

易方达天天理财货币市场基金

2021 年年度报告

2021 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：二〇二二年三月三十日

§ 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 2022 年 3 月 28 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 2021 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.....	13
§ 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.....	18
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.....	20
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.....	22
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.....	23
6.1	审计意见.....	23
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.....	24
§ 7	年度财务报表.....	25
7.1	资产负债表.....	25
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.....	59
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.....	60

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	61
	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	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
9.2	期末货币市场基金前十名份额持有人情况	63
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
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情况	64
9.5	期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产 品情况	64
§ 10	开放式基金份额变动	64
§ 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	65
11.4	基金投资策略的改变	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	65
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	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	65
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	68
12.1	备查文件目录	68
12.2	存放地点	69
12.3	查阅方式	69

§ 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	16,802,625,062.02 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	9,602,952,782. 79 份	3,652,950,378. 64 份	2,040,933,003. 19 份	1,505,788,897. 40 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	本基金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，主要投资策略包括资产配置策略、杠杆投资策略、银行存款及同业存单投资策略、债券回购投资策略、利率品种的投资策略、信用品种的投资策略、其他金融工具投资策略。
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		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	2021 年				2020 年				2019 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	229,574,203.14	158,263,260.64	57,256,626.39	33,200,434.23	303,569,443.63	380,653,908.58	83,567,533.33	20,502,038.12	627,236,454.35	899,005,214.35	91,012,362.90	10,596,061.58
本期利润	229,574,203.14	158,263,260.64	57,256,626.39	33,200,434.23	303,569,443.63	380,653,908.58	83,567,533.33	20,502,038.12	627,236,454.35	899,005,214.35	91,012,362.90	10,596,061.58
本期净值收益率	2.1556%	2.4012%	2.4115%	2.1561%	2.1030%	2.3485%	2.3588%	2.1032%	2.5636%	2.8106%	2.8209%	2.5651%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末				2020 年末				2019 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	9,602,952,782.79	3,652,950,378.64	2,040,933,003.19	1,505,788,897.40	11,842,433,377.79	8,903,452,614.72	2,649,125,162.41	931,503,974.60	17,569,248,524.92	17,417,328,142.47	3,348,679,461.90	883,993,621.15
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	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2021 年末				2020 年末				2019 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

											理 财 货 币 R	
累计净值收 率	33.5 946 %	36.4529 %	36.5739 %	11.79 20%	30.77 55%	33.25 32%	33.35 79%	9.432 6%	28.0820 %	30.1955 %	30.2 848 %	7.178 3%

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	0.5307%	0.0004%	0.0895%	0.0000%	0.4412%	0.0004%
过去六个月	1.0416%	0.0004%	0.1790%	0.0000%	0.8626%	0.0004%
过去一年	2.1556%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	1.8001%	0.0005%
过去三年	6.9779%	0.0010%	1.0712%	0.0000%	5.9067%	0.0010%
过去五年	15.4000%	0.0024%	1.7911%	0.0000%	13.6089%	0.0024%
自基金合同生效 起至今	33.5946%	0.0036%	3.1841%	0.0000%	30.4105%	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	0.5915%	0.0004%	0.0895%	0.0000%	0.5020%	0.0004%
过去六个月	1.1639%	0.0004%	0.1790%	0.0000%	0.9849%	0.0004%
过去一年	2.4012%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	2.0457%	0.0005%
过去三年	7.7518%	0.0010%	1.0712%	0.0000%	6.6806%	0.0010%
过去五年	16.7935%	0.0024%	1.7911%	0.0000%	15.0024%	0.0024%
自基金合同生效 起至今	36.4529%	0.0036%	3.1841%	0.0000%	33.2688%	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	0.5941%	0.0004%	0.0895%	0.0000%	0.5046%	0.0004%
过去六个月	1.1690%	0.0004%	0.1790%	0.0000%	0.9900%	0.0004%
过去一年	2.4115%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	2.0560%	0.0005%
过去三年	7.7842%	0.0010%	1.0712%	0.0000%	6.7130%	0.0010%
过去五年	16.8520%	0.0024%	1.7911%	0.0000%	15.0609%	0.0024%
自基金合同生效 起至今	36.5739%	0.0036%	3.1841%	0.0000%	33.3898%	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	0.5306%	0.0004%	0.0895%	0.0000%	0.4411%	0.0004%
过去六个月	1.0415%	0.0004%	0.1790%	0.0000%	0.8625%	0.0004%
过去一年	2.1561%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	1.8006%	0.0005%
过去三年	6.9802%	0.0010%	1.0712%	0.0000%	5.9090%	0.0010%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效 起至今	11.7920%	0.0021%	1.4986%	0.0000%	10.2934%	0.0021%

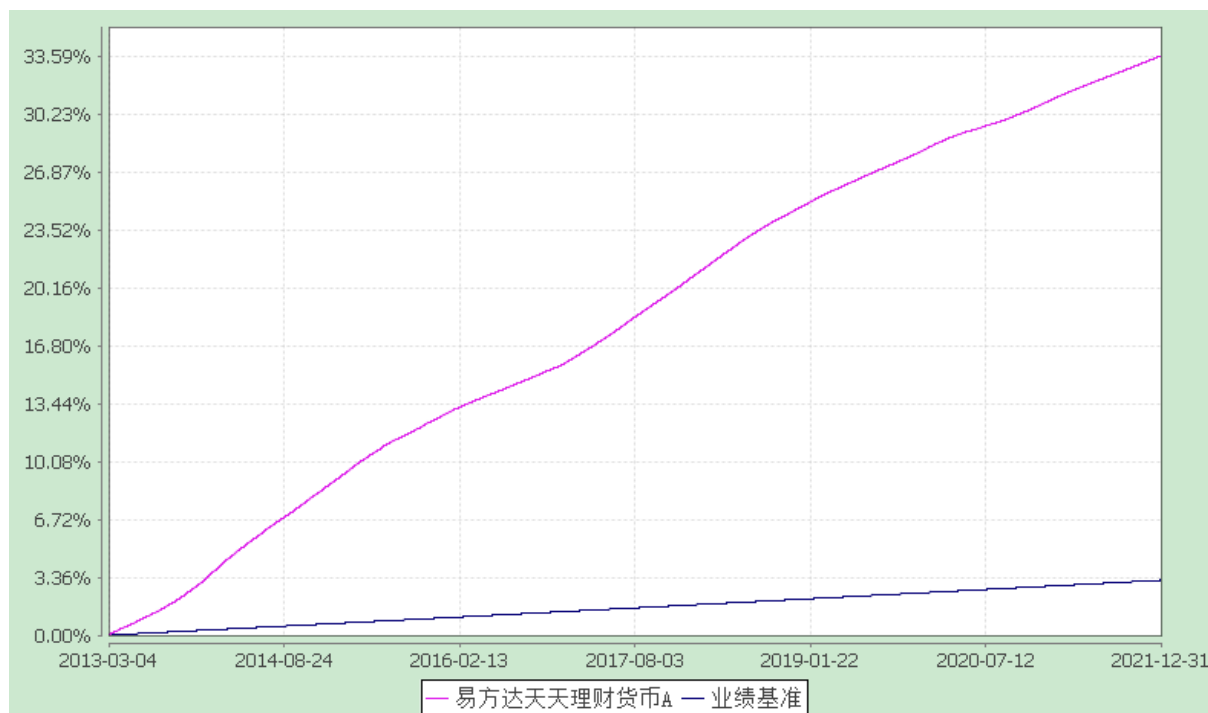
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

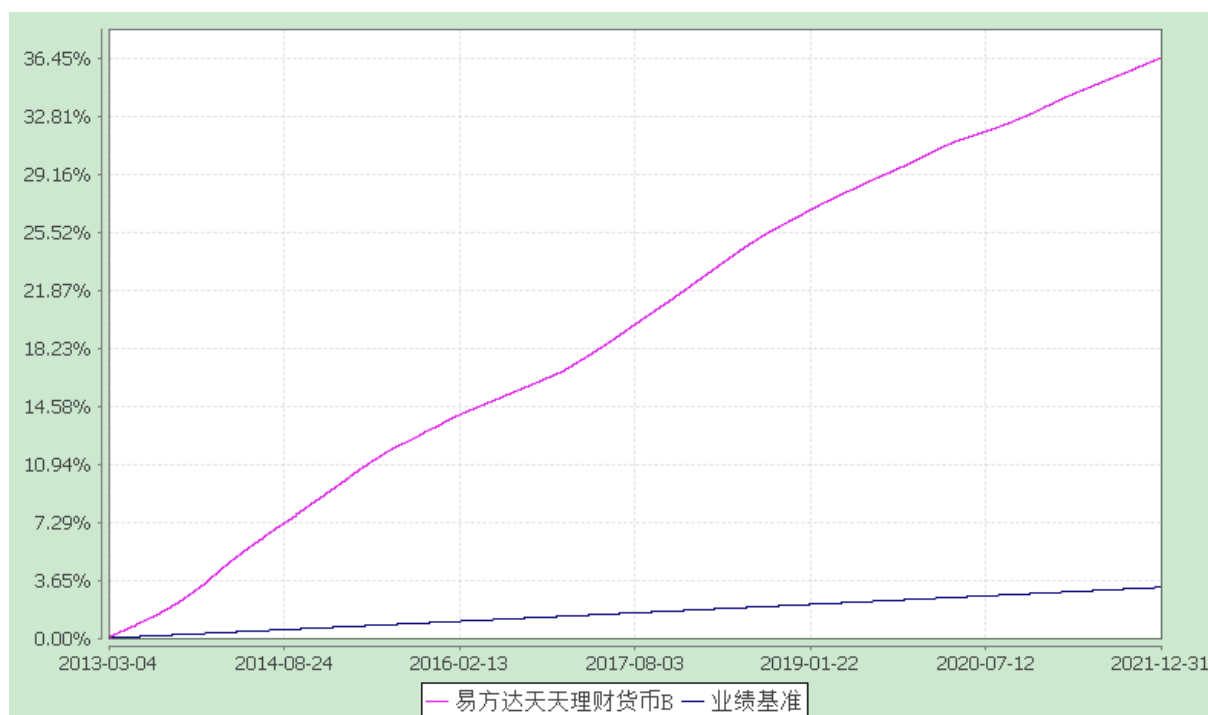
易方达天天理财货币 A

(2013 年 3 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日)



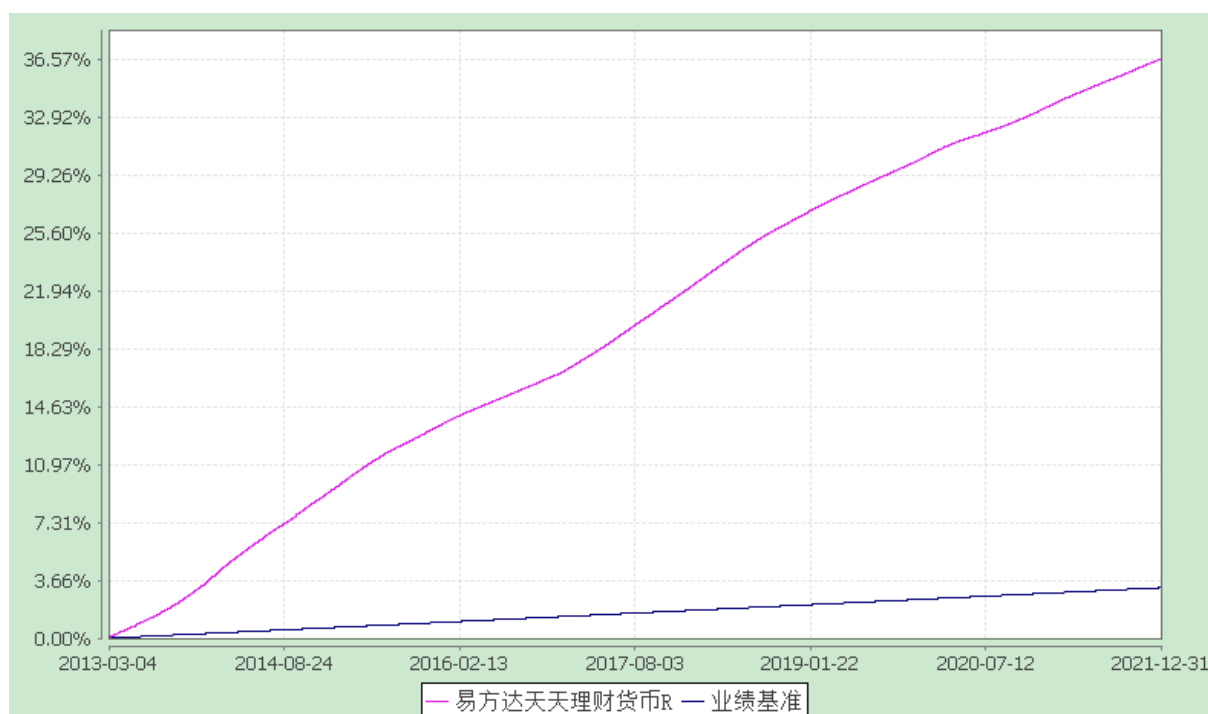
易方达天天理财货币 B

(2013 年 3 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日)



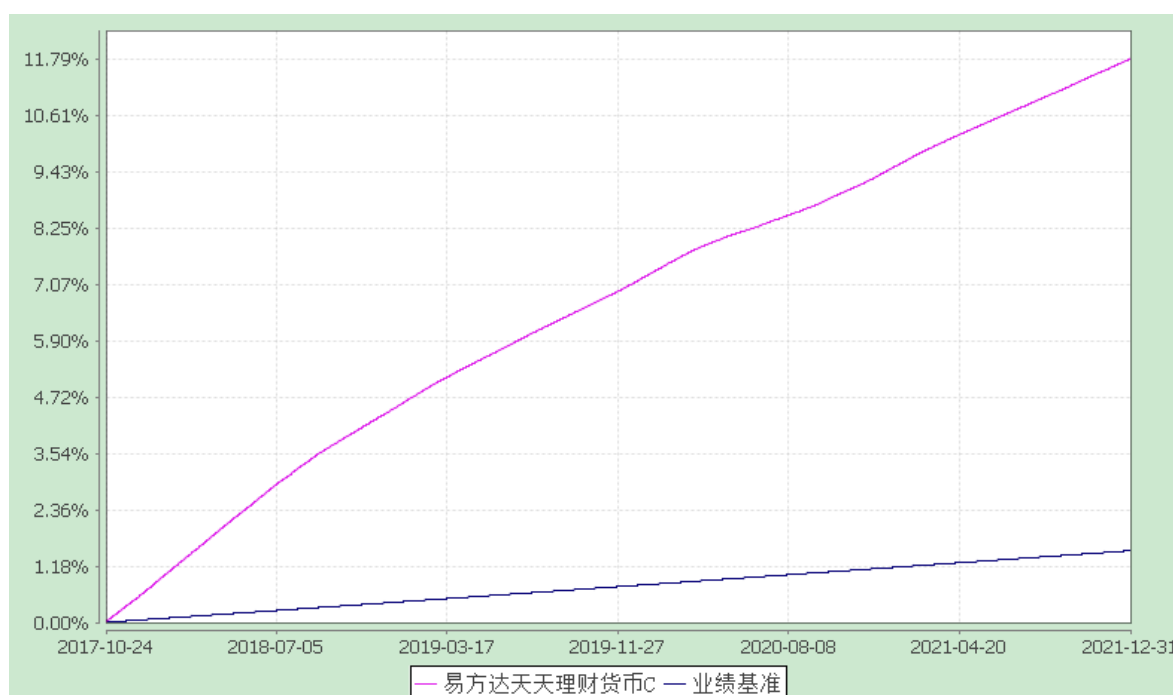
易方达天天理财货币 R

(2013 年 3 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日)



易方达天天理财货币 C

(2017 年 10 月 24 日至 2021 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。

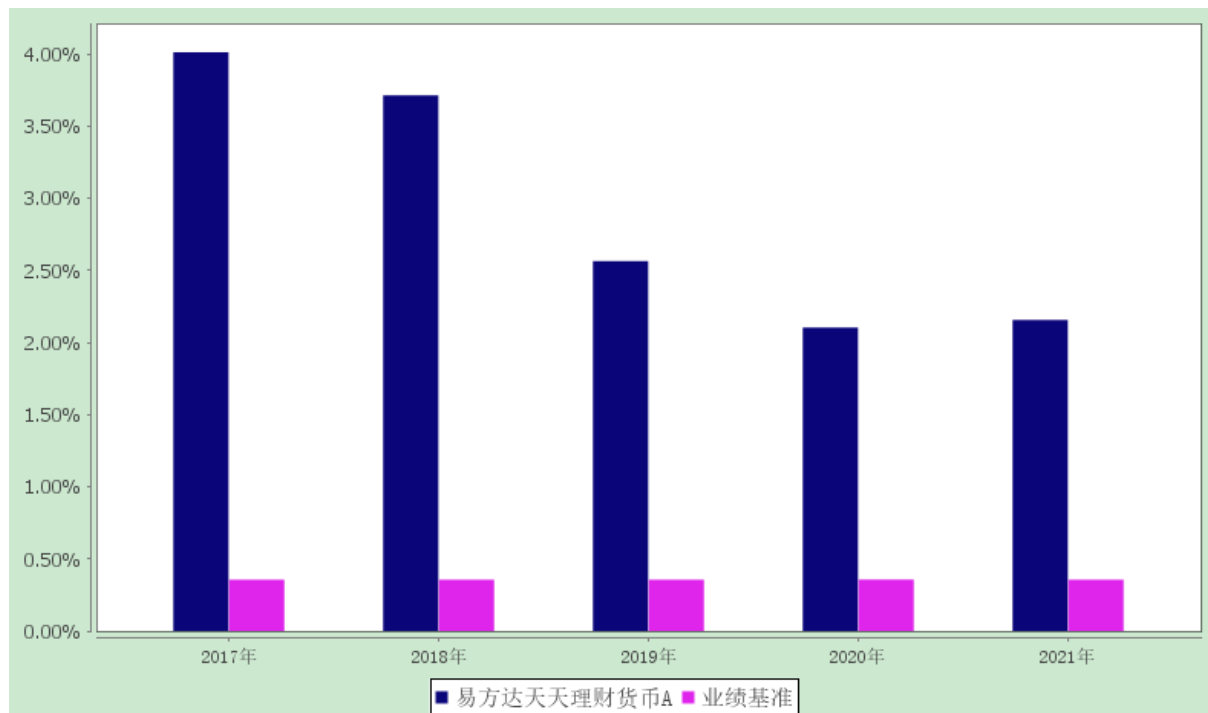
2. 自基金合同生效至报告期末, A 类基金份额净值收益率为 33.5946%, B 类基金份额净值收益率为 36.4529%, R 类基金份额净值收益率为 36.5739%, 同期业绩比较基准收益率为 3.1841%。C 类基金份额净值收益率为 11.7920%, 同期业绩比较基准收益率为 1.4986%。

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

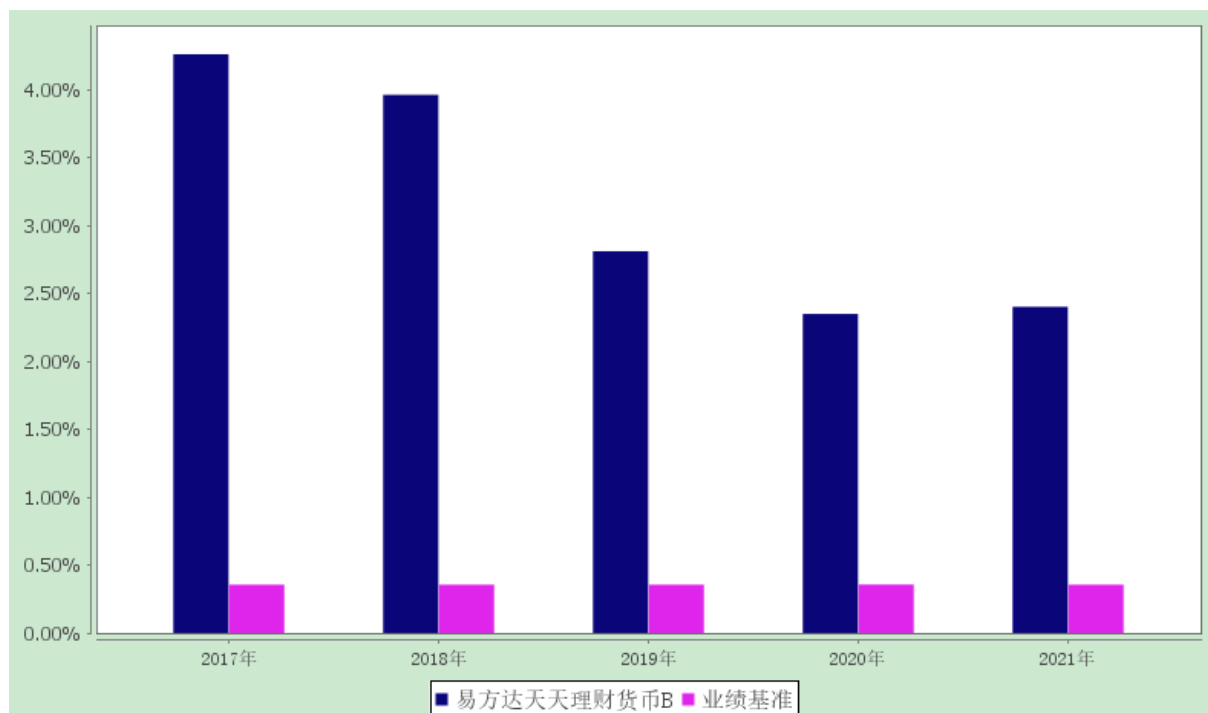
易方达天天理财货币市场基金

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

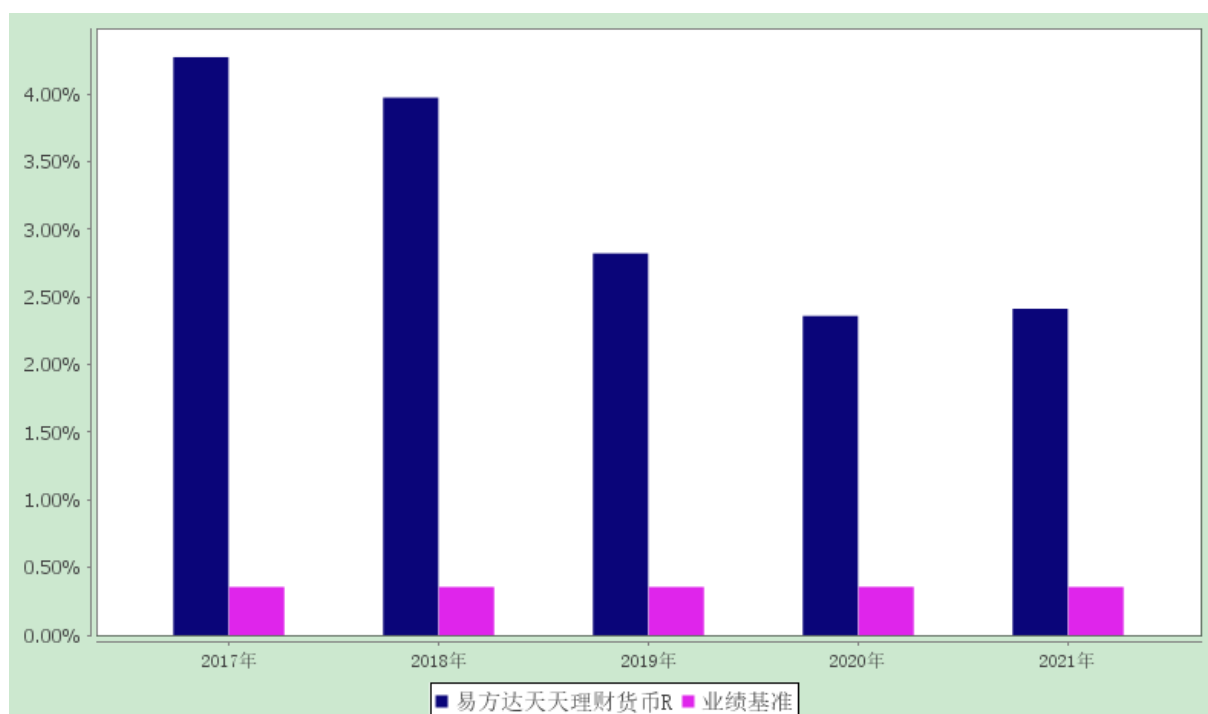
易方达天天理财货币 A



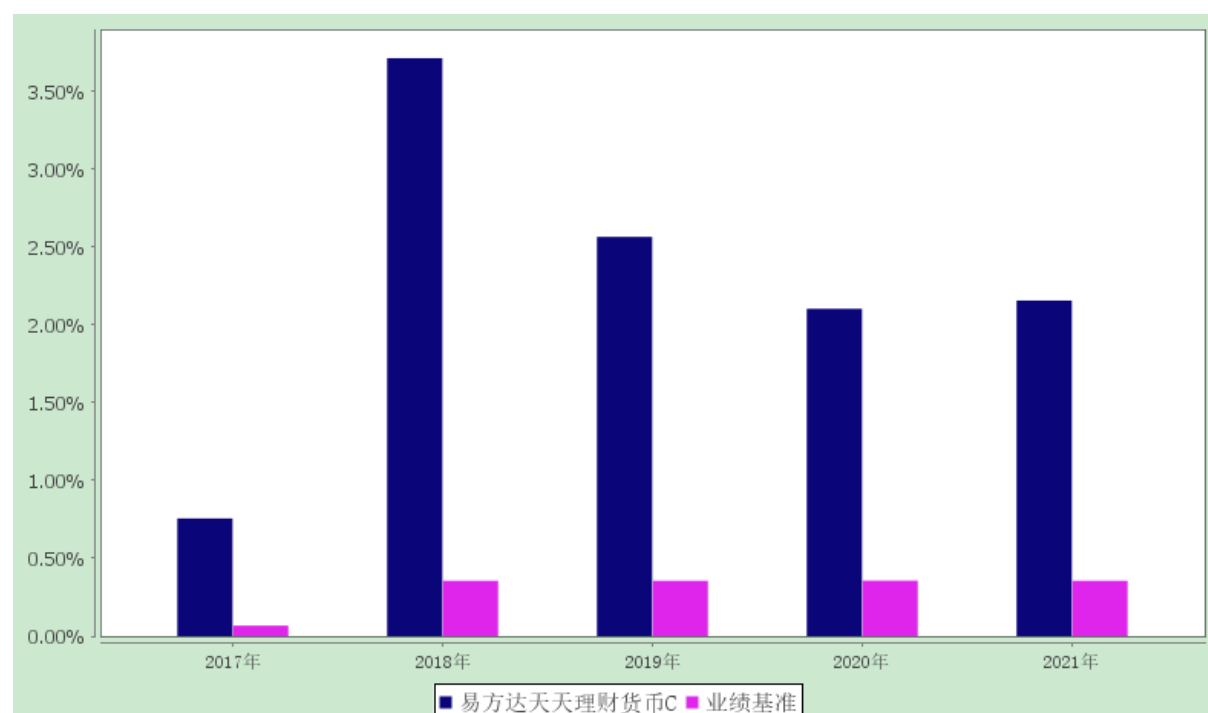
易方达天天理财货币 B



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	直接通过应付赎	应付利润本年变动	年度利润分配合	备注

	形式转实收 基金	回款转出金额		计	
2021 年	229,574,203. 14	-	-	229,574,203.14	-
2020 年	303,569,443. 63	-	-	303,569,443.63	-
2019 年	627,236,454. 35	-	-	627,236,454.35	-
合计	1,160,380,10 1.12	-	-	1,160,380,101.12	-

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
2021 年	158,263,260. 64	-	-	158,263,260.64	-
2020 年	380,653,908. 58	-	-	380,653,908.58	-
2019 年	899,005,214. 35	-	-	899,005,214.35	-
合计	1,437,922,38 3.57	-	-	1,437,922,383.57	-

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
2021 年	57,256,626.3 9	-	-	57,256,626.39	-
2020 年	83,567,533.3 3	-	-	83,567,533.33	-
2019 年	91,012,362.9 0	-	-	91,012,362.90	-
合计	231,836,522. 62	-	-	231,836,522.62	-

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
2021 年	33,200,434.2 3	-	-	33,200,434.23	-
2020 年	20,502,038.1 2	-	-	20,502,038.12	-
2019 年	10,596,061.5 8	-	-	10,596,061.58	-
合计	64,298,533.9 3	-	-	64,298,533.93	-

§ 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，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
石大悻	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、易方达财富快线货币市场基金的基金经理（自 2014 年 06 月 17 日至 2021 年 07 月 01 日）、易方达天	2013-03-04	-	12 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、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达掌柜季季盈

	天增利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（自 2014 年 09 月 12 日至 2021 年 10 月 19 日）、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、易方达安瑞短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳悦 120 天滚动持有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				理财债券型证券投资基金基金经理
刘朝阳	本基金的基金经理、易方达财富快线货币市场基金的基金经理、易方达易理财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、固定收益投资决策委员会委员、投资经理	2016-03-29	-	14 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固定收益部研究员、债券交易员、宏观策略高级研究员、基金经理
梁莹	本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、易方达财富快线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、易方达安和中短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理、易方达稳丰 90 天滚动持有短债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助理、易方达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、现金管理部总经理助理	2015-02-17	-	11 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、投资经理、易方达双月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达月月利理财债券型证券投资基金基金经理、易方达掌柜季季盈理财债券型证券投资基金基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理
易璨	本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、易方达现金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、易方达天天增利货币市场基金的基金	2018-06-20	-	11 年	硕士研究生，具有基金从业资格。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债券交易员、投资经理

经理助理、易方达龙宝货币市场基金的基金经理助理、易方达天天发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、易方达安悦超短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳悦 120 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达安和中短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳鑫 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理助理、易方达稳丰 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金的基金经理助理				
--	--	--	--	--

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/基金经理助理，“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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
刘朝阳	公募基金	4	242,560,684,467.76	2016-01-30
	私募资产管理计划	1	10,012,665.68	2021-12-13
	其他组合	0	0.00	-
	合计	5	242,570,697,133.44	-

注：1.“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2.报告期内，刘朝阳曾兼任管理的1个私募资产管理计划于2021年12月24日终止。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，其薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩，具体按其对产品业绩和投资团队的贡献等情况综合评定。

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》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度,明确公平交易的适用范围、公平交易的原则和内容、公平交易的管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、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)、境外投资、衍生品等投资管理活动,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。

公平交易的管控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,原则上应当做到“同时同价”,合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差;建立并实行集中交易制度,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;严格控制不同投资组合之间的同日反向交易;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反向交易、异常交易监控分析机制,对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,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,未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

针对基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情形,公司进一步加强了对投资指令下达、交易执行和反向交易控制等环节的控制措施,同时强化了对相关同反向交易价差及组合收益率差异的

事后监测分析，按监管要求完善了相关信息披露，进一步落实对兼任基金经理投资交易行为的规范和监督。本报告期内，相关制度措施执行情况良好，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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 30 次，其中 27 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基金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

2021 年经济逐渐从疫情造成的底部恢复，国内经济以有效的防疫机制和完整的产业链优势，继续保持稳中向好的韧性。2021 年 GDP（国内生产总值）同比增长 8.1%，两年平均增长 5.1%。全年经济走势先升后降，四季度面临需求收缩、供给冲击、预期转弱的三重压力。债券市场全年收益率明显下行，在年初和四季度初出现阶段性调整。全年市场关注点和债券市场利率走势大致分为五个阶段。第一阶段，1 月初央行重申货币政策“不急转弯”，纠偏流动性宽松预期，资金利率的上升带动整体收益率震荡上行；第二阶段，地方债发行不及预期、权益市场调整导致市场风险偏好下降，债券市场的配置压力加大，叠加央行保持较宽松的流动性环境，形成 3 月到 6 月的慢牛行情；第三阶段，央行 7 月超预期降准，给予市场流动性宽松的信心，叠加房地产市场走弱、经济增长压力加大，收益率快速下行；第四阶段，8 月中旬至 10 月中旬，大宗商品大涨引发对通胀和货币政策收紧的担忧，收益率震荡上行；第五阶段，10 月下旬至年末，经济基本面偏弱，通胀预期消退、地产信用风险显现，收益率再次震荡下行。12 月央行年内二次降准并下调 1 年期 LPR（贷款市场报价利率），市场降息预期走强，收益率达到年内低点。全年货币市场较为宽松，收益率震荡下行。一年期同业存单利率从一季度 3.1% 的高点下行至 8 月的最低点 2.65%，季末和四季度回调至 2.8% 左右后，年底再次下行至 2.6%。

报告期内，基金的运作在以保证资产的流动性的前提下，为投资者提供了较好的收益。本基金结合负债端特点，根据货币市场的变化情况适度使用杠杆，主要配置同业存单、短期逆回购和同业存款等资产。上半年操作较为稳健，下半年配置更为积极。

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 2.1556%，同期业绩比较基准收益率为 0.3555%；

B 类基金份额净值收益率为 2.4012%，同期业绩比较基准收益率为 0.3555%；R 类基金份额净值收益率为 2.4115%，同期业绩比较基准收益率为 0.3555%；C 类基金份额净值收益率为 2.1561%，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，世界进入到疫情后第三年，我们相信全世界的经济活动有望逐渐恢复正常化。在此预期下，发达经济体的政策重心将逐渐从如何拉动需求变成如何抑制通胀。但我国面对的宏观环境与海外诸多国家不同，从 2020 年四季度开始我国主动改变了经济增长的模式，降低了经济增长对地产和“老基建”的依赖。政府收紧了对地方政府与房地产的融资，而同时将信贷更多地投向制造业部门。由于房地产与地方政府融资是近年来我国信用创造的主体，上述转变导致了社会融资增速持续下行。我们判断未来国内经济政策将在高质量发展和托底经济之间进行平衡和取舍，政策的节奏是决定宏观经济和利率走势的关键。短期来看央行货币政策维持宽松的确信性较高。长期来看，随着国内宏观杠杆率的不断上升，国内整体利率水平的中枢不断下移可能也是确定的。尽管政府稳增长和宽信用的政策只在力度和时间上存在不确定性，但目前债券市场收益率水平处于历史低位，货币市场收益率曲线较为平坦，整体来看债券类资产的赔率较低。2022 年，我们需要不断观察政策和基本面的变化，在相对较低的机会成本与投资收益之间进行权衡。

本基金将坚持流动性管理工具的定位，密切关注基金的负债结构变化，在保持投资组合流动性安全的情况下，尽量提高组合的收益率。根据宏观走势灵活调整组合久期和杠杆，积极把握市场波段操作的机会。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，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务创新发展的实际需要，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，持续审视健全制度流程并强化对法规和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。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 培育合规文化、严守合规底线、防控违法违规行为是监察稽核工作的重中之重。围绕这个工作重点，秉持“客户利益至上、实事求是、坚守长期”的核心价值观，树立弘扬“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，促进公司合规文化建设。加大力度持续开展员工合规风控教育培训、强化合规监督考评机制，不断提高员工合规风控意识，深入践行“受人之托、为人理财”的信义义务。

(2) 坚持“守底线、保合规、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提示；认真贯彻落实法律法规的各项控制要求，加强对投资、研究、交易等业务运作的监控检查和反馈提示；持续完善公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，严格防控内幕交易、市场操纵和利益输送等违法违规行为，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。

(3) 参与新产品设计、新业务拓展工作，持续督促健全公募基金募集申请材料质量内控机制和工具手段，严格进行合规审查，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续深入贯彻落实《证券期货投资者适当性管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券基金期货经营机构投资者投诉处理工作指引（试行）》等法律法规和监管政策、自律准则，进一步完善基金销售相关业务规范，加强投资者权益保护、促进长期理性投资。持续优化投资者适当性管理和客户投诉纠纷处理机制，认真履行“了解客户、了解产品，将适当产品销售给适当客户”职责义务，保障投资者合法权益。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，进一步健全信息披露管理工作机制流程，不断推进信息披露文件制作审核的系统化，持续做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 全面落实《金融机构反洗钱和反恐怖融资监督管理办法》等最新反洗钱法规与监管要求，下大力气完善提升洗钱风险管理体系和内控机制：进一步修订制度流程、充实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，健全洗钱风险自评估工作机制方法，提升洗钱风险控制措施的针对性、有效性，不断提高反洗钱合规和风险管理水平，推动反洗钱工作以风险为本向纵深发展。

(7) 深入贯彻落实《证券期货经营机构及其工作人员廉洁从业规定》《基金经营机构及其工作人员廉洁从业实施细则》《公开募集证券投资基金管理人及从业人员职业操守和道德规范指南》等规定，不断完善业务过程中的廉洁从业管理机制，加强对员工廉洁从业、职业操守和道德规范等方面的教育宣导和培训，努力将廉洁从业、职业操守和道德规范要求渗透落实到业务活动和日常经营的各个环节。

(8) 以法律法规、基金合同以及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、产品运营、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，坚持不断查缺补漏、防微杜渐，推动公司内控及合规管理有效性的提升。

(9) 不断检讨回顾合规管控框架和机制，促进监察稽核自身制度流程和工具手段的完善，持续提升监察稽核工作的独立性、规范性、针对性与有效性。

(10) 继续顺利通过 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，获得 GIPS 鉴证报告，鉴证日期区间为

2001 年 9 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日。

本基金管理人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，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，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直接的重大利益冲突。

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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——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本基金 2021 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（2022）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 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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（包括披露）、结构和内容，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

昌华 马婧

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

2022 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：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,337,012,680.00	3,901,831,650.87
结算备付金		67,877,681.82	182,859,047.62
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	9,607,822,320.82	16,946,449,578.01
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,515,146,425.60	16,280,884,578.01
资产支持证券投资		92,675,895.22	665,565,000.00
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	3,420,735,177.52	5,293,857,120.78
应收证券清算款		549,398,842.45	-
应收利息	7.4.7.5	35,644,686.56	52,122,433.17
应收股利		-	-
应收申购款		131,375,200.55	229,092,475.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		19,149,866,589.72	26,606,212,305.97
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2021 年 12 月 31 日	2020 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		1,760,996,438.50	1,990,706,651.26
应付证券清算款		499,397,808.19	-
应付赎回款		77,145,774.58	276,292,175.60
应付管理人报酬		4,843,697.82	6,962,373.92
应付托管费		1,467,787.25	2,109,810.26
应付销售服务费		2,381,137.04	2,748,516.02
应付交易费用	7.4.7.7	146,379.96	199,321.32
应交税费		136,798.39	146,163.38
应付利息		481,034.85	268,359.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	244,671.12	263,805.31
负债合计		2,347,241,527.70	2,279,697,176.45
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	16,802,625,062.02	24,326,515,129.52
未分配利润	7.4.7.10	0.00	0.00
所有者权益合计		16,802,625,062.02	24,326,515,129.52
负债和所有者权益总计		19,149,866,589.72	26,606,212,305.97

注：报告截止日 2021 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 16,802,625,062.02 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 9,602,952,782.79 份，B 类基金份额总额 3,652,950,378.64 份，R 类基金份额总额 2,040,933,003.19 份，C 类基金份额总额 1,505,788,897.40 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		630,981,330.44	1,035,614,462.48
1.利息收入		638,685,521.92	1,068,760,133.79
其中：存款利息收入	7.4.7.11	178,361,708.65	275,550,552.29
债券利息收入		282,218,160.02	531,642,214.93
资产支持证券利息收入		24,944,731.07	35,239,439.47
买入返售金融资产收入		153,160,922.18	226,327,927.10
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-7,708,942.02	-33,155,238.94
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-7,708,942.02	-33,155,238.94
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	4,750.54	9,567.63
减：二、费用		152,686,806.04	247,321,538.82
1. 管理人报酬		70,213,668.38	117,586,242.90
2. 托管费		21,276,869.26	35,632,194.75
3. 销售服务费		31,420,321.51	40,326,147.97
4. 交易费用	7.4.7.14	-	-
5. 利息支出		29,279,406.22	53,124,137.71

其中：卖出回购金融资产支出		29,279,406.22	53,124,137.71
6. 税金及附加		122,817.97	264,464.55
7. 其他费用	7.4.7.15	373,722.70	388,350.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		478,294,524.40	788,292,923.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		478,294,524.40	788,292,923.66

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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	24,326,515,129.52	-	24,326,515,129.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	478,294,524.40	478,294,524.40
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）	-7,523,890,067.50	-	-7,523,890,067.50
其中：1.基金申购款	69,179,008,660.50	-	69,179,008,660.50
2.基金赎回款	-76,702,898,728.00	-	-76,702,898,728.00
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）	-	-478,294,524.40	-478,294,524.40
五、期末所有者权益（基金净值）	16,802,625,062.02	-	16,802,625,062.02
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	39,219,249,750.44	-	39,219,249,750.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	788,292,923.66	788,292,923.66
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）	-14,892,734,620.92	-	-14,892,734,620.92
其中：1.基金申购款	78,285,422,805.29	-	78,285,422,805.29
2.基金赎回款	-93,178,157,426.21	-	-93,178,157,426.21
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）	-	-788,292,923.66	-788,292,923.66
五、期末所有者权益（基金净值）	24,326,515,129.52	-	24,326,515,129.52

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》、《公开募集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<年度报告和中期报告>》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。付息债券、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) 资产支持证券利息收入按实际持有期内逐日计提。资产支持证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；

(4) 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；

(5) 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；

(6) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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；

(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更正。

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,012,680.00	1,831,650.87
定期存款	5,335,000,000.00	3,900,000,000.00

其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	5,335,000,000.00	3,900,000,000.00
其他存款	-	-
合计	5,337,012,680.00	3,901,831,650.87

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 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	9,515,146,425.60	9,528,134,000.00	12,987,574.40	0.0773
	合计	9,515,146,425.60	9,528,134,000.00	12,987,574.40	0.0773
资产支持证券		92,675,895.22	93,031,000.00	355,104.78	0.0021
合计		9,607,822,320.82	9,621,165,000.00	13,342,679.18	0.0794
项目		上年度末 2020 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	16,280,884,578.01	16,303,877,000.00	22,992,421.99	0.0945
	合计	16,280,884,578.01	16,303,877,000.00	22,992,421.99	0.0945
资产支持证券		665,565,000.00	667,302,900.00	1,737,900.00	0.0071
合计		16,946,449,578.01	16,971,179,900.00	24,730,321.99	0.1017

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 2021 年 12 月 31 日

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	1,729,051,000.00	-
银行间市场	1,691,684,177.52	-
合计	3,420,735,177.52	-
项目	上年度末	
	2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,800,000,000.00	-
银行间市场	1,493,857,120.78	-
合计	5,293,857,120.78	-

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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	203.22	9,897.90
应收定期存款利息	21,492,812.61	8,279,500.25
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	30,545.00	82,286.60
应收债券利息	11,370,646.57	33,645,034.30
应收资产支持证券利息	1,679,977.37	7,696,522.19
应收买入返售证券利息	1,070,501.79	2,409,191.93
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	35,644,686.56	52,122,433.17

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 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	146,379.96	199,321.32
合计	146,379.96	199,321.32

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	4,571.12	17,805.31
预提费用	240,100.00	246,000.00
合计	244,671.12	263,805.31

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 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,842,433,377.79	11,842,433,377.79
本期申购	40,995,345,720.94	40,995,345,720.94
本期赎回（以“-”号填列）	-43,234,826,315.94	-43,234,826,315.94
本期末	9,602,952,782.79	9,602,952,782.79

易方达天天理财货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,903,452,614.72	8,903,452,614.72
本期申购	7,322,244,532.94	7,322,244,532.94

本期赎回（以“-”号填列）	-12,572,746,769.02	-12,572,746,769.02
本期末	3,652,950,378.64	3,652,950,378.64

易方达天天理财货币 R

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,649,125,162.41	2,649,125,162.41
本期申购	3,947,753,432.06	3,947,753,432.06
本期赎回（以“-”号填列）	-4,555,945,591.28	-4,555,945,591.28
本期末	2,040,933,003.19	2,040,933,003.19

易方达天天理财货币 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	931,503,974.60	931,503,974.60
本期申购	16,913,664,974.56	16,913,664,974.56
本期赎回（以“-”号填列）	-16,339,380,051.76	-16,339,380,051.76
本期末	1,505,788,897.40	1,505,788,897.40

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	0.00	-	0.00
本期利润	229,574,203.14	-	229,574,203.14
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	-229,574,203.14	-	-229,574,203.14
本期末	0.00	-	0.00

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	0.00	-	0.00
本期利润	158,263,260.64	-	158,263,260.64
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	-158,263,260.64	-	-158,263,260.64
本期末	0.00	-	0.00

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	0.00	-	0.00
本期利润	57,256,626.39	-	57,256,626.39
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	-57,256,626.39	-	-57,256,626.39
本期末	0.00	-	0.00

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	0.00	-	0.00
本期利润	33,200,434.23	-	33,200,434.23

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	-33,200,434.23	-	-33,200,434.23
本期末	0.00	-	0.00

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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	173,579.09	522,319.11
定期存款利息收入	176,641,098.60	272,062,294.61
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,547,030.96	2,965,938.57
其他	-	-
合计	178,361,708.65	275,550,552.29

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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	46,001,665,081.28	65,598,781,069.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	45,895,529,553.72	65,475,169,778.62
减：应收利息总额	113,844,469.58	156,766,530.18
买卖债券差价收入	-7,708,942.02	-33,155,238.94

7.4.7.12.1 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日

卖出资产支持证券成交总额	1,086,794,184.14	1,299,992,648.95
减：卖出资产支持证券成本总额	1,062,916,000.00	1,263,435,000.00
减：应收利息总额	23,878,184.14	36,557,648.95
资产支持证券投资收益	-	-

7.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	4,750.54	9,567.63
合计	4,750.54	9,567.63

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 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	111,100.00	117,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
银行汇划费	103,372.38	114,150.94
银行间账户维护费	35,800.00	36,000.00
其他	3,450.32	1,200.00
合计	373,722.70	388,350.94

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	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、基金销售机构
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	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
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
广东省易方达公益基金会	基金管理人发起的公益基金会

注：1.广东省广晟资产经营有限公司自 2021 年 3 月 12 日起将名称变更为广东省广晟控股集团有限公司；盈峰控股集团有限公司自 2021 年 7 月 26 日起将名称变更为盈峰集团有限公司；广东省易方达教育基金会自 2021 年 12 月 9 日起将名称变更为广东省易方达公益基金会。2.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 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.5 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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	70,213,668.38	117,586,242.90
其中：支付销售机构的客户维护费	14,895,738.24	19,567,547.03

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,276,869.26	35,632,194.75

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 2021年1月1日至2021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	3,547,028.54	604,363.10	-	-	4,151,391.64
中国工商银行	2,659,976.50	7,586.36	-	-	2,667,562.86
广发证券	18,621.87	-	-	-	18,621.87
合计	6,225,626.91	611,949.46	-	-	6,837,576.37
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	7,082,269.16	1,561,588.71	-	-	8,643,857.87
中国工商银行	3,389,259.56	10,139.93	-	-	3,399,399.49
广发证券	18,278.59	1,083.06	-	-	19,361.65
合计	10,489,807.31	1,572,811.70	-	-	12,062,619.01

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。

本基金今后若开通份额类别之间升降级的有关业务，应自其升降级后的下一个工作日起适用升

降级后的基金份额的销售服务费年费率,业务规则详见届时发布的有关公告及更新招募说明书。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

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 2021年1月1日至2021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	-	199,691,75 0.00	501,980,00 0.00	1,119,848 .95	8,141,850,000. 00	848,356.1 4
上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	-	-	-	122,966,591,0 00.00	7,558,006 .49

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日				上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	-	292,622, 340.64	-	-	-	401,988, 398.91	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	1,229,67 9,497.26	-	-	-	1,390,63 3,941.73	-	-

报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	1,150,000,000.00	-	-	-	1,500,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	372,301,837.90	-	-	-	292,622,340.64	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	10.1918%	-	-	-	3.2866%	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

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 2021年12月31日		上年度末 2020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
广东省易方达公益基金会	-	-	1,011,439.21	0.0085%

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等相关法律文件有关规定支付。

易方达天天理财货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020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
易方达资产管理有 限公司	52,127,429.46	1.4270%	50,904,818.44	0.5717%

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等相关法律文件有关规定支付。

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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日		2020年1月1日至2020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	2,012,680.00	173,579.09	1,831,650.87	522,319.11

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

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
229,574,203.14	-	-	229,574,203.14	-

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
158,263,260.64	-	-	158,263,260.64	-

			64	
--	--	--	----	--

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
57,256,626.39	-	-	57,256,626.3 9	-

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
33,200,434.23	-	-	33,200,434.2 3	-

7.4.12 期末（2021 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 2021 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 1,760,996,438.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
112103054	21 农业银行 CD054	2022-01-04	99.06	1,261,000	124,914,473.88
112103099	21 农业银行 CD099	2022-01-04	98.52	1,000,000	98,516,417.83
112103101	21 农业银行 CD101	2022-01-04	98.52	1,000,000	98,523,097.37
112107060	21 招商银行	2022-01-04	99.33	449,000	44,597,645.76

	CD060				
112109181	21 浦发银行 CD181	2022-01-04	99.07	3,000,000	297,206,803.95
190207	19 国开 07	2022-01-04	100.28	589,000	59,067,428.17
190303	19 进出 03	2022-01-04	100.08	1,700,000	170,132,301.75
210301	21 进出 01	2022-01-04	100.04	406,000	40,617,753.13
219939	21 贴现国债 39	2022-01-04	99.69	3,500,000	348,907,050.23
112104029	21 中国银行 CD029	2022-01-05	98.45	1,000,000	98,449,389.55
112105076	21 建设银行 CD076	2022-01-05	98.92	261,000	25,818,461.58
112111159	21 平安银行 CD159	2022-01-05	98.52	1,000,000	98,519,815.43
112117098	21 光大银行 CD098	2022-01-05	98.55	1,000,000	98,545,370.63
112109237	21 浦发银行 CD237	2022-01-06	98.42	3,261,000	320,954,175.54
合计				19,427,000	1,924,770,184.80

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 2021 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、基金投资部门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、监察合规管理部门、集中交易部门、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，属于证券投资基金中高流动性、低风险品种，其预期风险和预期收益率都低于股票基金、债券基金和混合基金。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

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，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 2021 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 52.08%(2020 年 12 月 31 日：64.68%)。

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
A-1	0.00	30,238,931.61
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	870,903,913.87	1,435,052,193.98
合计	870,903,913.87	1,465,291,125.59

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。

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 2021年12月31日	上年度末 2020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 2021年12月31日	上年度末 2020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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	94,355,872.59	673,261,522.19
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	94,355,872.59	673,261,522.19

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	8,655,613,158.30	14,849,238,486.72
AAA 以下	0.00	0.00

未评级	0.00	0.00
合计	8,655,613,158.30	14,849,238,486.72

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2021 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。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所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

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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 2021 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	5,337,012,680.00	-	-	-	5,337,012,680.00
结算备付金	67,877,681.82	-	-	-	67,877,681.82
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	9,607,822,320.82	-	-	-	9,607,822,320.82
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	3,420,735,177.52	-	-	-	3,420,735,177.52
应收证券清算款	-	-	-	549,398,842.45	549,398,842.45
应收利息	-	-	-	35,644,686.56	35,644,686.56
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	131,375,200.55	131,375,200.55
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	18,433,447,860.16	-	-	716,418,729.56	19,149,866,589.72
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	1,760,996,438.50	-	-	-	1,760,996,438.50

应付证券清算款	-	-	-	499,397,808.19	499,397,808.19
应付赎回款	-	-	-	77,145,774.58	77,145,774.58
应付管理人报酬	-	-	-	4,843,697.82	4,843,697.82
应付托管费	-	-	-	1,467,787.25	1,467,787.25
应付销售服务费	-	-	-	2,381,137.04	2,381,137.04
应付交易费用	-	-	-	146,379.96	146,379.96
应交税费	-	-	-	136,798.39	136,798.39
应付利息	-	-	-	481,034.85	481,034.85
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	244,671.12	244,671.12
负债总计	1,760,996,438.50	-	-	586,245,089.20	2,347,241,527.70
利率敏感度缺口	16,672,451,421.66	-	-	130,173,640.36	16,802,625,062.02
上年度末 2020 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	3,901,831,650.87	-	-	-	3,901,831,650.87
结算备付金	182,859,047.62	-	-	-	182,859,047.62
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	16,946,449,578.01	-	-	-	16,946,449,578.01
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	5,293,857,120.78	-	-	-	5,293,857,120.78
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	52,122,433.17	52,122,433.17
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	229,092,475.52	229,092,475.52
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	26,324,997,397.2	-	-	281,214,908.69	26,606,212,305.9

	8			7
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	1,990,706,651.26	-	-	1,990,706,651.26
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	276,292,175.60	276,292,175.60
应付管理人报酬	-	-	6,962,373.92	6,962,373.92
应付托管费	-	-	2,109,810.26	2,109,810.26
应付销售服务费	-	-	2,748,516.02	2,748,516.02
应付交易费用	-	-	199,321.32	199,321.32
应交税费	-	-	146,163.38	146,163.38
应付利息	-	-	268,359.38	268,359.38
应付利润	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-
其他负债	-	-	263,805.31	263,805.31
负债总计	1,990,706,651.26	-	288,990,525.19	2,279,697,176.45
利率敏感度缺口	24,334,290,746.02	-	-7,775,616.50	24,326,515,129.52

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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	1.市场利率下降 25 个基点	8,699,894.32	7,495,634.91
2.市场利率上升 25 个基点	-8,680,465.35	-7,486,437.35	

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。

7.4.14 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 2021 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 9,607,822,320.82 元，无属于第一或第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第二层次 16,946,449,578.01 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

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2021 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(2020 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) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定,以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公开募集证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外,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	9,607,822,320.82	50.17
	其中:债券	9,515,146,425.60	49.69
	资产支持证券	92,675,895.22	0.48
2	买入返售金融资产	3,420,735,177.52	17.86
	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	5,404,890,361.82	28.22
4	其他各项资产	716,418,729.56	3.74
5	合计	19,149,866,589.72	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	6.47	
	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	1,760,996,438.50	10.48
	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	117
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

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	26.20	13.45
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	9.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	16.75	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天（含）—397 天（含）	49.47	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	112.98	13.45

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	348,907,050.23	2.08
2	央行票据	-	-
3	金融债券	510,626,217.07	3.04
	其中：政策性金融债	510,626,217.07	3.04
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	8,655,613,158.30	51.51
8	其他	-	-
9	合计	9,515,146,425.60	56.63
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	112173147	21 宁波银行 CD316	6,000,000	598,370,871.29	3.56
2	112109237	21 浦发银行 CD237	5,000,000	492,110,051.43	2.93
3	112117193	21 光大银行 CD193	4,000,000	398,942,937.64	2.37
4	112106155	21 交通银行 CD155	4,000,000	395,317,796.14	2.35
5	219939	21 贴现国债 39	3,500,000	348,907,050.23	2.08
6	112106128	21 交通银行 CD128	3,500,000	346,950,453.32	2.06

7	112104014	21 中国银行 CD014	3,000,000	298,479,271.86	1.78
8	112105072	21 建设银行 CD072	3,000,000	297,846,108.17	1.77
9	112113213	21 浙商银行 CD213	3,000,000	297,429,391.75	1.77
10	112109181	21 浦发银行 CD181	3,000,000	297,206,803.95	1.77

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	0.1047%
报告期内偏离度的最低值	0.0012%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0528%

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）	摊余成本（元）	占基金资产净值比例(%)
1	137795	荟享 053A	300,000	30,000,000.00	0.18
2	137721	桂语 9A1	200,000	20,026,895.22	0.12
3	137657	中铁 8 优 A	200,000	20,000,000.00	0.12
4	137628	21 融惠 1A	100,000	10,000,000.00	0.06
4	179582	至诚 4A	100,000	10,000,000.00	0.06
6	137590	荟享 051A	300,000	2,649,000.00	0.02

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。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局、国家外汇管理局宁波市分局、中国人民银行宁波市中心支行的处罚。上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、中国银行保险监督管理委员会上海监管局、中国银行保险监督管理委员会的处罚。交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局上海市分局、中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。浙商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局浙江省分局、中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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	549,398,842.45
3	应收利息	35,644,686.56
4	应收申购款	131,375,200.55
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	716,418,729.56

§ 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	3,047,008	3,151.60	569,333,471.38	5.93%	9,033,619,311.41	94.07%
易方达天天理财货币 B	215	16,990,466.88	3,389,327,328.22	92.78%	263,623,050.42	7.22%
易方达天天理财货币 R	410	4,977,885.37	2,040,933,003.19	100.00%	0.00	0.00%
易方达天天理财货币 C	95,123	15,829.91	0.00	0.00%	1,505,788,897.40	100.00%
合计	3,142,756	5,346.46	5,999,593,802.79	35.71%	10,803,031,259.23	64.29%

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	753,655,899.11	4.49%
2	基金类机构	372,328,429.11	2.22%
3	银行类机构	311,057,357.08	1.85%
4	其他机构	308,168,979.34	1.83%
5	保险类机构	273,008,341.12	1.62%
6	其他机构	148,418,015.09	0.88%
7	银行类机构	103,539,381.05	0.62%
8	银行类机构	102,134,137.51	0.61%
9	其他机构	88,088,945.28	0.52%
10	其他机构	74,623,490.51	0.44%

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	3,308,076.10	0.0344%
	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	10.54	0.0000%
	合计	3,308,086.64	0.0197%

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
	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

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
刘朝阳	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0
	合计	0~10

注：持有本人管理的产品份额总量的数量区间为基金经理本人及其直系亲属持有份额的合计数。

§ 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）	3,017,838,433.09	841,741,198.56	600,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	11,842,433,377.79	8,903,452,614.72	2,649,125,162.41	931,503,974.60
本报告期基金总申购份额	40,995,345,720.94	7,322,244,532.94	3,947,753,432.06	16,913,664,974.56
减：本报告期基金总赎回份额	43,234,826,315.94	12,572,746,769.02	4,555,945,591.28	16,339,380,051.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-

本报告期末基金份额总额	9,602,952,782.	3,652,950,378.	2,040,933,003.	1,505,788,897.
	79	64	19	40

§ 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 2021 年 1 月 23 日发布公告，自 2021 年 1 月 23 日起聘任娄利舟女士担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 17 日发布公告，自 2021 年 7 月 15 日起陈丽园女士不再担任公司副总经理级高级管理人员；2021 年 7 月 24 日发布公告，自 2021 年 7 月 24 日起聘任萧楠先生担任公司副总经理级高级管理人员，聘任管勇先生担任公司首席信息官；2021 年 7 月 30 日发布公告，自 2021 年 7 月 30 日起聘任杨冬梅女士担任公司副总经理级高级管理人员。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

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 9 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 111,100.00 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，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稽查或处罚。

报告期内，公司收到中国证券监督管理委员会广东监管局对公司及相关人员的监管措施。公司已及时按要求改正并报告。

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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为广发证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		券成交总 额的比例		券回购成 交总额的 比例		成交总额的 比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	30,029,100.0 0	59.44%	187,184,5 00,000.00	83.98%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	20,494,000.0 0	40.56%	26,858,69 0,000.00	12.05%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	8,850,046 ,000.00	3.97%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

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旗下部分开放式基金增加东方财富证券为销售机构的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-08
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-01-21
3	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-01-23
4	易方达基金管理有限公司关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	基金管理人网站	2021-02-08
5	易方达基金管理有限公司旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	上海证券报	2021-03-30
6	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-02
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第	上海证券报	2021-04-19

	1 季度报告提示性公告		
8	易方达基金管理有限公司关于终止攀枝花市商业银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-04-27
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-17
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-07-20
11	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
12	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-24
13	易方达基金管理有限公司关于南京分公司营业场所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-28
14	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-07-30
15	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年中期报告提示性公告	上海证券报	2021-08-28
16	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	上海证券报	2021-10-27
17	易方达基金管理有限公司关于暂停北京钱景基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-10
18	易方达基金管理有限公司关于成都分公司营业场所变更的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2021-12-17

§ 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

二〇二二年三月三十日