

# 易方达天天增利货币市场基金

## 2022 年中期报告

### 2022 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

送出日期：二〇二二年八月三十日

## 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。本中期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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 债券回购融资情况	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限	42
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	43
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	43
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明	44
报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明	44
7.8 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	44

7.9 投资组合报告附注 .....	44
8 基金份额持有人信息 .....	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
8.4 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 .....	46
9 开放式基金份额变动 .....	47
10 重大事件揭示 .....	47
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	47
10.4 基金投资策略的改变 .....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	50
10.9 其他重大事件 .....	50
11 备查文件目录 .....	51
11.1 备查文件目录 .....	51
11.2 存放地点 .....	51
11.3 查阅方式 .....	52

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达天天增利货币市场基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	23,784,727,291.48 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	21,549,607,972.31 份	2,235,119,319.17 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	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，主要投资策略包括银行存款及同业存单投资策略、利率品种的投资策略、信用品种的投资策略、债券回购投资策略、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。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	李申
	联系电话	020-85102688	021-60637102
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com

客户服务电话	400 881 8088	021-60637111
传真	020-38798812	021-60635778
注册地址	广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码	510620	100033
法定代表人	刘晓艳	田国立

## 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
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 43 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	易方达基金管理有限公司	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州 银行大厦 40-43 楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 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
本期已实现收益	205,691,059.05	13,044,539.56
本期利润	205,691,059.05	13,044,539.56
本期净值收益率	0.9398%	1.0601%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 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
期末基金资产净值	21,549,607,972.31	2,235,119,319.17
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 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
累计净值收益率	26.6496%	29.1027%

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）

扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金按实际利率法计算账面价值，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 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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1399%	0.0004%	0.1126%	0.0000%	0.0273%	0.0004%
过去三个月	0.4395%	0.0007%	0.3418%	0.0000%	0.0977%	0.0007%
过去六个月	0.9398%	0.0007%	0.6810%	0.0000%	0.2588%	0.0007%
过去一年	1.9718%	0.0006%	1.3781%	0.0000%	0.5937%	0.0006%
过去三年	6.3539%	0.0008%	4.1955%	0.0000%	2.1584%	0.0008%
自基金合同生效起至今	26.6496%	0.0033%	11.6053%	0.0000%	15.0443%	0.0033%

##### 易方达天天增利货币 B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1597%	0.0004%	0.1126%	0.0000%	0.0471%	0.0004%
过去三个月	0.4996%	0.0007%	0.3418%	0.0000%	0.1578%	0.0007%
过去六个月	1.0601%	0.0007%	0.6810%	0.0000%	0.3791%	0.0007%
过去一年	2.2169%	0.0006%	1.3781%	0.0000%	0.8388%	0.0006%
过去三年	7.1207%	0.0008%	4.1955%	0.0000%	2.9252%	0.0008%
自基金合同生效起至今	29.1027%	0.0033%	11.6053%	0.0000%	17.4974%	0.0033%

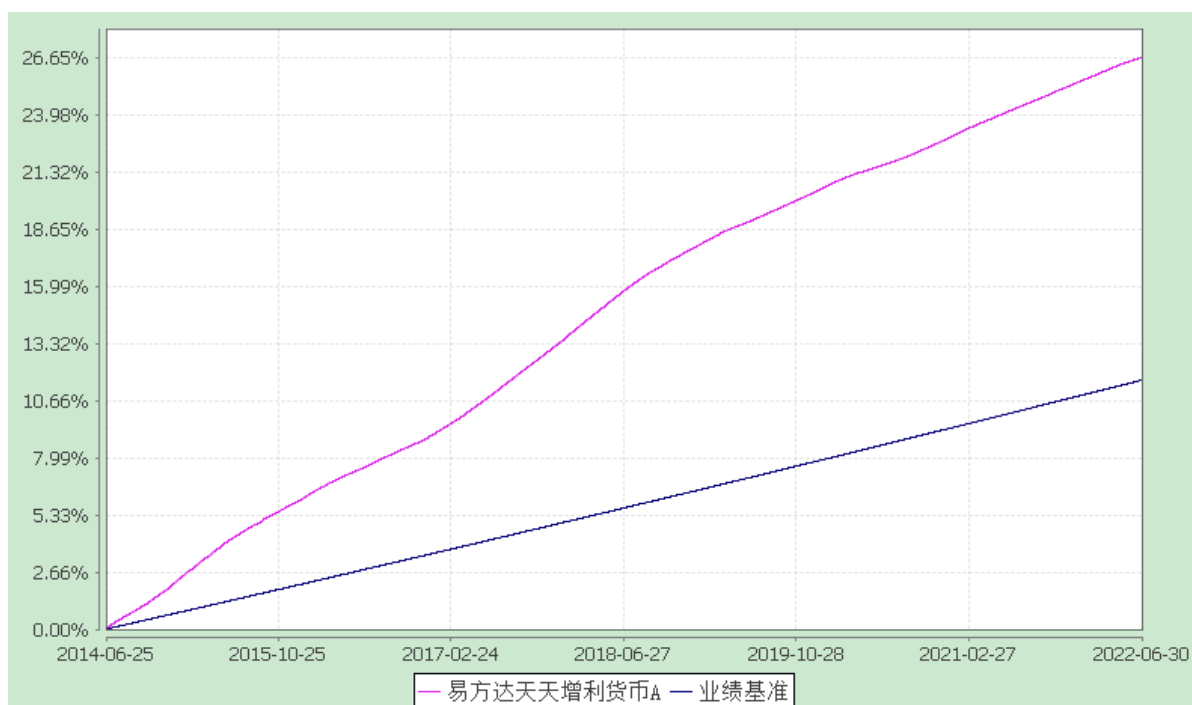
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达天天增利货币市场基金

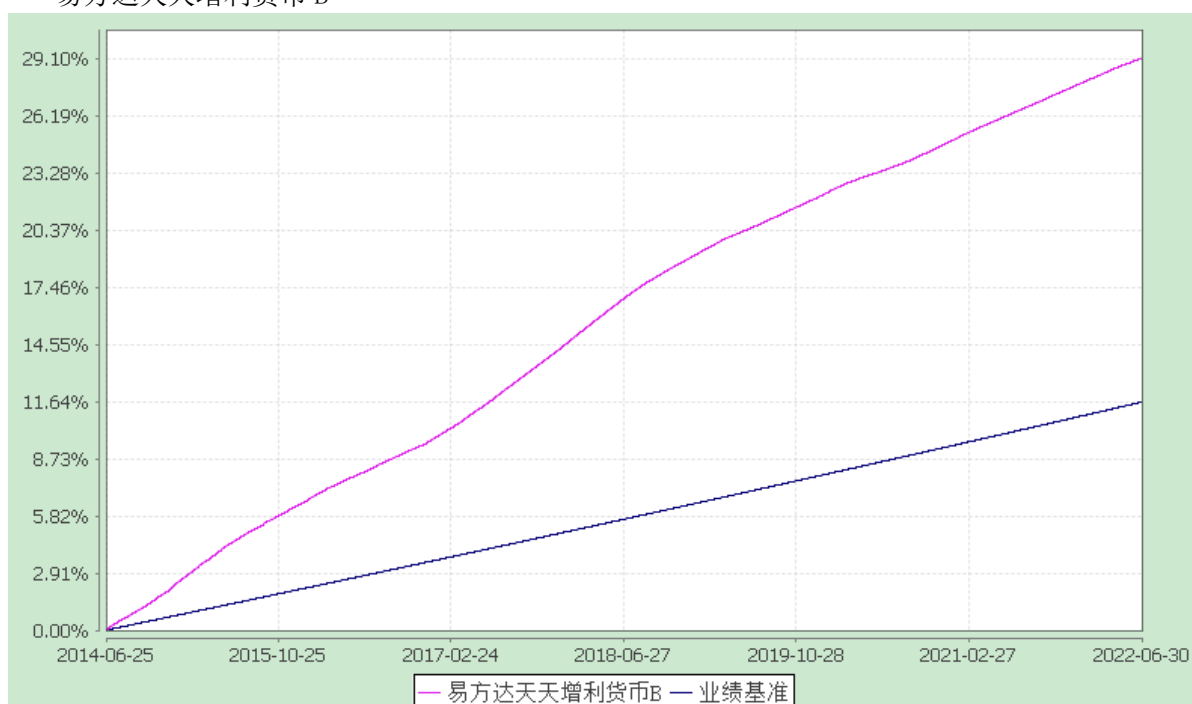
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年6月25日至2022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26.6496%，同期业绩比较基准收益率为11.6053%；B类基金份额净值收益率为29.1027%，同期业绩比较基准收益率为11.6053%。

## 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、另类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		
石大悛	本基金的基金经理，易方达天天理财货币、易方达货币、易方达保证金货币（自 2013 年 04 月 22 日至 2022 年 04 月 07 日）、易方达易理财货币、易方达现金增利货币、易方达天天发货币、易方达安瑞短债债券、易方达稳悦 120 天滚动短债的基金经理，易方达恒安定开债券发起式的基金经理助理	2014-06-25	2022-04-08	13 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，易方达月月理财债券、易方达双月理财债券、易方达财富快线货币、易方达龙宝货币、易方达掌柜季季盈理财债券的基金经理。
梁莹	本基金的基金经理，易方达增金宝货币、易方达财富快线货币、易方达龙宝货币、易方达现金增利货币、易方达保证金货币、易方达安悦超短债债券、易方达安和中短债债券、易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳丰 90 天滚动短债的基金经理，易方达天天理财货币、易方达易理财货币、易方达货币、易方达天天发货币的基金经理助理，现金管理部总经理助理	2015-03-17	-	12 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，易方达月月理财债券、易方达双月理财债券、易方达掌柜季季盈理财债券的基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。
易臻	本基金的基金经理助理，易方达天天理财货币、易方达易理财货币、易方达现金增利货币、易方达财富快线货币、易方达龙宝货币、易方达天天发货币、易方达增金宝货币、易方达货币、易方达保证金货币、易方达安悦超短债债券、易方达安和中短债债券、易方达稳鑫 30 天滚动短债、易方达稳丰 90 天滚动短债、易方达稳悦 120 天滚动短债的基金经理助理	2018-06-20	-	12 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。

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行业协会相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人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 22 次，其中 14 次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，8 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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，受国内外超预期因素影响，国内经济受到需求收缩、供给冲击、预期转弱影响，面临自 2020 年疫情以来的又一次重大考验。一方面，上半年国际环境较 2020 年更加严峻复杂，2 月底以来俄乌危机不断发酵升级，对俄实施制裁国家之多、制裁强度之大，创冷战后历史最高水平，

给全球政治、经贸、能源、金融等领域带来巨大影响。全球“滞胀”风险显著增大，国际金融市场大幅震荡，全球地缘政治格局加速分化，全球开启新一轮加息周期。另一方面，国内疫情防控难度加大，疫情持续时间较长，对经济供需两端造成较大影响。上半年我国国内生产总值（GDP）同比增长 2.5%。分季度看，一季度增长 4.8%，二季度受疫情因素影响，增长 0.4%。从拉动经济的各个分项来看，投资方面，1-6 月，全国固定资产投资同比增长 6.1%，固定资产投资增速保持较高增速，成为拉动经济增长的主要动力。消费方面，上半年社会零售总额同比下降 0.7%，同比增速在 4 月筑底。随着疫情好转，消费虽有所复苏，但预计周期较长。进出口方面，货物进出口同比增长 9.4%，其中出口增长 13.2%，进口增长 4.8%。出口增速虽略有回落，但韧性仍较强。

从债券市场的表现来看，2022 年上半年，债市长短端利率陡峭化加剧。货币市场利率总体呈现了震荡下行的走势，以 1 年期同业存单为代表的货币市场收益率从年初的 2.6% 下行至半年末的 2.3%；而长端的 10 年期国债收益率上半年基本围绕 2.8% 在波动。形成分化的原因主要包括两方面。一方面是在经济复苏阶段，货币政策与财政等稳增长政策在见效上存在时间差。货币政策能较快传导至银行体系，而银行体系传导至实体经济则需要实体融资需求的真正修复。受地缘政治、疫情反复、地产行业风险发酵等因素影响，虽然政策持续发力，但实体经济的复苏节奏仍慢于预期。这使得银行体系的流动性维持在相对充裕的水平，短端资产在供需博弈下，收益率出现了较显著的下行。另一方面，海外通胀持续攀升，外围经济体纷纷进入加息周期，中美利差持续倒挂，国内经济金融数据在稳增长政策推动下也出现边际改善，内外部因素都制约了长端利率的显著下行。

货币市场收益率在震荡下行的过程中出现过两次显著反弹。一次是春节后至 3 月底，由于 1 月份社融数据显著好于预期，市场对经济复苏产生了较强的预期，叠加年初海外加息预期抬升，1 年期同业存单收益率上行。第二次反弹是 5 月下旬开始，北京、上海疫情得到控制，同时 6 月份地方债发行提速，在资金面即将收紧和经济重回复苏的预期下，1 年期同业存单收益率反弹。

具体操作来看，报告期内基金以同业存单、同业存款、短期逆回购和政策性金融债为主要配置资产。基于对宏观经济和货币政策的判断，我们灵活调整组合中各类资产的比例和久期，在确保组合流动性安全和偏离度安全的前提下，力争更优的收益水平。总体来看，组合在上半年保持了较好的流动性和较稳定的收益率。

#### 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 0.9398%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%；B 类基金份额净值收益率为 1.0601%，同期业绩比较基准收益率为 0.6810%。

#### 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，全球经济滞胀风险上升，主要经济体政策趋向收紧，外部不确定因素增加，国内疫情影响还没有完全消除，需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力犹存。“经济反弹的持续性和恢复程度”是当前债市的核心关注点。虽然上半年部分月份的经济和金融数据在好转，尤其是 6 月份的信贷结构和消费数据都有较明显的边际改善，但受到疫情反复和房地产市场问题持续发酵的干扰，市场对经济持续向好的信心不足。目前阶段，政策仍在发力拉动经济。货币政策稳定偏松，一方面是为各项稳增长政策的执行铺垫良好的流动性环境，另一方面也是为了防范房地产行业可能引起的金融体系风险。基于此，货币政策短期内出现方向上的转变的概率相对较小。在流动性宽松，经济也没有全面复苏的阶段，债券市场在低位震荡的可能性较大。

中长期看，债券市场利率始终围绕经济发展的中枢波动。经济转好，市场活力旺盛，融资主体对利率的承受能力增强，债券市场利率将会上行。反之亦然。同时，对于同业存单所处的短端货币市场而言，资金面也是影响其走势的重要因素。目前同业存单利率处于 2020 年疫情以来的历史次低点，重要原因是银行体系流动性宽松，短端的货币市场配置需求旺盛。未来随着经济基本面的修复，实体融资需求逐渐改善，货币市场的流动性供需结构会因此发生改变，这将影响货币市场投资品种的利率走势。

基于以上逻辑，本基金将持续关注资金面、货币政策、疫情走势、以及重要政策和经济金融数据对债券市场的影响。未来我们将继续保持合理的组合久期和杠杆，坚持货币市场基金是流动性管理工具的定位，在保持组合流动性安全的前提下，把握市场的波段操作机会，尽量提高组合收益率。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。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规及《易方达天天增利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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：易方达天天增利货币市场基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,507,197,635.20	9,541,263,776.17
结算备付金		1,629,447,767.22	711,363,636.36
存出保证金		-	466.18
交易性金融资产	6.4.7.2	6,776,928,283.28	11,369,491,779.57
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,092,986,377.91	10,938,406,279.25
资产支持证券投资		683,941,905.37	431,085,500.32
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	10,350,147,733.35	6,906,111,758.27
应收清算款		146,887,550.27	48,746,991.64
应收股利		-	-
应收申购款		1,928,779.98	2,575,327.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	115,473,301.50
资产总计		26,412,537,749.30	28,695,027,037.42
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		1,595,464,434.89	2,486,796,916.45
应付清算款		1,019,699,177.97	699,394,520.58
应付赎回款		247,401.64	155,233.83
应付管理人报酬		6,514,844.40	7,325,396.17
应付托管费		987,097.62	1,109,908.53
应付销售服务费		4,467,563.27	5,520,572.48
应付投资顾问费		-	-

应交税费		149,852.86	304,297.41
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	280,085.17	917,111.71
负债合计		2,627,810,457.82	3,201,523,957.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	23,784,727,291.48	25,493,503,080.26
未分配利润	6.4.7.8	0.00	0.00
净资产合计		23,784,727,291.48	25,493,503,080.26
负债和净资产总计		26,412,537,749.30	28,695,027,037.42

注：1.报告截止日 2022 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 1.0000 元，B 类基金份额净值 1.0000 元；基金份额总额 23,784,727,291.48 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 21,549,607,972.31 份，B 类基金份额总额 2,235,119,319.17 份。

2.上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达天天增利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		302,624,069.53	336,101,252.44
1.利息收入		188,598,886.73	339,230,487.84
其中：存款利息收入	6.4.7.9	106,400,399.85	126,864,947.32
债券利息收入		-	115,042,579.36
资产支持证券利息收入		-	11,981,812.42
买入返售金融资产收入		82,198,486.88	85,341,148.74
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		114,020,117.59	-3,135,906.79
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.10	105,911,881.43	-3,135,906.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.11	8,108,236.16	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	5,065.21	6,671.39
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>83,888,470.92</b>	<b>86,135,473.29</b>
1. 管理人报酬		38,197,027.75	38,495,990.82
2. 托管费		5,787,428.49	8,739,000.07
3. 销售服务费		27,351,813.12	28,677,061.09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		12,213,933.00	9,958,513.45
其中：卖出回购金融资产支出		12,213,933.00	9,958,513.45
6. 信用减值损失	6.4.7.13	-	-
7. 税金及附加		153,702.45	83,424.90
8. 其他费用	6.4.7.14	184,566.11	181,482.96
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>218,735,598.61</b>	<b>249,965,779.15</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>218,735,598.61</b>	<b>249,965,779.15</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>218,735,598.61</b>	<b>249,965,779.15</b>

注：上表中以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达天天增利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计



一、上期期末净资产（基金净值）	25,493,503,080.26	-	-	25,493,503,080.26
二、本期期初净资产（基金净值）	25,493,503,080.26	-	-	25,493,503,080.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,708,775,788.78	-	0.00	-1,708,775,788.78
（一）、综合收益总额	-	-	218,735,598.61	218,735,598.61
（二）、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）	-1,708,775,788.78	-	-	-1,708,775,788.78
其中：1.基金申购款	171,004,483,097.80	-	-	171,004,483,097.80
2.基金赎回款	-172,713,258,886.58	-	-	-172,713,258,886.58
（三）、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）	-	-	-218,735,598.61	-218,735,598.61
四、本期期末净资产（基金净值）	23,784,727,291.48	-	0.00	23,784,727,291.48
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	19,558,790,798.73	-	-	19,558,790,798.73
二、本期期初净资产（基金净值）	19,558,790,798.73	-	-	19,558,790,798.73
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,743,700,553.85	-	0.00	6,743,700,553.85
（一）、综合收益总额	-	-	249,965,779.15	249,965,779.15
（二）、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）	6,743,700,553.85	-	-	6,743,700,553.85
其中：1.基金申购	261,472,472,434.41	-	-	261,472,472,434.41

款				34.41
2.基金赎回款	-254,728,771,880.56	-	-	-254,728,771,880.56
(三)、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)	-	-	-249,965,779.15	-249,965,779.15
四、本期期末净资产(基金净值)	26,302,491,352.58	-	0.00	26,302,491,352.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达天天增利货币市场基金(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[2014]610号《关于核准易方达天天增利货币市场基金募集的批复》注册，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《易方达天天增利货币市场基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达天天增利货币市场基金基金合同》于2014年6月25日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为202,470,332.87份基金份额，其中认购资金利息折合8,076.77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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《易方达天天增利货币市场基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金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。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的金融资产主要为债务工具，是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

###### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

###### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

###### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

##### 6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计

利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息，同时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，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.4 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。

以摊余成本计量的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则按直线法计算。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《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》及《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”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a)金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 9,541,263,776.17 元、711,363,636.36 元、466.18 元、6,906,111,758.27 元、115,473,301.50 元、48,746,991.64 元和 2,575,327.73 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返

售金融资产、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 9,592,920,822.70 元、711,418,249.96 元、466.38 元、6,910,113,810.65 元、0.00 元、48,746,991.64 元和 2,575,327.73 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,369,491,779.57 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,429,251,368.36 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,486,796,916.45 元、699,394,520.58 元、155,233.83 元、7,325,396.17 元、1,109,908.53 元、5,520,572.48 元、224,642.46 元、445,383.76 元和 1,085.49 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 2,487,242,300.21 元、699,394,520.58 元、155,233.83 元、7,325,396.17 元、1,109,908.53 元、5,520,572.48 元、224,642.46 元、0.00 元和 1,085.49 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b)修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号

《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	1,907,497.09
等于：本金	1,907,314.05

加：应计利息	183.04
定期存款	7,505,290,138.11
等于：本金	7,460,000,000.00
加：应计利息	45,290,138.11
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	7,505,290,138.11
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	7,507,197,635.20

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6,092,986,377.91	6,109,805,069.05	16,818,691.14	0.0707
	合计	6,092,986,377.91	6,109,805,069.05	16,818,691.14	0.0707
资产支持证券		683,941,905.37	684,648,305.37	706,400.00	0.0030
合计		6,776,928,283.28	6,794,453,374.42	17,525,091.14	0.0737

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	7,849,618,226.75	-
银行间市场	2,500,529,506.60	-
合计	10,350,147,733.35	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券



本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,198.02
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	152,506.39
其中：交易所市场	-
银行间市场	152,506.39
应付利息	-
预提费用	126,380.76
合计	280,085.17

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 易方达天天增利货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	25,425,654,950.33	25,425,654,950.33
本期申购	164,053,813,858.24	164,053,813,858.24
本期赎回（以“-”号填列）	-167,929,860,836.26	-167,929,860,836.26
本期末	21,549,607,972.31	21,549,607,972.31

##### 易方达天天增利货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	67,848,129.93	67,848,129.93
本期申购	6,950,669,239.56	6,950,669,239.56
本期赎回（以“-”号填列）	-4,783,398,050.32	-4,783,398,050.32
本期末	2,235,119,319.17	2,235,119,319.17

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 易方达天天增利货币 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	205,691,059.05	-	205,691,059.05
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	-205,691,059.05	-	-205,691,059.05
本期末	0.00	-	0.00

**易方达天天增利货币 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	13,044,539.56	-	13,044,539.56
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	-13,044,539.56	-	-13,044,539.56
本期末	0.00	-	0.00

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	15,927.96
定期存款利息收入	103,216,942.58
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	3,167,527.01
其他	2.30
合计	106,400,399.85

**6.4.7.10 债券投资收益****6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	118,660,873.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-12,748,991.78
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	105,911,881.43

#### 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,815,202,206.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,725,772,753.76
减：应计利息总额	102,178,444.84
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-12,748,991.78

#### 6.4.7.11 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.11.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	8,108,236.16
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	8,108,236.16

##### 6.4.7.11.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	350,268,473.20
减：卖出资产支持证券成本总额	341,836,000.00
减：应计利息总额	8,432,473.20
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

**6.4.7.12 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	5,065.21
合计	5,065.21

**6.4.7.13 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.14 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	58,019.55
信息披露费	59,507.37
银行汇划费	49,405.35
银行间账户维护费	17,033.84
其他	600.00
合计	184,566.11

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易****6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期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。

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	-	-	173,929,000.00	55.31%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券	5,810,010,000.00	1.75%	7,654,267,000.00	6.28%

#### 6.4.10.1.5 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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	38,197,027.75	38,495,990.82
其中：支付销售机构的客户维护费	18,178,612.80	18,522,316.42

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

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。

若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,787,428.49	8,739,000.07

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达天天增利货币 A	易方达天天增利货币 B	合计
易方达基金管理有限公司	107,898.04	63,448.26	171,346.30
中国建设银行	195,672.26	194.08	195,866.34
合计	303,570.30	63,642.34	367,212.64
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2021年1月1日至2021年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	易方达天天增利货币 A	易方达天天增利货币 B	合计
易方达基金管理有限公司	148,515.89	19,623.37	168,139.26
中国建设银行	247,879.80	477.80	248,357.60
合计	396,395.69	20,101.17	416,496.86

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。

两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

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

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

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。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初五个工作日内、按照指定的帐户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

销售服务费可用于本基金市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

###### 易方达天天增利货币 A

无。

###### 易方达天天增利货币 B

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	1,907,497.09	15,927.96	11,686,788.51	81,689.41

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 6.4.11 利润分配情况

## 易方达天天增利货币 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
205,691,059.05	-	-	205,691,059. 05	-

## 易方达天天增利货币 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
13,044,539.56	-	-	13,044,539.5 6	-

## 6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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	受限 期	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
13515 1	创惠 07A1	2022-0 4-29	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.36	10,000	1,000, 000.00	1,003, 590.14	-
13515 2	创惠 07A2	2022-0 4-29	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.36	20,000	2,000, 000.00	2,007, 180.27	-
13515 3	创惠 07A3	2022-0 4-29	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.37	110,00 0	11,000 ,000.0 0	11,041 ,010.4 1	-
13519 9	22 如 樾 2A	2022-0 5-26	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.21	100,00 0	10,000 ,000.0 0	10,021 ,479.4 5	-
13520 1	鹏睿 03A	2022-0 6-01	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.16	100,00 0	10,000 ,000.0 0	10,016 ,462.4 7	-
13521 5	22 瑞 链 13	2022-0 5-30	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.18	110,00 0	11,000 ,000.0 0	11,019 ,432.3 3	-



135256	起航09优	2022-06-16	1-6个月(含)	新发流通受限	100.00	100.08	110,000	11,000,000.00	11,008,944.66	-
135257	惠和17A	2022-06-15	1-6个月(含)	新发流通受限	100.00	100.09	110,000	11,000,000.00	11,010,338.19	-
135265	鹏睿04A	2022-06-16	1-6个月(含)	新发流通受限	100.00	100.08	100,000	10,000,000.00	10,008,223.56	-
135291	链融60A1	2022-06-15	1-6个月(含)	新发流通受限	100.00	100.09	110,000	11,000,000.00	11,009,692.05	-
180046	25欲晓A2	2022-06-16	1个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.08	500,000	50,000,000.00	50,039,736.99	-
180094	22成轨1A	2022-06-16	-	新发流通受限	100.00	100.08	20,000	2,000,000.00	2,001,650.85	-
180118	22ZH2A1	2022-06-20	1个月内(含)	新发流通受限	100.00	100.05	200,000	20,000,000.00	20,010,915.07	-
180153	星辰05A	2022-06-28	1-6个月(含)	新发流通受限	100.00	100.01	200,000	20,000,000.00	20,002,437.26	-
180239	悦信01优	2022-06-23	1-6个月(含)	新发流通受限	100.00	100.04	110,000	11,000,000.00	11,004,556.71	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 1,595,464,434.89 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
112206090	22 交通银行 CD090	2022-07-01	97.57	381,000	37,176,072.42
112206161	22 交通银行 CD161	2022-07-01	98.42	5,000,000	492,077,166.79
190214	19 国开 14	2022-07-01	102.33	500,000	51,165,347.94

210306	21 进出 06	2022-07-01	101.80	1,100,000	111,977,221.41
210312	21 进出 12	2022-07-01	101.64	3,500,000	355,755,655.84
220201	22 国开 01	2022-07-01	101.03	4,400,000	444,523,136.16
229908	22 贴现国债 08	2022-07-01	99.70	2,700,000	269,196,559.78
合计				17,581,000	1,761,871,160.34

注：期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部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。

##### 6.4.13.2 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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 23.31%(2021 年 12 月 31 日：39.58%)。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	151,863,132.40	30,973,283.30
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	2,644,227,239.87	5,747,106,317.93
合计	2,796,090,372.27	5,778,079,601.23

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。

#### 6.4.13.2.2 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 2022年6月30日	上年度末 2021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

#### 6.4.13.2.3 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 2022年6月30日	上年度末 2021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

#### 6.4.13.2.4 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	81,871,659.26
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	81,871,659.26

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。

#### 6.4.13.2.5 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	683,941,905.37	437,977,086.30
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	683,941,905.37	437,977,086.30

**6.4.13.2.6 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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	3,296,896,005.64	5,131,323,021.57
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	3,296,896,005.64	5,131,323,021.57

**6.4.13.3 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 2022 年 6 月 30 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约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。

**6.4.13.3.1 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。

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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,507,197,635.20	-	-	-	7,507,197,635.20
结算备付金	1,629,447,767.22	-	-	-	1,629,447,767.22
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	6,756,925,846.02	20,002,437.26	-	-	6,776,928,283.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	10,350,147,733.35	-	-	-	10,350,147,733.35
应收清算款	-	-	-	146,887,550.27	146,887,550.27
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,928,779.98	1,928,779.98
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	26,243,718,981.79	20,002,437.26	-	148,816,330.25	26,412,537,749.30
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	1,595,464,434.89	-	-	-	1,595,464,434.89
应付清算款	-	-	-	1,019,699,177.97	1,019,699,177.97
应付赎回款	-	-	-	247,401.64	247,401.64
应付管理人报酬	-	-	-	6,514,844.40	6,514,844.40
应付托管费	-	-	-	987,097.62	987,097.62
应付销售服务费	-	-	-	4,467,563.27	4,467,563.27
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	149,852.86	149,852.86
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	280,085.17	280,085.17
负债总计	1,595,464,434.89	-	-	1,032,346,022.93	2,627,810,457.82
利率敏感缺口	24,648,254,546.90	20,002,437.26	-	-883,529,692.68	23,784,727,291.48
上年度末 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	9,541,263,776.17	-	-	-	9,541,263,776.17
结算备付金	711,363,636.36	-	-	-	711,363,636.36
存出保证金	466.18	-	-	-	466.18
交易性金融资产	11,369,491,779.57	-	-	-	11,369,491,779.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,906,111,758.27	-	-	-	6,906,111,758.27

应收证券清算款	-	-	-	48,746,991.64	48,746,991.64
应收利息	-	-	-	115,473,301.50	115,473,301.50
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,575,327.73	2,575,327.73
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	28,528,231,416.55	-	-	166,795,620.87	28,695,027,037.42
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,486,796,916.45	-	-	-	2,486,796,916.45
应付证券清算款	-	-	-	699,394,520.58	699,394,520.58
应付赎回款	-	-	-	155,233.83	155,233.83
应付管理人报酬	-	-	-	7,325,396.17	7,325,396.17
应付托管费	-	-	-	1,109,908.53	1,109,908.53
应付销售服务费	-	-	-	5,520,572.48	5,520,572.48
应付交易费用	-	-	-	224,642.46	224,642.46
应交税费	-	-	-	304,297.41	304,297.41
应付利息	-	-	-	445,383.76	445,383.76
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	247,085.49	247,085.49
负债总计	2,486,796,916.45	-	-	714,727,040.71	3,201,523,957.16
利率敏感度缺口	26,041,434,500.10	-	-	-547,931,419.84	25,493,503,080.26

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.市场利率下降 25 个基点	7,937,093.21	9,277,806.21
	2.市场利率上升 25 个基点	-7,914,248.32	-9,258,380.52

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金不直接在二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购和新股增发，同时本基金不参与可转换债券投资。于本期末和上一年度末，无重大其他市场价格风险。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	6,776,928,283.28
第三层次	-
合计	6,776,928,283.28

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明



不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	6,776,928,283.28	25.66
	其中：债券	6,092,986,377.91	23.07
	资产支持证券	683,941,905.37	2.59
2	买入返售金融资产	10,350,147,733.35	39.19
	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	9,136,645,402.42	34.59
4	其他各项资产	148,816,330.25	0.56
5	合计	26,412,537,749.30	100.00

### 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.68	
	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	1,595,464,434.89	6.71
	其中：买断式回购融资	-	-

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

#### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 7.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	87
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	54

#### 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。

#### 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	55.01	10.99
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	5.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.41	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	35.24	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	110.72	10.99

#### 7.4 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。

#### 7.5 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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	269,196,559.78	1.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,175,130,601.62	4.94
	其中：政策性金融债	963,421,361.35	4.05
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,351,763,210.87	5.68
6	中期票据	-	-
7	同业存单	3,296,896,005.64	13.86
8	其他	-	-
9	合计	6,092,986,377.91	25.62
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 7.6 期末按实际利率计算账面价值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）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112206161	22 交通银行 CD161	5,000,000	492,077,166.79	2.07
2	220201	22 国开 01	4,400,000	444,523,136.16	1.87
3	210312	21 进出 12	3,500,000	355,755,655.84	1.50
4	112110347	21 兴业银行 CD347	3,000,000	298,297,845.29	1.25
5	112206090	22 交通银行 CD090	3,000,000	292,724,979.66	1.23
6	229908	22 贴现国债 08	2,700,000	269,196,559.78	1.13
7	112106294	21 交通银行 CD294	2,000,000	197,874,175.22	0.83
8	112106293	21 交通银行 CD293	2,000,000	197,815,543.06	0.83
9	112216083	22 上海银行 CD083	2,000,000	197,216,019.46	0.83
10	112106315	21 交通银行 CD315	2,000,000	197,033,834.59	0.83

#### 7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.1139%
报告期内偏离度的最低值	0.0656%

报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0884%
------------------------	---------

### 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。

### 7.8 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	180046	25 欲晓 A2	500,000	50,039,736.99	0.21
2	183853	长兴 09A2	400,000	40,153,863.01	0.17
3	136396	南链优 18	300,000	30,646,823.01	0.13
4	136889	链融 54A1	300,000	30,360,986.30	0.13
5	183460	明珠 02 优	210,000	21,204,637.81	0.09
6	136909	国链 34A1	200,000	20,205,939.73	0.08
7	136910	国链 35A1	200,000	20,203,962.74	0.08
8	136969	22 融惠 1A	200,000	20,192,394.52	0.08
9	183287	明珠 03 优	200,000	20,186,318.90	0.08
10	136987	起航 07 优	200,000	20,160,911.78	0.08

### 7.9 投资组合报告附注

#### 7.9.1 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。

**7.9.2** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，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。国家开发银行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。中国进出口银行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。兴业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福建省分局、中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。上海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上海监管局的处罚。

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。

### 7.9.3 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	应收清算款	146,887,550.27
3	应收利息	-
4	应收申购款	1,928,779.98
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	148,816,330.25

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构				
			机构投资者		个人投资者		
			持有份额	占总份	持有份额	占总份	

				额比例		额比例
易方达天天增利货币 A	3,772,036	5,712.99	135,810,287.43	0.63%	21,413,797,684.88	99.37%
易方达天天增利货币 B	31	72,100,623.20	2,232,577,121.53	99.89%	2,542,197.64	0.11%
合计	3,772,067	6,305.49	2,368,387,408.96	9.96%	21,416,339,882.52	90.04%

### 8.2 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	1,003,363,391.41	4.22%
2	保险类机构	268,212,554.61	1.13%
3	保险类机构	265,002,337.06	1.11%
4	保险类机构	204,327,370.39	0.86%
5	保险类机构	200,469,850.31	0.84%
6	其他机构	95,104,255.18	0.40%
7	其他机构	51,212,051.67	0.22%
8	其他机构	50,171,076.27	0.21%
9	保险类机构	33,043,232.16	0.14%
10	其他机构	31,102,616.65	0.13%

### 8.3 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	易方达天天增利货币 A	228,933.76	0.0011%
	易方达天天增利货币 B	0.00	0.0000%
	合计	228,933.76	0.0010%

### 8.4 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	易方达天天增利货币 A	0~10
	易方达天天增利货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	易方达天天增利货币 A	0
	易方达天天增利货币 B	0

	合计	0
--	----	---

## 9 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
基金合同生效日（2014 年 6 月 25 日）基金份额总额	2,462,332.87	200,008,000.00
本报告期期初基金份额总额	25,425,654,950.33	67,848,129.93
本报告期基金总申购份额	164,053,813,858.24	6,950,669,239.56
减：本报告期基金总赎回份额	167,929,860,836.26	4,783,398,050.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	21,549,607,972.31	2,235,119,319.17

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期，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。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-



西南证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	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安信证券股份有限公司、华创证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、申港证券股份有限公司。

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。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	5,810,010,000.00	1.75%	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	326,044,689,000.00	98.25%	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期不存在偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2022-01-01

	的公告	电子披露网站	
2	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-01-21
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证券报	2022-03-30
5	易方达天天增利货币市场基金基金经理变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-08
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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-11
7	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-04-21
8	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2022-04-22
9	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、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
10	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-05-14

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会核准易方达天天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。

### 11.2 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。

### 11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日