

广发天天利货币市场基金

2022 年中期报告

2022 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：二〇二二年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
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.....	13
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.....	13
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.....	14
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.....	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 债券回购融资情况.....	43
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	43
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.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	45
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.....	45
7.9 投资组合报告附注.....	45
8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	46

8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
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	47
9	开放式基金份额变动	47
10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4	基金投资策略的改变	48
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8	偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	50
10.9	其他重大事件	51
11	备查文件目录	51
11.1	备查文件目录	51
11.2	存放地点	51
11.3	查阅方式	51

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	110,155,885,092.15 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	791,391,070.30 份	242,540,832.67 份	109,121,953,189.18 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	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	95566
	电子邮箱	ccl@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环岛东路3018号2608室	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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（2022年1月1日至2022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	9,660,528.78	2,914,286.16	1,041,545,116.87
本期利润	9,660,528.78	2,914,286.16	1,041,545,116.87
本期净值收益率	0.9449%	1.0654%	0.9452%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022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	791,391,070.30	242,540,832.67	109,121,953,189.18
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)		
	广发天天利货币 A	广发天天利货币 B	广发天天利货币 E
累计净值收益率	28.1242%	30.7264%	21.9064%

注：（1）本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

（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，由于本基金采用实际利率法计算账面价值并用影子定价和偏离度加以控制的模式核算，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	0.1370%	0.0003%	0.0292%	0.0000%	0.1078%	0.0003%
过去三个月	0.4462%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.3577%	0.0005%
过去六个月	0.9449%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	0.7689%	0.0006%
过去一年	1.9449%	0.0005%	0.3549%	0.0000%	1.5900%	0.0005%
过去三年	6.2805%	0.0010%	1.0656%	0.0000%	5.2149%	0.0010%
自基金合同生效 起至今	28.1242%	0.0044%	2.9915%	0.0000%	25.1327%	0.0044%

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	0.1568%	0.0003%	0.0292%	0.0000%	0.1276%	0.0003%
过去三个月	0.5065%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.4180%	0.0005%
过去六个月	1.0654%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	0.8894%	0.0006%
过去一年	2.1899%	0.0005%	0.3549%	0.0000%	1.8350%	0.0005%
过去三年	7.0484%	0.0010%	1.0656%	0.0000%	5.9828%	0.0010%
自基金合同生效 起至今	30.7264%	0.0044%	2.9915%	0.0000%	27.7349%	0.0044%

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 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	0.1370%	0.0003%	0.0292%	0.0000%	0.1078%	0.0003%
过去三个月	0.4464%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.3579%	0.0005%
过去六个月	0.9452%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	0.7692%	0.0006%
过去一年	1.9449%	0.0005%	0.3549%	0.0000%	1.5900%	0.0005%
过去三年	6.2809%	0.0010%	1.0656%	0.0000%	5.2153%	0.0010%
自基金合同生效 起至今	21.9064%	0.0038%	2.5832%	0.0000%	19.3232%	0.0038%

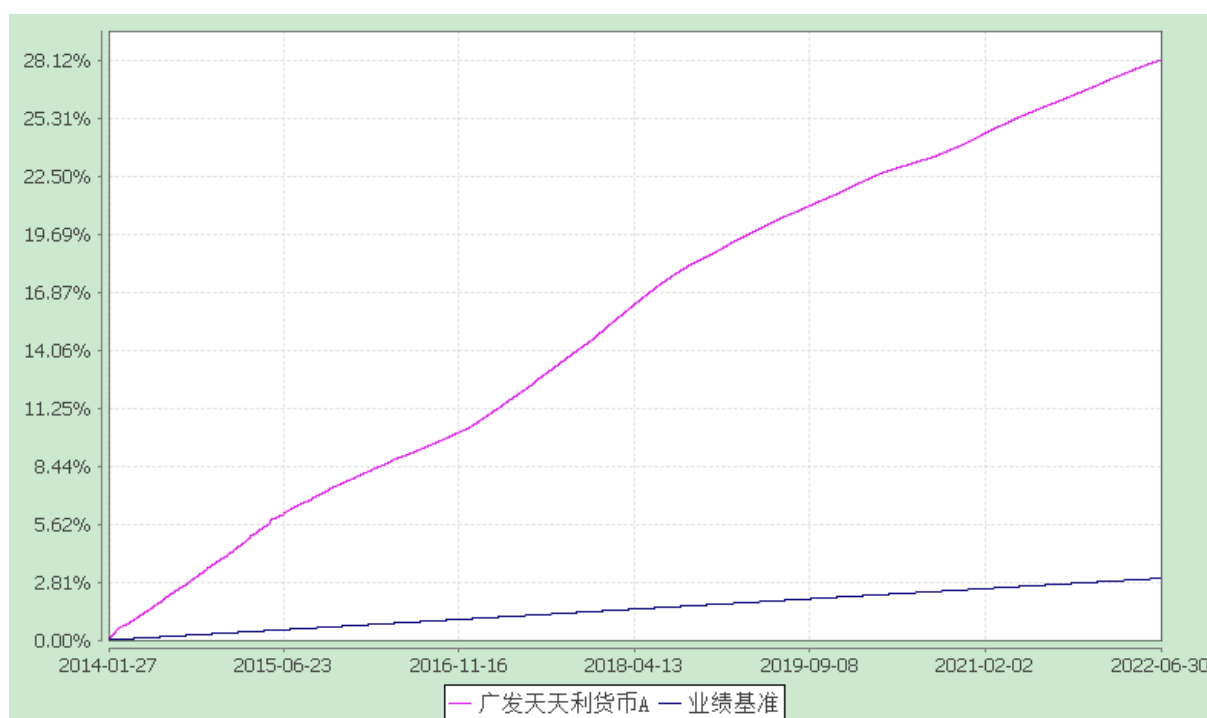
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发天天利货币市场基金

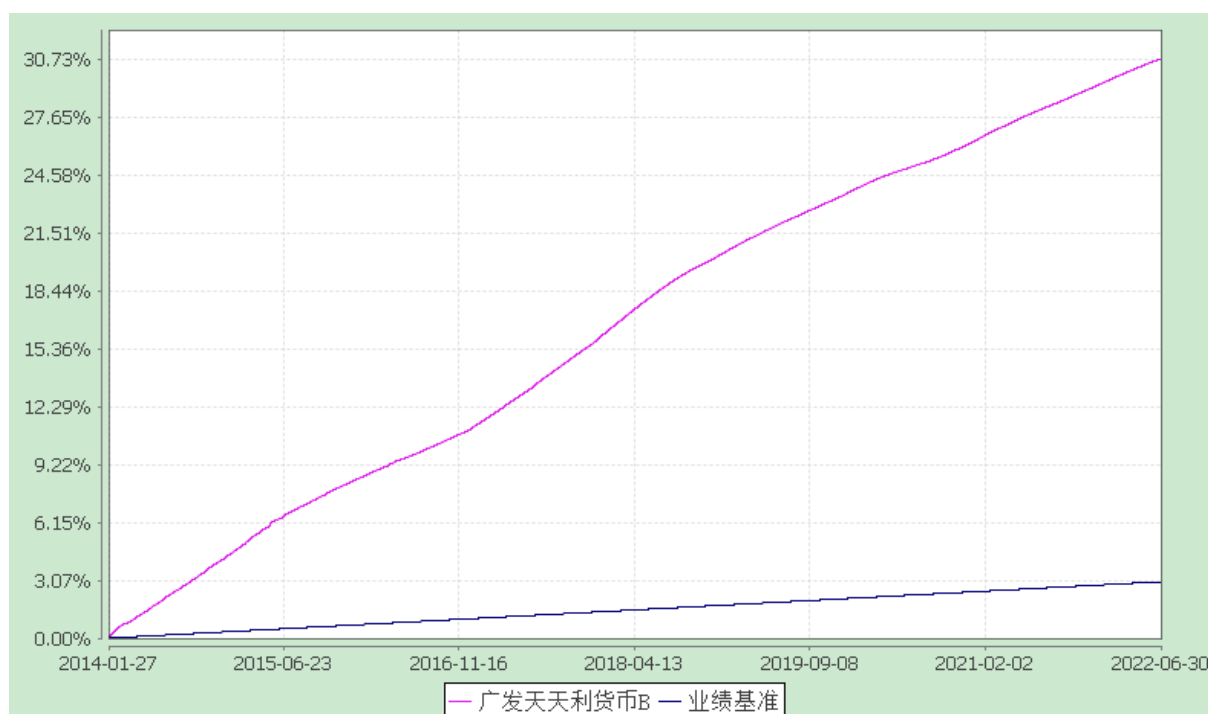
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 1 月 27 日至 2022 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

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[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、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、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、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

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；广发天天红发起式货币	2014-01-27	-	14 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

	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；现金指数投资部副总经理				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)、广发鑫益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 2019 年 10 月 29 日)、广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 27 日至 2019 年 10 月 29 日)、广发理财 7 天债券型证券投资基金基金经理(自 2013 年 6 月 20 日至 2020 年 4 月 21 日)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 12 月 9 日至 2020 年 5 月 28 日)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 8 日至 2020 年 7 月 1 日)、广发景宁纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 22 日至 2020 年 12 月 21 日)、广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 3 月 21 日至 2021 年 10 月 14 日)。
曾雪兰	本基金的基金经理；广发现金宝场内实时申赎货币市场基金的基金经理；广发景荣纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发添利交	2020-12-22	-	12 年	曾雪兰女士，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债券交易员、债券研究员、基金经理助理、广发集安债券型证券投资基金基金经理(自 2017 年 2 月 6 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发理财 30 天债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 7 月 22 日至 2020 年 9 月 24 日)。

	易型货币市场基金的基金经理				
周卓熙	本基金的基金经理；广发添利交易型货币市场基金的基金经理	2021-05-06	-	7 年	周卓熙先生，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管理总部债券交易员。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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

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，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，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。金融工程与风险管理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

本报告期内，本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% 的交易共有 17 次，其中 14 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 3 次为不同投资经理管理的组合间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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2022 年上半年，央行货币政策整体较为宽松，资金利率持续下行并维持在较低水平。央行在 2021 年 12 月金融数据发布会上的表态相对积极，提出了“避免信贷塌方”和各种政策工具尚有一定空间的说法，全力呵护经济基本面，并在 1 月 17 日分别调降 MLF 和 OMO 政策利率 10bp。4 月至 5 月，国内疫情反复，在此期间，央行在 4 月降准 25bp，并通过上缴利润、结构性货币政策工具等方式释放大量流动性；5 月份，央行单独调降五年 LPR，降幅 15bp，传递了稳增长信号，银行间流动性十分充裕，短端利率进一步下探。从海外情况来看，美国通胀维持在高位，美联储紧缩节奏加快，中国央行货币政策受到的外部约束增强，因此二季度央行并未调降 MLF 和 OMO 的政策利率。

报告期内，本组合仍以保持流动性为第一要务，在此基础上采取一些操作尽量增厚组合收益。

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 0.9449%，B 类基金份额净值收益率为 1.0654%，E 类基金份额净值收益率为 0.9452%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，受制于潜在通胀压力、海外货币政策继续紧缩等因素，央行进一步调降政策利率的空间有限。但是国内经济修复的过程仍需宽松资金面的支持，货币政策难以紧缩，货币市场利率也较难出现大幅上行。未来我们将会根据情况适时调整组合配置，争取在稳健的基础上继续为投资者获取良好的投资回报。

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 1,054,119,931.81 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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合规守信、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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	43,945,159,937.71	45,041,799,909.78
结算备付金		76,577,321.62	179,947,816.70
存出保证金		598,133.53	125,136.14
交易性金融资产	6.4.7.2	50,972,046,151.72	46,269,497,864.81
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		50,849,943,357.20	45,944,497,864.81
资产支持证券投资		122,102,794.52	325,000,000.00
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	23,656,026,461.13	24,226,350,151.86
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	833,911,013.14
应收股利		-	-
应收申购款		3,125,902.54	2,781,238.97
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	493,201,890.72
资产总计		118,653,533,908.25	117,047,615,022.12
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		8,428,619,165.96	6,383,619,354.39
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		30,257,911.59	31,009,200.35
应付托管费		9,169,064.13	9,396,727.38
应付销售服务费		22,813,674.07	23,448,919.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		611,402.54	729,428.21
应付利润		5,036,774.78	6,857,332.76
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	1,140,823.03	1,655,208.69
负债合计		8,497,648,816.10	6,456,716,171.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	110,155,885,092.15	110,590,898,850.63
未分配利润	6.4.7.9	-	-
净资产合计		110,155,885,092.15	110,590,898,850.63
负债和净资产总计		118,653,533,908.25	117,047,615,022.12

注：（1）报告截止日 2022 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 791,391,070.30 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 242,540,832.67 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 109,121,953,189.18 份；总份额总额 110,155,885,092.15 份。

（2）以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他

负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：广发天天利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,503,859,560.97	1,681,501,208.72
1.利息收入		847,757,640.52	1,626,577,470.02
其中：存款利息收入	6.4.7.10	605,735,306.87	635,030,872.55
债券利息收入		-	660,523,693.65
资产支持证券利息收入		-	37,694,652.87
买入返售金融资产收入		242,022,333.65	293,328,250.95
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		656,100,510.45	54,916,786.58
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	651,781,652.76	54,916,786.58
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	4,318,857.69	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.18	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	1,410.00	6,952.12
减：二、营业总支出		449,739,629.16	448,132,506.52
1. 管理人报酬		183,303,068.14	181,609,459.43
2. 托管费		55,546,384.27	55,033,169.57
3. 销售服务费		138,529,544.01	137,314,181.14
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		71,741,883.71	73,434,844.17
其中：卖出回购金融资产支出		71,741,883.71	73,434,844.17
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-

7. 税金及附加		433,769.41	549,981.45
8. 其他费用	6.4.7.21	184,979.62	190,870.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,054,119,931.81	1,233,368,702.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,054,119,931.81	1,233,368,702.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,054,119,931.81	1,233,368,702.20

注：以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发天天利货币市场基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	110,590,898,850.63	-	110,590,898,850.63
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	110,590,898,850.63	-	110,590,898,850.63
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-435,013,758.48	-	-435,013,758.48
（一）、综合收益总额	-	1,054,119,931.81	1,054,119,931.81
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-435,013,758.48	-	-435,013,758.48
其中：1.基金申购款	632,522,082,395.60	-	632,522,082,395.60
2.基金赎回款	-632,957,096,154.08	-	-632,957,096,154.08
（三）、本期向基	-	-1,054,119,931.81	-1,054,119,931.81

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）			
四、本期期末净资产（基金净值）	110,155,885,092.15	-	110,155,885,092.15
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	83,839,322,769.06	-	83,839,322,769.06
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	83,839,322,769.06	-	83,839,322,769.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	34,410,571,359.18	-	34,410,571,359.18
（一）、综合收益总额	-	1,233,368,702.20	1,233,368,702.20
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	34,410,571,359.18	-	34,410,571,359.18
其中：1.基金申购款	1,027,176,704,298.39	-	1,027,176,704,298.39
2.基金赎回款	-992,766,132,939.21	-	-992,766,132,939.21
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-1,233,368,702.20	-1,233,368,702.20
四、本期期末净资产（基金净值）	118,249,894,128.24	-	118,249,894,128.24

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 2022 年 8 月 25 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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

（2）金融负债分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单

项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

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

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

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

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

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

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

6.4.4.3 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

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

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

(4) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.5 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。

6.4.5.2 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

境内证券(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。

（5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	100,604,221.48
等于：本金	100,587,432.89
加：应计利息	16,788.59
定期存款	43,844,555,716.23
等于：本金	43,500,000,000.00
加：应计利息	344,555,716.23
其中：存款期限 1 个月以内	7,162,142,681.60
存款期限 1-3 个月	9,865,490,301.65
存款期限 3 个月以上	26,816,922,732.98
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	43,945,159,937.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	4,000,926,699.54	3,998,725,317.33	-2,201,382.21	-0.0020
	银行间市场	46,849,016,657.66	46,925,164,315.11	76,147,657.45	0.0691
	合计	50,849,943,357.20	50,923,889,632.44	73,946,275.24	0.0671
资产支持证券		122,102,794.52	122,450,794.52	348,000.00	0.0003
合计		50,972,046,151.72	51,046,340,426.96	74,294,275.24	0.0674

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

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,322,108,974.63	-
银行间市场	19,333,917,486.50	-
合计	23,656,026,461.13	-

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 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	961,619.72
其中：交易所市场	-
银行间市场	961,619.72
应付利息	-
预提费用	179,203.31
合计	1,140,823.03

6.4.7.8 实收基金

广发天天利货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,257,798,471.10	1,257,798,471.10
本期申购	222,360,250.19	222,360,250.19
本期赎回（以“-”号填列）	-688,767,650.99	-688,767,650.99
本期末	791,391,070.30	791,391,070.30

广发天天利货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	164,823,894.28	164,823,894.28
本期申购	1,228,616,097.95	1,228,616,097.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,150,899,159.56	-1,150,899,159.56
本期末	242,540,832.67	242,540,832.67

广发天天利货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	109,168,276,485.25	109,168,276,485.25
本期申购	631,071,106,047.46	631,071,106,047.46
本期赎回（以“-”号填列）	-631,117,429,343.53	-631,117,429,343.53
本期末	109,121,953,189.18	109,121,953,189.18

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。

6.4.7.9 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	9,660,528.78	-	9,660,528.78
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	-9,660,528.78	-	-9,660,528.78
本期末	0.00	-	0.00

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	2,914,286.16	-	2,914,286.16
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	-2,914,286.16	-	-2,914,286.16
本期末	0.00	-	0.00

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	1,041,545,116.87	-	1,041,545,116.87
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,041,545,116.87	-	-1,041,545,116.87
本期末	0.00	-	0.00

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	76,701.30
定期存款利息收入	604,473,786.10
其他存款利息收入	2,770.25
结算备付金利息收入	1,182,049.22
其他	-
合计	605,735,306.87

6.4.7.11 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	660,316,365.11
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-8,534,712.35
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	651,781,652.76

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	103,978,403,463.81
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	103,555,077,217.27
减：应计利息总额	431,860,958.89
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-8,534,712.35

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	4,318,857.69
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	4,318,857.69

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	207,993,849.86
减：卖出资产支持证券成本总额	205,000,000.00
减：应计利息总额	2,993,849.86
减：交易费用	-
资产支持证券投资收益	-

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	1,410.00
合计	1,410.00

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	审计费用	
信息披露费		59,507.37
证券出借违约金		-
银行汇划费		68,726.42
账户维护费		18,000.00
其他		2,049.89
合计		184,979.62

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
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	基金管理人控股股东、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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期债券

		券成交总 额的比例		成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	3,474,325,896.98	83.55%	4,387,343,901.95	90.53%

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	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	153,597,001,000.00	100.00%	196,811,200,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 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
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	183,303,068.14	181,609,459.43
其中：支付销售机构的客户维护费	91,414,321.15	90,541,898.49

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	55,546,384.27	55,033,169.57
----------------	---------------	---------------

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 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	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	20,223.84	8,131.80	628,885.01	657,240.65
中国银行股份有限公司	1,064,507.57	16.44	4.95	1,064,528.96
广发证券股份有限公司	8,520.78	-	-	8,520.78
合计	1,093,252.19	8,148.24	628,889.96	1,730,290.39
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	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	21,965.93	4,002.96	876,497.90	902,466.79
中国银行股份有限公司	521,512.29	-	-	521,512.29
广发证券股份有限公司	9,117.65	56.19	-	9,173.84
合计	552,595.87	4,059.15	876,497.90	1,433,152.92

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 2022年1月1日至2022年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	-	-	-	-	2,735,917,000.00	237,773.75
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	90,006,252.06	122,516,367.12	-	-	17,460,667,000.00	1,250,633.34

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 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除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发天天利货币 B

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发天天利货币 E

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	6,136,528,807.17	17,082,424.54	11,601,300,422.24	127,890,667.20

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。

6.4.10.7 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
9,702,330.04	-	-41,801.26	9,660,528.78	-

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
2,912,942.01	-	1,344.15	2,914,286.16	-

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
1,043,325,217.74	-	-1,780,100.87	1,041,545,116.87	-

6.4.12 期末（2022 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

截至本报告期末 2022 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 2022 年 6 月 30 日止，本基金未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 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 8,428,619,165.96 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
012280569	22 南电 SCP002	2022-07-01	100.61	500,000.00	50,302,983.60
012281071	22 深燃气 SCP001	2022-07-01	100.82	500,000.00	50,408,661.43
012281278	22 深圳水务 SCP001	2022-07-01	100.35	173,000.00	17,360,947.36
042100383	21 电网 CP010	2022-07-01	101.98	400,000.00	40,791,821.13
112103115	21 农业银行 CD115	2022-07-01	99.66	454,000.00	45,243,838.90
112105160	21 建设银行 CD160	2022-07-01	99.69	1,000,000.00	99,693,311.96
112107125	21 招商银行 CD125	2022-07-01	99.26	500,000.00	49,629,713.30
112108144	21 中信银行 CD144	2022-07-01	99.60	500,000.00	49,801,184.13
112109277	21 浦发银行 CD277	2022-07-01	99.29	1,687,000.00	167,499,905.29
112110381	21 兴业银行 CD381	2022-07-01	99.47	2,500,000.00	248,687,175.63
112117155	21 光大银行 CD155	2022-07-01	99.54	1,000,000.00	99,543,839.13
112117157	21 光大银行 CD157	2022-07-01	99.54	305,000.00	30,359,724.86
112117158	21 光大银行 CD158	2022-07-01	99.50	1,000,000.00	99,503,803.39
112118206	21 华夏银行 CD206	2022-07-01	99.69	1,000,000.00	99,693,297.17
112118210	21 华夏银行	2022-07-01	99.60	1,000,000.00	99,597,298.94

	CD210				
112118223	21 华夏银行 CD223	2022-07-01	99.54	2,000,000.00	199,087,816.66
112118246	21 华夏银行 CD246	2022-07-01	99.25	2,000,000.00	198,506,444.78
112207012	22 招商银行 CD012	2022-07-01	99.49	1,000,000.00	99,493,213.85
112220084	22 广发银行 CD084	2022-07-01	99.28	1,968,000.00	195,380,325.67
112295577	22 重庆银行 CD044	2022-07-01	98.69	330,000.00	32,566,286.50
112296209	22 北京农商 银行 CD099	2022-07-01	99.36	6,820,000.00	677,661,614.25
112299311	22 江苏江南 农村商业银行 CD050	2022-07-01	99.08	1,250,000.00	123,854,597.35
120242	12 国开 42	2022-07-01	103.92	1,500,000.00	155,875,361.22
170412	17 农发 12	2022-07-01	103.97	600,000.00	62,381,487.74
190214	19 国开 14	2022-07-01	102.40	500,000.00	51,201,134.13
1928037	19 交通银行 02	2022-07-01	102.13	4,000,000.00	408,516,227.94
210211	21 国开 11	2022-07-01	101.93	5,000,000.00	509,625,139.85
210306	21 进出 06	2022-07-01	101.87	2,079,000.00	211,778,419.00
2203676	22 进出 676	2022-07-01	99.77	2,910,000.00	290,326,586.29
2203678	22 进出 678	2022-07-01	99.68	5,700,000.00	568,150,229.40
2203679	22 进出 679	2022-07-01	99.64	6,000,000.00	597,834,666.83
227707	22 贴现国开 07	2022-07-01	99.70	1,000,000.00	99,698,448.08
227708	22 贴现国开 08	2022-07-01	99.69	4,100,000.00	408,731,161.91
227709	22 贴现国开 09	2022-07-01	99.64	5,000,000.00	498,193,749.87
229915	22 贴现国债 15	2022-07-01	99.92	4,600,000.00	459,609,287.20
229916	22 贴现国债 16	2022-07-01	99.88	4,839,000.00	483,334,990.58
229925	22 贴现国债 25	2022-07-01	99.67	1,573,000.00	156,783,307.76
229926	22 贴现国债 26	2022-07-01	99.65	400,000.00	39,859,598.80
120242	12 国开 42	2022-07-04	103.92	2,000,000.00	207,833,814.97
190214	19 国开 14	2022-07-04	102.40	1,000,000.00	102,402,268.26
210016	21 付息国债 16	2022-07-04	101.65	100,000.00	10,164,711.95

210306	21 进出 06	2022-07-04	101.87	521,000.00	53,071,936.65
2203674	22 进出 674	2022-07-04	99.82	1,000,000.00	99,819,079.27
2203676	22 进出 676	2022-07-04	99.77	1,990,000.00	198,539,486.84
227708	22 贴现国开 08	2022-07-04	99.69	900,000.00	89,721,474.57
227709	22 贴现国开 09	2022-07-04	99.64	2,000,000.00	199,277,499.95
229916	22 贴现国债 16	2022-07-04	99.88	161,000.00	16,081,201.38
229925	22 贴现国债 25	2022-07-04	99.67	927,000.00	92,395,503.05
112295577	22 重庆银行 CD044	2022-07-05	98.69	1,135,000.00	112,008,288.41
012281294	22 中石油 SCP001	2022-07-06	100.31	757,000.00	75,937,964.98
合计				90,179,000.00	9,033,820,832.16

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	1,331,252,677.51	1,210,447,315.32
A-1 以下	-	-
未评级	15,606,732,534.77	14,982,582,503.78
合计	16,937,985,212.28	16,193,029,819.10

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资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	-	205,000,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	205,000,000.00

注：1、资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

2、短期信用评级 A-1 所填列的资产支持证券均为 AAA 的短期资产支持证券，短期信用评级 A-1 以下所填列的资产支持证券均为 AAA 以下的短期资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
A-1	28,410,339,672.13	23,392,830,622.44
A-1 以下	-	1,456,292,307.62
未评级	-	-
合计	28,410,339,672.13	24,849,122,930.06

注：1、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。

2、短期同业存单 A-1 所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 的短期同业存单，短期同业存单 A-1 以下所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 以下的短期同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	4,901,381,117.89	3,119,724,189.83
AAA 以下	-	-
未评级	600,237,354.90	1,782,620,925.82
合计	5,501,618,472.79	4,902,345,115.65

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期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	122,102,794.52	120,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	122,102,794.52	120,000,000.00

注：资产支持证券评级取自第三方评级机构的优先级资产支持证券债项评级。

6.4.13.2.6 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，本基金所持大部分投资品种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资产。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 2022年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	43,945,159,937.71	-	-	-	43,945,159,937.71
结算备付金	76,577,321.62	-	-	-	76,577,321.62
存出保证金	598,133.53	-	-	-	598,133.53
交易性金融资产	50,972,046,151.72	-	-	-	50,972,046,151.72
买入返售金融资产	23,656,026,461.13	-	-	-	23,656,026,461.13
应收申购款	-	-	-	3,125,902.54	3,125,902.54
资产总计	118,650,408,005.71	-	-	3,125,902.54	118,653,533,908.25

负债					
卖出回购金 融资产款	8,428,619,165.96	-	-	-	8,428,619,165.96
应付管理人 报酬	-	-	-	30,257,911.59	30,257,911.59
应付托管费	-	-	-	9,169,064.13	9,169,064.13
应付销售服 务费	-	-	-	22,813,674.07	22,813,674.07
应交税费	-	-	-	611,402.54	611,402.54
应付利润	-	-	-	5,036,774.78	5,036,774.78
其他负债	-	-	-	1,140,823.03	1,140,823.03
负债总计	8,428,619,165.96	-	-	69,029,650.14	8,497,648,816.10
利率敏感度 缺口	110,221,788,839.7 5	-	-	-65,903,747.60	110,155,885,092.1 5
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,041,799,909.7 8	-	-	-	45,041,799,909.7 8
结算备付金	179,947,816.70	-	-	-	179,947,816.70
存出保证金	125,136.14	-	-	-	125,136.14
交易性金融 资产	46,269,497,864.8 1	-	-	-	46,269,497,864.8 1
买入返售金 融资产	24,226,350,151.8 6	-	-	-	24,226,350,151.8 6
应收证券清 算款	-	-	-	833,911,013.14	833,911,013.14
应收利息	-	-	-	493,201,890.72	493,201,890.72
应收申购款	-	-	-	2,781,238.97	2,781,238.97
资产总计	115,717,720,879.2 9	-	-	1,329,894,142.83	117,047,615,022.1 2
负债					
卖出回购金 融资产款	6,383,619,354.39	-	-	-	6,383,619,354.39
应付管理人 报酬	-	-	-	31,009,200.35	31,009,200.35
应付托管费	-	-	-	9,396,727.38	9,396,727.38
应付销售服 务费	-	-	-	23,448,919.71	23,448,919.71
应付交易费	-	-	-	992,005.15	992,005.15

用					
应交税费	-	-	-	729,428.21	729,428.21
应付利息	-	-	-	460,203.54	460,203.54
应付利润	-	-	-	6,857,332.76	6,857,332.76
其他负债	-	-	-	203,000.00	203,000.00
负债总计	6,383,619,354.39			73,096,817.10	6,456,716,171.49
利率敏感度 缺口	109,334,101,524. 90			-1,256,797,325.73	110,590,898,850.6 3

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-35,579,234.04	-31,517,417.09
市场利率下降 25 个基点	35,643,679.00	31,576,504.96	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。本基金主要投资于证券交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种和债券回购产品，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	50,972,046,151.72
第三层次	-
合计	50,972,046,151.72

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	50,972,046,151.72	42.96
	其中：债券	50,849,943,357.20	42.86
	资产支持证券	122,102,794.52	0.10
2	买入返售金融资产	23,656,026,461.13	19.94
	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	44,021,737,259.33	37.10
4	其他各项资产	3,724,036.07	0.00
5	合计	118,653,533,908.25	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	7.03	
	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	8,428,619,165.96	7.65
	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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	75

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	25.73	7.65
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	17.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	16.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	8.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

5	120 天（含）—397 天（含）	38.77	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	107.19	7.65

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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	1,258,228,600.72	1.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	6,816,725,669.15	6.19
	其中：政策性金融债	4,425,005,233.41	4.02
4	企业债券	4,000,926,699.54	3.63
5	企业短期融资券	10,200,126,246.15	9.26
6	中期票据	163,596,469.51	0.15
7	同业存单	28,410,339,672.13	25.79
8	其他	-	-
9	合计	50,849,943,357.20	46.16
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)	摊余成本	占基金资产净 值比例(%)
1	112216023	22 上海银行 CD023	20,000,000.00	1,994,445,550.51	1.81
2	112280935	22 中原银行 CD166	12,000,000.00	1,188,504,935.46	1.08
3	112220012	22 广发银行 CD012	10,000,000.00	997,239,104.64	0.91
4	112109248	21 浦发银行 CD248	10,000,000.00	996,203,856.27	0.90
5	112206092	22 交通银行 CD092	10,000,000.00	994,371,152.43	0.90
6	112220084	22 广发银行 CD084	10,000,000.00	992,786,207.67	0.90
7	112220085	22 广发银行 CD085	10,000,000.00	991,798,894.17	0.90
8	112292413	22 徽商银行 CD006	10,000,000.00	990,423,793.11	0.90

9	112218119	22 华夏银行 CD119	10,000,000.00	990,314,659.61	0.90
10	112296138	22 广东顺德农商行 CD044	10,000,000.00	985,540,794.86	0.89

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	0.0855%
报告期内偏离度的最低值	0.0301%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0574%

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前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	136701	至泰 3A1	1,200,000	122,102,794.52	0.11

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金按照实际利率法计算金融资产的账面价值，并使用影子定价和偏离度加以控制。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，广东顺德农村商业银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中原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或其派出机构的处罚。广东顺德农村商业银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、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或其分支行的处罚。

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	598,133.53
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	3,125,902.54
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	3,724,036.07

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	274,127	2,886.95	11,884,886.97	1.50%	779,506,183.33	98.50%
广发天天利货币 B	17	14,267,107.80	237,507,115.13	97.92%	5,033,717.54	2.08%
广发天天利货币 E	15,290,702	7,136.49	1.48	0.00%	109,121,953.18 7.70	100.00 %
合计	15,564,846	7,077.22	249,392,003.58	0.23%	109,906,493.08 8.57	99.77%

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	信托类机构	60,062,032.55	0.05%
2	个人	38,936,185.74	0.04%
3	保险类机构	27,781,672.51	0.03%
4	个人	26,665,920.84	0.02%
5	个人	21,623,296.65	0.02%
6	信托类机构	20,062,730.91	0.02%
7	信托类机构	20,042,116.14	0.02%
8	个人	17,828,693.39	0.02%
9	其他机构	16,966,254.12	0.02%
10	个人	16,944,927.16	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	广发天天利货币 A	5,020,316.98	0.6344%
	广发天天利货币 B	0.00	0.0000%
	广发天天利货币 E	630,004.57	0.0006%
	合计	5,650,321.55	0.0051%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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
	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）	3,876,744,129.16	129,505,530.00	-

日) 基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	1,257,798,471.10	164,823,894.28	109,168,276,485.25
本报告期基金总申购份额	222,360,250.19	1,228,616,097.95	631,071,106,047.46
减: 本报告期基金总赎回份额	688,767,650.99	1,150,899,159.56	631,117,429,343.53
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期末基金份额总额	791,391,070.30	242,540,832.67	109,121,953,189.18

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金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

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
西南证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (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、交易单元选择流程：

(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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	683,905,107.26	16.45%	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	3,474,325,896.98	83.55%	153,597,001,000.00	100.00%	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-

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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-03-30
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-04-21
4	关于面向特定投资者通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022-05-19

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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日