

# 广发天天利货币市场基金

## 2019 年半年度报告

### 2019 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十八日

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
<b>5 托管人报告</b> .....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	14
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.....	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
<b>7 投资组合报告</b> .....	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
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	38
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
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	40
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	40
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	40

<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	41
<b>10</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	41
10.1	基金份额持有人大会决议.....	41
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.....	41
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	41
10.4	基金投资策略的改变.....	41
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	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.....	43
10.9	其他重大事件.....	43
<b>11</b>	<b>备查文件目录</b> .....	44
11.1	备查文件目录.....	44
11.2	存放地点.....	44
11.3	查阅方式.....	44

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发天天利货币市场基金		
基金简称	广发天天利货币		
基金主代码	000475		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2014 年 1 月 27 日		
基金管理人	广发基金管理有限公司		
基金托管人	中国银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	87,170,980,883.58 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	广发天天利货币 A	广发天天利货币 B	广发天天利货币 E
下属分级基金的交易代码	000475	000476	001134
报告期末下属分级基金的份额总额	1,005,879,756.56 份	2,135,941,865.85 份	84,029,159,261.1 7 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，力争为基金份额持有人创造稳定的、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	人民币活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金属于货币市场基金，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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邱春杨	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	qcy@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566

传真	020-89899158	010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1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	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	刘连舸

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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（2019年1月1日至2019年6月30日）		
	广发天天利货币 A	广发天天利货币 B	广发天天利货币 E
本期已实现收益	13,580,845.65	42,670,486.64	1,075,871,098.93
本期利润	13,580,845.65	42,670,486.64	1,075,871,098.93
本期净值收益率	1.2783%	1.3987%	1.2781%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2019年6月30日)		
	广发天天利货币 A	广发天天利货币 B	广发天天利货币 E
期末基金资产净值	1,005,879,756.56	2,135,941,865.85	84,029,159,261.17
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)		
	广发天天利货币	广发天天利货币	广发天天利货币

	A	B	E
累计净值收益率	20.5529%	22.1190%	14.7021%

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. 广发天天利货币 A:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1968%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.1680%	0.0005%
过去三个月	0.6094%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5221%	0.0004%
过去六个月	1.2783%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	1.1047%	0.0005%
过去一年	2.8087%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	2.4587%	0.0010%
过去三年	10.5481%	0.0021%	1.0500%	0.0000%	9.4981%	0.0021%
自基金合同生效起至今	20.5529%	0.0049%	1.8996%	0.0000%	18.6533%	0.0049%

##### 2. 广发天天利货币 B:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2166%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.1878%	0.0005%
过去三个月	0.6697%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5824%	0.0004%
过去六个月	1.3987%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	1.2251%	0.0005%
过去一年	3.0556%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	2.7056%	0.0010%
过去三年	11.3455%	0.0021%	1.0500%	0.0000%	10.2955%	0.0021%
自基金合同生效起至今	22.1190%	0.0049%	1.8996%	0.0000%	20.2194%	0.0049%

##### 3. 广发天天利货币 E:

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①-③	②-④

		②		准差④		
过去一个月	0.1968%	0.0005%	0.0288%	0.0000%	0.1680%	0.0005%
过去三个月	0.6095%	0.0004%	0.0873%	0.0000%	0.5222%	0.0004%
过去六个月	1.2781%	0.0005%	0.1736%	0.0000%	1.1045%	0.0005%
过去一年	2.8094%	0.0010%	0.3500%	0.0000%	2.4594%	0.0010%
过去三年	10.5522%	0.0021%	1.0500%	0.0000%	9.5022%	0.0021%
自基金合同生效起至今	14.7021%	0.0044%	1.4968%	0.0000%	13.2053%	0.0044%

注：业绩比较基准：人民币活期存款利率（税后）。

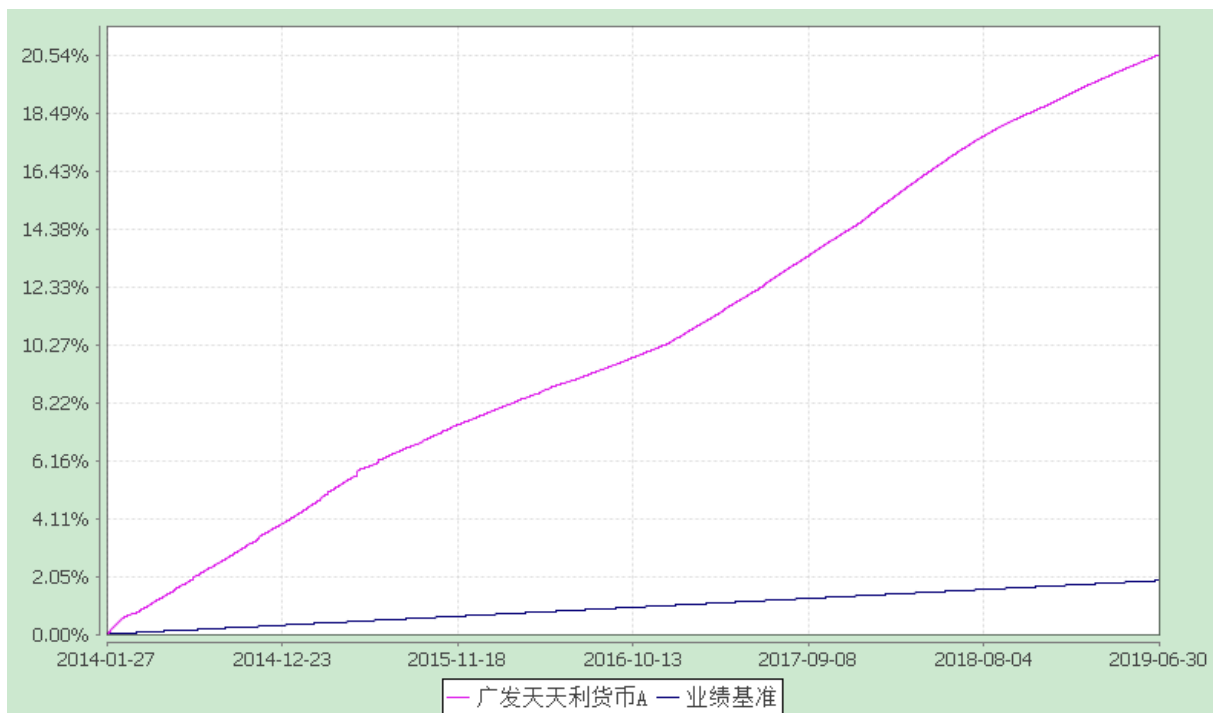
### 3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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

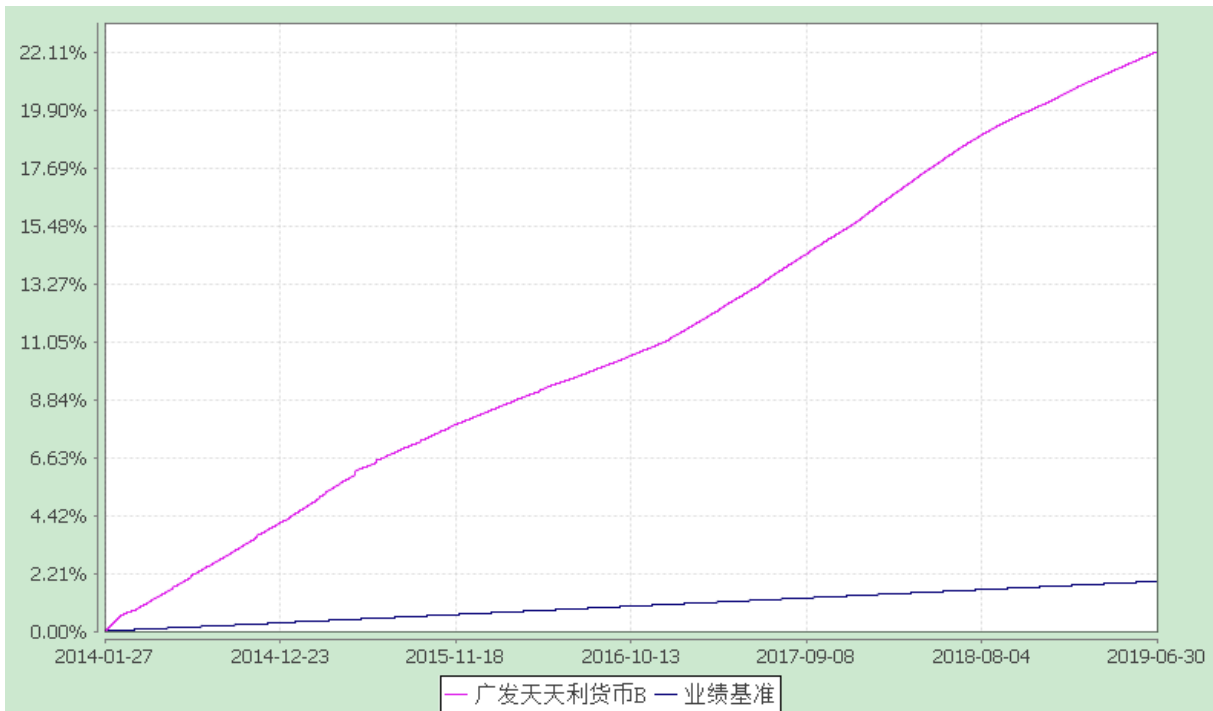
(2014 年 1 月 27 日至 2019 年 6 月 30 日)

广发天天利货币 A

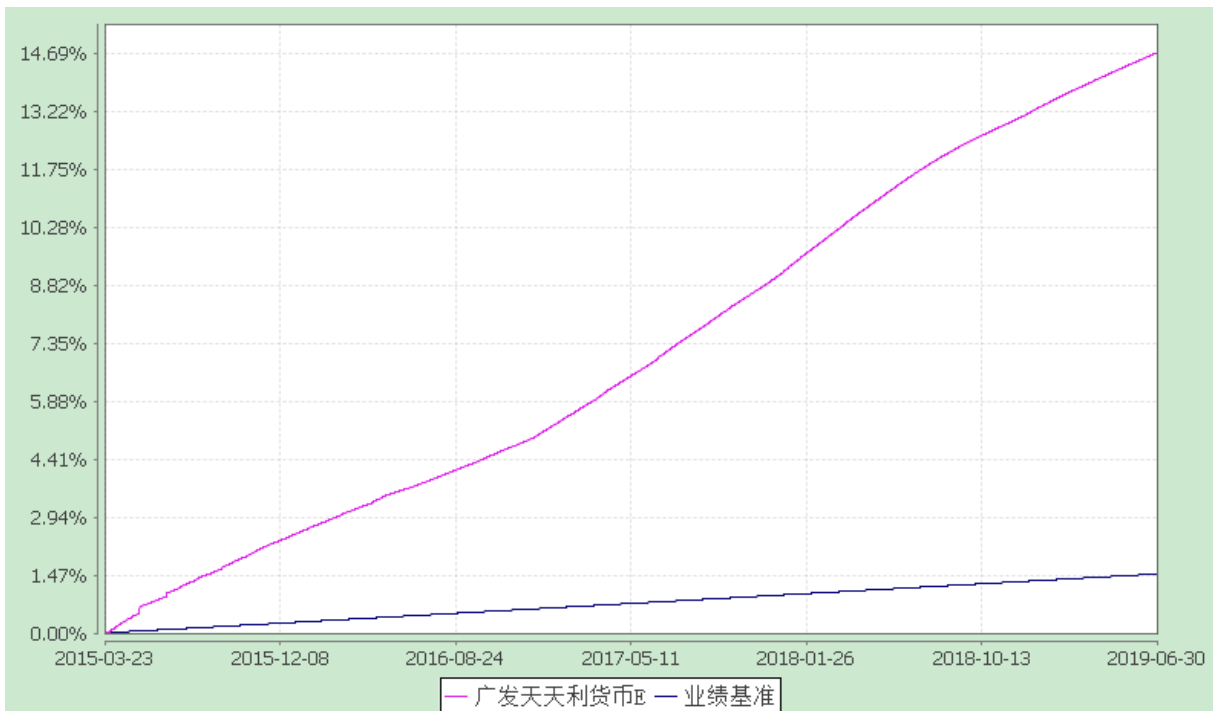


广发天天利货币 B





广发天天利货币 E



注：本基金于 2015 年 3 月 23 日增加 E 类份额。

## 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。公司拥有公募基金管理、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 32 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、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），参股了证通股份有限公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百九十只开放式基金，管理公募基金规模为 4452 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		
任爽	本基金的基金经理；广发理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理；广	2014-01-27	-	11 年	任爽女士，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部交易员兼任研究员、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 11 月 16 日至 2018 年 3 月 20 日)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金

	<p>发天天红发起式货币市场基金的基金经理；广发钱袋子货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的基金经理；广发聚泰混合型证券投资基金的基金经理；广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发安盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理</p>				<p>经理(自 2016 年 12 月 2 日至 2018 年 11 月 9 日)、广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2012 年 12 月 12 日至 2019 年 1 月 8 日)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 3 月 21 日至 2019 年 3 月 26 日)。</p>
--	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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《中华人民共和国证券投资基金法》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，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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现该组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

##### 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（完全复制指数组合及量化组合除外）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，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 4 次，均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。

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

上半年，与宏观经济走势相对应，货币市场利率先边际收敛，后逐月宽松。具体来看：

一季度，大部分时间里资金面相当宽松，但部分时间段资金面有所波动，包括 2 月末资金面超预期转紧、3 月中旬资金面面临临时点性的收紧压力等。新增的变化是，央行在解读金融数据时提到降准空间已经没有很大，结合总理此前提到的打击票据空转套利，市场担忧央行货币政策态度边际

变化。

随着 4 月降准预期落空，市场确认货币政策转入观察期，短期内流动性宽松不会进一步加码，引发债券市场一轮快速调整；但 5 月中美谈判波澜再起，央行盘前通过完善三档两优的框架对县域农商行定向降准，加上资金利率一度非常宽松，市场开始预期逆周期政策重新加码。但随后一季度货政报告定调确认、人民币汇率急贬至敏感关口，市场再度回归货币政策观察期、难以大幅宽松的一致预期。月底，部分银行的风险事件引发市场动荡，为切断风险扩散，央行一方面加量投放，另一方面通过多种结构性手段直接对接中小银行和非银。从 6 月的资金利率来看，结构性问题有所改善但幅度有限，流动性更多淤积在高信用机构市场，造成这些机构之间的回购利率异常走低。

本基金在报告期内操作仍以流动性和安全性为最重要考虑因素。虽然整体货币政策较为宽松，但是某些时间点，市场会出现突然的结构性紧张，因此本基金也一直较为注重现金流的合理安排。5 月底银行点状的风险事件引发了全市场对于金融机构信用风险的担忧，我们对于资产选择也更加的审慎，以求未来在更加稳健的基础上为投资者获取回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值收益率为 1.2783%，B 类基金份额净值收益率为 1.3987%，E 类基金份额净值收益率为 1.2781%，同期业绩比较基准收益率为 0.1736%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，预计宽松的货币政策将会得以延续，但货币市场收益已经处于近几年最低的位置，能否维持尚存疑问。未来需要进一步观察中美贸易摩擦以及国内经济下滑程度。而信用方面，信用扩张随着货币政策的宽松已经进行了将近一年的时间。在当前环境下，不同金融机构和不同资质企业主体的信用扩张能力差异很大，预计这种割裂和分化的情况仍会持续下去。在经济下滑期，信用风险的爆发预计也会持续下去。所以在此过程中，我们必须选择经过风险调整后性价比较高的资产进行配置。

#### 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、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理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、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。合规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 1,132,122,431.22 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**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发天天利货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

### **5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金净值收益率的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：广发天天利货币市场基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	29,295,626,081.60	40,791,917,570.71
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	32,931,740,966.14	30,845,691,921.68
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		32,931,740,966.14	30,845,691,921.68
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	25,310,819,270.95	9,812,779,279.16
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	246,843,530.61	207,721,356.04
应收股利		-	-
应收申购款		2,298,200.22	8,319,007.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>87,787,328,049.52</b>	<b>81,666,429,135.51</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
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		561,649,599.17	4,143,616,146.75

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		23,692,651.65	17,784,760.39
应付托管费		7,179,591.41	5,389,321.33
应付销售服务费		17,494,464.39	13,319,997.38
应付交易费用	6.4.7.7	526,401.26	342,223.30
应交税费		189,588.14	82,836.25
应付利息		64,105.79	2,477,557.91
应付利润		5,349,805.20	6,182,655.86
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	200,958.93	383,000.00
负债合计		616,347,165.94	4,189,578,499.17
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	87,170,980,883.58	77,476,850,636.34
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		87,170,980,883.58	77,476,850,636.34
负债和所有者权益总计		87,787,328,049.52	81,666,429,135.51

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日,广发天天利货币 A 基金份额净值人民币 1.0000 元,基金份额总额 1,005,879,756.56 份;广发天天利货币 B 基金份额净值人民币 1.0000 元,基金份额总额 2,135,941,865.85 份;广发天天利货币 E 基金份额净值人民币 1.0000 元,基金份额总额 84,029,159,261.17 份; 总份额总额 87,170,980,883.58 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发天天利货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>1,456,022,331.20</b>	<b>711,561,809.20</b>
1.利息收入		1,454,961,146.21	711,847,686.05
其中：存款利息收入	6.4.7.11	725,434,000.86	260,912,929.11
债券利息收入		442,993,356.40	353,001,506.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		286,533,788.95	97,933,250.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,061,184.99	-285,876.85
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-



债券投资收益	6.4.7.12	1,061,184.99	-285,876.85
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
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）	6.4.7.13	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>323,899,899.98</b>	<b>117,549,104.61</b>
1. 管理人报酬		145,414,629.38	46,620,834.09
2. 托管费		44,065,039.23	14,127,525.57
3. 销售服务费		106,530,183.73	31,893,525.46
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		27,677,503.31	24,614,633.38
其中：卖出回购金融资产支出		27,677,503.31	24,614,633.38
6. 税金及附加		34,354.89	30,939.61
7. 其他费用	6.4.7.15	178,189.44	261,646.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>1,132,122,431.22</b>	<b>594,012,704.59</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>1,132,122,431.22</b>	<b>594,012,704.59</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发天天利货币市场基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	77,476,850,636.34	-	77,476,850,636.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,132,122,431.22	1,132,122,431.22
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）	9,694,130,247.24	-	9,694,130,247.24
其中：1.基金申购款	504,045,971,771.73	-	504,045,971,771.73
2.基金赎回款	-494,351,841,524.49	-	-494,351,841,524.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变	-	-1,132,122,431.22	-1,132,122,431.22

动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	87,170,980,883.58	-	87,170,980,883.58
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	16,474,086,942.09	-	16,474,086,942.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	594,012,704.59	594,012,704.59
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）	15,594,679,171.56	-	15,594,679,171.56
其中：1.基金申购款	92,142,038,292.22	-	92,142,038,292.22
2.基金赎回款	-76,547,359,120.66	-	-76,547,359,120.66
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）	-	-594,012,704.59	-594,012,704.59
五、期末所有者权益（基金净值）	32,068,766,113.65	-	32,068,766,113.65

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

广发天天利货币市场基金（“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]1439 号文《关于核准广发天天利货币市场基金募集的批复》批准，由基金发起人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《广发天天利货币市场基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2014 年 1 月 27 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 1 月 8 日至 2014 年 1 月 21 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 4,006,249,659.16 元，有效认购户数为 9,187 户。其中广发天天利货币基金 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 3,876,530,705.09 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 213,424.07 元；广发天天利货币基金 B 类基金（“B 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 129,500,000.00 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 5,530.00 元。认

购资金在募集期间产生的利息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。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。

本基金自 2015 年 3 月 23 日起增设 E 类基金份额，并自该日起接受投资者对 E 类基金份额的申购。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 26 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为

销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	626,081.60
定期存款	29,295,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	8,490,000,000.00
存款期限 1-3 个月	20,605,000,000.00
存款期限 3 个月以上	200,000,000.00
其他存款	-
合计	29,295,626,081.60

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2019 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	32,931,740,966.14	32,946,765,600.00	15,024,633.86	0.0172
	合计	32,931,740,966.14	32,946,765,600.00	15,024,633.86	0.0172
资产支持证券		-	-	-	-
合计		32,931,740,966.14	32,946,765,600.00	15,024,633.86	0.0172

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 2019年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	10,623,500,000.00	-
银行间市场	14,687,319,270.95	-
合计	25,310,819,270.95	-

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	278.09
应收定期存款利息	116,834,260.37
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	110,867,222.21
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	19,141,769.94
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	246,843,530.61

#### 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 2019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	526,401.26
合计	526,401.26

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	200,958.93
合计	200,958.93

### 6.4.7.9 实收基金

#### 广发天天利货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	765,681,109.81	765,681,109.81
本期申购	2,123,848,301.57	2,123,848,301.57
本期赎回（以“-”号填列）	-1,883,649,654.82	-1,883,649,654.82
本期末	1,005,879,756.56	1,005,879,756.56

#### 广发天天利货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	300,015,931.91	300,015,931.91
本期申购	5,004,003,485.99	5,004,003,485.99
本期赎回（以“-”号填列）	-3,168,077,552.05	-3,168,077,552.05
本期末	2,135,941,865.85	2,135,941,865.85

#### 广发天天利货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	76,411,153,594.62	76,411,153,594.62
本期申购	496,918,119,984.17	496,918,119,984.17
本期赎回（以“-”号填列）	-489,300,114,317.62	-489,300,114,317.62
本期末	84,029,159,261.17	84,029,159,261.17

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
本期利润	13,580,845.65	-	13,580,845.65
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-13,580,845.65	-	-13,580,845.65
本期末	-	-	-

**广发天天利货币 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
本期利润	42,670,486.64	-	42,670,486.64
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	-42,670,486.64	-	-42,670,486.64
本期末	-	-	-

**广发天天利货币 E**

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	1,075,871,098.93	-	1,075,871,098.93
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	-1,075,871,098.93	-	-1,075,871,098.93
本期末	-	-	-

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	649,964.80
定期存款利息收入	724,599,675.87
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	184,360.19
其他	-
合计	725,434,000.86

**6.4.7.12 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	49,743,007,694.02
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	49,511,955,458.39



减：应收利息总额	229,991,050.64
买卖债券差价收入	1,061,184.99

#### 6.4.7.13 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.14 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	55,262.99
银行汇划费	67,630.51
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	178,189.44

#### 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
中国银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构

#### 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度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 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
广发证券股份有限公司	55,665,800,000.00	98.58%	-	-

### 6.4.10.1.4 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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	145,414,629.38	46,620,834.09
其中：支付销售机构的客户维护费	96,561,870.92	21,043,451.35

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.33% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.33\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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 2 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 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	44,065,039.23	14,127,525.57

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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 2 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 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	广发天天利货币 A	广发天天利货 币 B	广发天天利货币 E	合计
广发基金管理有限公司	40,736.02	147,084.37	5,361,777.79	5,549,598.18
中国银行股份有限公司	844,777.41	453.25	-	845,230.66
广发证券股份有限公司	33,509.39	420.22	-	33,929.61
合计	919,022.82	147,957.84	5,361,777.79	6,428,758.45
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	广发天天利货币 A	广发天天利货 币 B	广发天天利货币 E	合计
广发基金管理有限公司	55,355.59	116,870.01	30,672,731.34	30,844,956.94
中国银行股份有限公司	247,244.65	3,871.93	-	251,116.58
广发证券股份有限公司	60,432.56	3,276.91	-	63,709.47
合计	363,032.80	124,018.85	30,672,731.34	31,159,782.99

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。本基金 E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

三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

基金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 2 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 2019年1月1日至2019年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	10,308,259.86	-	-	-	20,186,502,00 0.00	1,466,650 .51
上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	30,473,094.03	653,576,64 6.93	-	-	9,870,399,000. 00	2,415,992 .03

### 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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

#### 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

##### 广发天天利货币 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。

##### 广发天天利货币 B

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。

##### 广发天天利货币 E

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。

### 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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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
中国银行股份有限公司	626,081.60	24,146,630.63	750,638,867.45	6,606,426.17

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国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、广发天天利货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
13,580,357.35	-	488.30	13,580,845.65	-

##### 2、广发天天利货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
42,551,607.51	-	118,879.13	42,670,486.64	-

##### 3、广发天天利货币 E

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
1,076,823,317.02	-	-952,218.09	1,075,871,098.93	-

#### 6.4.12 期末（2019 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 2019 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 2019 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 2019 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 561,649,599.17 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
090208	09 国开 08	2019-07-01	99.97	5,975,000.00	597,320,750.00
合计				5,975,000.00	597,320,750.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，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。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理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交易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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日

A-1	600,073,309.91	100,000,194.43
A-1 以下	-	122,121,075.98
未评级	32,190,579,611.91	3,931,425,449.19
合计	32,790,652,921.82	4,153,546,719.60

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。

#### 6.4.13.2.2 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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
AAA	22,320,199,319.81	23,375,397,956.01
AAA 以下	49,584,648.60	3,316,747,246.07
未评级	-	-
合计	22,369,783,968.41	26,692,145,202.08

注：短期同业存单评级取自第三方评级机构的发行主体信用评级。

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人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，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业

市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，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 2019年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,295,626,081.60	-	-	-	29,295,626,081.60
交易性金融资产	32,931,740,966.14	-	-	-	32,931,740,966.14
买入返售金融资产	25,310,819,270.95	-	-	-	25,310,819,270.95
应收利息	-	-	-	246,843,530.61	246,843,530.61
应收申购款	-	-	-	2,298,200.22	2,298,200.22
资产总计	87,538,186,318.69	-	-	249,141,730.83	87,787,328,049.52
负债					
卖出回购金融资产款	561,649,599.17	-	-	-	561,649,599.17
应付管理人报酬	-	-	-	23,692,651.65	23,692,651.65
应付托管费	-	-	-	7,179,591.41	7,179,591.41



应付销售服务费	-	-	-	17,494,464.39	17,494,464.39
应付交易费用	-	-	-	526,401.26	526,401.26
应交税费	-	-	-	189,588.14	189,588.14
应付利息	-	-	-	64,105.79	64,105.79
应付利润	-	-	-	5,349,805.20	5,349,805.20
其他负债	-	-	-	200,958.93	200,958.93
负债总计	561,649,599.17	-	-	54,697,566.77	616,347,165.94
利率敏感度缺口	86,976,536,719.52	-	-	194,444,164.06	87,170,980,883.58
上年度末 2018 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	40,791,917,570.71	-	-	-	40,791,917,570.71
交易性金融资产	30,845,691,921.68	-	-	-	30,845,691,921.68
买入返售金融资产	9,812,779,279.16	-	-	-	9,812,779,279.16
应收申购款	-	-	-	8,319,007.92	8,319,007.92
应收利息	-	-	-	207,721,356.04	207,721,356.04
资产总计	81,450,388,771.55	-	-	216,040,363.96	81,666,429,135.51
负债					
卖出回购金融资产款	4,143,616,146.75	-	-	-	4,143,616,146.75
应交税金	-	-	-	82,836.25	82,836.25
应付托管费	-	-	-	5,389,321.33	5,389,321.33
应付销售服务费	-	-	-	13,319,997.38	13,319,997.38
应付交易费用	-	-	-	342,223.30	342,223.30
应付利润	-	-	-	6,182,655.86	6,182,655.86
其他负债	-	-	-	383,000.00	383,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	17,784,760.39	17,784,760.39
应付利息	-	-	-	2,477,557.91	2,477,557.91
负债总计	4,143,616,146.75	-	-	45,962,352.42	4,189,578,499.17

利率敏感度 缺口	77,306,772,624.8 0	-	-	170,078,011.54	77,476,850,636.3 4
-------------	-----------------------	---	---	----------------	-----------------------

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-19,489,334.03	-21,371,441.41
市场利率下降 25 个基点	19,520,218.33	21,407,412.69	

#### 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。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，且以摊余成本计价，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

其他价格风险是指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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，且以摊余成本计价，因此无重大其他价格风险。

#### 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

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。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 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人民币 32,931,740,966.14 元，无属于第一层级和第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第二层级的余额为人民币 30,845,691,921.68 元，无属于第一层级和第三层级的金额）。

(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。

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	32,931,740,966.14	37.51
	其中：债券	32,931,740,966.14	37.51
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	25,310,819,270.95	28.83
	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	29,295,626,081.60	33.37
4	其他各项资产	249,141,730.83	0.28
5	合计	87,787,328,049.52	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	2.86	
	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	561,649,599.17	0.64
	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

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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	106
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

### 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	43.36	0.64
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.87	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	36.39	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	0.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	9.69	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

合计	100.42	0.64
----	--------	------

#### 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	3,477,704,491.19	3.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,812,822,386.48	4.37
	其中：政策性金融债	3,812,822,386.48	4.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,130,342,075.74	3.59
6	中期票据	141,088,044.32	0.16
7	同业存单	22,369,783,968.41	25.66
8	其他	-	-
9	合计	32,931,740,966.14	37.78
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	199925	19 贴现国债 25	20,000,000.00	1,990,039,776.21	2.28
2	111909153	19 浦发银行 CD153	15,000,000.00	1,493,080,493.13	1.71
3	111903076	19 农业银行 CD076	10,000,000.00	998,381,934.78	1.15
4	111915225	19 民生银行 CD225	10,000,000.00	994,056,210.90	1.14
5	111915245	19 民生银行 CD245	10,000,000.00	993,953,328.28	1.14
6	111915237	19 民生银行 CD237	10,000,000.00	993,811,905.65	1.14
7	111903071	19 农业银行 CD071	8,500,000.00	844,953,202.62	0.97
7	111905069	19 建设银行 CD069	8,500,000.00	844,953,202.62	0.97

7	111922009	19 邮储银行 CD009	8,500,000.00	844,953,202.62	0.97
8	111909174	19 浦发银行 CD174	8,500,000.00	844,947,779.25	0.97
8	111918184	19 华夏银行 CD184	8,500,000.00	844,947,779.25	0.97
9	111911091	19 平安银行 CD091	8,100,000.00	804,987,643.56	0.92
9	111918198	19 华夏银行 CD198	8,100,000.00	804,987,643.56	0.92
10	111906043	19 交通银行 CD043	8,100,000.00	801,580,570.22	0.92

### 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0599%
报告期内偏离度的最低值	0.0022%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0264%

#### 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中，上海浦东发展银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚；上海浦东发展银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、交通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。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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	246,843,530.61
4	应收申购款	2,298,200.22
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	249,141,730.83

## 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
广发天天利货币 A	71,131	14,141.23	14,952,581.35	1.49%	990,927,175.21	98.51%
广发天天利货币 B	15	142,396,124.39	2,073,878,211.79	97.09%	62,063,654.06	2.91%
广发天天利货币 E	16,284,149	5,160.18	0.00	0.00%	84,029,159,261.17	100.00%
合计	16,355,295	5,329.83	2,088,830,793.	2.40%	85,082,150,090	97.60%

			14		.44	
--	--	--	----	--	-----	--

### 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	1,518,322,349.85	1.74%
2	银行类机构	506,190,013.16	0.58%
3	保险类机构	25,948,527.05	0.03%
4	个人	20,646,660.88	0.02%
5	个人	15,764,759.47	0.02%
6	个人	12,170,816.51	0.01%
7	个人	11,389,436.71	0.01%
8	其他机构	10,297,194.55	0.01%
9	个人	8,061,763.41	0.01%
10	个人	7,895,616.13	0.01%

### 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	广发天天利货币 A	1,136,293.12	0.1130%
	广发天天利货币 B	0.00	0.0000%
	广发天天利货币 E	882.89	0.0000%
	合计	1,137,176.01	0.0013%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	广发天天利货币 A	>100
	广发天天利货币 B	0
	广发天天利货币 E	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发天天利货币 A	0
	广发天天利货币 B	0
	广发天天利货币 E	0
	合计	0



## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发天天利货币 A	广发天天利货币 B	广发天天利货币 E
基金合同生效日（2014 年 1 月 27 日）基金份额总额	3,876,744,129.16	129,505,530.00	-
本报告期期初基金份额总额	765,681,109.81	300,015,931.91	76,411,153,594.62
本报告期基金总申购份额	2,123,848,301.57	5,004,003,485.99	496,918,119,984.17
减：本报告期基金总赎回份额	1,883,649,654.82	3,168,077,552.05	489,300,114,317.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	1,005,879,756.56	2,135,941,865.85	84,029,159,261.17

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 4 日发布公告，自 2019 年 6 月 1 日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	----	------	-----------	----

	单元数量	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	
东莞证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	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。

### 10.7.2 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	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
东莞证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	800,000,000.00	1.42%	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	55,665,800,000.00	98.58%	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

### 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

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加晋中银行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-05
2	关于广发天天利货币市场基金 A/B 类份额端午节假期前暂停申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-04
3	关于增加和耕传承为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-16
4	关于增加汇林保大为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-08
5	关于广发天天利货币市场基金 A/B 类份额劳	中国证监会指定报刊及	2019-04-24

	动节假日前暂停申购业务的公告	网站	
6	关于增加德邦证券为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-12
7	关于广发天天利货币市场基金 A/B 类份额清明假期前暂停申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-01
8	关于调整旗下基金首次申购、追加申购及定期定额投资最低数额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-01
9	关于增加广州银行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-02-28
10	关于广发天天利货币市场基金 A/B 类份额春节假期前暂停申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-29
11	关于广发天天利货币市场基金 B 类份额恢复机构投资者申购业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-01-16

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会核准广发天天利货币市场基金募集的文件
2. 《广发天天利货币市场基金基金合同》
3. 《广发天天利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. 法律意见书
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照
8. 中国证监会要求的其他文件

### 11.2 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

### 11.3 查阅方式

1. 书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，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

二〇一九年八月二十八日