

易方达天天理财货币市场基金

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
5 托管人报告.....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
7 投资组合报告.....	46
7.1 期末基金资产组合情况.....	46
7.2 债券回购融资情况.....	47
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	47
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.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	49
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.....	49
报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明.....	49

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明.....	49
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	49
7.9 投资组合报告附注.....	50
8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
9 开放式基金份额变动.....	53
10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	55
10.9 其他重大事件	56
11 备查文件目录.....	56
11.1 备查文件目录.....	56
11.2 存放地点.....	57
11.3 查阅方式.....	57

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	19,146,327,395.88 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总额	9,275,073,467.78 份	4,418,110,176.67 份	3,661,602,382.80 份	1,791,541,368.63 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 $\times(1-$ 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	王玉	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.efunds.com.cn
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	93,046,028.87	45,911,585.34	32,796,013.89	16,465,556.11
本期利润	93,046,028.87	45,911,585.34	32,796,013.89	16,465,556.11
本期净值收益率	0.9565%	1.0767%	1.0817%	0.9566%
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	9,275,073,467.78	4,418,110,176.67	3,661,602,382.80	1,791,541,368.63
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	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
累计净值收益率	34.8724%	37.9221%	38.0512%	12.8614%

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
过去一个月	0.1343%	0.0003%	0.0292%	0.0000%	0.1051%	0.0003%
过去三个月	0.4423%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.3538%	0.0005%
过去六个月	0.9565%	0.0006%	0.1761%	0.0000%	0.7804%	0.0006%
过去一年	2.0080%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	1.6525%	0.0005%
过去三年	6.5885%	0.0009%	1.0712%	0.0000%	5.5173%	0.0009%
自基金合同生效起至今	34.8724%	0.0036%	3.3658%	0.0000%	31.5066%	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
过去一个月	0.1541%	0.0003%	0.0292%	0.0000%	0.1249%	0.0003%
过去三个月	0.5025%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.4140%	0.0005%
过去六个月	1.0767%	0.0006%	0.1761%	0.0000%	0.9006%	0.0006%
过去一年	2.2532%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	1.8977%	0.0005%
过去三年	7.3593%	0.0009%	1.0712%	0.0000%	6.2881%	0.0009%
自基金合同生效	37.9221%	0.0036%	3.3658%	0.0000%	34.5563%	0.0036%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

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
过去一个月	0.1549%	0.0003%	0.0292%	0.0000%	0.1257%	0.0003%
过去三个月	0.5050%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.4165%	0.0005%
过去六个月	1.0817%	0.0006%	0.1761%	0.0000%	0.9056%	0.0006%
过去一年	2.2634%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	1.9079%	0.0005%
过去三年	7.3916%	0.0009%	1.0712%	0.0000%	6.3204%	0.0009%
自基金合同生效 起至今	38.0512%	0.0036%	3.3658%	0.0000%	34.6854%	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
过去一个月	0.1343%	0.0003%	0.0292%	0.0000%	0.1051%	0.0003%
过去三个月	0.4423%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.3538%	0.0005%
过去六个月	0.9566%	0.0006%	0.1761%	0.0000%	0.7805%	0.0006%
过去一年	2.0080%	0.0005%	0.3555%	0.0000%	1.6525%	0.0005%
过去三年	6.5908%	0.0009%	1.0712%	0.0000%	5.5196%	0.0009%
自基金合同生效 起至今	12.8614%	0.0021%	1.6774%	0.0000%	11.1840%	0.0021%

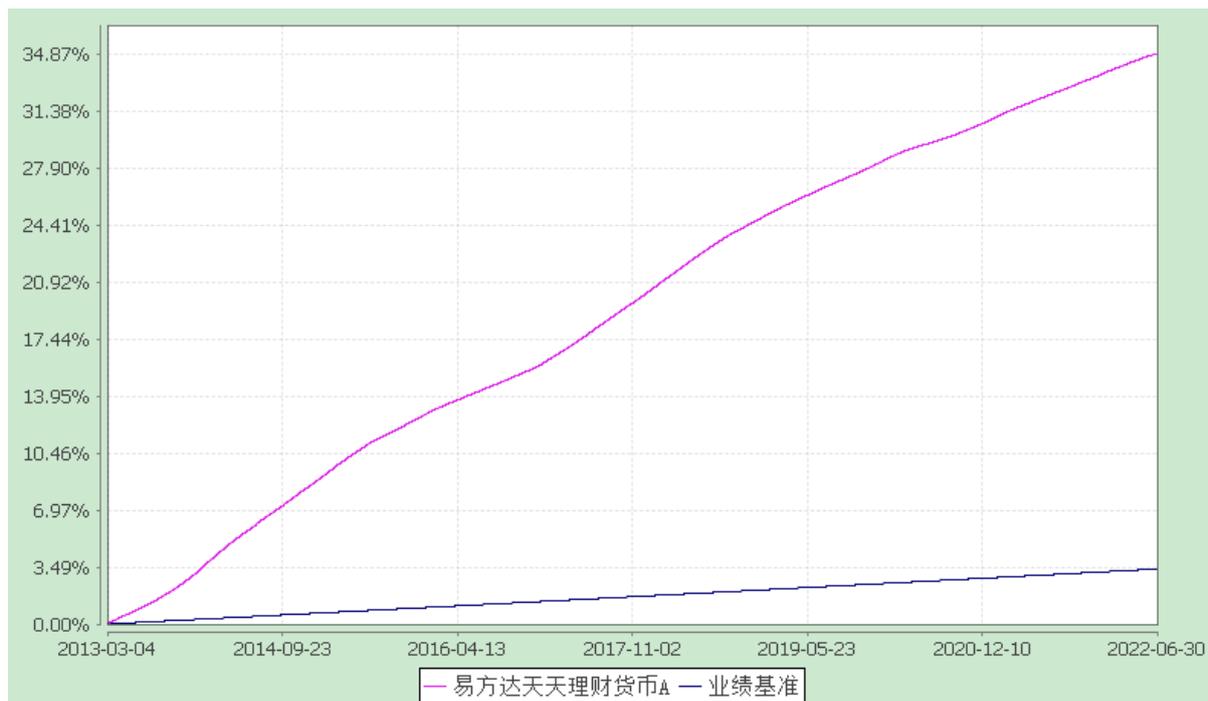
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

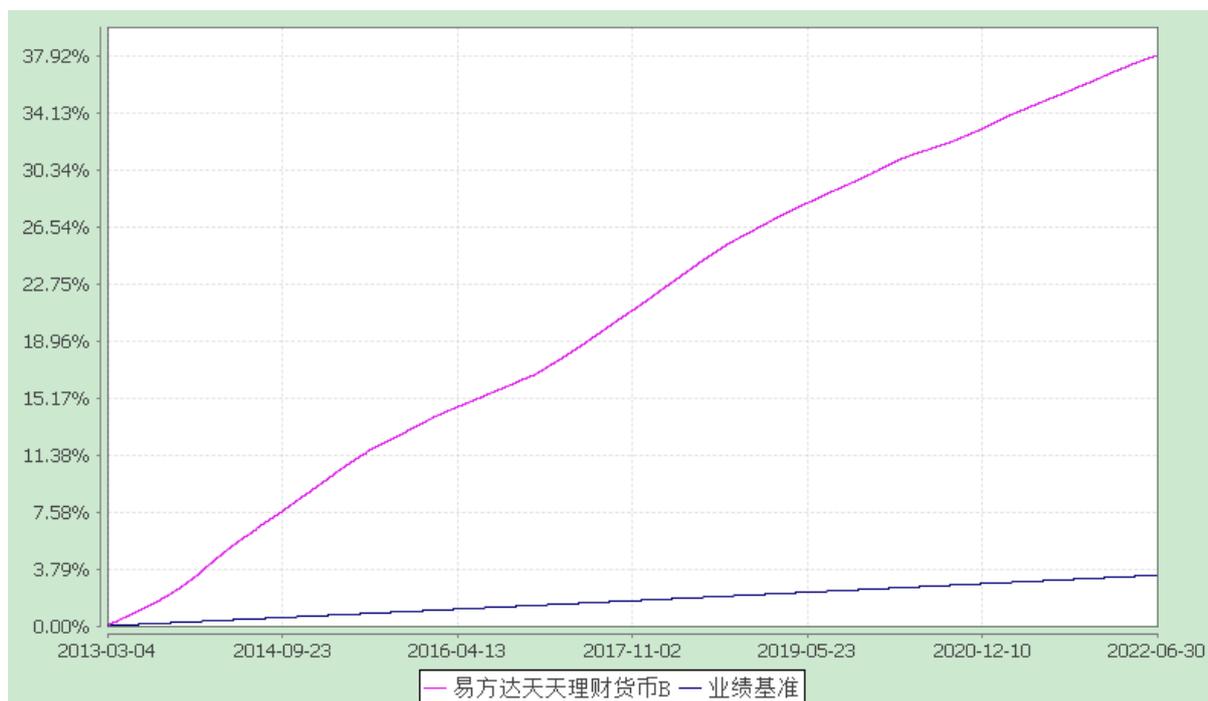
易方达天天理财货币 A

(2013 年 3 月 4 日至 2022 年 6 月 30 日)



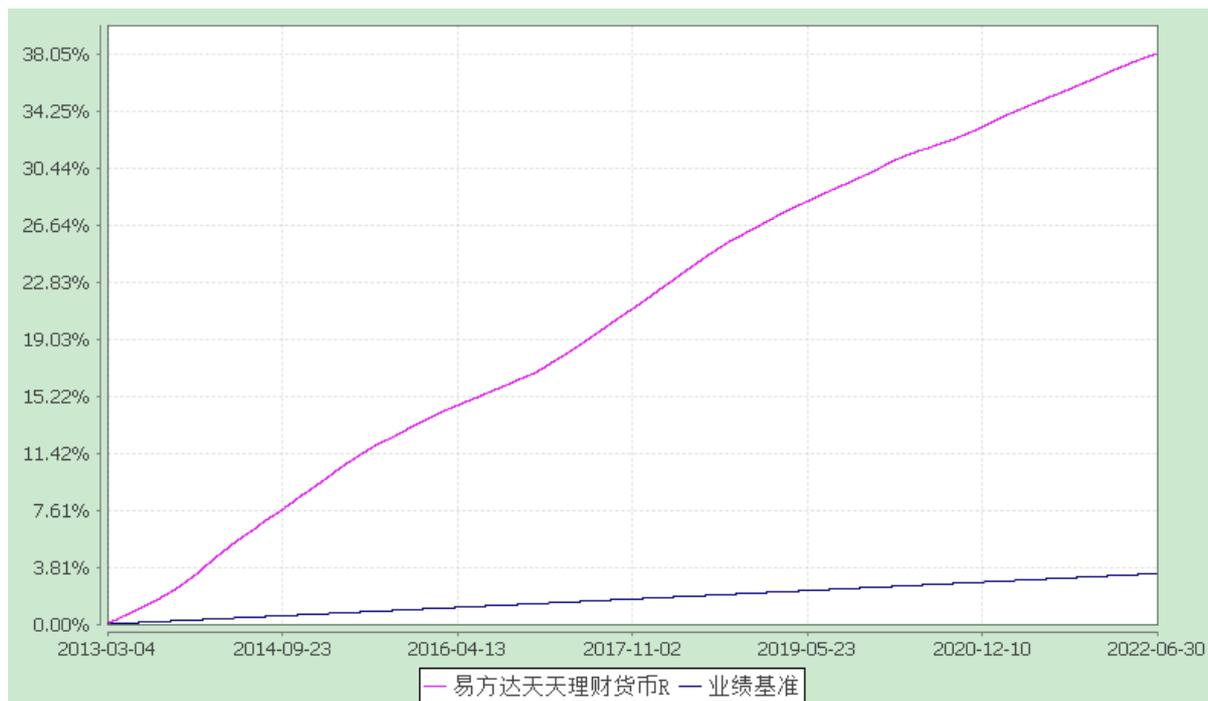
易方达天天理财货币 B

(2013 年 3 月 4 日至 2022 年 6 月 30 日)



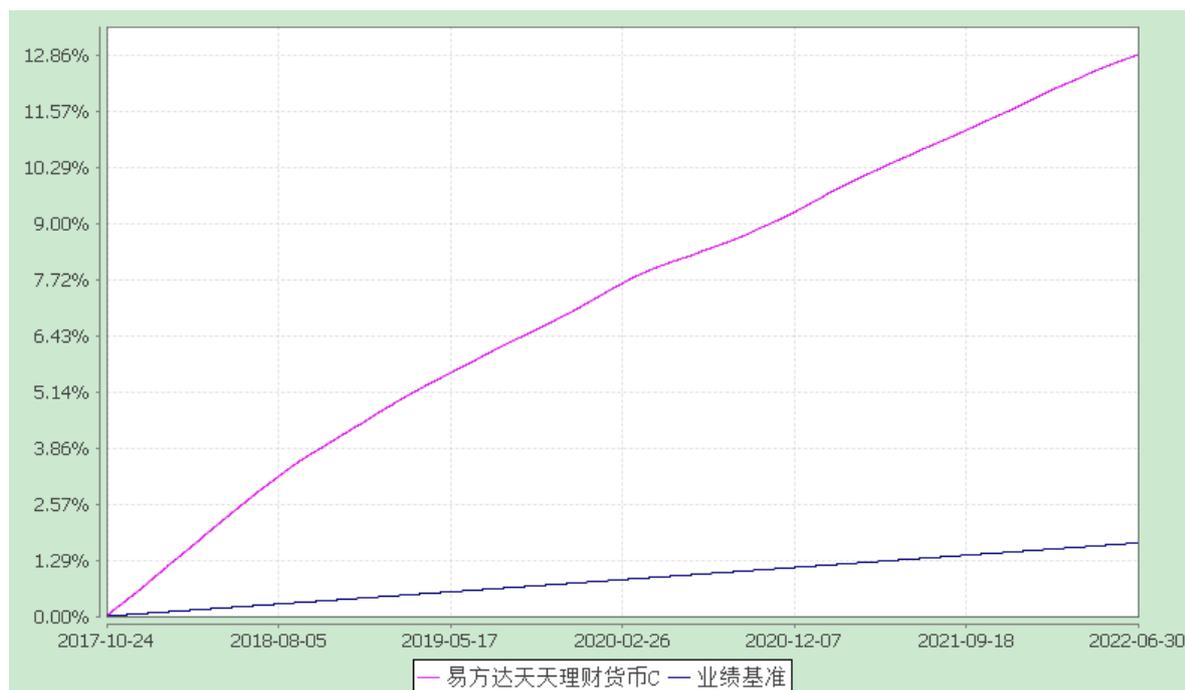
易方达天天理财货币 R

(2013 年 3 月 4 日至 2022 年 6 月 30 日)



易方达天天理财货币 C

(2017 年 10 月 24 日至 2022 年 6 月 30 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 34.8724%，同期业绩比较基准收益率为 3.3658%；B 类基金份额净值收益率为 37.9221%，同期业绩比较基准收益率为 3.3658%；R 类基金份额净值收益率为 38.0512%，同期业绩比较基准收益率为 3.3658%；C 类基金份额净值收益率为 12.8614%，同期业绩比较基准收益率为 1.6774%。

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		
石大烽	本基金的基金经理，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、易方达天天增利货币（自 2014 年 06 月 25 日至 2022 年 04 月 07 日）、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	2013-03-04	-	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，易方达月月利理财债券、易方达双月利理财债券、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。
刘朝阳	本基金的基金经理，易方达财富快线货币、易方达易理财货币、易方达安悦超短债债券、易方达中证同业存单 AAA 指数 7 天持有的基金经理，现金管理部总经理、固定收益投资决策委员会委员	2016-03-29	-	15 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，易方达基金管理有限公司投资经理。
梁莹	本基金的基金经理助理，易方达增金宝货币、易方达财富快线货币、易方达天天增利货币、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	2015-02-17	-	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，易方达月月利理财债券、易方达双月利理财债券、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。

	金管理部总经理助理				
易 臻	本基金的基金经理助理，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、易方达天天增利货币、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。

4.1.3 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

报告期内，刘朝阳曾兼任管理的 1 个私募资产管理计划于 2022 年 2 月 15 日终止。报告期末，刘朝阳没有兼任私募资产管理计划的投资经理。

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，中国经济面临较大压力。从外部来说，俄乌战争的突发，给全球的政治、经贸、能源、金融等带来巨大冲击。全球“滞胀”风险显著增大，海外开启新一轮加息周期。从内部看，国内疫情情况超预期，防控存在难度，疫情持续时间较长，对经济供需两端造成了较大影响。上半年我国国内生产总值（GDP）同比增长 2.5%。一季度增长 4.8%，二季度顶住压力仍实现了正增长 0.4%。上半年全国固定资产投资同比增长 6.1%，保持较高增速，成为拉动经济增长的主要动力。从进出口数据来看，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%。虽然出口增速有所回落，但出口韧性仍较强。受到疫情影响，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，消费有所复苏，但复苏幅度和周期预期将会较长。

上半年，财政政策逐步出台稳增长措施，货币政策保持宽松。受地缘政治、疫情反复、地产行业风险发酵等因素影响，整体需求较弱，宽信用较为艰难，经济的复苏节奏持续慢于预期。银行体系的流动性维持充裕的水平，在供需博弈下，货币市场收益率震荡下行。以 1 年期同业存单为代表，货币市场收益率从年初的 2.6% 左右下行至半年末的 2.3%。受国内稳增长的预期、海外高通胀和加息周期影响，上半年国内债券市场长端整体保持区间震荡，10 年期国债收益率基本围绕 2.8% 在波动。整体，债券市场长短端利率呈现陡峭化趋势。

上半年，随着货币市场收益率的下降，货币基金的收益率整体也有所下降。操作方面，报告期内基金以同业存单、同业存款、逆回购为主要配置资产。根据对经济政策基本面和市场供求的判断，结合基金规模变化情况，组合积极参与了市场波段操作。总体来看，组合在上半年保障了投资者的流动性需求，同时创造了稳定的投资收益率。

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 0.9565%，同期业绩比较基准收益率为 0.1761%；B 类基金份额净值收益率为 1.0767%，同期业绩比较基准收益率为 0.1761%；R 类基金份额净值收益

率为 1.0817%，同期业绩比较基准收益率为 0.1761%；C 类基金份额净值收益率为 0.9566%，同期业绩比较基准收益率为 0.1761%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外经济滞胀风险上升，主要经济体货币政策进入加息周期，国内疫情影响还没有完全消除，因此需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力犹存，国内实现经济增长预期目标有较大挑战。目前债券市场主要关注“经济反弹的持续性和恢复程度”。虽然二季度后半段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行业风险持续发酵的影响，市场对经济持续向好的信心不足。短期内，为了托底经济和防范风险，货币政策将会保持宽松，债券市场低位震荡概率更大。中长期看，债券市场利率始终是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，债券市场利率就会出现上行。

本基金将持续关注经济基本面、货币政策的变化，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，积极把握市场的波段操作机会，保持合理资产配置，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。

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

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：易方达天天理财货币市场基金

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	3,876,522,436.22	5,337,012,680.00
结算备付金		95,923,686.01	67,877,681.82
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	10,936,280,128.58	9,607,822,320.82
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		10,085,367,459.99	9,515,146,425.60
资产支持证券投资		850,912,668.59	92,675,895.22
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	6,870,351,413.51	3,420,735,177.52
应收清算款		221,451,301.38	549,398,842.45
应收股利		-	-
应收申购款		112,606,753.59	131,375,200.55
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	35,644,686.56
资产总计		22,113,135,719.29	19,149,866,589.72
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		2,665,357,856.30	1,760,996,438.50
应付清算款		220,679,945.20	499,397,808.19
应付赎回款		70,741,583.40	77,145,774.58
应付管理人报酬		5,495,087.09	4,843,697.82
应付托管费		1,665,177.90	1,467,787.25
应付销售服务费		2,349,464.06	2,381,137.04
应付投资顾问费		-	-
应交税费		78,544.84	136,798.39
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	440,664.62	872,085.93
负债合计		2,966,808,323.41	2,347,241,527.70
净资产：			

实收基金	6.4.7.7	19,146,327,395.88	16,802,625,062.02
未分配利润	6.4.7.8	0.00	0.00
净资产合计		19,146,327,395.88	16,802,625,062.02
负债和净资产总计		22,113,135,719.29	19,149,866,589.72

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，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 19,146,327,395.88 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 9,275,073,467.78 份，B 类基金份额总额 4,418,110,176.67 份，R 类基金份额总额 3,661,602,382.80 份，C 类基金份额总额 1,791,541,368.63 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：易方达天天理财货币市场基金

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
一、营业总收入		256,404,181.38	362,247,854.09
1.利息收入		132,411,443.04	366,017,531.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	76,056,365.96	92,182,686.65
债券利息收入		-	168,170,374.73
资产支持证券利息收入		-	12,461,256.65
买入返售金融资产收入		56,355,077.08	93,203,213.61
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		123,987,360.50	-3,774,428.09
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	118,805,063.46	-3,774,428.09
资产支持证券投资收益	6.4.7.11	5,182,297.04	-
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	5,377.84	4,750.54
减：二、营业总支出		68,184,997.17	83,847,737.53
1. 管理人报酬		30,979,879.49	39,403,502.27
2. 托管费		9,387,842.30	11,940,455.28
3. 销售服务费		14,479,947.91	16,582,608.75
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		13,130,490.69	15,665,881.50
其中：卖出回购金融资产支出		13,130,490.69	15,665,881.50
6. 信用减值损失	6.4.7.13	-	-
7. 税金及附加		24,693.97	63,497.37
8. 其他费用	6.4.7.14	182,142.81	191,792.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		188,219,184.21	278,400,116.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		188,219,184.21	278,400,116.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		188,219,184.21	278,400,116.56

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：易方达天天理财货币市场基金

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）	16,802,625,062.02	-	-	16,802,625,062.02
二、本期期初净资产（基金净值）	16,802,625,062.02	-	-	16,802,625,062.02
三、本期增减变动	2,343,702,333.86	-	0.00	2,343,702,333.86

额（减少以“-”号填列）				86
（一）、综合收益总额	-	-	188,219,184.21	188,219,184.21
（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）	2,343,702,333.86	-	-	2,343,702,333.86
其中：1.基金申购款	27,526,926,348.12	-	-	27,526,926,348.12
2.基金赎回款	-25,183,224,014.26	-	-	-25,183,224,014.26
（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）	-	-	-188,219,184.21	-188,219,184.21
四、本期期末净资产（基金净值）	19,146,327,395.88	-	0.00	19,146,327,395.88
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）	24,326,515,129.52	-	-	24,326,515,129.52
二、本期期初净资产（基金净值）	24,326,515,129.52	-	-	24,326,515,129.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,189,445,593.93	-	0.00	-4,189,445,593.93
（一）、综合收益总额	-	-	278,400,116.56	278,400,116.56
（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）	-4,189,445,593.93	-	-	-4,189,445,593.93
其中：1.基金申购款	41,119,586,529.26	-	-	41,119,586,529.26
2.基金赎回款	-45,309,032,123.19	-	-	-45,309,032,123.19
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-278,400,116.56	-278,400,116.56

配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产（基金净值）	20,137,069,535.59	-	0.00	20,137,069,535.59

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。

6.4.2 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（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本基金的金融资产于初始确认时根据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、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

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

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。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信

用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.3 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损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资产支持证券投资的收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 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。

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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 5,337,012,680.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 21,493,015.83 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账

面价值为人民币 5,358,505,695.83 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 67,877,681.82 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 30,545.00 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 67,908,226.82 元。

买入返售金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,420,735,177.52 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 1,070,501.79 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，买入返售金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,421,805,679.31 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 35,644,686.56 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 21,493,015.83 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 30,545.00 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 13,050,623.94 元，转出至买入返售金融资产的重分类金额为人民币 1,070,501.79 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,607,822,320.82 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 13,050,623.94 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 9,620,872,944.76 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,760,996,438.50 元，自应付利息转入的重分类金额为人民币 481,034.85 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,761,477,473.35 元。

应付利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 481,034.85 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币 481,034.85 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

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

(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。

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	2,912,131.16
等于：本金	2,911,966.79
加：应计利息	164.37
定期存款	3,873,610,305.06
等于：本金	3,840,000,000.00
加：应计利息	33,610,305.06
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	3,873,610,305.06
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

合计	3,876,522,436.22
----	------------------

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	10,085,367,459.99	10,101,963,615.89	16,596,155.90	0.0867
	合计	10,085,367,459.99	10,101,963,615.89	16,596,155.90	0.0867
资产支持证券		850,912,668.59	851,503,114.65	590,446.06	0.0031
合计		10,936,280,128.58	10,953,466,730.54	17,186,601.96	0.0898

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	3,924,446,926.57	-
银行间市场	2,945,904,486.94	-
合计	6,870,351,413.51	-

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	27,345.54
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	169,865.09
其中：交易所市场	-
银行间市场	169,865.09
应付利息	-
预提费用	243,453.99
合计	440,664.62

6.4.7.7 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 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	9,602,952,782.79	9,602,952,782.79
本期申购	11,620,771,744.65	11,620,771,744.65
本期赎回（以“-”号填列）	-11,948,651,059.66	-11,948,651,059.66
本期末	9,275,073,467.78	9,275,073,467.78

易方达天天理财货币 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	3,652,950,378.64	3,652,950,378.64
本期申购	3,509,917,626.32	3,509,917,626.32
本期赎回（以“-”号填列）	-2,744,757,828.29	-2,744,757,828.29
本期末	4,418,110,176.67	4,418,110,176.67

易方达天天理财货币 R

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	2,040,933,003.19	2,040,933,003.19
本期申购	4,500,357,875.96	4,500,357,875.96
本期赎回（以“-”号填列）	-2,879,688,496.35	-2,879,688,496.35
本期末	3,661,602,382.80	3,661,602,382.80

易方达天天理财货币 C

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	1,505,788,897.40	1,505,788,897.40

本期申购	7,895,879,101.19	7,895,879,101.19
本期赎回（以“-”号填列）	-7,610,126,629.96	-7,610,126,629.96
本期末	1,791,541,368.63	1,791,541,368.63

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	93,046,028.87	-	93,046,028.87
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	-93,046,028.87	-	-93,046,028.87
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	45,911,585.34	-	45,911,585.34
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-45,911,585.34	-	-45,911,585.34
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	32,796,013.89	-	32,796,013.89
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	-32,796,013.89	-	-32,796,013.89
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	16,465,556.11	-	16,465,556.11
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-16,465,556.11	-	-16,465,556.11
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	25,884.08
定期存款利息收入	75,197,117.30
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	833,364.58
其他	-
合计	76,056,365.96

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	118,378,077.64
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	426,985.82
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	118,805,063.46

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	14,723,050,065.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	14,707,413,079.82

减：应计利息总额	15,210,000.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	426,985.82

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	5,182,297.04
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	5,182,297.04

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	94,491,068.70
减：卖出资产支持证券成本总额	92,649,000.00
减：应计利息总额	1,842,068.70
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	5,377.84
合计	5,377.84

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	55,092.78
信息披露费	59,507.37
银行汇划费	47,942.19
银行间账户维护费	17,853.84
其他	1,746.63
合计	182,142.81

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
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

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。

6.4.10.1.4 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。

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	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管理费	30,979,879.49	39,403,502.27
其中：支付销售机构的客户维护费	7,149,091.88	7,748,209.50

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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	9,387,842.30	11,940,455.28

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。

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	1,361,403.64	190,593.56	-	-	1,551,997.20
中国工商银行	1,278,055.45	3,480.34	-	-	1,281,535.79
广发证券	10,380.00	338.25	-	-	10,718.25
合计	2,649,839.09	194,412.15	-	-	2,844,251.24
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	1,993,825.99	392,170.37	-	-	2,385,996.36
中国工商银行	1,391,324.23	4,256.84	-	-	1,395,581.07
广发证券	9,773.59	-	-	-	9,773.59
合计	3,394,923.81	396,427.21	-	-	3,791,351.02

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。

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年6月30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	50,366,489.04	-	-	-	33,423,550.00	1,953,982.55
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30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	-	199,691,750.00	501,980,000.00	1,119,848.95	7,353,150,000.00	538,539.59

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

份额单位：份

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			
	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	-	372,301,837.90	-	-	-	292,622,340.64	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	4,016,009.33	-	-	-	926,495,176.96	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-	-	-	800,000,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	376,317,847.23	-	-	-	419,117,517.60	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	8.5176%	-	-	-	7.9475%	-	-

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。

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

易方达天天理财货币 A

无。

易方达天天理财货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	34,928,640.53	0.7906%	52,127,429.46	1.4270%
广发证券股份有限 公司	200,818,816.03	4.5454%	-	-

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。

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
中国工商银行-活 期存款	2,912,131.16	25,884.08	2,006,875.64	83,160.76

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。

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
93,046,028.87	-	-	93,046,028.8 7	-

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
45,911,585.34	-	-	45,911,585.3 4	-

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
32,796,013.89	-	-	32,796,013.8 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
16,465,556.11	-	-	16,465,556.1 1	-

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	20,000	2,000, 000.00	2,007, 180.27	-
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	-
13524 8	恒煦 08A1	2022-0 6-09	1-6 个 月	新发 流通	100.00	100.12	420,00 0	42,000 ,000.0	42,051 ,228.4	-

			(含)	受限				0	9	
13525 6	起航 09 优	2022-0 6-16	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.08	110,00 0	11,000 ,000.0 0	11,008 ,944.6 6	-
13525 7	惠和 17A	2022-0 6-15	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.09	100,00 0	10,000 ,000.0 0	10,009 ,398.3 6	-
13526 5	鹏睿 04A	2022-0 6-16	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.08	100,00 0	10,000 ,000.0 0	10,008 ,223.5 6	-
13529 1	链融 60A1	2022-0 6-15	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.09	10,000	1,000, 000.00	1,000, 881.10	-
18003 1	蒙牛 4 优	2022-0 6-07	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.11	400,00 0	40,000 ,000.0 0	40,044 ,186.3 0	-
18004 6	25 欲 晓 A2	2022-0 6-16	1 个月 内 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.08	610,00 0	61,000 ,000.0 0	61,048 ,479.1 2	-
18019 0	中公 07A1	2022-0 6-23	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.04	30,000	3,000, 000.00	3,001, 123.07	-
18023 9	悦信 01 优	2022-0 6-23	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.04	10,000	1,000, 000.00	1,000, 414.25	-
18390 9	至信 1 优	2022-0 5-24	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.21	320,00 0	32,000 ,000.0 0	32,066 ,693.2 6	-
18397 0	至信 2 优	2022-0 5-31	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.17	230,00 0	23,000 ,000.0 0	23,038 ,564.3 8	-
19328 3	至诚 11A	2022-0 5-17	1-6 个 月 (含)	新发 流通 受限	100.00	100.25	200,00 0	20,000 ,000.0 0	20,050 ,147.9 5	-

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 2,665,357,856.30 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
112105201	21 建设银行 CD201	2022-07-01	99.29	1,472,000	146,150,311.71
112109237	21 浦发银行 CD237	2022-07-01	99.74	5,000,000	498,713,000.88
112205093	22 建设银行 CD093	2022-07-01	97.78	2,874,000	281,014,798.98
112205094	22 建设银行 CD094	2022-07-01	98.43	2,000,000	196,854,239.78
112209118	22 浦发银行 CD118	2022-07-01	97.75	3,000,000	293,255,287.55
112217046	22 光大银行 CD046	2022-07-01	97.98	3,000,000	293,954,857.98
112217133	22 光大银行 CD133	2022-07-01	97.76	2,000,000	195,522,057.34
2203676	22 进出 676	2022-07-01	99.77	2,000,000	199,542,971.36
2203677	22 进出 677	2022-07-01	99.74	1,000,000	99,741,363.43
229908	22 贴现国债 08	2022-07-01	99.72	2,000,000	199,438,106.41
229915	22 贴现国债 15	2022-07-01	99.92	800,000	79,933,303.93
229916	22 贴现国债 16	2022-07-01	99.88	300,000	29,964,263.04
229918	22 贴现国债 18	2022-07-01	99.81	1,800,000	179,656,627.94
229923	22 贴现国债 23	2022-07-01	99.76	1,000,000	99,755,319.62
229926	22 贴现国债 26	2022-07-01	99.65	1,000,000	99,650,974.96
合计				29,246,000	2,893,147,484.91

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、低风险的品种，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 51.96%(2021 年 12 月 31 日：52.08%)。

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	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	2,102,561,082.23	870,903,913.87
合计	2,102,561,082.23	870,903,913.87

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	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。

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	850,912,668.59	94,355,872.59
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	850,912,668.59	94,355,872.59

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	7,982,806,377.76	8,655,613,158.30
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	7,982,806,377.76	8,655,613,158.30

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。

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	3,876,522,436.22	-	-	-	3,876,522,436.22
结算备付金	95,923,686.01	-	-	-	95,923,686.01
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	10,936,280,128.58	-	-	-	10,936,280,128.58
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	6,870,351,413.51	-	-	-	6,870,351,413.51
应收清算款	-	-	-	221,451,301.38	221,451,301.38
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	112,606,753.59	112,606,753.59
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	21,779,077,664.32	-	-	334,058,054.97	22,113,135,719.29
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	2,665,357,856.30	-	-	-	2,665,357,856.30
应付清算款	-	-	-	220,679,945.20	220,679,945.20
应付赎回款	-	-	-	70,741,583.40	70,741,583.40
应付管理人报酬	-	-	-	5,495,087.09	5,495,087.09
应付托管费	-	-	-	1,665,177.90	1,665,177.90
应付销售服务费	-	-	-	2,349,464.06	2,349,464.06
应付投资顾	-	-	-	-	-

问费					
应交税费	-	-	-	78,544.84	78,544.84
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税 负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	440,664.62	440,664.62
负债总计	2,665,357,856.30	-	-	301,450,467.11	2,966,808,323.41
利率敏感度 缺口	19,113,719,808.02	-	-	32,607,587.86	19,146,327,395.88
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	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

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	13,893,437.89	8,699,894.32
2.市场利率上升25个基点	-13,845,898.74	-8,680,465.35	

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。

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	10,936,280,128.58
第三层次	-
合计	10,936,280,128.58

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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	10,936,280,128.58	49.46
	其中：债券	10,085,367,459.99	45.61

	资产支持证券	850,912,668.59	3.85
2	买入返售金融资产	6,870,351,413.51	31.07
	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	3,972,446,122.23	17.96
4	其他各项资产	334,058,054.97	1.51
5	合计	22,113,135,719.29	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	7.20	
	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	2,665,357,856.30	13.92
	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	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	118
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	80

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	46.29	15.07
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.64	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	8.14	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	10.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	39.49	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
合计		114.67	15.07

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	688,398,595.90	3.60
2	央行票据	-	-
3	金融债券	399,463,589.41	2.09
	其中：政策性金融债	299,284,334.79	1.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,014,698,896.92	5.30
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,982,806,377.76	41.69
8	其他	-	-
9	合计	10,085,367,459.99	52.68

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	112203035	22 农业银行 CD035	10,000,000	980,577,624.40	5.12
2	112109237	21 浦发银行 CD237	5,000,000	498,713,000.88	2.60
3	112103114	21 农业银行 CD114	3,000,000	298,945,893.00	1.56
4	112108155	21 中信银行 CD155	3,000,000	297,780,859.94	1.56
5	112216015	22 上海银行 CD015	3,000,000	297,600,020.82	1.55
6	112108168	21 中信银行 CD168	3,000,000	295,857,648.23	1.55
7	112208030	22 中信银行 CD030	3,000,000	294,586,415.06	1.54
8	112212030	22 北京银行 CD030	3,000,000	294,399,145.53	1.54
9	112217046	22 光大银行 CD046	3,000,000	293,954,857.98	1.54
10	112204021	22 中国银行 CD021	3,000,000	293,667,989.03	1.53

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	0.1015%
报告期内偏离度的最低值	0.0336%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0663%

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	189766	明远 01A2	700,000	70,978,986.03	0.37
2	180046	25 欲晓 A2	610,000	61,048,479.12	0.32
3	189455	致远 09A2	560,000	56,777,126.58	0.30
4	135248	恒煦 08A1	420,000	42,051,228.49	0.22
5	180031	蒙牛 4 优	400,000	40,044,186.30	0.21
6	193284	至诚 10A	330,000	33,268,484.38	0.17
7	183909	至信 1 优	320,000	32,066,693.26	0.17
8	189767	明远 01A3	300,000	30,531,992.37	0.16
9	183970	至信 2 优	230,000	23,038,564.38	0.12
10	135163	行知优 01	220,000	22,056,850.41	0.12

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，中国农业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。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、中国银行保险监督管理委员会上海监管局的处罚。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。中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会苏州监管分局的处罚。中国光大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北京外汇管理部、中国银行保险监督管理委员会、中国银行保险监督管理委员会北京监管局的处罚。北京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北京监管局的处罚。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。

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	221,451,301.38
3	应收利息	-
4	应收申购款	112,606,753.59
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	334,058,054.97

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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
易方达天天理财 货币 A	3,042,795	3,048.21	544,002,581.44	5.87%	8,731,070,886.34	94.13%
易方达天天理财 货币 B	230	19,209,174.68	4,133,448,467.10	93.56%	284,661,709.57	6.44%
易方达天天理财 货币 R	482	7,596,685.44	3,661,602,382.80	100.00%	0.00	0.00%

易方达天天理财 货币 C	105,726	16,945.14	0.00	0.00%	1,791,541,368. 63	100.00 %
合计	3,149,233	6,079.68	8,339,053,431. 34	43.55%	10,807,273,964 .54	56.45%

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	761,771,011.19	3.98%
2	基金类机构	376,337,535.83	1.97%
3	银行类机构	314,406,717.60	1.64%
4	保险类机构	275,958,722.23	1.44%
5	保险类机构	230,984,581.18	1.21%
6	银行类机构	201,605,725.48	1.05%
7	银行类机构	201,230,804.13	1.05%
8	银行类机构	200,840,640.49	1.05%
9	券商类机构	200,829,322.69	1.05%
10	保险类机构	198,046,113.69	1.03%

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	易方达天天理财货币 A	11,900,061.61	0.1283%
	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	10.64	0.0000%
	合计	11,900,072.25	0.0622%

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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达天天理财货币 A	易方达天天理财货币 B	易方达天天理财货币 R	易方达天天理财货币 C
基金合同生效日（2013 年 3 月 4 日）基金份额总额	3,017,838,433.09	841,741,198.56	600,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	9,602,952,782.79	3,652,950,378.64	2,040,933,003.19	1,505,788,897.40
本报告期基金总申购份额	11,620,771,744.65	3,509,917,626.32	4,500,357,875.96	7,895,879,101.19
减：本报告期基金总赎回份额	11,948,651,059.66	2,744,757,828.29	2,879,688,496.35	7,610,126,629.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	9,275,073,467.78	4,418,110,176.67	3,661,602,382.80	1,791,541,368.63

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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	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	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	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西南证券股份有限公司。

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、个股分析的报告及丰富全面的信息;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	176,353,840.00	100.00%	111,883,340,000.00	87.53%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	14,349,059,000.00	11.23%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	1,592,084,000.00	1.25%	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	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	2022-01-07
3	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第四季度报告提示性公告	上海证券报	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	上海证券报	2022-03-30
5	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	2022-04-11
6	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	2022-04-21
7	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告提示性公告	上海证券报	2022-04-22
8	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	2022-05-13
9	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变更的公告	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	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。

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