

# 易方达天天增利货币市场基金

## 2025 年中期报告

2025 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：二〇二五年八月三十日

## § 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 2025 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 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              | 11 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望              | 11 |
| 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                  | 12 |
| 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        | 12 |
| § 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）                      | 13 |
| 6.1 资产负债表                                | 13 |
| 6.2 利润表                                  | 14 |
| 6.3 净资产变动表                               | 15 |
| 6.4 报表附注                                 | 17 |
| § 7 投资组合报告                               | 37 |
| 7.1 期末基金资产组合情况                           | 37 |
| 7.2 债券回购融资情况                             | 37 |
| 7.3 基金投资组合平均剩余期限                         | 38 |
| 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          | 38 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                     | 39 |
| 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 | 39 |
| 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       | 39 |
| 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   | 40 |
| 7.9 投资组合报告附注                             | 40 |
| § 8 基金份额持有人信息                            | 41 |

|      |                                    |    |
|------|------------------------------------|----|
| 8.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....            | 41 |
| 8.2  | 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....           | 41 |
| 8.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....         | 42 |
| 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情况 ..... | 42 |
| § 9  | 开放式基金份额变动 .....                    | 42 |
| § 10 | 重大事件揭示 .....                       | 42 |
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                  | 42 |
| 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 .....  | 42 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....       | 43 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变 .....                    | 43 |
| 10.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....             | 43 |
| 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 .....     | 43 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....            | 43 |
| 10.8 | 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....             | 46 |
| 10.9 | 其他重大事件 .....                       | 46 |
| § 11 | 备查文件目录 .....                       | 47 |
| 11.1 | 备查文件目录 .....                       | 47 |
| 11.2 | 存放地点 .....                         | 47 |
| 11.3 | 查阅方式 .....                         | 47 |

## § 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      | 37,229,997,267.36 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 | 37,118,881,678.29 份 | 111,115,589.07 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<br>负责人 | 姓名   | 王玉                      | 王小飞                    |
|             | 联系电话 | 020-85102688            | 021-60637103           |
|             | 电子邮箱 | service@efunds.com.cn   | wangxiaofei.zh@ccb.com |
| 客户服务电话      |      | 400 881 8088            | 021-60637228           |
| 传真          |      | 020-38798812            | 021-60635778           |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区荣粤道<br>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；<br>广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层 | 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼 |
| 邮政编码  | 510620；519031                                         | 100033            |
| 法定代表人 | 吴欣荣                                                   | 张金良               |

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 | www.efunds.com.cn |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人的办公地址        |

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；广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层 |

§ 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（2025 年 1 月 1 日至 2025 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       | 236,978,317.16                       | 1,462,211.81   |
| 本期利润          | 236,978,317.16                       | 1,462,211.81   |
| 本期净值收益率       | 0.6486%                              | 0.7682%        |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 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      | 37,118,881,678.29                    | 111,115,589.07 |
| 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(2025 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       | 33.0227%                             | 36.5781%       |

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<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③      | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月          | 0.0996%      | 0.0003%             | 0.1126%        | 0.0000%               | -0.0130% | 0.0003% |
| 过去三个月          | 0.3048%      | 0.0002%             | 0.3418%        | 0.0000%               | -0.0370% | 0.0002% |
| 过去六个月          | 0.6486%      | 0.0004%             | 0.6810%        | 0.0000%               | -0.0324% | 0.0004% |
| 过去一年           | 1.3604%      | 0.0004%             | 1.3781%        | 0.0000%               | -0.0177% | 0.0004% |
| 过去三年           | 5.0321%      | 0.0008%             | 4.1955%        | 0.0000%               | 0.8366%  | 0.0008% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 33.0227%     | 0.0033%             | 16.2877%       | 0.0000%               | 16.7350% | 0.0033% |

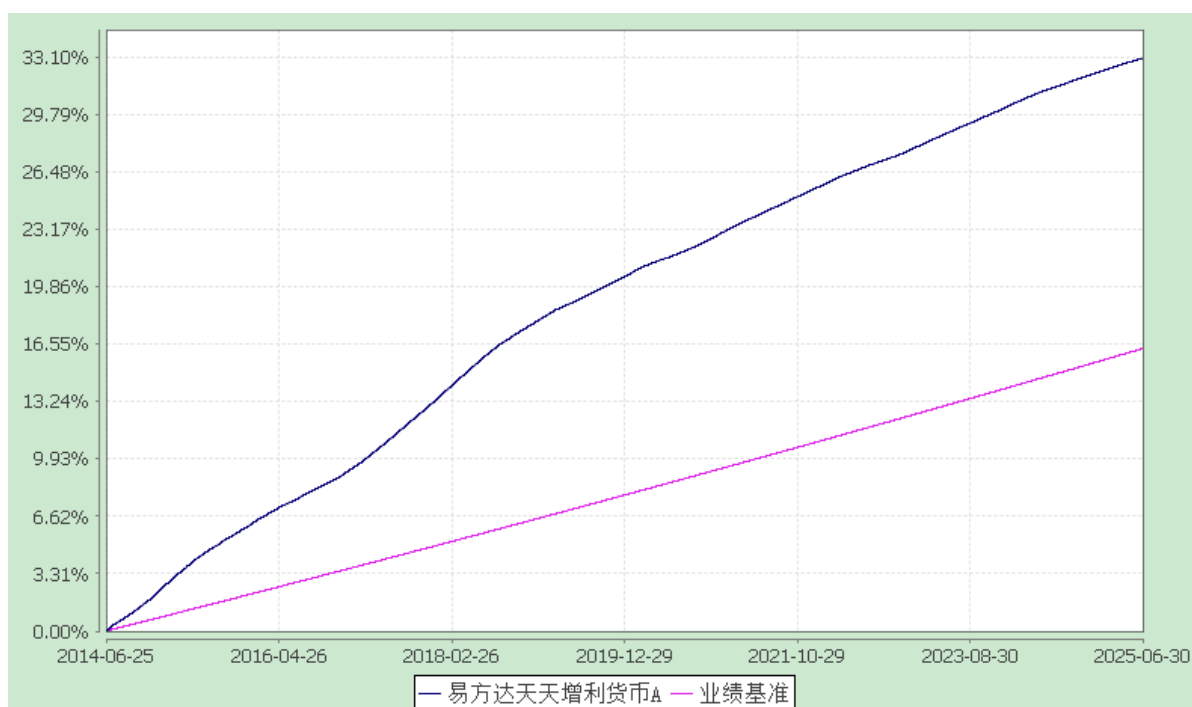
易方达天天增利货币 B

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③      | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去一个月          | 0.1194%      | 0.0003%             | 0.1126%        | 0.0000%               | 0.0068%  | 0.0003% |
| 过去三个月          | 0.3647%      | 0.0002%             | 0.3418%        | 0.0000%               | 0.0229%  | 0.0002% |
| 过去六个月          | 0.7682%      | 0.0004%             | 0.6810%        | 0.0000%               | 0.0872%  | 0.0004% |
| 过去一年           | 1.6034%      | 0.0004%             | 1.3781%        | 0.0000%               | 0.2253%  | 0.0004% |
| 过去三年           | 5.7902%      | 0.0008%             | 4.1955%        | 0.0000%               | 1.5947%  | 0.0008% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 36.5781%     | 0.0033%             | 16.2877%       | 0.0000%               | 20.2904% | 0.0033% |

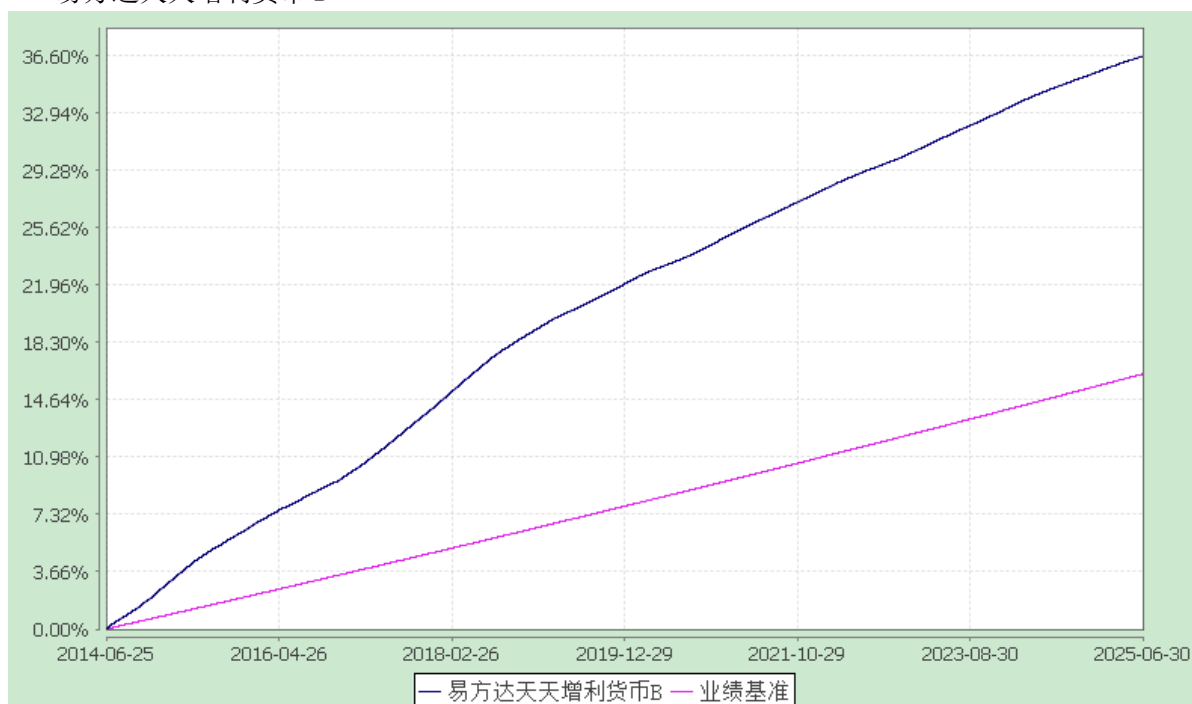
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2025 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 33.0227%，同期业绩比较基准收益率为 16.2877%；B 类基金份额净值收益率为 36.5781%，同期业绩比较基准收益率为 16.2877%。

## § 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。本基金管理人拥有包括公募、社保、基本养老保险、年金、特定客户资产管理、QDII、投资顾问等在内的多类业务资格，在主动权益、指数投资、债券、多资产、另类资产等投资领域全面布局，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<br>基金经理（助<br>理）期限 |          | 证券<br>从业<br>年限 | 说明                                                                                                                                                   |
|-----|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|----------|----------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                                                                                                                                                                                                      | 任职<br>日期                | 离任<br>日期 |                |                                                                                                                                                      |
| 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、易方达稳丰 90 天滚动短债、易方达安汇 120 天持有债券的基金经理，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，现金和短债投资部副总经理                               | 2015-03-17              | -        | 15 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、现金管理部总经理助理，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、易方达稳鑫 30 天滚动短债的基金经理，易方达资产管理（香港）有限公司基金经理。 |
| 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、易方达天天理财货币、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、易方达安裕 60 天持有债券、易方达稳裕 120 天滚动债券的基金经理，现金和短债投资部总经理、固定收益投资决策委员会委员                                                                | 2023-03-16              | -        | 18 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。                                                                            |
| 易璎  | 本基金的基金经理助理，易方达保证金货币、易方达安裕 60 天持有债券、易方达中证同业存单 AAA 指数 7 天持有的基金经理，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、易方达安悦超短债债券、易方达安和中短债债券、易方达稳丰 90 天滚动短债、易方达安益 90 天持有债券、易方达安嘉 30 天 | 2018-06-20              | -        | 15 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。                                                                                             |

|    |                                                                                                                                                                           |            |   |     |                                      |
|----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|---|-----|--------------------------------------|
|    | 持有债券的基金经理助理                                                                                                                                                               |            |   |     |                                      |
| 邹南 | 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、易方达增金宝货币、易方达龙宝货币、易方达安瑞短债债券、易方达安汇 120 天持有债券、易方达保证金货币、易方达天天发货币、易方达安悦超短债债券、易方达安益 90 天持有债券、易方达货币、易方达安和中短债债券的基金经理助理，投资支持高级专员 | 2025-01-07 | - | 7 年 | 硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司固定收益交易员。 |

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。
- 3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 38 次，其中 31 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，7 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

2025 年上半年，国内经济阶段性改善与压力并存，经济增长展现出较强的抗压力与韧性。一季度，在抢出口效应的影响下，外需和国内生产保持了韧性，对经济增长形成支撑；二季度以来，受关税扰动影响，4 月制造业 PMI 下行。消费方面，受益于大规模设备更新、消费品以旧换新等政策刺激，社会消费品零售总额增速显著提升。物价指数层面，CPI 低位震荡，PPI 持续下跌，显示了内生通胀下行压力并没有真正缓解。整体来看，上半年国内经济局部领域出现了积极变化，但内生增长动力仍显不足，经济结构中供大于求的矛盾仍未得到根本性改善。

从政策角度来看，上半年，宏观经济政策根据经济形势灵活调整。年初政府债券发行积极，支出力度明显前置。受汇率等多方面因素约束，货币政策在开年的操作上并未释放过多的宽松信号。进入二季度，随着关税冲击显性化，国内政策逆周期调节力度明显加大，4 月中共中央政治局会议提及“根据形势变化及时推出增量储备政策，加强超常规逆周期调节”。货币政策率先发力，5 月央行降准 0.5%并下调政策利率 10bp，6 月央行提前公告买断式逆回购操作，释放稳市场信号；财政政策也强调存量工具加快落地，增量政策正处于储备阶段。

在经济基本面与市场供需关系影响下，上半年债券市场整体呈现震荡走势。年初债券利率处于较低位置，透支了较多宽松货币政策预期。1 月至 3 月中旬，随着资金市场一度偏紧的扰动，市场收益率普遍出现与资金利率“倒挂”的情况；随着对经济基本面和货币政策的重新判断，债券市场波动加大，收益率震荡上行，1 年期 AAA 同业存单收益率于 2 月底上升至 2%以上，10 年期国债收益率于 3 月中旬一度上行至 1.9%左右，债券市场收益率曲线呈现平坦化上行的形态。3 月下旬，资金面逐步改善，尤其随着 5-6 月央行操作释放流动性宽松信号，隔夜和 7 天回购利率较一季度大幅下行约 40bp，收益率曲线走陡。

操作方面，报告期内本基金以同业存单、同业存款、短期逆回购为主要配置资产。我们根据对经济政策、基本面和市场供求的判断，结合绝对收益率的变化，调整组合剩余期限和杠杆水平。总体来看，组合上半年在保障投资者流动性需求的同时，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 0.6486%，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 0.7682%，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 2025 年下半年，放眼全球经济格局，国际贸易的不确定性因素仍将持续，关税对美国经济

的影响或逐步显现。影响后续国内经济增长的因素较多，一方面需关注抢出口效应与消费刺激政策影响的减弱，或带来需求端修复趋缓；另一方面，也需关注“反内卷”政策的推进，或有助于改善供求关系，推动物价回升，提升企业盈利能力，激发创新动能。政策方面，考虑到全年 5% 增长目标压力不大，预计下半年或以加速存量政策落地为主，关注新型政策性金融工具推进情况。债市走势方面，当前国内需求不足与海外需求不确定性的背景下，避险情绪与基本面环境仍对债券市场较为有利，但考虑到权益市场情绪修复的影响以及三季度政府债发行加速的影响，再考虑到目前国内债券收益率处于历史低位——10 年期国债收益率在 1.75% 附近、1 年期 AAA 同业存单收益率在 1.65% 附近，债券市场预计下行空间相对有限。即便考虑到可能的资本利得，投资者能从债券、货币类产品中获得的投资回报也相对有限。低利率环境下，管理好货币基金的流动性、控制好短债类基金的净值波动率，在此基础上再给投资者提供相对稳定的回报，是我们作为货币短债基金的基金经理的重要责任。本基金将关注未来政策调整带来的交易机会，尽量灵活调整基金的配置结构，力争在保障流动性的前提下，为投资者创造长期稳定的回报。

#### 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程序和技术，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：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：      |         |                        |                          |
| 货币资金     | 6.4.7.1 | 12,526,657,852.37      | 11,980,391,381.25        |
| 结算备付金    |         | 65,882,601.07          | 173,120,750.26           |
| 存出保证金    |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 13,976,983,759.31      | 10,270,504,192.90        |
| 其中：股票投资  |         | -                      | -                        |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 13,976,983,759.31      | 10,230,493,277.83        |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | 40,010,915.07            |
| 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    | 14,963,603,729.97              | 16,473,645,323.53                |
| 应收清算款         |            | -                              | -                                |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 3,579,081.31                   | 1,049,274.07                     |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.5    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 41,536,707,024.03              | 38,898,710,922.01                |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2025 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                |                                  |
| 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     |            | 3,087,095,399.45               | 1,814,114,975.58                 |
| 应付清算款         |            | 1,199,990,161.64               | 1,599,681,917.85                 |
| 应付赎回款         |            | 77,875.85                      | 71,290.81                        |
| 应付管理人报酬       |            | 10,011,116.24                  | 9,844,593.79                     |
| 应付托管费         |            | 1,516,835.79                   | 1,491,605.15                     |
| 应付销售服务费       |            | 7,562,176.87                   | 7,359,987.47                     |
| 应付投资顾问费       |            | -                              | -                                |
| 应交税费          |            | 30,135.79                      | 60,800.16                        |
| 应付利润          |            | -                              | -                                |
| 递延所得税负债       |            | -                              | -                                |
| 其他负债          | 6.4.7.6    | 426,055.04                     | 702,964.22                       |
| 负债合计          |            | 4,306,709,756.67               | 3,433,328,135.03                 |
| <b>净资产：</b>   |            |                                |                                  |
| 实收基金          | 6.4.7.7    | 37,229,997,267.36              | 35,465,382,786.98                |
| 未分配利润         | 6.4.7.8    | 0.00                           | 0.00                             |
| 净资产合计         |            | 37,229,997,267.36              | 35,465,382,786.98                |
| 负债和净资产总计      |            | 41,536,707,024.03              | 38,898,710,922.01                |

注：报告截止日 2025 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 37,229,997,267.36 份，下属分级基金的份额总额分别为：A 类基金份额总额 37,118,881,678.29 份，B 类基金份额总额 111,115,589.07 份。

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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 |
|----|-----|-----------------------|----------------------------|
|----|-----|-----------------------|----------------------------|

|                            |          | 2025 年 6 月 30 日       | 2024 年 6 月 30 日       |
|----------------------------|----------|-----------------------|-----------------------|
| <b>一、营业总收入</b>             |          | 360,373,456.20        | 423,666,455.92        |
| 1.利息收入                     |          | 262,463,297.48        | 306,207,102.34        |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.9  | 143,628,299.22        | 156,069,905.64        |
| 债券利息收入                     |          | -                     | -                     |
| 资产支持证券利息收入                 |          | -                     | -                     |
| 买入返售金融资产收入                 |          | 118,834,998.26        | 150,137,196.70        |
| 其他利息收入                     |          | -                     | -                     |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           |          | 97,910,158.72         | 117,459,353.58        |
| 其中：股票投资收益                  |          | -                     | -                     |
| 基金投资收益                     |          | -                     | -                     |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.10 | 97,679,670.38         | 111,351,485.31        |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.11 | 230,488.34            | 6,107,868.27          |
| 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 | -                     | -                     |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |          | 121,932,927.23        | 119,840,152.00        |
| 1. 管理人报酬                   |          | 60,349,121.35         | 56,378,418.19         |
| 2. 托管费                     |          | 9,143,806.23          | 8,542,184.47          |
| 3. 销售服务费                   |          | 45,493,011.52         | 41,981,523.43         |
| 4. 投资顾问费                   |          | -                     | -                     |
| 5. 利息支出                    |          | 6,735,382.81          | 12,654,056.92         |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 6,735,382.81          | 12,654,056.92         |
| 6. 信用减值损失                  | 6.4.7.13 | -                     | -                     |
| 7. 税金及附加                   |          | 28,085.57             | 94,137.23             |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.14 | 183,519.75            | 189,831.76            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>238,440,528.97</b> | <b>303,826,303.92</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                     | -                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>238,440,528.97</b> | <b>303,826,303.92</b> |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |          | -                     | -                     |
| <b>六、综合收益总额</b>            |          | <b>238,440,528.97</b> | <b>303,826,303.92</b> |

### 6.3 净资产变动表

会计主体：易方达天天增利货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日      |                 |                     |
|------------------------------------------|--------------------------------------------|-----------------|---------------------|
|                                          | 实收基金                                       | 未分配利润           | 净资产合计               |
| 一、上期期末净资产                                | 35,465,382,786.98                          | 0.00            | 35,465,382,786.98   |
| 二、本期期初净资产                                | 35,465,382,786.98                          | -               | 35,465,382,786.98   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 1,764,614,480.38                           | 0.00            | 1,764,614,480.38    |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | 238,440,528.97  | 238,440,528.97      |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 1,764,614,480.38                           | -               | 1,764,614,480.38    |
| 其中：1.基金申购款                               | 261,633,995,337.58                         | -               | 261,633,995,337.58  |
| 2.基金赎回款                                  | -259,869,380,857.20                        | -               | -259,869,380,857.20 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                          | -238,440,528.97 | -238,440,528.97     |
| 四、本期期末净资产                                | 37,229,997,267.36                          | 0.00            | 37,229,997,267.36   |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |                 |                     |
|                                          | 实收基金                                       | 未分配利润           | 净资产合计               |
| 一、上期期末净资产                                | 31,307,104,397.53                          | 0.00            | 31,307,104,397.53   |
| 二、本期期初净资产                                | 31,307,104,397.53                          | -               | 31,307,104,397.53   |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 3,388,045,839.40                           | 0.00            | 3,388,045,839.40    |
| （一）、综合收益总额                               | -                                          | 303,826,303.92  | 303,826,303.92      |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净                  | 3,388,045,839.40                           | -               | 3,388,045,839.40    |

|                                          |                     |                 |                     |
|------------------------------------------|---------------------|-----------------|---------------------|
| 资产减少以“-”号填列)                             |                     |                 |                     |
| 其中：1.基金申购款                               | 269,912,297,370.75  | -               | 269,912,297,370.75  |
| 2.基金赎回款                                  | -266,524,251,531.35 | -               | -266,524,251,531.35 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                   | -303,826,303.92 | -303,826,303.92     |
| 四、本期期末净资产                                | 34,695,150,236.93   | 0.00            | 34,695,150,236.93   |

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：吴欣荣，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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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净资产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

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。

#### 6.4.5 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。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### （2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

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征增值税试点的通知》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 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

|                |                   |
|----------------|-------------------|
| 活期存款           | 1,298,068,667.62  |
| 等于：本金          | 1,297,565,858.55  |
| 加：应计利息         | 502,809.07        |
| 定期存款           | 11,228,589,184.75 |
| 等于：本金          | 11,158,000,000.00 |
| 加：应计利息         | 70,589,184.75     |
| 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    | 11,228,589,184.75 |
| 其他存款           | -                 |
| 等于：本金          | -                 |
| 加：应计利息         | -                 |
| 合计             | 12,526,657,852.37 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日 |                   |              |        |
|--------|-------|------------------------|-------------------|--------------|--------|
|        |       | 按实际利率计算的<br>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 | 13,976,983,759.31      | 13,984,406,478.78 | 7,422,719.47 | 0.0199 |
|        | 合计    | 13,976,983,759.31      | 13,984,406,478.78 | 7,422,719.47 | 0.0199 |
| 资产支持证券 |       | -                      | -                 | -            | -      |
| 合计     |       | 13,976,983,759.31      | 13,984,406,478.78 | 7,422,719.47 | 0.0199 |

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<br>2025 年 6 月 30 日 |           |
|-------|------------------------|-----------|
|       | 账面余额                   | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 4,868,195,327.10       | -         |
| 银行间市场 | 10,095,408,402.87      | -         |
| 合计    | 14,963,603,729.97      | -         |

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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付交易费用      | 309,772.91             |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | 309,772.91             |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 112,992.19             |
| 申购款利息摊销     | 3,289.94               |
| 合计          | 426,055.04             |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                     |
|---------------|----------------------------|---------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额                |
| 上年度末          | 35,298,027,266.51          | 35,298,027,266.51   |
| 本期申购          | 259,966,973,448.82         | 259,966,973,448.82  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -258,146,119,037.04        | -258,146,119,037.04 |
| 本期末           | 37,118,881,678.29          | 37,118,881,678.29   |

易方达天天增利货币 B

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                   |
|---------------|----------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额              |
| 上年度末          | 167,355,520.47             | 167,355,520.47    |
| 本期申购          | 1,667,021,888.76           | 1,667,021,888.76  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,723,261,820.16          | -1,723,261,820.16 |
| 本期末           | 111,115,589.07             | 111,115,589.07    |

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            |
| 本期期初           | 0.00            | -     | 0.00            |
| 本期利润           | 236,978,317.16  | -     | 236,978,317.16  |
| 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        | -236,978,317.16 | -     | -236,978,317.16 |
| 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          |
| 本期期初           | 0.00          | -     | 0.00          |
| 本期利润           | 1,462,211.81  | -     | 1,462,211.81  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -             | -     | -             |
| 其中：基金申购款       | -             | -     | -             |
| 基金赎回款          | -             | -     | -             |
| 本期已分配利润        | -1,462,211.81 | -     | -1,462,211.81 |
| 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<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 11,872,007.06                         |
| 定期存款利息收入  | 131,451,089.27                        |
| 其他存款利息收入  | -                                     |
| 结算备付金利息收入 | 238,754.15                            |
| 其他        | 66,448.74                             |
| 合计        | 143,628,299.22                        |

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 |
|----|----|
|----|----|

|                              | 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------------|----------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 96,974,753.24        |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 704,917.14           |
| 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                           | 97,679,670.38        |

#### 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 18,338,452,563.45          |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 18,310,786,734.67          |
| 减：应计利息总额               | 26,960,911.64              |
| 减：交易费用                 | -                          |
| 买卖债券差价收入               | 704,917.14                 |

#### 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|--------------------------|----------------------------|
| 资产支持证券投资收益——利息收入         | 230,488.34                 |
| 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                       | 230,488.34                 |

##### 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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|--------------|----------------------------|
| 卖出资产支持证券成交总额 | 40,198,654.25              |

|                |               |
|----------------|---------------|
| 减：卖出资产支持证券成本总额 | 40,000,000.00 |
| 减：应计利息总额       | 198,654.25    |
| 减：交易费用         | -             |
| 资产支持证券投资收益     | -             |

6.4.7.12 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 审计费用     | 44,630.98                  |
| 信息披露费    | 59,507.37                  |
| 银行间账户维护费 | 17,853.84                  |
| 银行汇划费    | 60,927.56                  |
| 其他       | 600.00                     |
| 合计       | 183,519.75                 |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |              | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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  | -                          | -            | 68,093,830.00                   | 87.18%       |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |                | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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  | 8,812,159,000.00           | 6.25%          | 13,831,065,000.00               | 1.91%          |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|------------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 60,349,121.35              | 56,378,418.19                   |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 29,910,323.59              | 27,500,607.92                   |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 30,438,797.76              | 28,877,810.27                   |

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,143,806.23               | 8,542,184.47                    |

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<br>2025年1月1日至2025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    | 26,568.94                       | 1,412.52   | 27,981.46  |
| 中国建设银行         | 130,408.07                      | 23.29      | 130,431.36 |
| 合计             | 156,977.01                      | 1,435.81   | 158,412.82 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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    | 39,139.92                       | 24,771.38  | 63,911.30  |

|        |            |           |            |
|--------|------------|-----------|------------|
| 中国建设银行 | 149,852.62 | 97.53     | 149,950.15 |
| 合计     | 188,992.54 | 24,868.91 | 213,861.45 |

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。

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日      |                  |                |       |      |                   |              |
|---------------------------------|------------------|----------------|-------|------|-------------------|--------------|
| 银行间市场<br>交易的各关<br>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         |
| 中国建设银行                          | 1,245,594,757.45 | 999,457,610.64 | -     | -    | 487,000,000.00    | 28,462.68    |
| 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |                  |                |       |      |                   |              |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>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         |
| 中国建设银行                          | -                | -              | -     | -    | 21,371,006.000.00 | 3,159,394.53 |

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<br>2025年1月1日至2025年6月30日 |               | 上年度可比期间<br>2024年1月1日至2024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 | 1,298,068,667.62           | 11,872,007.06 | 1,502,054,409.37                | 22,208,878.82 |
| 中国建设银行-定期存款 | 1,200,835,000.05           | 17,720,613.94 | -                               | -             |

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<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计   | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|----------------|----|
| 236,978,317.16   | -                 | -            | 236,978,317.16 | -  |

易方达天天增利货币 B

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------|----|
| 1,462,211.81     | -                 | -            | 1,462,211.81 | -  |

6.4.12 期末（2025 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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 2025 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 3,087,095,399.45 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称             | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）     | 期末估值总额         |
|-----------|------------------|------------|------------|-----------|----------------|
| 112403208 | 24 农业银行<br>CD208 | 2025-07-01 | 99.74      | 1,000,000 | 99,737,799.43  |
| 112404044 | 24 中国银行<br>CD044 | 2025-07-01 | 99.77      | 1,000,000 | 99,765,794.61  |
| 112404052 | 24 中国银行<br>CD052 | 2025-07-01 | 99.52      | 2,000,000 | 199,042,580.25 |
| 112404053 | 24 中国银行<br>CD053 | 2025-07-01 | 99.40      | 1,000,000 | 99,398,799.91  |
| 112404069 | 24 中国银行<br>CD069 | 2025-07-01 | 99.12      | 1,000,000 | 99,122,898.72  |
| 112406272 | 24 交通银行<br>CD272 | 2025-07-01 | 99.71      | 216,000   | 21,536,918.75  |
| 112408241 | 24 中信银行<br>CD241 | 2025-07-01 | 99.76      | 1,000,000 | 99,763,947.59  |
| 112408390 | 24 中信银行<br>CD390 | 2025-07-01 | 99.05      | 1,000,000 | 99,053,992.89  |
| 112412162 | 24 北京银行<br>CD162 | 2025-07-01 | 99.03      | 2,000,000 | 198,055,595.22 |
| 112502178 | 25 工商银行<br>CD178 | 2025-07-01 | 99.77      | 4,000,000 | 399,086,927.03 |
| 112502217 | 25 工商银行<br>CD217 | 2025-07-01 | 98.82      | 3,000,000 | 296,458,368.85 |
| 112503153 | 25 农业银行<br>CD153 | 2025-07-01 | 99.81      | 5,000,000 | 499,026,422.61 |
| 112503165 | 25 农业银行<br>CD165 | 2025-07-01 | 99.75      | 1,000,000 | 99,747,673.55  |
| 112504020 | 25 中国银行<br>CD020 | 2025-07-01 | 98.54      | 1,000,000 | 98,537,307.48  |
| 112504029 | 25 中国银行<br>CD029 | 2025-07-01 | 98.42      | 1,590,000 | 156,495,039.23 |
| 112506086 | 25 交通银行<br>CD086 | 2025-07-01 | 99.12      | 1,000,000 | 99,122,863.91  |

|           |                  |            |        |            |                  |
|-----------|------------------|------------|--------|------------|------------------|
| 112515149 | 25 民生银行<br>CD149 | 2025-07-01 | 98.82  | 1,905,000  | 188,252,677.30   |
| 200212    | 20 国开 12         | 2025-07-01 | 103.28 | 1,000,000  | 103,280,197.72   |
| 210203    | 21 国开 03         | 2025-07-01 | 102.25 | 500,000    | 51,127,016.45    |
| 210403    | 21 农发 03         | 2025-07-01 | 102.21 | 500,000    | 51,104,786.94    |
| 220207    | 22 国开 07         | 2025-07-01 | 102.00 | 1,000,000  | 102,001,540.67   |
| 230213    | 23 国开 13         | 2025-07-01 | 100.74 | 2,000,000  | 201,484,410.23   |
| 259925    | 25 贴现国债<br>25    | 2025-07-01 | 99.91  | 128,000    | 12,787,879.70    |
| 合计        |                  |            |        | 33,839,000 | 3,373,991,439.04 |

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 2025 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，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。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 2025 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 35.91%(2024 年 12 月 31 日：27.90%)。

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<br>2025年6月30日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | 0.00              | 0.00                |
| A-1 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 953,678,684.92    | 948,419,823.35      |
| 合计     | 953,678,684.92    | 948,419,823.35      |

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企业发行的债券。

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<br>2025年6月30日 | 上年度末<br>2024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<br>2025年6月30日 | 上年度末<br>2024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<br>2025年6月30日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 81,875,812.96     | 408,361,982.81      |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 81,875,812.96     | 408,361,982.81      |

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、央票及未有第三方机构评级的企业发行的债券。

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<br>2025年6月30日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 0.00              | 40,010,915.07       |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 0.00              | 40,010,915.07       |

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<br>2025年6月30日 | 上年度末<br>2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 12,941,429,261.43 | 8,873,711,471.67    |
| AAA 以下 | 0.00              | 0.00                |
| 未评级    | 0.00              | 0.00                |
| 合计     | 12,941,429,261.43 | 8,873,711,471.67    |

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 2025 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(净资产)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，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<br>2025 年 6 月<br>30 日 | 1 年以内             | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计                |
|---------------------------|-------------------|-------|-------|-----|-------------------|
| 资产                        |                   |       |       |     |                   |
| 货币资金                      | 12,526,657,852.37 | -     | -     | -   | 12,526,657,852.37 |
| 结算备付金                     | 65,882,601.07     | -     | -     | -   | 65,882,601.07     |
| 存出保证金                     | -                 | -     | -     | -   | -                 |
| 交易性金融资产                   | 13,976,983,759.31 | -     | -     | -   | 13,976,983,759.31 |
| 衍生金融资                     | -                 | -     | -     | -   | -                 |

|             |                  |       |       |                   |                  |
|-------------|------------------|-------|-------|-------------------|------------------|
| 产           |                  |       |       |                   |                  |
| 买入返售金       | 14,963,603,729.9 |       |       |                   | 14,963,603,729.9 |
| 融资产         | 7                | -     | -     | -                 | 7                |
| 应收清算款       | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 应收股利        | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 应收申购款       | -                | -     | -     | 3,579,081.31      | 3,579,081.31     |
| 递延所得税       | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 资产          | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 其他资产        | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 资产总计        | 41,533,127,942.7 | -     | -     | 3,579,081.31      | 41,536,707,024.0 |
|             | 2                |       |       |                   | 3                |
| 负债          |                  |       |       |                   |                  |
| 短期借款        | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 交易性金融       | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 负债          | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 衍生金融负       | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 债           | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 卖出回购金       | 3,087,095,399.45 | -     | -     | -                 | 3,087,095,399.45 |
| 融资产款        |                  | -     | -     | -                 |                  |
| 应付清算款       | -                | -     | -     | 1,199,990,161.64  | 1,199,990,161.64 |
| 应付赎回款       | -                | -     | -     | 77,875.85         | 77,875.85        |
| 应付管理人       | -                | -     | -     | 10,011,116.24     | 10,011,116.24    |
| 报酬          | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 应付托管费       | -                | -     | -     | 1,516,835.79      | 1,516,835.79     |
| 应付销售服       | -                | -     | -     | 7,562,176.87      | 7,562,176.87     |
| 务费          | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 应付投资顾       | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 问费          | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 应交税费        | -                | -     | -     | 30,135.79         | 30,135.79        |
| 应付利润        | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 递延所得税       | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 负债          | -                | -     | -     | -                 | -                |
| 其他负债        | -                | -     | -     | 426,055.04        | 426,055.04       |
| 负债总计        | 3,087,095,399.45 | -     | -     | 1,219,614,357.22  | 4,306,709,756.   |
|             |                  |       |       |                   | 67               |
| 利率敏感        | 38,446,032,543.2 | -     | -     | -1,216,035,275.91 | 37,229,997,267.3 |
| 度缺口         | 7                |       |       |                   | 6                |
| 上年度末        |                  |       |       |                   |                  |
| 2024 年 12 月 | 1 年以内            | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息               | 合计               |
| 31 日        |                  |       |       |                   |                  |

|           |                   |   |   |                  |                   |
|-----------|-------------------|---|---|------------------|-------------------|
| 资产        |                   |   |   |                  |                   |
| 货币资金      | 11,980,391,381.25 | - | - | -                | 11,980,391,381.25 |
| 结算备付金     | 173,120,750.26    | - | - | -                | 173,120,750.26    |
| 存出保证金     | -                 | - | - | -                | -                 |
| 交易性金融资产   | 10,270,504,192.90 | - | - | -                | 10,270,504,192.90 |
| 衍生金融资产    | -                 | - | - | -                | -                 |
| 买入返售金融资产  | 16,473,645,323.53 | - | - | -                | 16,473,645,323.53 |
| 应收清算款     | -                 | - | - | -                | -                 |
| 应收股利      | -                 | - | - | -                | -                 |
| 应收申购款     | -                 | - | - | 1,049,274.07     | 1,049,274.07      |
| 递延所得税资产   | -                 | - | - | -                | -                 |
| 其他资产      | -                 | - | - | -                | -                 |
| 资产总计      | 38,897,661,647.94 | - | - | 1,049,274.07     | 38,898,710,922.01 |
| 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 | 1,814,114,975.58  | - | - | -                | 1,814,114,975.58  |
| 应付清算款     | -                 | - | - | 1,599,681,917.85 | 1,599,681,917.85  |
| 应付赎回款     | -                 | - | - | 71,290.81        | 71,290.81         |
| 应付管理人报酬   | -                 | - | - | 9,844,593.79     | 9,844,593.79      |
| 应付托管费     | -                 | - | - | 1,491,605.15     | 1,491,605.15      |
| 应付销售服务费   | -                 | - | - | 7,359,987.47     | 7,359,987.47      |
| 应付投资顾问费   | -                 | - | - | -                | -                 |
| 应交税费      | -                 | - | - | 60,800.16        | 60,800.16         |
| 应付利润      | -                 | - | - | -                | -                 |
| 递延所得税负债   | -                 | - | - | -                | -                 |
| 其他负债      | -                 | - | - | 702,964.22       | 702,964.22        |
| 负债总计      | 1,814,114,975.58  | - | - | 1,619,213,159.45 | 3,433,328,135.03  |

|             |                   |   |                   |                   |
|-------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|
| 利率敏感度<br>缺口 | 37,083,546,672.36 | - | -1,618,163,885.38 | 35,465,382,786.98 |
|-------------|-------------------|---|-------------------|-------------------|

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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                    | 本期末<br>2025 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2024 年 12 月 31 日 |
|    | 1.市场利率下降 25 个基点    | 16,480,457.14                   | 12,005,154.99            |
|    | 2.市场利率上升 25 个基点    | -16,423,458.54                  | -11,970,242.62           |

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，因此无重大外汇风险。

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<br>2025 年 6 月 30 日 |
|---------------|------------------------|
| 第一层次          | -                      |
| 第二层次          | 13,976,983,759.31      |

|      |                   |
|------|-------------------|
| 第三层次 | -                 |
| 合计   | 13,976,983,759.31 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金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<br>(%) |
|----|-------------------|-------------------|------------------|
| 1  | 固定收益投资            | 13,976,983,759.31 | 33.65            |
|    | 其中：债券             | 13,976,983,759.31 | 33.65            |
|    | 资产支持证券            | -                 | -                |
| 2  | 买入返售金融资产          | 14,963,603,729.97 | 36.03            |
|    | 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      | 12,592,540,453.44 | 30.32            |
| 4  | 其他各项资产            | 3,579,081.31      | 0.01             |
| 5  | 合计                | 41,536,707,024.03 | 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 | 2.13          |            |
|    | 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 | 3,087,095,399.45 | 8.29 |
|   | 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    | 86 |
| 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 | 43 |

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                 | 54.37               | 11.51               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 12.66               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 15.73               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 0.75                | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 27.81               | -                   |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                   | -                   |
| 合计 |                        | 111.32              | 11.51               |

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                 | 99,905,310.16     | 0.27         |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -            |
| 3  | 金融债券                 | 508,997,952.01    | 1.37         |
|    | 其中：政策性金融债            | 508,997,952.01    | 1.37         |
| 4  | 企业债券                 | -                 | -            |
| 5  | 企业短期融资券              | 141,047,036.71    | 0.38         |
| 6  | 中期票据                 | 285,604,199.00    | 0.77         |
| 7  | 同业存单                 | 12,941,429,261.43 | 34.76        |
| 8  | 其他                   | -                 | -            |
| 9  | 合计                   | 13,976,983,759.31 | 37.54        |
| 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  | 112517117 | 25 光大银行 CD117 | 10,000,000 | 984,157,733.42 | 2.64         |
| 2  | 112504031 | 25 中国银行 CD031 | 7,500,000  | 738,116,550.50 | 1.98         |
| 3  | 112503125 | 25 农业银行 CD125 | 6,000,000  | 599,507,008.64 | 1.61         |
| 4  | 112503153 | 25 农业银行 CD153 | 5,000,000  | 499,026,422.61 | 1.34         |
| 5  | 112522005 | 25 邮储银行 CD005 | 5,000,000  | 498,842,534.44 | 1.34         |
| 6  | 112504016 | 25 中国银行 CD016 | 5,000,000  | 497,168,465.27 | 1.34         |
| 7  | 112518158 | 25 华夏银行 CD158 | 5,000,000  | 496,343,846.89 | 1.33         |
| 8  | 112504028 | 25 中国银行 CD028 | 5,000,000  | 494,236,327.97 | 1.33         |
| 9  | 112515149 | 25 民生银行 CD149 | 5,000,000  | 494,101,515.21 | 1.33         |
| 10 | 112517116 | 25 光大银行 CD116 | 5,000,000  | 492,101,335.96 | 1.32         |

## 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                   | 0.0469%  |
| 报告期内偏离度的最低值                   | -0.0132% |

|                        |         |
|------------------------|---------|
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0151% |
|------------------------|---------|

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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，中国光大银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。中国民生银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。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人民银行的处罚。中国邮政储蓄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市分局的处罚。

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 | -  |

|   |       |              |
|---|-------|--------------|
| 3 | 应收利息  | -            |
| 4 | 应收申购款 | 3,579,081.31 |
| 5 | 其他应收款 | -            |
| 6 | 待摊费用  | -            |
| 7 | 其他    | -            |
| 8 | 合计    | 3,579,081.31 |

§ 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 |
| 易方达天天增利货币 A | 4,224,432 | 8,786.72     | 44,069,513.36  | 0.12%  | 37,074,812,164.93 | 99.88% |
| 易方达天天增利货币 B | 23        | 4,831,112.57 | 68,078,137.37  | 61.27% | 43,037,451.70     | 38.73% |
| 合计          | 4,224,455 | 8,812.97     | 112,147,650.73 | 0.30%  | 37,117,849,616.63 | 99.70% |

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  | 个人    | 25,100,693.13 | 0.07%  |
| 2  | 个人    | 17,900,482.75 | 0.05%  |
| 3  | 个人    | 16,611,017.35 | 0.04%  |
| 4  | 基金类机构 | 15,195,040.59 | 0.04%  |
| 5  | 其他机构  | 11,095,576.12 | 0.03%  |
| 6  | 个人    | 7,608,577.92  | 0.02%  |
| 7  | 个人    | 7,504,964.39  | 0.02%  |
| 8  | 个人    | 7,498,889.84  | 0.02%  |
| 9  | 个人    | 7,336,321.87  | 0.02%  |
| 10 | 个人    | 7,056,833.23  | 0.02%  |

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 | 274,061.48 | 0.0007%  |
|                  | 易方达天天增利货币 B | 0.00       | 0.0000%  |
|                  | 合计          | 274,061.48 | 0.0007%  |

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 | 0~10              |
|                                | 易方达天天增利货币 B | 0                 |
|                                | 合计          | 0~10              |

§ 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                   | 35,298,027,266.51  | 167,355,520.47   |
| 本报告期基金总申购份额                    | 259,966,973,448.82 | 1,667,021,888.76 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 258,146,119,037.04 | 1,723,261,820.16 |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -                  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 37,118,881,678.29  | 111,115,589.07   |

§ 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 2025 年 3 月 22 日发布公告，自 2025 年 3 月 20 日起，刘晓艳女士担任公司董事长，其原任公司董事长（联席）职务自行免去，詹余引先生不再担任公司董事长；吴欣荣先生担任公司总经理，其原任公司执行总经理（总经理级）职务自行免去，刘晓艳女士不再担任公司总经理；陈皓先生、萧楠先生不再担任公司副总经理级高级管理人员；刘硕凌先生担任公司首席信息官，

管勇先生不再担任公司首席信息官。本基金管理人于 2025 年 5 月 17 日发布公告，自 2025 年 5 月 15 日起张坤先生不再担任公司副总经理级高级管理人员。

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 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<br>单元<br>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 |    |
| 财通证券 | 2              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 长城证券 | 1              | -    | -            | -         | -          | -  |
| 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 | - | - | - | - | - |
| 国泰海通  | 4 | - | - | - | - | - |
| 国投证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 国信证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 国元证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 华创证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 华西证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 华源证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 汇丰前海  | 2 | - | - | - | - | - |
| 民生证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 南京证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 平安证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源  | 1 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 天风证券  | 1 | - | - | - | - | - |
| 万联证券  | 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  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金财富  | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信建投  | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券  | 2 | - | - | - | - | - |
| 中邮证券  | 1 | - | - | - | - | - |

注：a) 本报告期内本基金减少交易单元的证券公司为中银国际证券股份有限公司，新增交易单元的证券公司为华源证券股份有限公司。国泰君安证券股份有限公司和海通证券股份有限公司合并为国泰海通证券股份有限公司。

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。本报告期内基金证券经营机构的选择标准有调整，调整后的标准如下：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范，在业内具有良好的声誉；
- 2) 具有较强的合规风控能力，内控制度健全并得到有效执行；
- 3) 具备产品运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足产品进行证券交易的需要；
- 4) 具有较强的研究、交易服务能力；

5) 佣金费率水平符合相关规定及监管要求，并在行业内具有较强竞争力。

c) 本报告期内基金证券经营机构的选择程序如下：

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 |
| 财通证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 长城证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 长江证券 | -    | -            | 3,933,622,000.00  | 2.79%          | -    | -            |
| 东方财富 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东方证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 东吴证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 方正证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 光大证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 广发证券 | -    | -            | 8,812,159,000.00  | 6.25%          | -    | -            |
| 国海证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国金证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国盛证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国泰海通 | -    | -            | 33,953,275,000.00 | 24.10%         | -    | -            |
| 国投证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国信证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 国元证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 华创证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | -    | -            | 36,095,082,000.00 | 25.62%         | -    | -            |
| 华西证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 华源证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 汇丰前海 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 民生证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 南京证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 平安证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |
| 上海证券 | -    | -            | -                 | -              | -    | -            |

|       |   |   |                   |        |   |   |
|-------|---|---|-------------------|--------|---|---|
| 申万宏源  | - | - | -                 | -      | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | -                 | -      | - | - |
| 天风证券  | - | - | -                 | -      | - | - |
| 万联证券  | - | - | 58,114,484,000.00 | 41.24% | - | - |
| 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  | - | - | -                 | -      | - | - |
| 中邮证券  | - | - | -                 | -      | - | - |

#### 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聘任基金经理助理的公告            | 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 | 2025-01-07 |
| 2  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证券报                       | 2025-01-21 |
| 3  | 易方达基金管理有限公司董事长变更公告                  | 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 | 2025-03-22 |
| 4  | 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 | 2025-03-22 |
| 5  | 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 | 2025-03-22 |
| 6  | 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 | 2025-03-22 |
| 7  | 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 | 2025-03-25 |
| 8  | 易方达基金管理有限公司旗下公募基金通过                 | 基金管理人网站及中国                  | 2025-03-31 |

|    |                                            |                             |            |
|----|--------------------------------------------|-----------------------------|------------|
|    | 证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）                   | 证监会基金电子披露网站                 |            |
| 9  | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告            | 中国证券报                       | 2025-03-31 |
| 10 | 易方达基金管理有限公司旗下基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告        | 中国证券报                       | 2025-04-22 |
| 11 | 易方达基金管理有限公司关于恢复北京加和基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2025-05-10 |
| 12 | 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 | 2025-05-17 |

§ 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  
二〇二五年八月三十日