易方达天天发货币市场基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§1 重要提示

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

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	易方达天天发货币
基金主代码	000829
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 2 月 16 日
报告期末基金份额总额	52,449,747,980.72 份
投资目标	在有效控制投资风险和保持高流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将对基金资产组合进行积极管理，在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，力争获得高于业绩比较基准的投资回报，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、基金投资策略、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。		
基金管理人	易方达基金管理有限公司		
基金托管人	广发银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	易方达天天发货币 A	易方达天天发货币 B	易方达天天发货币 D
下属分级基金的交易代码	000829	000830	018955
报告期末下属分级基金的份额总额	382,987,336.04 份	50,198,591,207.25 份	1,868,169,437.43 份

注：自 2023 年 7 月 31 日起，本基金增设 D 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 8 月 1 日。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)		
	易方达天天发货币 A	易方达天天发货币 B	易方达天天发货币 D
1.本期已实现收益	997,127.27	197,643,727.69	5,660,315.93
2.本期利润	997,127.27	197,643,727.69	5,660,315.93
3.期末基金资产净值	382,987,336.04	50,198,591,207.	1,868,169,437.4

		25	3

注：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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

易方达天天发货币 A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.2643%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	-0.0760%	0.0002%
过去六个月	0.5316%	0.0002%	0.6769%	0.0000%	-0.1453%	0.0002%
过去一年	1.1335%	0.0003%	1.3617%	0.0000%	-0.2282%	0.0003%
过去三年	4.5518%	0.0011%	4.1599%	0.0000%	0.3919%	0.0011%
过去五年	8.6916%	0.0013%	7.0318%	0.0000%	1.6598%	0.0013%
过去七年	13.4925%	0.0015%	9.9875%	0.0000%	3.5050%	0.0015%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	24.0549%	0.0026%	13.9816%	0.0000%	10.0733%	0.0026%

易方达天天发货币 B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3249%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	-0.0154%	0.0002%
过去六个月	0.6528%	0.0002%	0.6769%	0.0000%	-0.0241%	0.0002%

过去一年	1.3770%	0.0003%	1.3617%	0.0000%	0.0153%	0.0003%
过去三年	5.3091%	0.0011%	4.1599%	0.0000%	1.1492%	0.0011%
过去五年	10.0052%	0.0013%	7.0318%	0.0000%	2.9734%	0.0013%
过去七年	15.4178%	0.0015%	9.9875%	0.0000%	5.4303%	0.0015%
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	26.9639%	0.0026%	13.9816%	0.0000%	12.9823%	0.0026%

易方达天天发货币 D

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3249%	0.0002%	0.3403%	0.0000%	-0.0154%	0.0002%
过去六个月	0.6528%	0.0002%	0.6769%	0.0000%	-0.0241%	0.0002%
过去一年	1.3771%	0.0003%	1.3617%	0.0000%	0.0154%	0.0003%
过去三年	5.3092%	0.0011%	4.1599%	0.0000%	1.1493%	0.0011%
过去五年	-	-	-	-	-	-
过去七年	-	-	-	-	-	-
过去十年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	5.6806%	0.0011%	4.3969%	0.0000%	1.2837%	0.0011%

注：本基金利润分配是按日结转份额。

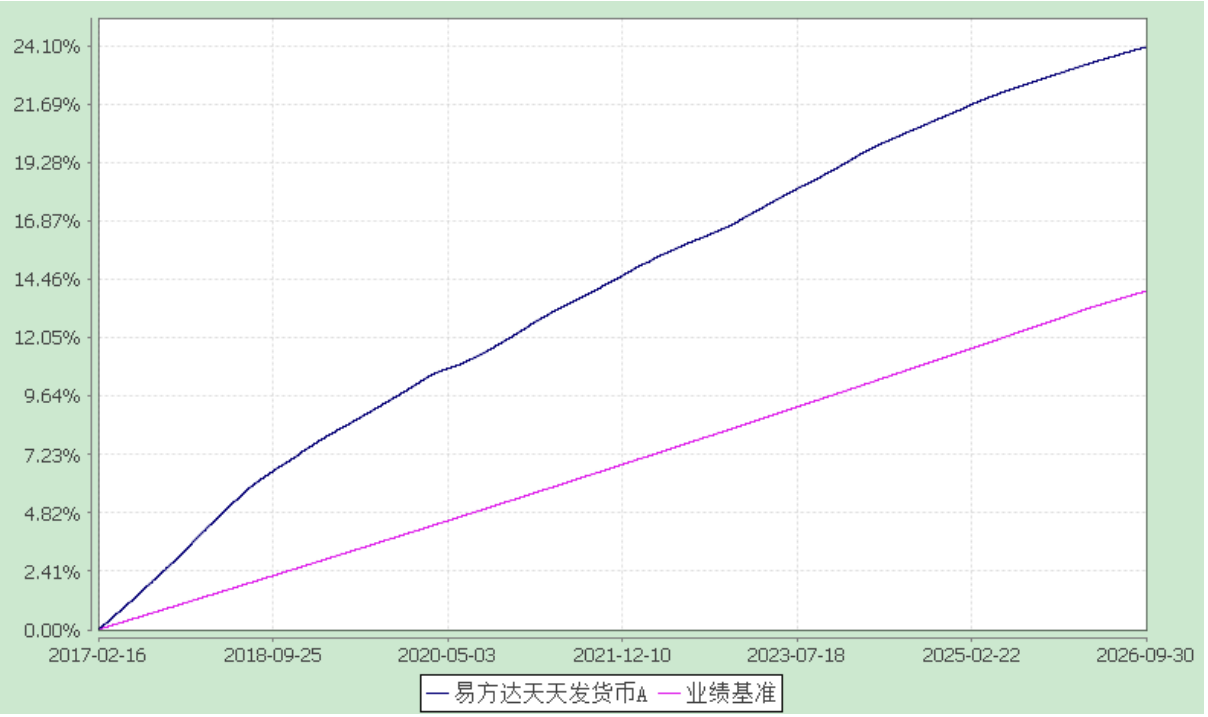
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

易方达天天发货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

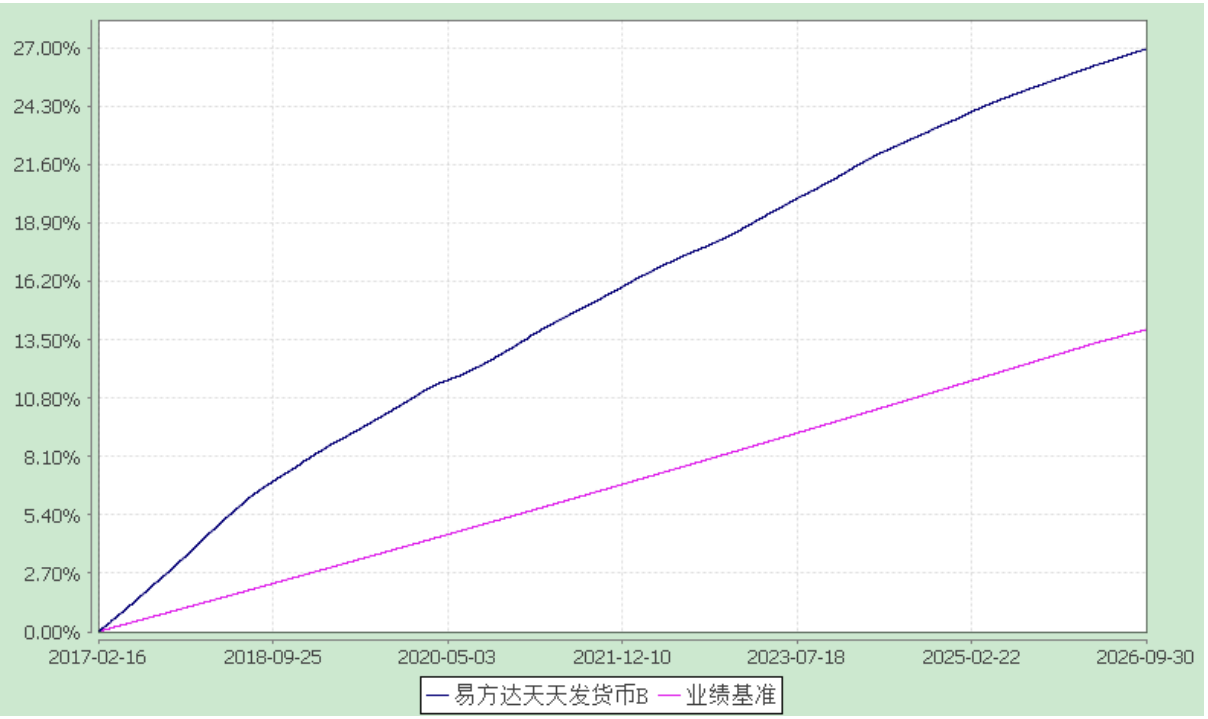
易方达天天发货币 A

（2017 年 2 月 16 日至 2026 年 9 月 30 日）



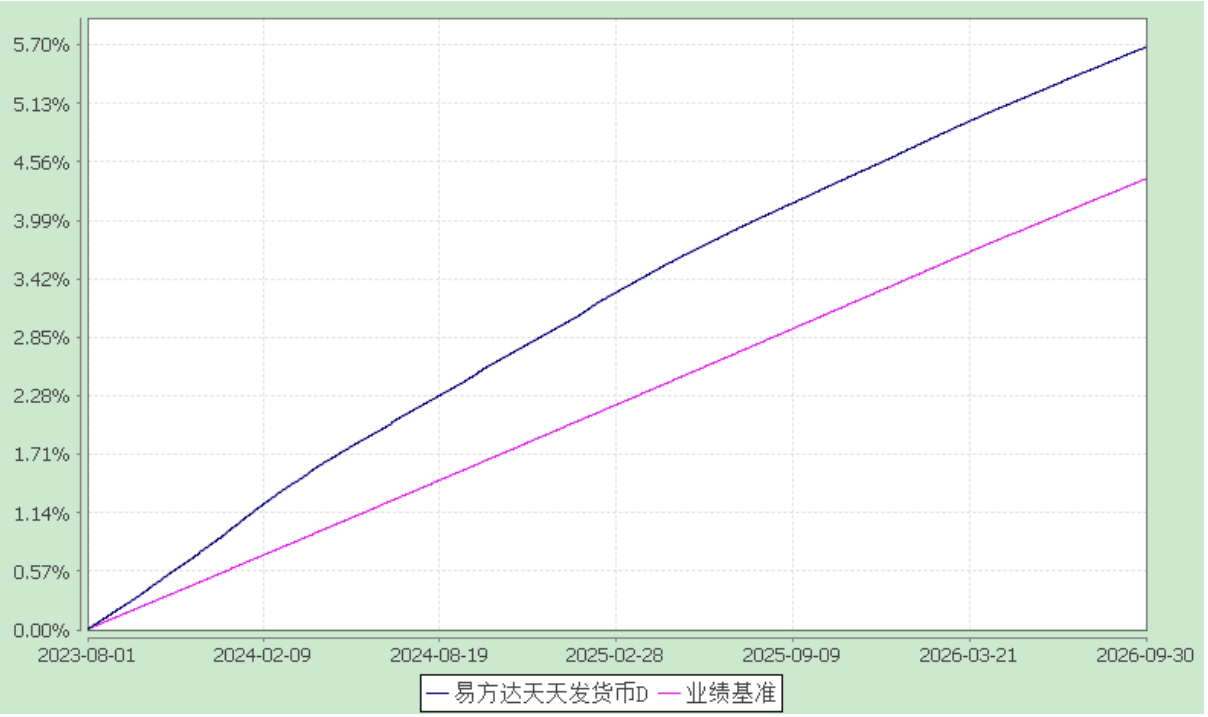
易方达天天发货币 B

（2017 年 2 月 16 日至 2026 年 9 月 30 日）



易方达天天发货币 D

（2023 年 8 月 1 日至 2026 年 9 月 30 日）



注：自 2023 年 7 月 31 日起，本基金增设 D 类份额类别，份额首次确认日为 2023 年 8 月 1 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
石大怿	本基金的基金经理，易方达天天理财货币、易方达货币、易方达易理财货币、易方达现金增利货币、易方达安瑞短债债券、易方达安益 90 天持有债券、易方达安嘉 30 天持有债券的基金经理	2017-02-16	-	17 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、基金经理助理，易方达月月利理财债券、易方达双月利理财债券、易方达保证金货

					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、易方达掌柜季季盈理财债券、易方达稳悦 120 天滚动短债的基金经理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究、决策流程和交易流程，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，通过投资交易系统中的公平交易模块，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 62 次，其中 59 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，3 次为不同投资经理管理的组合因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资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 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年三季度，国内经济延续弱修复格局，结构分化明显：上半年 GDP 同比增长 4.7%，其中二季度增长 4.3%，生产端保持韧性而内需依然偏弱，政策主线延续“反内卷”与稳增长并重。PPI 同比涨幅由 7 月的 3.5%扩大至 8 月的 3.8%，国际原油、有色等大宗商品涨价的输入性因素叠加“反内卷”下的上游供给约束，煤炭、有色行业价格同比分别上涨 26.6%和 20.8%，对企业盈利形成支撑，1—8 月规模以上工业企业利润总额累计同比增长 15.7%。制造业 PMI 自 7 月 49.2%、8 月 49.8%连续回升，9 月升至 50.1%，重回扩张区间，企业景气与盈利预期同步改善。通胀温和回升，8 月 CPI 同比上涨 0.8%，核心 CPI 回升至 1.0%。投资端仍是主要拖累，1-8 月固定资产投资同比下降 7.2%，其中房地产开发投资下降 19.9%，地产调整延续，但二手房成交保持增长、房价降幅有所收窄。消费修复偏慢，1-8 月社会消费品零售总额同比增长 1.1%，8 月当月同比仅增长 0.4%，商品消费偏弱、服务消费相对较好。展望四季度，出口韧性（8 月进出口同比增长 19.8%）与价格修复仍是主要支撑，重点关注四季度重要会议对明年政策基调的定调及地产、消费领域增量政策落地。海外方面，美联储 9 月 16 日加息 25 个基点，利率目标区间升至 3.75%—4.00%，为 2023 年 7 月以来首次加息，10 年期美债收益率上行至 5%上方，海外流动性边际收紧。国内货币政策保持稳健，7 天逆回购利率维持在 1.40%不变，资金面整体平稳。三季度债市收益率整体下行、曲线平坦化：10 年期国债收益率由季初 1.73%下行约 5bp 至季末 1.68%，1 年期品种收益率上行约 10bp，1 年期 AAA 评级同业存单利率大体运行于 1.40%-1.50%区间，货币市场基金收益率保持平稳。

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，积极参与市场行情。组合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，适当提高了组合的剩余期限。总体来看，组合三季度保持了较好的流动性和较稳健的收益。

4.5 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 0.2643%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；B 类基金份额净值收益率为 0.3249%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%；D 类基金份额净值收益率为 0.3249%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	30,008,836,885.01	57.20
	其中：债券	30,008,836,885.01	57.20
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	13,955,200,350.41	26.60
	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	8,347,302,217.72	15.91
4	其他资产	153,373,766.53	0.29
5	合计	52,464,713,219.67	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	2.23	
	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	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	82
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	82
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余期限未超过 120 天。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	47.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	5.14	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	4.56	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	5.88	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-

5	120天（含）—397天（含）	36.69	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		99.91	-

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未超过 240 天。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	30,008,836,885.01	57.21
8	其他	-	-
9	合计	30,008,836,885.01	57.21
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

注：本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。上表所列示金额为按实际利率计算的账面价值。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比

					例（%）
1	112697615	26 南京银行 CD175	18,000,000	1,787,184,464.53	3.41
2	112604036	26 中国银行 CD036	10,000,000	995,615,812.26	1.90
3	112605224	26 建设银行 CD224	10,000,000	995,308,470.72	1.90
4	112616080	26 上海银行 CD080	10,000,000	991,582,212.96	1.89
5	112604032	26 中国银行 CD032	10,000,000	991,455,090.01	1.89
6	112698182	26 天津银行 CD135	9,000,000	899,536,234.24	1.72
7	112606106	26 交通银行 CD106	9,000,000	894,323,871.51	1.71
8	112606122	26 交通银行 CD122	8,000,000	794,702,120.44	1.52
9	112698184	26 天津银行 CD136	7,000,000	699,639,293.33	1.33
10	112606085	26 交通银行 CD085	7,000,000	698,850,491.56	1.33

注：本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。上表所列示金额为按实际利率计算的账面价值。

5.7“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 次
报告期内偏离度的最高值	0.0272%
报告期内偏离度的最低值	0.0105%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0155%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金目前投资工具的估值方法如下：

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

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

（3）基金持有的银行存款以本金列示，按实际协议利率逐日计提利息。

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

如有新增事项，按国家最新规定估值。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、中国人民银行的处罚。上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局的处罚。天津银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局天津监管局、中国人民银行天津市分行的处罚。中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局、中国人民银行的处罚。中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。

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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	98,770,632.88
3	应收利息	-

4	应收申购款	54,603,133.65
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	153,373,766.53

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	易方达天天发货币 A	易方达天天发货币 B	易方达天天发货币 D
报告期期初基金份额总额	351,841,759.91	50,385,520,299.72	1,325,409,857.72
报告期期间基金总申购份额	280,292,145.40	32,625,948,759.21	1,461,740,074.99
报告期期间基金总赎回份额	249,146,569.27	32,812,877,851.68	918,980,495.28
报告期期末基金份额总额	382,987,336.04	50,198,591,207.25	1,868,169,437.43

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	红利再投	-	443,180.71	-	-
合计			443,180.71	-	

注：基金管理人持有的份额类别的收益分配方式为红利再投资，本报告期的收益分配按日计算并列示在红利再投资项下汇总披露。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会准予易方达天天发货币市场基金注册的文件；

2.《易方达天天发货币市场基金基金合同》；

3.《易方达天天发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。

9.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 30 号 42 层。

9.3 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

二〇二六年十月二十七日