

广发天天红发起式货币市场基金

2017 年半年度报告

2017 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：广发银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年八月二十五日

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 债券回购融资情况.....	35
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	36
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.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	37
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	37
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	38
7.9 投资组合报告附注.....	38
8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
8.3 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.....	39

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	39
9 开放式基金份额变动	40
10 重大事件揭示	40
10.1 基金份额持有人大会决议	40
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	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	40
10.4 基金投资策略的改变	41
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	41
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	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	42
10.9 其他重大事件	42
11 影响投资者决策的其他重要信息	42
12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	43
12.3 查阅方式	43

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发天天红发起式货币市场基金	
基金简称	广发天天红	
基金主代码	000389	
交易代码	000389	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2013 年 10 月 22 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	广发银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,728,745,690.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发天天红货币 A	广发天天红货币 B
下属分级基金的交易代码	000389	002183
报告期末下属分级基金的份额总额	3,547,990,553.34 份	1,180,755,136.69 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将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，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于货币市场基金，长期风险收益水平低于股票型基金、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		广发基金管理有限公司	广发银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	戴辉
	联系电话	020-83936666	010-65169958
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	daihui@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95508

传真	020-89899158	020-65169555
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	广州市越秀区东风东路713号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市东城区东长安街甲2号
邮政编码	510308	510080
法定代表人	孙树明	杨明生

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、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33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（2017年1月1日至2017年6月30日）	
	广发天天红货币 A	广发天天红货币 B
本期已实现收益	63,405,692.88	83,068,445.97
本期利润	63,405,692.88	83,068,445.97
本期净值收益率	1.3868%	1.5078%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末（2017年6月30日）	
	广发天天红货币 A	广发天天红货币 B
期末基金资产净值	3,547,990,553.34	1,180,755,136.69
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（2017年6月30日）	
	广发天天红货币 A	广发天天红货币 B

累计净值收益率	15.1078%	4.6938%
---------	----------	---------

注：(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(3) 本基金利润分配按日结转份额。

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

1. 广发天天红货币 A:

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.2902%	0.0035%	0.0292%	0.0000%	0.2610%	0.0035%
过去三个月	0.7610%	0.0023%	0.0885%	0.0000%	0.6725%	0.0023%
过去六个月	1.3868%	0.0021%	0.1760%	0.0000%	1.2108%	0.0021%
过去一年	2.6905%	0.0018%	0.3549%	0.0000%	2.3356%	0.0018%
过去三年	10.7900%	0.0029%	1.0656%	0.0000%	9.7244%	0.0029%
自基金合同生效起至今	15.1078%	0.0037%	1.3106%	0.0000%	13.7972%	0.0037%

2. 广发天天红货币 B:

阶段	份额净值收益率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
过去一个月	0.3100%	0.0035%	0.0292%	0.0000%	0.2808%	0.0035%
过去三个月	0.8215%	0.0023%	0.0885%	0.0000%	0.7330%	0.0023%
过去六个月	1.5078%	0.0021%	0.1760%	0.0000%	1.3318%	0.0021%
过去一年	2.9376%	0.0018%	0.3549%	0.0000%	2.5827%	0.0018%
自基金合同生效起至今	4.6938%	0.0017%	0.5474%	0.0000%	4.1464%	0.0017%

注：业绩比较基准：人民币活期存款利率(税后)。

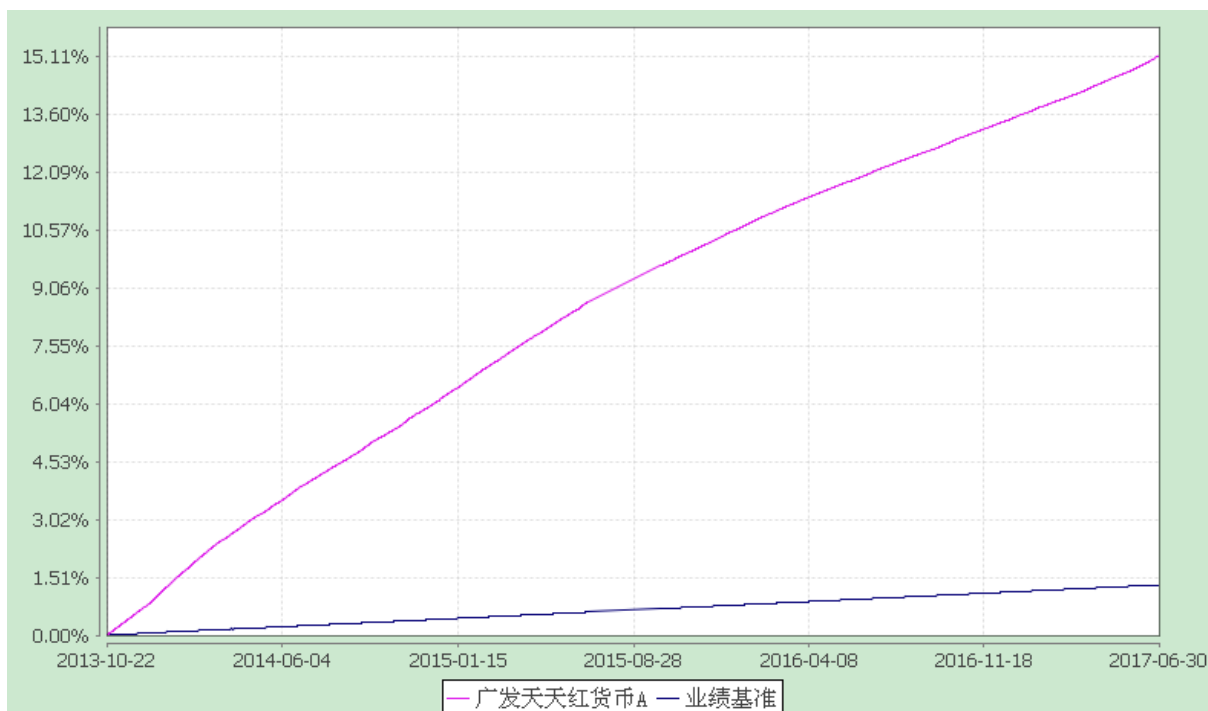
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发天天红发起式货币市场基金

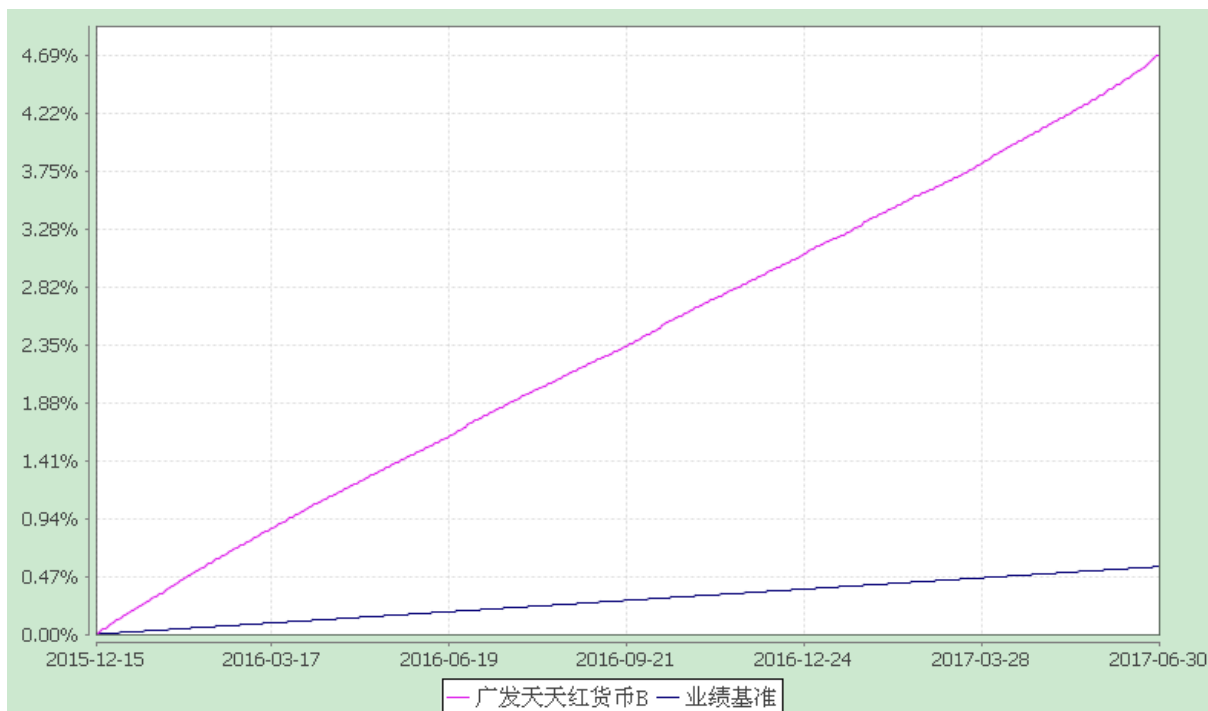
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 10 月 22 日至 2017 年 6 月 30 日)

广发天天红货币 A



广发天天红货币 B



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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 26 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百四十四只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发

起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新

机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、广发集富纯债债券型证券投资基金、广发集安债券型证券投资基金、广发集源债券型证券投资基金、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金、广发景源纯债债券型证券投资基金、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）、广发景祥纯债债券型证券投资基金、广发鑫瑞混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、广发多元新兴股票型证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金，管理资产规模为 2518 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
谭昌杰	本基金的 基金经 理；广发 理财年年	2013-10-22	-	9 年	男，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2008 年 7 月至 2012 年 7 月在广发基金管理有限公司固定收益部任

	<p>红债券基金的基金经理；广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理；广发聚安混合基金的基金经理；广发聚宝混合基金的基金经理；广发稳安保本基金的基金经理；广发安泽回报纯债基金的基金经理；广发鑫源混合基金的基金经理</p>			<p>研究员，2012 年 7 月 19 日起任广发理财年年红债券基金的基金经理，2012 年 9 月 20 日至 2015 年 5 月 26 日任广发双债添利债券基金的基金经理，2013 年 10 月 22 日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理，2014 年 1 月 10 日至 2015 年 7 月 23 日任广发钱袋子货币市场基金的基金经理，2014 年 1 月 27 日至 2015 年 5 月 26 日任广发集鑫债券型证券投资基金，2014 年 1 月 27 日至 2015 年 7 月 23 日任广发天天利货币市场基金的基金经理，2014 年 9 月 29 日至 2015 年 4 月 29 日任广发季季利债券基金的基金经理，2015 年 1 月 29 日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理，2015 年 3 月 25 日起任广发聚安混合基金的基金经理，2015 年 4 月 9 日起任广发聚宝混合基金的基金经理，2015 年 6 月 1 日至 2016 年 5 月 24 日任广发聚康混合基金的基金经理，2016 年 2 月 4 日起任广发稳安保本混合基金的基金经理，2016 年 6 月 17 日至 2016 年 11 月 17 日任广发安泽回报混合基金的基金经理，2016 年 11 月 2 日起任广发鑫源混合基金的基金经理，2016 年 11 月 18 日起任广发安泽纯债债券基金的基金经理。</p>
<p>任爽</p>	<p>本基金的基金经理；广发纯债债券基金的基金经理；广发理财 7 天债券基金的基金经理；广发天天利货币基金的基金</p>	<p>2013-10-22</p>	<p>-</p>	<p>9 年</p> <p>女，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2008 年 7 月至 2012 年 12 月在广发基金管理有限公司固定收益部兼任交易员和研究员，2012 年 12 月 12 日起任广发纯债债券基金的基金经理，2013 年 6 月 20 日起任广发理财 7 天债券基金的基金经理，2013 年 10 月 22 日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理，2014 年 1 月 27 日起任广发天天利货币市场基金的基金经理，2014 年 5 月 30 日起任广发钱</p>

	经理；广发钱袋子基金的基金经理；广发活期宝货币基金的基金经理；广发聚泰混合基金的基金经理；广发稳鑫保本基金的基金经理；广发鑫惠混合基金的基金经理；广发鑫益混合基金的基金经理；广发鑫利混合基金的基金经理；广发安盈混合基金的基金经理				袋子货币市场基金的基金经理，2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理，2015年6月8日起任广发聚泰混合基金的基金经理，2016年3月21日起任广发稳鑫保本基金的基金经理，2016年11月16日起任广发鑫益混合和广发鑫惠混合基金的基金经理，2016年12月2日起任广发鑫利混合基金的基金经理，2016年12月9日起任广发安盈混合基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1. “任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套法规、《广发天天红发起式货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

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

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

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

本报告期内，进出口、房地产以及基建投资带动宏观经济持续回暖，CPI 维持低位。金融监管是上半年资管行业的主基调，并于 4-5 月份达到高点。货币政策中性偏紧，6 月上半月资金利率大幅跳升后，央行大量投放短期回购，资金面平稳过半年。债券市场整体仍受金融去杠杆的政策压力，收益率受预期扰动比较明显，跟经济基本面的关联度不高。

本报告期内，本基金一直在通过变现资产以应对持续的赎回压力并获取更好的再投资收益，取得了一定的效果。在 6 月中旬的收益率高点增持了大额存单，力求获得较高的组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，天天红 A 净值增长率为 1.3868%，天天红 B 净值增长率为 1.5078%，同期业绩比较基准收益率为 0.176%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为进出口、房地产对经济的拉动还会继续，但下半年面临去库存的压力，经济增速会有所回落。同时，发达经济体的回暖会带来全球加息预期的升温，在金融去杠杆的大背景下，货币政策转向空间有限。我们认为在国内经济出现阶段性回落的背景下，下半年的债券市场能有一定的资本利得空间，但不要有太大的期待。由于受到明年外围发达经济体加息预期的影响，债券资产中长期的配置价值还有待观察。

本基金规模已经相对稳定，剩余期限较短，后续将着力抓住收益率高点的机会，积极提高再投资的收益，合理安排资产的到期结构，提高组合的静态收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金基金收益分配方式为红利再投资，每日分配，按日支付。本基金报告期内累计分配收益 146,474,138.85 元。

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，广发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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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：广发天天红发起式货币市场基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	968,783,726.91	10,221,965,554.39
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	3,025,495,467.06	19,193,053,654.16
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		3,025,495,467.06	19,193,053,654.16

资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	949,215,903.82	14,968,641,880.94
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	41,549,841.39	186,018,817.31
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,985,044,939.18	44,569,679,906.80
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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		234,599,682.70	1,060,388,090.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,093,946.02	8,011,310.92
应付托管费		202,582.62	1,483,576.10
应付销售服务费		763,275.30	1,641,097.20
应付交易费用	6.4.7.7	96,970.98	337,318.57
应交税费		-	-
应付利息		20,030.70	199,961.58
应付利润		459,946.35	3,226,335.90
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	19,062,814.48	349,000.00
负债合计		256,299,249.15	1,075,636,690.27
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	4,728,745,690.03	43,494,043,216.53
未分配利润	6.4.7.1 0	-	-
所有者权益合计		4,728,745,690.03	43,494,043,216.53
负债和所有者权益总计		4,985,044,939.18	44,569,679,906.80

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，广发天天红 A 基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 3,547,990,553.34 份；广发天天红 B 基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 1,180,755,136.69 份；总份额总额 4,728,745,690.03 份。

6.2 利润表

会计主体：广发天天红发起式货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		184,909,769.76	564,048,512.67
1. 利息收入		179,233,860.49	531,576,922.07
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	46,731,654.58	182,474,122.91
债券利息收入		105,158,307.09	231,775,497.74
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		27,343,898.82	117,327,301.42
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,675,909.27	32,471,590.60
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 2	5,675,909.27	32,471,590.60
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 3	-	-
股利收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 4	-	-
减：二、费用		38,435,630.91	82,639,796.12
1. 管理人报酬		14,630,544.78	44,183,573.93
2. 托管费		2,709,360.14	8,182,143.37
3. 销售服务费		6,149,022.78	19,921,521.45
4. 交易费用		-	1,200.00
5. 利息支出		14,738,464.11	10,143,472.97
其中：卖出回购金融资产支出		14,738,464.11	10,143,472.97
6. 其他费用	6.4.7.1 5	208,239.10	207,884.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		146,474,138.85	481,408,716.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		146,474,138.85	481,408,716.55

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发天天红发起式货币市场基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	43,494,043,216.53	-	43,494,043,216.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	146,474,138.85	146,474,138.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-38,765,297,526.50	-	-38,765,297,526.50
其中：1. 基金申购款	32,738,273,095.36	-	32,738,273,095.36
2. 基金赎回款	-71,503,570,621.86	-	-71,503,570,621.86
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-146,474,138.85	-146,474,138.85
五、期末所有者权益（基金净值）	4,728,745,690.03	-	4,728,745,690.03
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	26,832,965,246.53	-	26,832,965,246.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	481,408,716.55	481,408,716.55
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	358,613,892.04	-	358,613,892.04
其中：1. 基金申购款	57,746,481,506.95	-	57,746,481,506.95
2. 基金赎回款	-57,387,867,614.91	-	-57,387,867,614.91
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-481,408,716.55	-481,408,716.55
五、期末所有者权益（基金净值）	27,191,579,138.57	-	27,191,579,138.57

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：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发天天红发起式货币市场基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2013]1287号《关于核准广发天天红发起式货币市场基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发天天红发起式货币市场基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2013 年 10 月 22 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为广发银行股份有限公司。

本基金募集期为 2013 年 10 月 17 日至 2013 年 10 月 18 日，本基金为契约型开放式、发起式基金，存续期限不定。本基金募集资金总额为人民币 50,201,108.00 元，有效认购户数为 206 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 1,610.00 元，折合基金份额 1,610.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。作为本基金的发起资金，广发基金管理有限公司在 2013 年 10 月 17 日通过代销机构认购 10,000,000.00 元，认购费用 0.00 元，所认购本基金份额的持有期限不低于 3 年。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括现金、通知存款、短期融资券(包括超级短期融资券)、1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单、期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的资产支持证券、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的中期票据、期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”)、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金业绩比较基准为：活期存款利率(税后)。

本基金于 2015 年 12 月 15 日起实施分级，分为 A 级基金份额和 B 级基金份额，其中 B 类基金份额适用于首次申购申请达到或超过 2 亿元的投资者(追加申购最低金额为 1,000 万元)。自 2015 年 12 月 16 日起，B 类基金份额暂停单日单账户申购合计超过 2,000 万元(不含)的大额业务，如单日单个基金账户累计申购 B 类基金份额金额合计超过 2,000 万元(不含)，本基金注册登记人将有权确认相关业务失败。两类基金份额单独设置基金代码，收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率。

本基金的财务报表于 2017 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金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 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1. 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债券免征营业税或增值税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入、债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	18,783,726.91
定期存款	950,000,000.00
其中:存款期限 3-12 个月	950,000,000.00
其他存款	-
合计	968,783,726.91

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目		本期末 2017 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	3,025,495,467.06	3,031,747,000.00	6,251,532.94	0.1322
	合计	3,025,495,467.06	3,031,747,000.00	6,251,532.94	0.1322

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中: 买断式逆回购
交易所买入返售金融资产	-	-
银行间买入返售金融资产	949,215,903.82	-
合计	949,215,903.82	-

6.4.7.5 应收利息

单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,183.56
应收定期存款利息	1,720,555.60
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	38,752,514.53
应收买入返售证券利息	1,075,587.70
应收申购款利息	-
其他	-
合计	41,549,841.39

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	96,970.98
合计	96,970.98

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	197,439.10
其他	18,865,375.38
合计	19,062,814.48

6.4.7.9 实收基金

广发天天红货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	6,541,988,296.07	6,541,988,296.07
本期申购	21,686,749,734.29	21,686,749,734.29
本期赎回（以“-”号填列）	-24,680,747,477.02	-24,680,747,477.02
本期末	3,547,990,553.34	3,547,990,553.34

广发天天红货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	36,952,054,920.46	36,952,054,920.46
本期申购	11,051,523,361.07	11,051,523,361.07
本期赎回（以“-”号填列）	-46,822,823,144.84	-46,822,823,144.84
本期末	1,180,755,136.69	1,180,755,136.69

注：申购含转换转入、红利再投资、级别调整入份(金)额，赎回含转换转出、级别调整出份(金)额。

6.4.7.10 未分配利润

广发天天红货币 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
本期利润	63,405,692.88	-	63,405,692.88
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	-63,405,692.88	-	-63,405,692.88
本期末	-	-	-

广发天天红货币 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
本期利润	83,068,445.97	-	83,068,445.97
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	-83,068,445.97	-	-83,068,445.97
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	64,375.51
定期存款利息收入	46,657,963.73
其他存款利息收入	0.00
结算备付金利息收入	9,315.34
其他	-
合计	46,731,654.58

6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	18,775,816,677.12
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	18,540,601,976.59
减：应收利息总额	229,538,791.26
买卖债券差价收入	5,675,909.27

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.14 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	148,767.52
账户维护费	18,000.00
其他	1,800.00
合计	208,239.10

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要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

本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

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
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司
康美药业股份有限公司	基金管理人股东

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

本基金本报告期内及上年可比期间内无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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,630,544.78	44,183,573.93
其中：支付销售机构的客户维护费	2,976,453.83	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,709,360.14	8,182,143.37

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 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
	2017年1月1日至2017年6月30日

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发天天红货币 A	广发天天红货币 B	合计
广发基金管理有限公司	5,840,782.04	308,240.74	6,149,022.78
合计	5,840,782.04	308,240.74	6,149,022.78
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发天天红货币A	广发天天红货币B	合计
广发基金管理有限公司	19,046,971.72	874,549.73	19,921,521.45
合计	19,046,971.72	874,549.73	19,921,521.45

注：本基金的年销售服务费率为 0.25%，计算公式如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

本基金 A 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%。

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

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 2017年1月1日至2017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
广发银行股 份有限公司	-	-	-	-	534,500,000.00	69,144.24
上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
广发银行股 份有限公司	-	-	-	-	2,176,100,00 0.00	119,870. 16

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	广发天天红货币A	广发天天红货币B	广发天天红货币A	广发天天红货币B
基金合同生效日 (2013年10月22 日)持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份 额	-	1,262,940,167.2 6	10,013,279.82	805,805,037.00
期间申购/买入总份 额	-	11,516,875.51	142,286.12	685,557,916.18
期间因拆分变动份 额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出 总份额	-	617,000,000.00	-	880,000,000.00
期末持有的基金份 额	-	657,457,042.77	10,155,565.94	611,362,953.18
期末持有的基金份 额占基金总份额比 例	-	55.68%	0.09%	3.71%

注：申购份额含红利转投资份额。基金管理人本报告期内及上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

广发天天红货币 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发天天红货币 B

份额单位：份

关联方名称	广发天天红货币B本期末 2017年6月30日		广发天天红货币B上年度末 2016年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例

广发证券股份有限公司	-	-	1,817,153,254.43	4.92%
广发银行股份有限公司	-	-	2,000,346,365.65	5.41%

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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
广发银行股份有限公司	18,783,726.91	64,375.51	7,973,630.15	134,790.76

注：本基金的部分银行存款由基金托管人广发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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

1、广发天天红货币 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
63,515,221.85	-	-109,528.97	63,405,692 .88	-

2、广发天天红货币 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
85,725,306.55	-	-2,656,860.58	83,068,445 .97	-

6.4.12 期末（2017 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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而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

截至本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

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 2017 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 234,599,682.70 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
070225	07 国开 25	2017-07-03	100.65	965,000.00	97,127,250.00
160217	16 国开 17	2017-07-03	99.64	500,000.00	49,820,000.00
160314	16 进出 14	2017-07-03	99.52	400,000.00	39,808,000.00
179912	17 贴现国债 12	2017-07-03	99.37	500,000.00	49,685,000.00
合计				2,365,000.00	236,440,250.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 06 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

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，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

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 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
A-1	419,950,969.96	1,780,227,237.03

A-1 以下	-	-
未评级	2,585,413,221.87	17,301,503,529.64
合计	3,005,364,191.83	19,081,730,766.67

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券和同业存单。

6.4.13.2 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 2017年6月30日	上年末 2016年12月31日
AAA	20,131,275.23	111,322,887.49
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	20,131,275.23	111,322,887.49

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债和央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产均为银行间同业市场交易，未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有卖出回购金融资产款的合同约定到期日均为一年以内且计息，账面余额接近其未折现的合约到期现金流量。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）的合约无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形式等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

6.4.13.4 市场风险

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大的风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。

市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
----------------	------	------	------	-----	----

30 日					
资产					
银行存款	968,783,726.91	-	-	-	968,783,726.91
交易性金融资产	3,025,495,467.06	-	-	-	3,025,495,467.06
买入返售金融资产	949,215,903.82	-	-	-	949,215,903.82
应收利息	-	-	-	41,549,841.39	41,549,841.39
资产总计	4,943,495,097.79	-	-	41,549,841.39	4,985,044,939.18
负债					
卖出回购金融资产款	234,599,682.70	-	-	-	234,599,682.70
应付管理人报酬	-	-	-	1,093,946.02	1,093,946.02
应付托管费	-	-	-	202,582.62	202,582.62
应付销售服务费	-	-	-	763,275.30	763,275.30
应付交易费用	-	-	-	96,970.98	96,970.98
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00
应付利润	-	-	-	459,946.35	459,946.35
其他负债	-	-	-	19,062,814.48	19,062,814.48
应付利息	-	-	-	20,030.70	20,030.70
负债总计	234,599,682.70	-	-	21,699,566.45	256,299,249.15
利率敏感度缺口	4,708,895,415.09	-	-	19,850,274.94	4,728,745,690.03
上年度末 2016 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	10,221,965,554.39	-	-	-	10,221,965,554.39
交易性金融	19,193,053,654.	-	-	-	19,193,053,654.

资产	16				3,654.16
买入返售金 融资产	14,968,641,880.94				14,968,641,880.94
应收利息				186,018,817.31	186,018,817.31
资产总计	44,383,661,089.49			186,018,817.31	44,569,679,906.80
负债					
卖出回购金 融资产款	1,060,388,090.00			-	1,060,388,090.00
应付管理人 报酬				8,011,310.92	8,011,310.92
应付托管费				1,483,576.10	1,483,576.10
应付销售服 务费				1,641,097.20	1,641,097.20
应付交易费 用				337,318.57	337,318.57
应付证券清 算款				-	0.00
应付利润				3,226,335.90	3,226,335.90
其他负债				349,000.00	349,000.00
应付利息				199,961.58	199,961.58
负债总计	1,060,388,090.00			15,248,600.27	1,075,636,690.27
利率敏感度 缺口	43,323,272,999.49			170,770,217.04	43,494,043,216.53

注：上表按金融资产和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

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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-1,242,056.34	-17,225,210.60
	市场利率下降 25 个基点	1,242,056.34	17,264,021.96

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

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大市场价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1. 公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 3,025,495,467.06 元，无属于第一层级和第三层级的余额(2016 年 12 月 31 日：第二层级 19,193,053,654.16 元，无属于第一层级和第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

2. 除公允价值外，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	3,025,495,467.06	60.69
	其中：债券	3,025,495,467.06	60.69
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	949,215,903.82	19.04
	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	968,783,726.91	19.43
4	其他各项资产	41,549,841.39	0.83
5	合计	4,985,044,939.18	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	10.33	
	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	234,599,682.70	4.96
	其中：买断式回购融资	-	-

注：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日融资余额占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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2017-03-20	20.02	赎回被动超标	尽快调整
2	2017-04-07	21.80	赎回被动超标	尽快调整
3	2017-04-08	21.80	赎回被动超标	尽快调整
4	2017-04-09	21.80	赎回被动超标	尽快调整
5	2017-04-10	25.60	赎回被动超标	尽快调整

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	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	116
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

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	38.23	4.96
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	24.29	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	26.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	4.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	104.54	4.96

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

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,683,260.80	1.05

2	央行票据	-	-
3	金融债券	190,275,846.25	4.02
	其中：政策性金融债	190,275,846.25	4.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,889,803,378.85	39.96
6	中期票据	20,131,275.23	0.43
7	同业存单	875,601,705.93	18.52
8	其他	-	-
9	合计	3,025,495,467.06	63.98
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	011698719	16 振华 SCP001	2,000,000.00	199,988,270.65	4.23
2	111711211	17 平安银行 CD211	2,000,000.00	198,582,039.80	4.20
3	111709250	17 浦发银行 CD250	2,000,000.00	197,885,812.86	4.18
4	111604022	16 中行 CD022	1,800,000.00	177,570,985.15	3.76
5	011698937	16 兖州煤业 SCP008	1,600,000.00	159,982,885.89	3.38
6	011698793	16 鲁能源 SCP007	1,500,000.00	149,986,364.44	3.17
7	011698714	16 粤珠江 SCP004	1,300,000.00	129,992,377.65	2.75
8	011698711	16 兖州煤业 SCP006	1,200,000.00	119,992,973.72	2.54
9	011698709	16 现代投资 SCP002	1,100,000.00	109,994,574.82	2.33
10	070225	07 国开 25	1,000,000.00	100,650,847.00	2.13

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	39
报告期内偏离度的最高值	0.4799%
报告期内偏离度的最低值	-0.0518%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1652%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生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

本基金本报告期内未发生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所有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

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现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	应收证券清算款	-
3	应收利息	41,549,841.39
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	41,549,841.39

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
广发天 天红货 币 A	2,764,521	1,283.40	100,558,495.51	2.83%	3,447,432,057.83	97.17%
广发天 天红货 币 B	14	84,339,652.62	1,180,755,136.69	100.00%	0.00	0.00%
合计	2,764,535	1,710.50	1,281,313,632.20	27.10%	3,447,432,057.83	72.90%

8.2 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	广发天天红货 币 A	44.83	0.0000%
	广发天天红货 币 B	-	-
	合计	44.83	0.0000%

8.3 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	广发天天红货币 A	0~10
	广发天天红货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开 放式基金	广发天天红货币 A	0
	广发天天红货币 B	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份额	发起份额总 数	发起份额占 基金总份额	发起份额承 诺持有期限

		比例		比例	
基金管理人固有资金	657,457,042.77	13.90%	10,000,800.00	0.21%	三年
基金管理人高级管理人员	1.34	0.00%	-	-	-
基金经理等人员	10.36	0.00%	-	-	-
基金管理人股东	34,556.73	0.00%	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	657,491,611.20	13.90%	10,000,800.00	0.21%	三年

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发天天红货币 A	广发天天红货币 B
基金合同生效日(2013年10月22日)基金份额总额	50,201,108.00	-
本报告期期初基金份额总额	6,541,988,296.07	36,952,054,920.46
本报告期基金总申购份额	21,686,749,734.29	11,051,523,361.07
减：本报告期基金总赎回份额	24,680,747,477.02	46,822,823,144.84
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,547,990,553.34	1,180,755,136.69

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市

人民法院一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

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 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内本基金管理人和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

无

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170117-20170208	1,625,568,673.77	2,019,808,351.28	3,645,377,025.05	0.00	0.00%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发天天红发起式货币市场基金募集的文件；
2. 《广发天天红发起式货币市场基金合同》；
3. 《广发天天红发起式货币市场基金托管协议》；
4. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；
5. 《广发天天红发起式货币市场基金招募说明书》及其更新版；
6. 广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照；
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司
二〇一七年八月二十五日