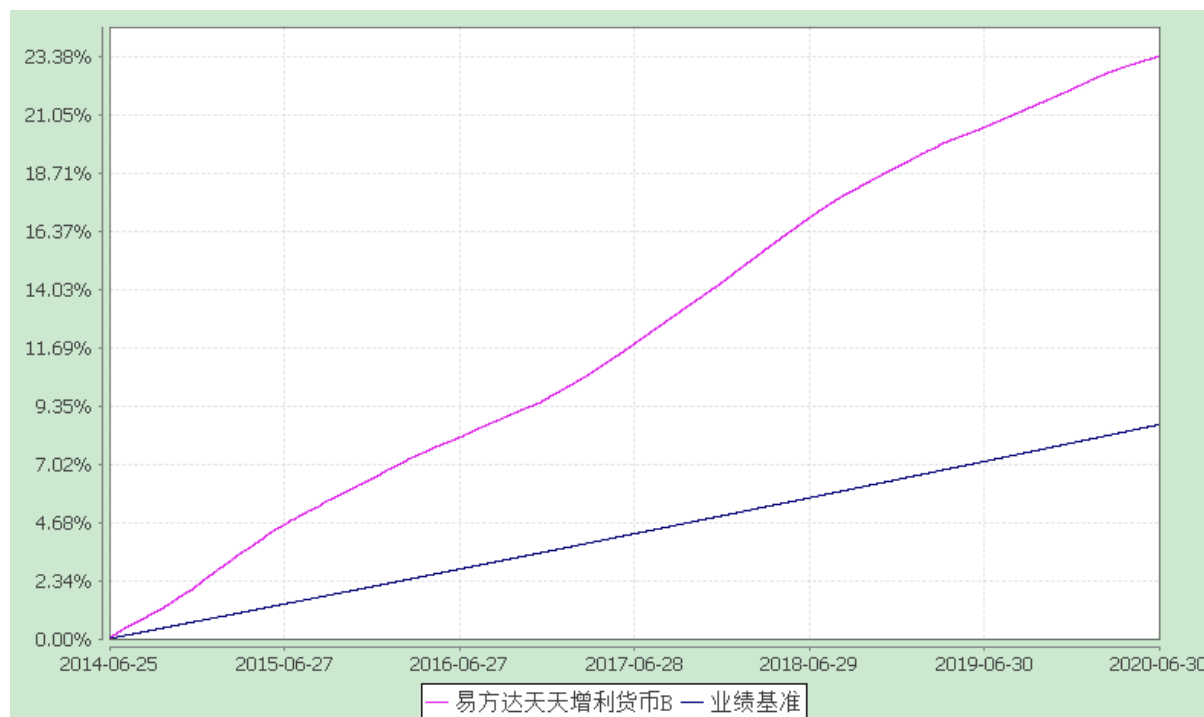
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达天天增利货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014 年 6 月 25 日至 2020 年 6 月 30 日)

易方达天天增利货币 A



易方达天天增利货币 B



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 21.6247%，B 类基金份额净值收益率为 23.3881%，同期业绩比较基准收益率为 8.5916%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 石大恽 | 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、易方达天天理财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、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 | 2014-06-25 | - | 11 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。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、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理。 |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|------|--|
| | 金的基金经理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理、易方达现金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、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、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 | | | | |
| 梁莹 | 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、易方达增金宝货币市场基金的基金经理、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、易方达现金增利货币市场基金的基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金的基金经理、易方达保证金收益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、易方达货币市场基金的基金经理助理、易方达天天理财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、易方达天天发货币市场基金的基金经理助理、投资经理 | 2015-03-17 | - | 10 年 | 硕士研究生,具有基金从业资格。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、易方达保证金收益货币市场基金基金经理助理、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理。 |

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别

指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 42 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年二季度，宏观经济总体来看呈现边际企稳复苏的态势。4 月工业增加值同比增长 3.9%，5 月工业增加值同比增长 4.4%，显示虽然经济回升的速度在放缓，但仍然处于持续回升的过程中。投资方面，2020 年 1-5 月份全国固定资产投资同比下降 6.3%，降幅比 1-3 月份收窄 9.8 个百分点，投资总体也在恢复，结构上基建和制造业投资连续两个月回升，房地产投资在 5 月出现小幅回落。消费方面，4 月和 5 月社会消费品零售

总额同比下降分别为 7.5% 和 2.8%，也呈现持续恢复的态势，其中服装、日用品等商品消费的恢复较快，餐饮消费拖累较多。通胀方面，4 月和 5 月 CPI 同比分别上涨 3.3% 和 2.4%，连续低于市场预期，结构上，主要是食品明显低于预期，非食品总体来看基本符合预期，但从高频数据来看环比已经开始上涨，反映供需平衡的状况在持续改善。金融数据方面，4 月新增社会融资数据较好，高于市场预期，5 月社融数据符合市场预期，多增的幅度有所下降，但是社融月度环比仍然保持较高增速，总体融资环境持续有所改善。

债券市场在二季度收益率先下后上，波动较大。季初，受海内外疫情继续发酵的持续影响，市场风险偏好仍处于相对低位。清明节期间，央行实行了定向降准，同时将超额准备金利率从 0.72% 下调到 0.35%，资金面整体更加宽松，债券市场各期限收益率快速下行。5 月上旬，货币政策进一步宽松的程度不及市场预期，随着央行开始打击资金空转套利，货币市场各资产收益率出现小幅上行，货币市场在 5 月底呈现短期紧张。在此期间，叠加经济修复延续，债券市场长端收益率开始上行。随后，社融放量强化了经济修复预期，债券收益率进一步大幅上行，货币市场上行幅度更大，收益率曲线呈现出熊平趋势。进入 6 月，货币环境仍未好转，在此期间，地方债巨量发行，债券市场市场情绪进一步悲观，一级市场发行利率不断上行，推动二级市场各期限债券收益率持续大幅上行。直到半年末，央行开启公开市场逆回购操作呵护半年末流动性后，市场情绪有所恢复，债券市场和货币市场收益率趋于稳定。信用债走势与利率债类似，全季来看收益率整体大幅上行。

操作方面，报告期内基金以同业存单、同业存款、短期逆回购为主要配置资产，同时根据自身的客户结构特性进行了资产配置，维持了适当的剩余期限和杠杆率。总体来看，组合在二季度保持了较好的流动性和稳定的收益率。

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 0.4064%，同期业绩比较基准收益率为 0.3418%；B 类基金份额净值收益率为 0.4662%，同期业绩比较基准收益率为 0.3418%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1 | 固定收益投资 | 2,766,584,401.68 | 31.00 |
| | 其中：债券 | 2,583,584,401.68 | 28.95 |
| | 资产支持证券 | 183,000,000.00 | 2.05 |
| 2 | 买入返售金融资产 | 4,237,826,247.79 | 47.49 |
| | 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 | 1,895,962,003.95 | 21.25 |
| 4 | 其他资产 | 23,516,028.33 | 0.26 |
| 5 | 合计 | 8,923,888,681.75 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例（%） | |
|----|--------------|----------------|---------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 4.50 | |
| | 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 | 521,583,139.21 | 6.22 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：上表中报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|----|----|
|----|----|

| | |
|-------------------|----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 75 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 88 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 55 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 (%) | 各期限负债占基金资产净值的比例 (%) |
|----|----------------------|---------------------|---------------------|
| 1 | 30天以内 | 47.44 | 6.34 |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 3.70 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 25.23 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—120天 | 4.28 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120天(含)—397天(含) | 25.49 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 106.14 | 6.34 |

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本（元） | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------------------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 9,965,599.68 | 0.12 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 853,261,404.09 | 10.17 |
| | 其中：政策性金融债 | 413,255,153.72 | 4.93 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 360,266,214.33 | 4.30 |
| 6 | 中期票据 | 221,522,794.50 | 2.64 |
| 7 | 同业存单 | 1,138,568,389.08 | 13.58 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 2,583,584,401.68 | 30.81 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 摊余成本（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 200401 | 20 农发 01 | 2,000,000 | 200,660,913.75 | 2.39 |
| 2 | 112016060 | 20 上海银行 CD060 | 2,000,000 | 199,045,190.03 | 2.37 |
| 3 | 112018183 | 20 华夏银行 CD183 | 2,000,000 | 198,933,539.10 | 2.37 |
| 4 | 112008051 | 20 中信银行 CD051 | 1,500,000 | 149,175,179.83 | 1.78 |
| 5 | 072000164 | 20 银河证券 CP007 | 1,200,000 | 120,001,722.51 | 1.43 |
| 6 | 072000156 | 20 华泰证券 | 1,000,000 | 100,001,353.39 | 1.19 |

| | | CP006 | | | |
|----|-----------|------------------|-----------|---------------|------|
| 7 | 012001778 | 20 中铝 SCP011 | 1,000,000 | 99,874,493.07 | 1.19 |
| 8 | 111918256 | 19 华夏银行 CD256 | 1,000,000 | 99,772,103.47 | 1.19 |
| 9 | 112009128 | 20 浦发银行 CD128 | 1,000,000 | 99,013,689.79 | 1.18 |
| 10 | 112014007 | 20 江苏银行 CD007 | 1,000,000 | 98,557,769.21 | 1.18 |

5.7 “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 次 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.2052% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0037% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.1140% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量（份） | 摊余成本 （元） | 占基金资产 净值比例 （%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|----------------------|
| 1 | 138305 | 瑞新 9A1 | 290,000 | 29,000,000.00 | 0.35 |
| 2 | 138325 | 国链 17A1 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.24 |
| 2 | 138364 | 南链优 03 | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.24 |
| 2 | 138383 | 中交 6 优 A | 200,000 | 20,000,000.00 | 0.24 |
| 5 | 138173 | 链融 17A1 | 110,000 | 11,000,000.00 | 0.13 |
| 6 | 138262 | 诚意 3A1 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.12 |
| 6 | 138290 | 链融 19A1 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.12 |
| 6 | 138324 | 瑞新 10A1 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.12 |
| 6 | 138351 | 瑞新 11A1 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.12 |
| 6 | 138752 | 鹏举 06 优 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.12 |
| 6 | 138762 | 南链 6 优 1 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.12 |

| | | | | | |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|
| 6 | 138763 | 南链 6 优 2 | 100,000 | 10,000,000.00 | 0.12 |
|---|--------|----------|---------|---------------|------|

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

(1) 基金持有的债券（包括票据）购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，按实际利率计算其摊余成本及各期利息收入，每日计提收益；

(2) 基金持有的回购以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息；合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；

(3) 基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

5.9.2 2020 年 4 月 30 日，北京市西城区卫生健康委员会对中国农业发展银行违反《北京市生活饮用水卫生监督管理条例》第二十一条第（三）项的行为作出“罚款 5000 元”的行政处罚决定。

2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款 40 万元”的行政处罚决定：2019 年 12 月，该中心在为部分客户办理信用卡业务时，未遵守总授信额度管理制度。2019 年 11 月 2 日，中国人民银行上海分行对上海银行股份有限公司违反支付业务规定的行为，没收违法所得 1,762,787.61 元，并处以 1,762,787.61 元罚款，共计 3,525,575.22 元，同时对相关高级管理人员作出处罚。

2019 年 7 月 3 日，中国银行保险监督管理委员会针对中信银行股份有限公司的如下违法违规行为，作出“没收违法所得 33.6677 万元，罚款 2190 万元，合计 2223.6677 万元”的行政处罚决定：（一）未按规定提供报表且逾期未改正；（二）错报、漏报银行业监管统计资料；（三）未向监管部门报告重要信息系统运营中断事件；（四）信息系统控制存在较大安全漏洞，未做到有效的安全控制；（五）未按企业划型标准将多家企业划分为小微企业，报送监管数据不真实；（六）向关系人发放信用贷款、向关系人发放担保贷款的条件优于其他借款人同类贷款条件；（七）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部

门报告；（八）贷后管理不到位导致贷款资金被挪用；（九）以流动资金贷款名义发放房地产开发贷款；（十）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；（十一）投资同一家银行机构同期非保本理财产品采用风险权重不一致；（十二）购买非保本理财产品签订可提前赎回协议，未准确计量风险加权资产；（十三）未按规定计提资产支持证券业务的风险加权资产。2020 年 2 月 20 日，北京银保监局对中信银行股份有限公司的如下违法违规行，作出“责令中信银行股份有限公司改正，并给予合计 2020 万元罚款”的行政处罚决定：中信银行股份有限公司违规发放土地储备贷款；受托支付不符合监管规定；信托消费贷款业务开展不审慎；流动资金贷款被挪用于股权投资；信贷资金被挪用流入房地产开发公司；个人经营性贷款资金被挪用于购房；非真实转让不良信贷资产；未对融资人交易材料合理性进行必要的审查，资金被用于缴纳土地竞买保证金；违规为房地产开发企业发放流动资金性质融资；签署抽屉协议互投涉房信贷资产腾挪信贷规模；卖出回购信贷资产收益权，实现信贷规模阶段性出表；理财资金违规投向未上市房地产企业股权；理财资金被挪用于支付土地出让价款；违规向资本金不足的房地产开发项目提供融资；并购贷款真实性审核不足，借款人变相用于置换项目公司缴纳的土地出让价款；协助合作机构签署抽屉协议，规避相关监管规定；理财资金实际用于置换项目前期股东支付的土地出让金；违规为房地产企业支付土地购置费用提供融资；违规向四证不全的商业性房地产开发项目提供融资。2020 年 4 月 20 日，中国银行保险监督管理委员会对中信银行股份有限公司的如下违法违规行作出罚款 160 万元的行政处罚决定：中信银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在（一）理财产品数量漏报；（二）信贷资产转让业务漏报；（三）贸易融资业务漏报；（四）分户账明细记录应报未报；（五）分户账账户数据应报未报；（六）关键且应报字段漏报或填报错误。

2020 年 2 月 10 日，中国人民银行针对华泰证券股份有限公司如下违法事实：1、未按规定履行客户身份识别义务；2、未按规定报送可疑交易报告；3、与身份不明的客户进行交易，处以责令改正，并处罚款 1010 万元的行政处罚。

2019 年 9 月 16 日，山西省应急管理厅对中国铝业股份有限公司兴县奥家湾铝矿的如下违法违规行作出“责令限期改正，处人民币贰万元罚款”的行政处罚决定：1.1040 中段 6 号下山封闭墙未悬挂管理标志牌；2.1 号风机未设置安全警示标志；3.配电室警示标识设置在旋转门上不符合规范；4.1040 通往采场的分岔口未设置安全警示标识。2019 年 9

月 16 日，山西省应急管理厅对中国铝业股份有限公司兴县奥家湾铝矿的如下违法违规行为作出“责令限期改正，处人民币壹万元罚款”的行政处罚决定：II 号矿未按应急预案物资储备清单储备物资。2019 年 9 月 16 日，山西省应急管理厅对中国铝业股份有限公司兴县奥家湾铝矿的如下违法违规行为作出“责令限期改正，处人民币贰万元罚款”的行政处罚决定：II 号矿 1、1 号风机房风门变形未及时维护，存在漏风隐患；2、1 号风机房风门变形，有杂物堆放未及时维护，存在安全出口不畅；3、1040 中段 6 号下山风管存在漏风隐患未及时维护；4、地表水泵房应急灯未接电没有及时维护。2020 年 4 月 18 日，广西省平果市应急管理局对中国铝业股份有限公司广西分公司的如下违法违规行为罚款 22 万元：中国铝业广西分公司在“12.29”事故案中存在落实企业安全生产主体责任不到位的违法事实，一是未能健全岗位操作规程，提高安全生产水平，确保安全生产；二是未能有效吸取类似事故教训和未能针对性开展岗位安全教育培训防止类似事故不再发生；三是未加强安全生产管理，清障作业现场安全监管缺失。对事故的发生负有一定的管理责任。

2019 年 7 月 8 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心的如下违法违规行为作出“责令改正，并处罚款 30 万元”的行政处罚决定：2015 年至 2018 年 6 月，该中心在为部分客户办理信用卡业务时，对申请人收入核定严重不审慎。2019 年 12 月 3 日，中国银行保险监督管理委员会上海监管局对上海浦东发展银行股份有限公司信用卡中心 2019 年 1 月信用卡催收外包管理严重违反审慎经营规则的违法违规事实，作出“责令改正，并处罚款 50 万元”的行政处罚决定。

本基金投资 20 农发 01、20 上海银行 CD060、20 中信银行 CD051、20 华泰证券 CP006、20 中铝 SCP011、20 浦发银行 CD128 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除 20 农发 01、20 上海银行 CD060、20 中信银行 CD051、20 华泰证券 CP006、20 中铝 SCP011、20 浦发银行 CD128 外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|-------|-------|
| 1 | 存出保证金 | - |

| | | |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 153,334.46 |
| 3 | 应收利息 | 22,383,945.26 |
| 4 | 应收申购款 | 978,748.61 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 23,516,028.33 |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 易方达天天增利货币A | 易方达天天增利货币B |
|-------------|-------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 6,621,128,530.85 | 99,900,961.83 |
| 报告期基金总申购份额 | 33,289,860,836.91 | 28,467,971.33 |
| 报告期基金总赎回份额 | 31,606,768,406.59 | 46,609,436.29 |
| 报告期期末基金份额总额 | 8,304,220,961.17 | 81,759,496.87 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金申购、赎回、买卖本基金份额。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达天天增利货币市场基金募集的文件；
- 2.《易方达天天增利货币市场基金基金合同》；
- 3.《易方达天天增利货币市场基金托管协议》；
- 4.《易方达基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
- 5.基金管理人业务资格批件、营业执照。

8.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二〇年七月二十一日