

广发天天红发起式货币市场基金  
2024 年年度报告  
2024 年 12 月 31 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

送出日期：二〇二五年三月二十九日

## §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 2025 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</b>          | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现                              | 8  |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 10 |
| <b>§4 管理人报告</b>                         | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 11 |
| 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                 | 13 |
| 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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17 |
| 4.9 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       | 17 |
| <b>§5 托管人报告</b>                         | 17 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17 |
| 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 | 17 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 17 |
| <b>§6 审计报告</b>                          | 17 |
| 6.1 审计意见                                | 17 |
| 6.2 形成审计意见的基础                           | 18 |
| 6.3 其他信息                                | 18 |
| 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任                     | 18 |
| 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任                     | 18 |
| <b>§7 年度财务报表</b>                        | 19 |
| 7.1 资产负债表                               | 19 |
| 7.2 利润表                                 | 21 |
| 7.3 净资产变动表                              | 23 |
| 7.4 报表附注                                | 24 |
| <b>§8 投资组合报告</b>                        | 52 |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 52 |
| 8.2 债券回购融资情况                            | 52 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限                        | 53 |

|      |                                            |    |
|------|--------------------------------------------|----|
| 8.4  | 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....          | 54 |
| 8.5  | 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                     | 54 |
| 8.6  | 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 ..... | 54 |
| 8.7  | “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 .....       | 55 |
| 8.8  | 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 .....    | 55 |
| 8.9  | 投资组合报告附注 .....                             | 55 |
| §9   | 基金份额持有人信息 .....                            | 56 |
| 9.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                    | 56 |
| 9.2  | 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....                   | 56 |
| 9.3  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                 | 57 |
| 9.4  | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....         | 57 |
| 9.5  | 发起式基金发起资金持有份额情况 .....                      | 57 |
| §10  | 开放式基金份额变动 .....                            | 58 |
| §11  | 重大事件揭示 .....                               | 58 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议 .....                          | 58 |
| 11.2 | 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 .....          | 58 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....               | 58 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变 .....                            | 58 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                     | 58 |
| 11.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....             | 58 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                    | 59 |
| 11.8 | 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....                     | 60 |
| 11.9 | 其他重大事件 .....                               | 60 |
| §12  | 备查文件目录 .....                               | 61 |
| 12.1 | 备查文件目录 .....                               | 61 |
| 12.2 | 存放地点 .....                                 | 61 |
| 12.3 | 查阅方式 .....                                 | 61 |

§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               |                     |
| 基金运作方式          | 契约型开放式               |                     |
| 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      | 187,273,494,786.55 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 A              | 广发天天红 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 | 149,175,018,239.37 份 | 38,098,476,547.18 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<br>负责人 | 姓名   | 项军                                                                       | 顾洪峰                        |
|             | 联系电话 | 020-83936666                                                             | 010-65169885               |
|             | 电子邮箱 | xiangj@gffunds.com.cn                                                    | guhongfeng@cgbchina.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 95105828                                                                 | 4008308003                 |
| 传真          |      | 020-34281105                                                             | 010-65169555               |
| 注册地址        |      | 广东省珠海市横琴新区环岛东<br>路3018号2608室                                             | 广东省广州市越秀区东风东路<br>713号      |
| 办公地址        |      | 广东省广州市海珠区琶洲大道<br>东1号保利国际广场南塔31-33<br>楼；广东省珠海市横琴新区环<br>岛东路3018号2603-2622室 | 北京市西城区金融大街十五号<br>鑫茂大厦北楼4层  |
| 邮政编码        |      | 510308                                                                   | 100032                     |
| 法定代表人       |      | 葛长伟                                                                      | 王凯                         |

## 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                          |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.gffunds.com.cn             |
| 基金年度报告备置地点          | 广东省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                                                         |
|--------|--------------------|--------------------------------------------------------------|
| 会计师事务所 | 安永华明会计师事务所（特殊普通合伙） | 中国 北京                                                        |
| 注册登记机构 | 广发基金管理有限公司         | 广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室 |

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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 | 2024 年             |                   | 2023 年             |                   | 2022 年            |                   |
|---------------|--------------------|-------------------|--------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
|               | 广发天天红 A            | 广发天天红 B           | 广发天天红 A            | 广发天天红 B           | 广发天天红 A           | 广发天天红 B           |
| 本期已实现收益       | 2,377,358,298.53   | 790,906,960.84    | 1,766,308,923.54   | 1,348,523,684.25  | 283,501,635.74    | 1,793,312,186.28  |
| 本期利润          | 2,377,358,298.53   | 790,906,960.84    | 1,766,308,923.54   | 1,348,523,684.25  | 283,501,635.74    | 1,793,312,186.28  |
| 本期净值收益率       | 1.6685%            | 1.9127%           | 1.9103%            | 2.1545%           | 1.8600%           | 2.1036%           |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2024 年末            |                   | 2023 年末            |                   | 2022 年末           |                   |
|               | 广发天天红 A            | 广发天天红 B           | 广发天天红 A            | 广发天天红 B           | 广发天天红 A           | 广发天天红 B           |
| 期末基金资产净值      | 149,175,018,239.37 | 38,098,476,547.18 | 130,879,201,339.48 | 37,139,185,401.74 | 44,228,027,021.17 | 62,014,984,319.57 |
| 期末基金份额净值      | 1.0000             | 1.0000            | 1.0000             | 1.0000            | 1.0000            | 1.0000            |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2024 年末            |                   | 2023 年末            |                   | 2022 年末           |                   |
|               | 广发天天红 A            | 广发天天红 B           | 广发天天红 A            | 广发天天红 B           | 广发天天红 A           | 广发天天红 B           |
| 累计净值收益率       | 37.7947%           | 27.6037%          | 35.5333%           | 25.2088%          | 32.9927%          | 22.5681%          |

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

广发天天红 A:

| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③      | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.3632%      | 0.0002%             | 0.0894%        | 0.0000%               | 0.2738%  | 0.0002% |
| 过去六个月          | 0.7443%      | 0.0003%             | 0.1789%        | 0.0000%               | 0.5654%  | 0.0003% |
| 过去一年           | 1.6685%      | 0.0007%             | 0.3558%        | 0.0000%               | 1.3127%  | 0.0007% |
| 过去三年           | 5.5378%      | 0.0007%             | 1.0656%        | 0.0000%               | 4.4722%  | 0.0007% |
| 过去五年           | 10.2217%     | 0.0010%             | 1.7762%        | 0.0000%               | 8.4455%  | 0.0010% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 37.7947%     | 0.0035%             | 3.9754%        | 0.0000%               | 33.8193% | 0.0035% |

广发天天红 B:

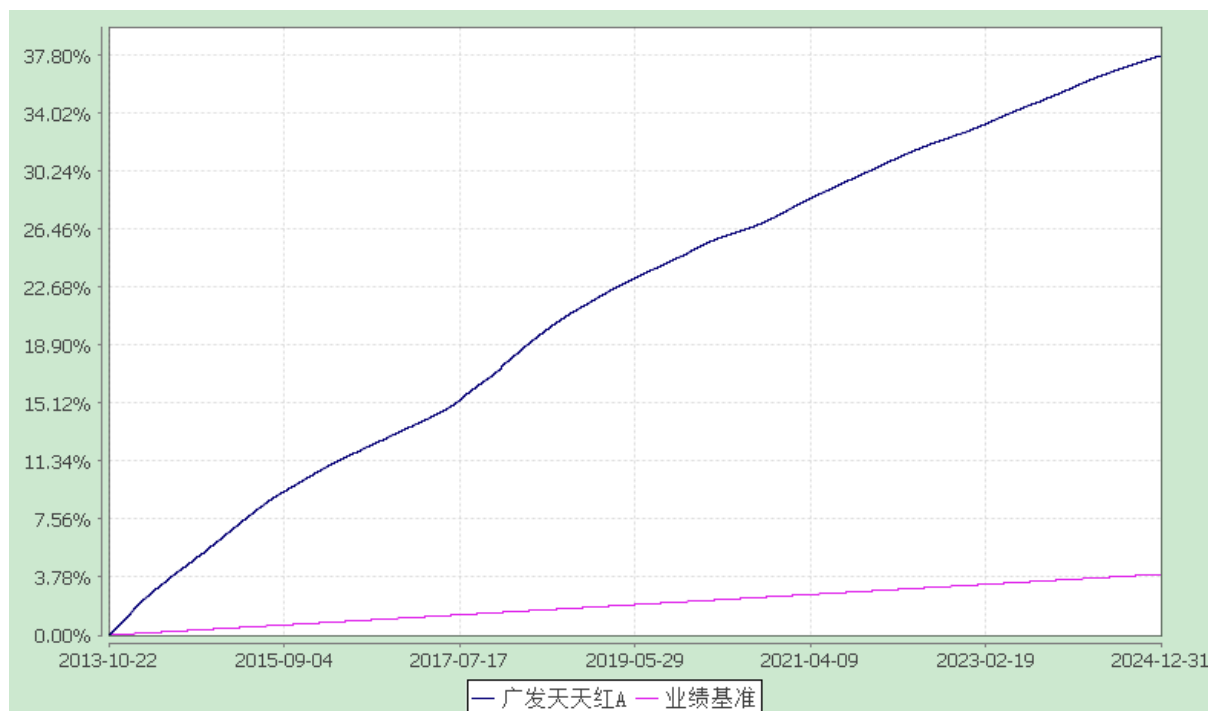
| 阶段             | 份额净值收<br>益率① | 份额净值收<br>益率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③      | ②-④     |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|----------|---------|
| 过去三个月          | 0.4238%      | 0.0002%             | 0.0894%        | 0.0000%               | 0.3344%  | 0.0002% |
| 过去六个月          | 0.8659%      | 0.0003%             | 0.1789%        | 0.0000%               | 0.6870%  | 0.0003% |
| 过去一年           | 1.9127%      | 0.0007%             | 0.3558%        | 0.0000%               | 1.5569%  | 0.0007% |
| 过去三年           | 6.2984%      | 0.0007%             | 1.0656%        | 0.0000%               | 5.2328%  | 0.0007% |
| 过去五年           | 11.5503%     | 0.0010%             | 1.7762%        | 0.0000%               | 9.7741%  | 0.0010% |
| 自基金合同生效<br>起至今 | 27.6037%     | 0.0025%             | 3.2132%        | 0.0000%               | 24.3905% | 0.0025% |

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

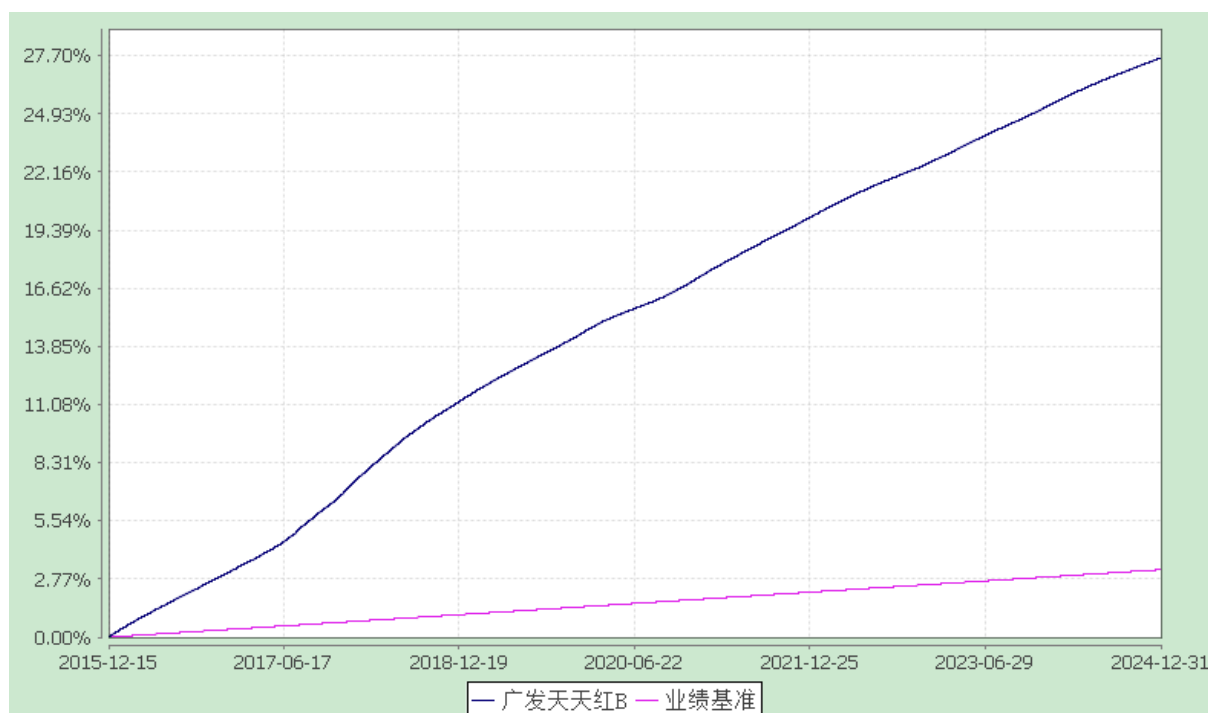
广发天天红发起式货币市场基金

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 2024 年 12 月 31 日)

广发天天红 A



### 广发天天红 B

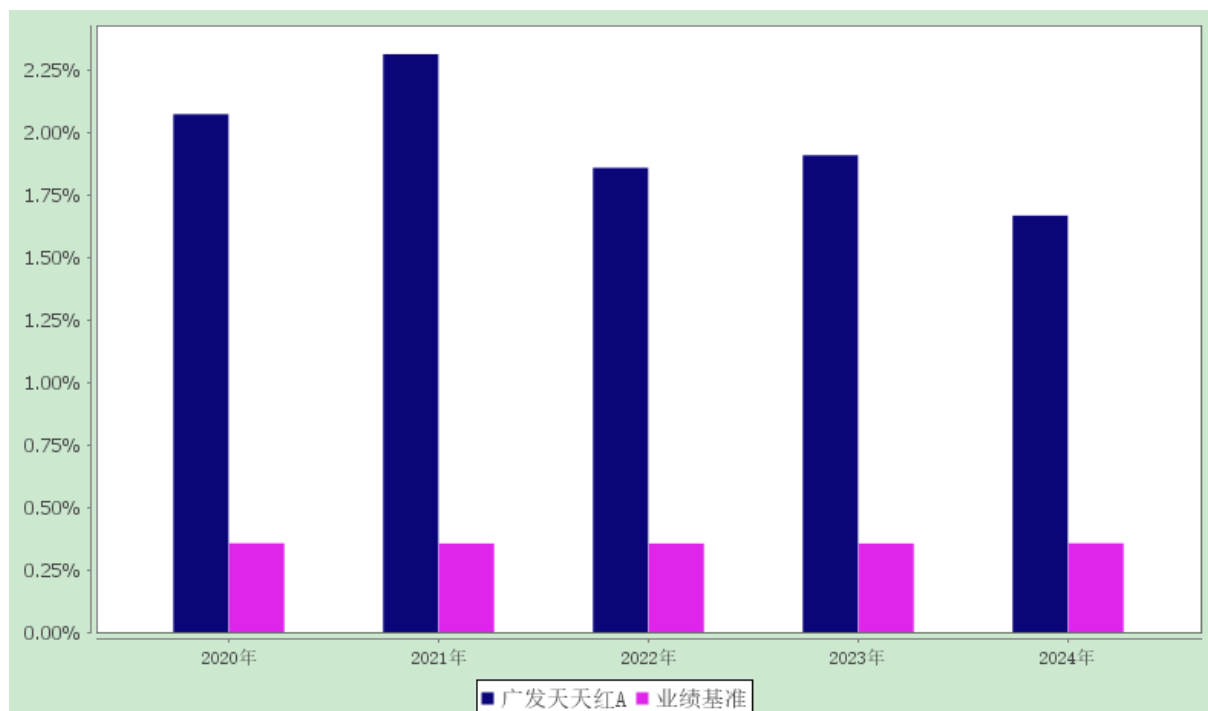


### 3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

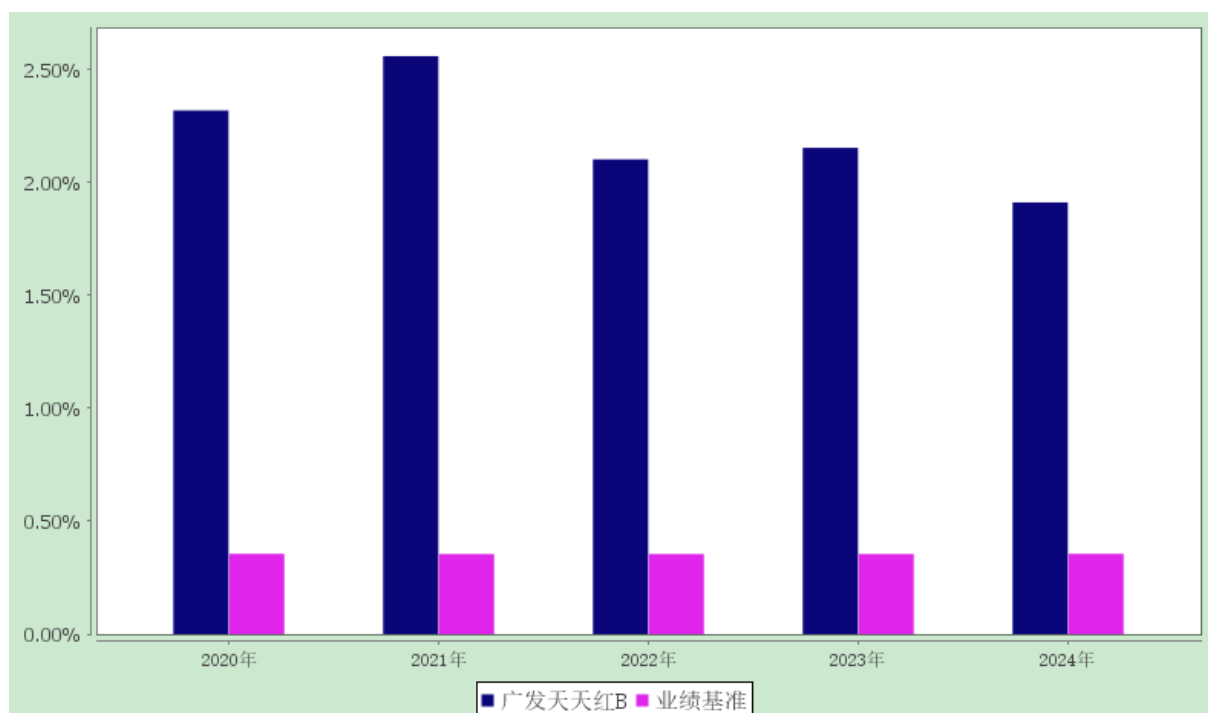
广发天天红发起式货币市场基金

过去五年基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 广发天天红 A



### 广发天天红 B



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

广发天天红 A:

单位：人民币元

| 年度 | 已按再投资<br>形式转实收<br>基金 | 直接通过应付赎<br>回款转出金额 | 应付利润本年变动 | 年度利润分配合<br>计 | 备注 |
|----|----------------------|-------------------|----------|--------------|----|
|    |                      |                   |          |              |    |

|        |                  |   |               |                  |   |
|--------|------------------|---|---------------|------------------|---|
| 2024 年 | 2,379,830,138.77 | - | -2,471,840.24 | 2,377,358,298.53 | - |
| 2023 年 | 1,760,911,574.56 | - | 5,397,348.98  | 1,766,308,923.54 | - |
| 2022 年 | 280,898,708.04   | - | 2,602,927.70  | 283,501,635.74   | - |
| 合计     | 4,421,640,421.37 | - | 5,528,436.44  | 4,427,168,857.81 | - |

广发天天红 B:

单位：人民币元

| 年度     | 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      | 年度利润分配合计         | 备注 |
|--------|------------------|---------------|---------------|------------------|----|
| 2024 年 | 791,766,749.64   | -             | -859,788.80   | 790,906,960.84   | -  |
| 2023 年 | 1,350,235,187.52 | -             | -1,711,503.27 | 1,348,523,684.25 | -  |
| 2022 年 | 1,793,169,623.33 | -             | 142,562.95    | 1,793,312,186.28 | -  |
| 合计     | 3,935,171,560.49 | -             | -2,428,729.12 | 3,932,742,831.37 | -  |

## §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、QDLP 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|------|--------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 温秀娟 | 本基金的基金经理；广发货币市场基金的基金经理；广发现金宝场内实时申赎货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的基金经理；广发添利交易型货币市场基金的基金经理；广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理；固定收益投资总监、兼任现金指数投资部总经理 | 2017-10-31 | -    | 24.5 年 | 温秀娟女士，中国籍，经济学学士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理、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)、广发理财 30 天债券型证券投资基金基金经理(自 2013 年 1 月 14 日至 2020 年 9 月 24 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)、广发中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 12 月 12 日至 2024 年 12 月 30 日)。                                                                |
| 任爽  | 本基金的基金经理；广发天天利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；现金指数投资部副总经理                                                                   | 2013-10-22 | -    | 16.5 年 | 任爽女士，中国籍，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)。 |
| 周卓熙 | 本基金的基金经理；广发天天利货币市场基金的基金经理；广发添利交易型货币市场基金的基金经理；广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理 | 2022-08-16 | - | 9.3 年 | 周卓熙先生，中国籍，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.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

#### 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 公平交易制度和控制方法

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。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；对于不同投资组合间的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

#### 4.3.2 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。在本年度本基金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专项分析中，未发现存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内本基金未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

#### 4.3.3 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 33 次，其中 32 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 1 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

2024 年，债券利率整体下行，下行幅度和斜率较 2023 年有所扩大，资金宽松主线贯穿全年。以一年期 AAA 存单利率为表征看，收益从年初的 2.45% 左右阶梯式下行至年底的 1.6% 附近，表现亮眼。从趋势看，全年可大致分为三个阶段：1 月至 8 月，短券利率持续下行，主要驱动因素在于国内经济新旧动能转换、信用收缩和货币政策宽松、存款手工补息被规范等，一年期 AAA 存单利率也一路下行至 1.85% 附近，较年初下行约 60BP。随后，资金面波动，主要因素包括政府债券缴款量较大、债券市场波动等，存单利率小幅回弹至 1.95%，但央行随后加大公开市场投放，并在 9 月宣布降息 20bp，同时下调存款准备金率 0.5%，反映央行对流动性的态度仍然偏呵护，且市场对货币政策宽松预期继续发酵，存单利率重新下行。4 季度，尽管财政发力升温对市场略有影响，但由于央行宣布启用公开市场买断式逆回购操作工具，并在 12 月调整货币政策基调至“适度宽松”，并发布《关于优化非银同业存款利率自律管理的倡议》，使得市场对短端宽松的预期进一步加强，存单收益也继续下行，最终落到 1.6% 附近的水平。

报告期内，本组合作为现金管理工具，密切跟踪经济基本面、货币政策等方面的变化，主动调节组合久期、杠杆和资产类别，在收益率高点进行集中配置，增强操作的灵活性。

#### 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 1.6685%，B 类基金份额净值收益率为 1.9127%，同期业绩比较基准收益率为 0.3558%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，财政政策更加积极后，经济发展的韧性和活力有望加强，但物价和经济弹性的修复仍然需要时间，预期央行仍将维持“适度宽松”的货币政策基调。同时，银行基于净息差压力在发行端也对存单利率有所把控，短端资产或将整体走强。因此，2025 年大概率仍处于流动性宽松的偏强市场中，尤其是在社融和物价明显回升之前。但操作节奏上需要关注财政发力、信用周期企稳、供需关系等具体因素，组合操作要求更加灵活。未来组合将继续跟踪经济基本面、货币政策以及监管政策等方面的变化，根据市场变化灵活调节组合，严控信用和利率风险，争取抓住市场机会，争取为投资人带来理想的回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本年度，公司继续严格遵循“合规、诚信、专业、稳健”的证券基金行业文化核心理念，稳步推进各项监察稽核工作。主要工作情况如下：

（一）扎实推进各项重要监管规定贯彻落实，通过邀请外部律师解读、制定专项工作方案、明

确工作流程、制定工作指引及建立系统监测等，确保新规全面内化。

（二）持续强化内部监督检查，聚焦重大监管政策变化和重点工作部署开展专项检查，对境外投资、投资者适当性、网下打新、子公司治理等多项重要业务及内部治理领域开展了专项检查，进一步规范内部管理。

（三）多措并举完善合规管理工作机制，推进制度体系建设，细化内部管理要求；强化合规培训宣导，持续完善合规培训课程库，不断提高培训专业性、针对性和有效性；改进合规考核工作，进一步优化考核方案和流程。

（四）聚焦员工日常行为管理，从制度建设、培训、检查、考核、问责等多个维度全面优化长效管理机制，从严从实加强员工言行管理，促进全员规范执业。

（五）持续加强投资合规行为日常监控，大力推进统一风险监控平台建设，提升信息化管理水平，完善对合规风险的闭环监控，实现对投资组合更精细化的风险管理。

（六）进一步完善公司信息技术合规管理，引进培养信息技术审计专业人才，聘请外部机构开展信息技术全面审计，将信息技术内部检查工作做细做深。

（七）进一步优化洗钱风险管理组织架构，扎实做好客户尽职调查、可疑交易报送和名单监测等工作，积极配合监管机构开展形式丰富的反洗钱宣传工作，持续推动反洗钱系统优化升级，探索提升反洗钱工作质效的有效路径。

（八）持续做好基金宣传推介材料的审核，坚持贯彻基金销售相关法规和监管要求，加强对自媒体账号、对外言论发布、网络直播等领域的合规管理，加大投资者教育和保护力度。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、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投资品种的估值数据。

#### 4.8 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，定期支付。本基金报告期内累计分配收益 3,168,265,259.37 元。

#### 4.9 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，广发银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发天天红发起式货币市场基金（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，不存在任何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方面进行了必要的监督，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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 审计报告

安永华明（2025）审字第 70009676\_G12 号

广发天天红发起式货币市场基金全体基金份额持有人：

#### 6.1 审计意见

我们审计了广发天天红发起式货币市场基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，

2024 年度的利润表和净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的广发天天红发起式货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了广发天天红发起式货币市场基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发天天红发起式货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

广发天天红发起式货币市场基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

广发天天红发起式货币市场基金管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估广发天天红发起式货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督广发天天红发起式货币市场基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在

某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发天天红发起式货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发天天红发起式货币市场基金不能持续经营。

（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

冯所腾 何明智

中国 北京

2025 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日         | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                 |                                  |
| 货币资金          | 7.4.7.1    | 61,170,139,144.77               | 89,767,931,028.36                |
| 结算备付金         |            | 27,929,278.63                   | 16,377,076.17                    |
| 存出保证金         |            | -                               | -                                |
| 交易性金融资产       | 7.4.7.2    | 82,690,332,716.22               | 62,745,818,829.38                |
| 其中：股票投资       |            | -                               | -                                |
| 基金投资          |            | -                               | -                                |
| 债券投资          |            | 82,690,332,716.22               | 62,745,818,829.38                |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 贵金属投资         |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 衍生金融资产        | 7.4.7.3    | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产      | 7.4.7.4    | 50,179,619,678.82               | 21,896,819,513.29                |
| 债权投资          | 7.4.7.5    | -                               | -                                |
| 其中：债券投资       |            | -                               | -                                |
| 资产支持证券投资      |            | -                               | -                                |
| 其他投资          |            | -                               | -                                |
| 应收清算款         |            | 478,041.12                      | 9,479.13                         |
| 应收股利          |            | -                               | -                                |
| 应收申购款         |            | 61,153,238.73                   | 40,924,513.04                    |
| 递延所得税资产       |            | -                               | -                                |
| 其他资产          | 7.4.7.6    | -                               | -                                |
| 资产总计          |            | 194,129,652,098.29              | 174,467,880,439.37               |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2024 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2023 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                 |                                  |
| 短期借款          |            | -                               | -                                |

|           |         |                    |                    |
|-----------|---------|--------------------|--------------------|
| 交易性金融负债   |         | -                  | -                  |
| 衍生金融负债    | 7.4.7.3 | -                  | -                  |
| 卖出回购金融资产款 |         | 6,765,744,509.51   | 6,361,405,827.85   |
| 应付清算款     |         | -                  | -                  |
| 应付赎回款     |         | -                  | -                  |
| 应付管理人报酬   |         | 42,480,620.28      | 40,210,997.67      |
| 应付托管费     |         | 7,866,781.52       | 7,446,481.04       |
| 应付销售服务费   |         | 31,080,842.08      | 28,220,402.80      |
| 应付投资顾问费   |         | -                  | -                  |
| 应交税费      |         | 107,670.93         | 104,570.65         |
| 应付利润      |         | 7,376,380.55       | 10,708,009.59      |
| 递延所得税负债   |         | -                  | -                  |
| 其他负债      | 7.4.7.7 | 1,500,506.87       | 1,397,408.55       |
| 负债合计      |         | 6,856,157,311.74   | 6,449,493,698.15   |
| 净资产：      |         |                    |                    |
| 实收基金      | 7.4.7.8 | 187,273,494,786.55 | 168,018,386,741.22 |
| 未分配利润     | 7.4.7.9 | -                  | -                  |
| 净资产合计     |         | 187,273,494,786.55 | 168,018,386,741.22 |
| 负债和净资产总计  |         | 194,129,652,098.29 | 174,467,880,439.37 |

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 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 149,175,018,239.37 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 38,098,476,547.18 份；总份额总额 187,273,494,786.55 份。

7.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注<br>号 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 12 月 31 日 |
|-----|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
|-----|---------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|

|                       |          |                  |                  |
|-----------------------|----------|------------------|------------------|
| 一、营业总收入               |          | 4,291,697,222.85 | 4,045,204,452.43 |
| 1.利息收入                |          | 2,715,240,185.84 | 2,513,980,001.09 |
| 其中：存款利息收入             | 7.4.7.10 | 2,150,312,518.35 | 1,828,308,007.84 |
| 债券利息收入                |          | -                | -                |
| 资产支持证券利息收入            |          | -                | -                |
| 买入返售金融资产收入            |          | 564,927,667.49   | 685,671,993.25   |
| 其他利息收入                |          | -                | -                |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 1,576,456,837.01 | 1,531,184,436.38 |
| 其中：股票投资收益             | 7.4.7.11 | -                | -                |
| 基金投资收益                | 7.4.7.12 | -                | -                |
| 债券投资收益                | 7.4.7.13 | 1,576,456,837.01 | 1,531,184,436.38 |
| 资产支持证券投资收益            | 7.4.7.14 | -                | -                |
| 贵金属投资收益               | 7.4.7.15 | -                | -                |
| 衍生工具收益                | 7.4.7.16 | -                | -                |
| 股利收益                  | 7.4.7.17 | -                | -                |
| 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） | 7.4.7.18 | -                | -                |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |          | -                | -                |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.19 | 200.00           | 40,014.96        |
| 减：二、营业总支出             |          | 1,123,431,963.48 | 930,371,844.64   |
| 1. 管理人报酬              |          | 500,100,940.14   | 424,043,761.89   |
| 2. 托管费                |          | 92,611,285.16    | 78,526,622.57    |
| 3. 销售服务费              |          | 363,143,167.51   | 240,452,159.34   |
| 4. 投资顾问费              |          | -                | -                |
| 5. 利息支出               |          | 167,225,502.72   | 186,916,139.60   |
| 其中：卖出回购金融资产支出         |          | 167,225,502.72   | 186,916,139.60   |
| 6. 信用减值损失             | 7.4.7.20 | -                | -                |

|                     |          |                  |                  |
|---------------------|----------|------------------|------------------|
| 7. 税金及附加            |          | 121,064.27       | 202,050.83       |
| 8. 其他费用             | 7.4.7.21 | 230,003.68       | 231,110.41       |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |          | 3,168,265,259.37 | 3,114,832,607.79 |
| 减：所得税费用             |          | -                | -                |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |          | 3,168,265,259.37 | 3,114,832,607.79 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |          | -                | -                |
| 六、综合收益总额            |          | 3,168,265,259.37 | 3,114,832,607.79 |

7.3 净资产变动表

会计主体：广发天天红发起式货币市场基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                       | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日      |                   |                       |
|------------------------------------------|---------------------------------------------|-------------------|-----------------------|
|                                          | 实收基金                                        | 未分配利润             | 净资产合计                 |
| 一、上期期末净资产                                | 168,018,386,741.22                          | -                 | 168,018,386,741.22    |
| 加：会计政策变更                                 | -                                           | -                 | -                     |
| 二、本期期初净资产                                | 168,018,386,741.22                          | -                 | 168,018,386,741.22    |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）                     | 19,255,108,045.33                           | -                 | 19,255,108,045.33     |
| （一）、综合收益总额                               | -                                           | 3,168,265,259.37  | 3,168,265,259.37      |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）      | 19,255,108,045.33                           | -                 | 19,255,108,045.33     |
| 其中：1.基金申购款                               | 2,852,220,251,452.66                        | -                 | 2,852,220,251,452.66  |
| 2.基金赎回款                                  | -2,832,965,143,407.33                       | -                 | -2,832,965,143,407.33 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -                                           | -3,168,265,259.37 | -3,168,265,259.37     |
| 四、本期期末净资产                                | 187,273,494,786.55                          | -                 | 187,273,494,786.55    |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |                   |                       |
|                                          | 实收基金                                        | 未分配利润             | 净资产合计                 |

|                                          |                       |                   |                       |
|------------------------------------------|-----------------------|-------------------|-----------------------|
| 一、上期期末净资产                                | 106,243,011,340.74    | -                 | 106,243,011,340.74    |
| 加：会计政策变更                                 | -                     | -                 | -                     |
| 二、本期期初净资产                                | 106,243,011,340.74    | -                 | 106,243,011,340.74    |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 61,775,375,400.48     | -                 | 61,775,375,400.48     |
| (一)、综合收益总额                               | -                     | 3,114,832,607.79  | 3,114,832,607.79      |
| (二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)      | 61,775,375,400.48     | -                 | 61,775,375,400.48     |
| 其中：1.基金申购款                               | 2,541,674,232,044.76  | -                 | 2,541,674,232,044.76  |
| 2.基金赎回款                                  | -2,479,898,856,644.28 | -                 | -2,479,898,856,644.28 |
| (三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列) | -                     | -3,114,832,607.79 | -3,114,832,607.79     |
| 四、本期期末净资产                                | 168,018,386,741.22    | -                 | 168,018,386,741.22    |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟 主管会计工作负责人：窦刚 会计机构负责人：张晓章

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

本基金自 2015 年 12 月 15 日起增设 B 类基金份额，并自该日起接受投资者对 B 类基金份额的

申购。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币为单位表示。

##### 7.4.4.3 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：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要包含货币资金、买入返售金融资产和其他应收科目等。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资等，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## （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。

本基金持有的以摊余成本计量的金融负债主要包括卖出回购金融资产款和其他应付科目等。

## （3）衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

### 7.4.4.4 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的有关过去事项、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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。

当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

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

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已经开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算认列。

#### 7.4.4.8 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投资收益于成交日确认，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。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。收益分配方式为红利再投资，申购的基金份额自确认之日起享有基金的收益分配权益，赎回的基金份额自赎回确认之日起不享有基金的收益分配权益。本基金每日计算当日收益并分配，定期支付且结转为相应的基金份额。

#### 7.4.4.11 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种及在银行间债券市场交易的固定收益品种，本基金根据具体情况按照《关于固定收益品种的估值处理标准》提供的估值方法进行估值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 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。

#### 7.4.5.2 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。

#### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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。根据财政部、税务总局公告 2023 年

第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

根据国税发明电[2002]47 号《黄金交易增值税征收管理办法》，基金买卖黄金现货实盘合约及黄金现货延期交收合约未发生实物交割的，免征增值税。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息

及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### （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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目   | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|------|-------------------------|--------------------------|
| 活期存款 | 8,417,366,487.24        | 47,542,025,443.17        |

|                |                   |                   |
|----------------|-------------------|-------------------|
| 等于：本金          | 8,402,883,674.95  | 47,500,803,444.32 |
| 加：应计利息         | 14,482,812.29     | 41,221,998.85     |
| 定期存款           | 52,752,772,657.53 | 42,225,905,585.19 |
| 等于：本金          | 52,550,000,000.00 | 42,020,000,000.00 |
| 加：应计利息         | 202,772,657.53    | 205,905,585.19    |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | 6,294,893,268.23  | 4,217,806,416.20  |
| 存款期限 1-3 个月    | 24,486,818,026.60 | 20,518,126,473.40 |
| 存款期限 3 个月以上    | 21,971,061,362.70 | 17,489,972,695.59 |
| 其他存款           | -                 | -                 |
| 等于：本金          | -                 | -                 |
| 加：应计利息         | -                 | -                 |
| 合计             | 61,170,139,144.77 | 89,767,931,028.36 |

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末               |                   |                |         |
|--------|-------|-------------------|-------------------|----------------|---------|
|        |       | 2024 年 12 月 31 日  |                   |                |         |
|        |       | 按实际利率计算的<br>账面价值  | 影子定价              | 偏离金额           | 偏离度（%）  |
| 债券     | 交易所市场 | 2,424,216,995.50  | 2,426,141,775.87  | 1,924,780.37   | 0.0010  |
|        | 银行间市场 | 80,266,115,720.72 | 80,381,484,808.19 | 115,369,087.47 | 0.0616  |
|        | 合计    | 82,690,332,716.22 | 82,807,626,584.06 | 117,293,867.84 | 0.0626  |
| 资产支持证券 |       | -                 | -                 | -              | -       |
| 合计     |       | 82,690,332,716.22 | 82,807,626,584.06 | 117,293,867.84 | 0.0626  |
| 项目     |       | 上年度末              |                   |                |         |
|        |       | 2023 年 12 月 31 日  |                   |                |         |
|        |       | 按实际利率计算的<br>账面价值  | 影子定价              | 偏离金额           | 偏离度（%）  |
| 债券     | 交易所市场 | 1,852,328,988.31  | 1,851,878,327.13  | -450,661.18    | -0.0003 |
|        | 银行间市场 | 60,893,489,841.07 | 60,930,560,018.73 | 37,070,177.66  | 0.0221  |

|        |    |                   |                   |               |        |
|--------|----|-------------------|-------------------|---------------|--------|
|        | 合计 | 62,745,818,829.38 | 62,782,438,345.86 | 36,619,516.48 | 0.0218 |
| 资产支持证券 |    | -                 | -                 | -             | -      |
| 合计     |    | 62,745,818,829.38 | 62,782,438,345.86 | 36,619,516.48 | 0.0218 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日  |           |
|-------|--------------------------|-----------|
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 3,449,760,979.44         | -         |
| 银行间市场 | 46,729,858,699.38        | -         |
| 合计    | 50,179,619,678.82        | -         |
| 项目    | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |           |
|       | 账面余额                     | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 20,144,778,202.20        | -         |
| 银行间市场 | 1,752,041,311.09         | -         |
| 合计    | 21,896,819,513.29        | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末及上年度末无债权投资。

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 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      | 1,299,506.87            | 1,196,408.55             |
| 其中：交易所市场    | -                       | -                        |
| 银行间市场       | 1,299,506.87            | 1,196,408.55             |
| 应付利息        | -                       | -                        |
| 预提费用        | 201,000.00              | 201,000.00               |
| 合计          | 1,500,506.87            | 1,397,408.55             |

#### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

| 广发天天红 A       |                       |                       |
|---------------|-----------------------|-----------------------|
| 项目            | 本期                    |                       |
|               | 2024年1月1日至2024年12月31日 |                       |
|               | 基金份额（份）               | 账面金额                  |
| 上年度末          | 130,879,201,339.48    | 130,879,201,339.48    |
| 本期申购          | 2,356,748,047,350.49  | 2,356,748,047,350.49  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,338,452,230,450.60 | -2,338,452,230,450.60 |
| 本期末           | 149,175,018,239.37    | 149,175,018,239.37    |

金额单位：人民币元

| 广发天天红B        |                       |                     |
|---------------|-----------------------|---------------------|
| 项目            | 本期                    |                     |
|               | 2024年1月1日至2024年12月31日 |                     |
|               | 基金份额（份）               | 账面金额                |
| 上年度末          | 37,139,185,401.74     | 37,139,185,401.74   |
| 本期申购          | 495,472,204,102.17    | 495,472,204,102.17  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -494,512,912,956.73   | -494,512,912,956.73 |

|     |                   |                   |
|-----|-------------------|-------------------|
| 本期末 | 38,098,476,547.18 | 38,098,476,547.18 |
|-----|-------------------|-------------------|

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。

#### 7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

| 广发天天红 A        |                   |       |                   |
|----------------|-------------------|-------|-------------------|
| 项目             | 已实现部分             | 未实现部分 | 未分配利润合计           |
| 本期期初           | -                 | -     | -                 |
| 本期利润           | 2,377,358,298.53  | -     | 2,377,358,298.53  |
| 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        | -2,377,358,298.53 | -     | -2,377,358,298.53 |
| 本期末            | -                 | -     | -                 |

单位：人民币元

| 广发天天红 B        |                 |       |                 |
|----------------|-----------------|-------|-----------------|
| 项目             | 已实现部分           | 未实现部分 | 未分配利润合计         |
| 本期期初           | -               | -     | -               |
| 本期利润           | 790,906,960.84  | -     | 790,906,960.84  |
| 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        | -790,906,960.84 | -     | -790,906,960.84 |
| 本期末            | -               | -     | -               |

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月<br>31 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月<br>31 日 |
|-----------|-------------------------------------------|------------------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 910,830,369.70                            | 651,916,481.79                                 |
| 定期存款利息收入  | 1,234,581,586.21                          | 1,168,672,668.23                               |
| 其他存款利息收入  | -                                         | -                                              |
| 结算备付金利息收入 | 4,812,625.56                              | 7,718,857.82                                   |
| 其他        | 87,936.88                                 | -                                              |
| 合计        | 2,150,312,518.35                          | 1,828,308,007.84                               |

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无股票投资收益。

##### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖股票差价收入。

#### 7.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2024年1月1日至2024年12<br>月31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12<br>月31日 |
|------------------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                 | 1,537,047,947.47                | 1,547,398,369.01                     |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 39,408,889.54                   | -16,213,932.63                       |
| 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                           | 1,576,456,837.01                | 1,531,184,436.38                     |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                    | 上年度可比期间               |
|------------------------|-----------------------|-----------------------|
|                        | 2024年1月1日至2024年12月31日 | 2023年1月1日至2023年12月31日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 157,935,538,879.79    | 181,310,640,309.37    |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 157,609,274,697.87    | 180,921,656,805.75    |
| 减：应计利息总额               | 286,855,292.38        | 405,197,436.25        |
| 减：交易费用                 | -                     | -                     |
| 买卖债券差价收入               | 39,408,889.54         | -16,213,932.63        |

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间内无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无股利收益。

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期                    | 上年度可比期间               |
|----|-----------------------|-----------------------|
|    | 2024年1月1日至2024年12月31日 | 2023年1月1日至2023年12月31日 |

|         |        |           |
|---------|--------|-----------|
| 基金赎回费收入 | -      | -         |
| 其他      | 200.00 | 40,014.96 |
| 合计      | 200.00 | 40,014.96 |

#### 7.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间内无信用减值损失。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |
|---------|---------------------------------|----------------------------------|
| 审计费用    | 72,000.00                       | 72,000.00                        |
| 信息披露费   | 120,000.00                      | 120,000.00                       |
| 证券出借违约金 | -                               | -                                |
| 银行汇划费   | 200.00                          | 400.00                           |
| 账户维护费   | 36,000.00                       | 36,000.00                        |
| 其他      | 1,803.68                        | 2,710.41                         |
| 合计      | 230,003.68                      | 231,110.41                       |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称             | 与本基金的关系             |
|-------------------|---------------------|
| 广发银行股份有限公司        | 基金托管人               |
| 广发基金管理有限公司        | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 广发证券股份有限公司        | 基金管理人控股股东、基金销售机构    |
| 深圳市前海香江金融控股集团有限公司 | 基金管理人股东             |
| 烽火通信科技股份有限公司      | 基金管理人股东             |

|                                                              |                      |
|--------------------------------------------------------------|----------------------|
| 广州科技金融创新投资控股有限公司                                             | 基金管理人股东              |
| 嘉裕元（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）                                        | 基金管理人股东              |
| 嘉裕祥（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）                                        | 基金管理人股东              |
| 嘉裕禾（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）                                        | 基金管理人股东              |
| 嘉裕泓（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）                                        | 基金管理人股东              |
| 嘉裕富（珠海）股权投资合伙企业（有限合伙）                                        | 基金管理人股东              |
| GF International Investment Management Limited（广发国际资产管理有限公司） | 基金管理人子公司             |
| 瑞元资本管理有限公司                                                   | 基金管理人子公司             |
| 广发期货有限公司                                                     | 基金管理人控股股东的子公司、基金销售机构 |
| 广东省广发基金公益基金会                                                 | 基金管理人作为主要捐赠人设立的基金会   |

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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末无应付关联方佣金余额。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31<br>日 |
|----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 500,100,940.14                  | 424,043,761.89                       |

|                      |                |                |
|----------------------|----------------|----------------|
| 其中：应支付销售机构的客<br>户维护费 | 239,523,917.04 | 180,027,288.00 |
| 应支付基金管理人的<br>净管理费    | 260,577,023.10 | 244,016,473.89 |

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目                 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31<br>日 | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31<br>日 |
|--------------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托<br>管费 | 92,611,285.16                   | 78,526,622.57                        |

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

|                    |                             |
|--------------------|-----------------------------|
| 获得销售服务费的各关<br>联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |
|--------------------|-----------------------------|

|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |              |              |
|----------------|-----------------------|--------------|--------------|
|                | 广发天天红 A               | 广发天天红 B      | 合计           |
| 广发基金管理有限公司     | 890,290.25            | 713,734.61   | 1,604,024.86 |
| 广发证券股份有限公司     | -                     | 1,734.16     | 1,734.16     |
| 广发期货有限公司       | 8.16                  | 78.93        | 87.09        |
| 合计             | 890,298.41            | 715,547.70   | 1,605,846.11 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间               |              |              |
|                | 2023年1月1日至2023年12月31日 |              |              |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费      |              |              |
|                | 广发天天红A                | 广发天天红B       | 合计           |
| 广发基金管理有限公司     | 1,816,486.32          | 2,222,164.84 | 4,038,651.16 |
| 广发证券股份有限公司     | -                     | 1,784.17     | 1,784.17     |
| 广发期货有限公司       | 16.13                 | 63.51        | 79.64        |
| 合计             | 1,816,502.45          | 2,224,012.52 | 4,040,514.97 |

注：本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%。

两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

$$H=E\times\text{年销售服务费}\div\text{当年天数}$$

H 为各类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为各类基金份额前一日的基金资产净值

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 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。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

7.4.10.3 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                    |
| 2024年1月1日至2024年12月31日 |

| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称           | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购              |                |
|----------------------------------|--------|------|-------|------|--------------------|----------------|
|                                  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额               | 利息支出           |
| 广发银行股<br>份有限公司                   | -      | -    | -     | -    | -                  | -              |
| 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31日 |        |      |       |      |                    |                |
| 银行间市场<br>交易的各关<br>联方名称           | 债券交易金额 |      | 基金逆回购 |      | 基金正回购              |                |
|                                  | 基金买入   | 基金卖出 | 交易金额  | 利息收入 | 交易金额               | 利息支出           |
| 广发银行股<br>份有限公司                   | -      | -    | -     | -    | 761,000,000.0<br>0 | 338,218.3<br>2 |

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目           | 本期                    |                       | 上年度可比期间 |                    |
|--------------|-----------------------|-----------------------|---------|--------------------|
|              | 2024年1月1日至2024年12月31日 | 2023年1月1日至2023年12月31日 | 广发天天红A  | 广发天天红B             |
| 报告期初持有的基金份额  | -                     | -                     | -       | 313,976,630.11     |
| 报告期间申购/买入总份额 | -                     | -                     | -       | 292,652,562.4<br>3 |
| 报告期间因拆分变动份额  | -                     | -                     | -       | -                  |
| 减：报告期间赎回/卖出总 | -                     | -                     | -       | 606,629,192.5      |

|                         |   |   |   |   |
|-------------------------|---|---|---|---|
| 份额                      |   |   |   | 4 |
| 报告期末持有的基金份额             | - | - | - | - |
| 报告期末持有的基金份额<br>占基金总份额比例 | - | - | - | - |

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

7.4.10.5.2 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

广发天天红 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。

广发天天红 B

份额单位：份

| 关联方名称            | 本期末<br>2024年12月31日 |                          | 上年度末<br>2023年12月31日 |                          |
|------------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|                  | 持有的<br>基金份额        | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 | 持有的<br>基金份额         | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例 |
| 广东省广发基金公<br>益基金会 | 5,134,721.93       | 0.01%                    | 7,338,899.11        | 0.02%                    |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

7.4.10.6 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<br>2024年1月1日至2024年12月31日 |               | 上年度可比期间<br>2023年1月1日至2023年12月31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<br>限公司 | 2,883,927.46                | 39,188,563.69 | 803,669.92                       | 7,205,791.22 |

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。

7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 1、广发天天红 A

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动  | 本期利润分<br>配合计         | 备注 |
|------------------|-------------------|---------------|----------------------|----|
| 2,379,830,138.77 | -                 | -2,471,840.24 | 2,377,358,29<br>8.53 | -  |

##### 2、广发天天红 B

单位：人民币元

| 已按再投资形式转<br>实收基金 | 直接通过应付<br>赎回款转出金额 | 应付利润<br>本年变动 | 本期利润分<br>配合计       | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|--------------------|----|
| 791,766,749.64   | -                 | -859,788.80  | 790,906,960.<br>84 | -  |

#### 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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 2024 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 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 6,755,144,347.99 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码      | 债券名称             | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）         | 期末估值总额           |
|-----------|------------------|------------|------------|---------------|------------------|
| 092318004 | 23 农发清发<br>04    | 2025-01-02 | 99.83      | 2,600,000.00  | 259,547,618.32   |
| 112405031 | 24 建设银行<br>CD031 | 2025-01-02 | 99.89      | 336,000.00    | 33,561,861.40    |
| 112405036 | 24 建设银行<br>CD036 | 2025-01-02 | 99.88      | 3,479,000.00  | 347,485,991.26   |
| 112405049 | 24 建设银行<br>CD049 | 2025-01-02 | 99.68      | 2,000,000.00  | 199,367,276.50   |
| 112405091 | 24 建设银行<br>CD091 | 2025-01-02 | 99.44      | 1,000,000.00  | 99,441,932.94    |
| 112405106 | 24 建设银行<br>CD106 | 2025-01-02 | 99.39      | 1,000,000.00  | 99,394,446.14    |
| 112405113 | 24 建设银行<br>CD113 | 2025-01-02 | 99.38      | 1,000,000.00  | 99,378,613.24    |
| 112405328 | 24 建设银行<br>CD328 | 2025-01-02 | 98.63      | 2,000,000.00  | 197,257,760.79   |
| 112409140 | 24 浦发银行<br>CD140 | 2025-01-02 | 99.38      | 5,000,000.00  | 496,903,163.05   |
| 112409148 | 24 浦发银行<br>CD148 | 2025-01-02 | 99.32      | 1,000,000.00  | 99,320,548.64    |
| 112409286 | 24 浦发银行<br>CD286 | 2025-01-02 | 98.34      | 2,246,000.00  | 220,872,683.70   |
| 112471252 | 24 杭州银行<br>CD247 | 2025-01-02 | 99.24      | 3,000,000.00  | 297,731,434.04   |
| 112471503 | 24 杭州银行<br>CD251 | 2025-01-02 | 98.78      | 900,000.00    | 88,897,585.53    |
| 112471807 | 24 杭州银行<br>CD256 | 2025-01-02 | 99.22      | 3,500,000.00  | 347,284,563.09   |
| 112487152 | 24 杭州银行<br>CD211 | 2025-01-02 | 99.09      | 2,000,000.00  | 198,178,554.55   |
| 220214    | 22 国开 14         | 2025-01-02 | 100.08     | 24,500,000.00 | 2,451,853,771.78 |
| 230213    | 23 国开 13         | 2025-01-02 | 100.94     | 2,893,000.00  | 292,023,807.33   |
| 230214    | 23 国开 14         | 2025-01-02 | 100.31     | 12,633,000.00 | 1,267,269,963.92 |
| 240421    | 24 农发 21         | 2025-01-02 | 100.47     | 2,500,000.00  | 251,165,055.85   |
| 合计        |                  |            |            | 73,587,000.00 | 7,346,936,632.07 |

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 10,600,161.52 元，于 2025 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证

券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 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。

##### 7.4.13.1 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。

##### 7.4.13.2 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，将对基金资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
|        |                    |                     |

|        |                  |                  |
|--------|------------------|------------------|
| A-1    | 1,813,494,238.53 | 774,438,501.94   |
| A-1 以下 | -                | -                |
| 未评级    | 5,851,018,331.48 | 3,340,677,256.02 |
| 合计     | 7,664,512,570.01 | 4,115,115,757.96 |

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。

#### 7.4.13.2.2 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<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 69,771,067,392.75  | 48,498,105,454.82   |
| A-1 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | -                  | -                   |
| 合计     | 69,771,067,392.75  | 48,498,105,454.82   |

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。

#### 7.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2024年12月31日 | 上年度末<br>2023年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 936,441,518.82     | 2,454,484,832.68    |
| AAA 以下 | -                  | -                   |
| 未评级    | 4,318,311,234.64   | 7,678,112,783.92    |
| 合计     | 5,254,752,753.46   | 10,132,597,616.60   |

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期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据、未有第三方机构评级的中期票据和公司债券。

#### 7.4.13.2.4 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无按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。本基金管理人每日通过“影子定价”机制对本基金的基金资产净值的公允性进行评估，并对本基金面临的市场风险进行监控。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，并

通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024 年 12 月<br>31 日  | 1 年以内              | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计                 |
|-----------------------------|--------------------|-------|-------|----------------|--------------------|
| <b>资产</b>                   |                    |       |       |                |                    |
| 货币资金                        | 61,170,139,144.77  | -     | -     | -              | 61,170,139,144.77  |
| 结算备付金                       | 27,929,278.63      | -     | -     | -              | 27,929,278.63      |
| 交易性金融资产                     | 82,690,332,716.22  | -     | -     | -              | 82,690,332,716.22  |
| 买入返售金融资产                    | 50,179,619,678.82  | -     | -     | -              | 50,179,619,678.82  |
| 应收清算款                       | -                  | -     | -     | 478,041.12     | 478,041.12         |
| 应收申购款                       | -                  | -     | -     | 61,153,238.73  | 61,153,238.73      |
| 资产总计                        | 194,068,020,818.44 | -     | -     | 61,631,279.85  | 194,129,652,098.29 |
| <b>负债</b>                   |                    |       |       |                |                    |
| 卖出回购金融资产款                   | 6,765,744,509.51   | -     | -     | -              | 6,765,744,509.51   |
| 应付管理人报酬                     | -                  | -     | -     | 42,480,620.28  | 42,480,620.28      |
| 应付托管费                       | -                  | -     | -     | 7,866,781.52   | 7,866,781.52       |
| 应付销售服务费                     | -                  | -     | -     | 31,080,842.08  | 31,080,842.08      |
| 应交税费                        | -                  | -     | -     | 107,670.93     | 107,670.93         |
| 应付利润                        | -                  | -     | -     | 7,376,380.55   | 7,376,380.55       |
| 其他负债                        | -                  | -     | -     | 1,500,506.87   | 1,500,506.87       |
| 负债总计                        | 6,765,744,509.51   | -     | -     | 90,412,802.23  | 6,856,157,311.74   |
| 利率敏感度缺口                     | 187,302,276,308.93 | -     | -     | -28,781,522.38 | 187,273,494,786.55 |
| 上年度末<br>2023 年 12 月<br>31 日 | 1 年以内              | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息            | 合计                 |
| <b>资产</b>                   |                    |       |       |                |                    |
| 货币资金                        | 89,767,931,028.36  | -     | -     | -              | 89,767,931,028.36  |

|           |                    |   |   |                |                    |
|-----------|--------------------|---|---|----------------|--------------------|
| 结算备付金     | 16,377,076.17      | - | - | -              | 16,377,076.17      |
| 交易性金融资产   | 62,745,818,829.38  | - | - | -              | 62,745,818,829.38  |
| 买入返售金融资产  | 21,896,819,513.29  | - | - | -              | 21,896,819,513.29  |
| 应收清算款     | -                  | - | - | 9,479.13       | 9,479.13           |
| 应收申购款     | -                  | - | - | 40,924,513.04  | 40,924,513.04      |
| 资产总计      | 174,426,946,447.20 | - | - | 40,933,992.17  | 174,467,880,439.37 |
| 负债        |                    |   |   |                |                    |
| 卖出回购金融资产款 | 6,361,405,827.85   | - | - | -              | 6,361,405,827.85   |
| 应付管理人报酬   | -                  | - | - | 40,210,997.67  | 40,210,997.67      |
| 应付托管费     | -                  | - | - | 7,446,481.04   | 7,446,481.04       |
| 应付销售服务费   | -                  | - | - | 28,220,402.80  | 28,220,402.80      |
| 应交税费      | -                  | - | - | 104,570.65     | 104,570.65         |
| 应付利润      | -                  | - | - | 10,708,009.59  | 10,708,009.59      |
| 其他负债      | -                  | - | - | 1,397,408.55   | 1,397,408.55       |
| 负债总计      | 6,361,405,827.85   | - | - | 88,087,870.30  | 6,449,493,698.15   |
| 利率敏感度缺口   | 168,065,540,619.35 | - | - | -47,153,878.13 | 168,018,386,741.22 |

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。

7.4.13.4.1.2 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<br>2024 年 12 月 31 日     | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|    | 市场利率上升 25 个基点      | -84,305,683.11              | -61,641,175.81           |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 84,512,331.80               | 61,759,126.68            |

7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末<br>2024 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | -                       | -                        |
| 第二层次          | 82,690,332,716.22       | 62,745,818,829.38        |
| 第三层次          | -                       | -                        |
| 合计            | 82,690,332,716.22       | 62,745,818,829.38        |

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无需披露的第三层次公允价值余额及变动情况。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

本基金本报告期末及上年度末无需披露的使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的项目。

###### 7.4.14.3 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未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

###### 7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内及上年度可比期间内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§8 投资组合报告

8.1 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            | 82,690,332,716.22  | 42.60        |
|    | 其中：债券             | 82,690,332,716.22  | 42.60        |
|    | 资产支持证券            | -                  | -            |
| 2  | 买入返售金融资产          | 50,179,619,678.82  | 25.85        |
|    | 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      | 61,198,068,423.40  | 31.52        |
| 4  | 其他各项资产            | 61,631,279.85      | 0.03         |
| 5  | 合计                | 194,129,652,098.29 | 100.00       |

8.2 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 | 4.99             |               |
|    | 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 | 6,765,744,509.51 | 3.61          |
|    | 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%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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 | 43 |

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。

8.3.2 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                 | 37.29              | 3.61               |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 2  | 30 天（含）—60 天           | 5.81               | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 3  | 60 天（含）—90 天           | 19.14              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | 0.83               | -                  |
| 4  | 90 天（含）—120 天          | 10.50              | -                  |
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | -                  | -                  |
| 5  | 120 天（含）—397 天（含）      | 30.73              | -                  |

|    |                            |        |      |
|----|----------------------------|--------|------|
|    | 其中：剩余存续期超过 397 天的<br>浮动利率债 | -      | -    |
| 合计 |                            | 103.48 | 3.61 |

8.4 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。

8.5 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<br>比例(%) |
|----|----------------------|-------------------|------------------|
| 1  | 国家债券                 | -                 | -                |
| 2  | 央行票据                 | -                 | -                |
| 3  | 金融债券                 | 4,854,758,643.16  | 2.59             |
|    | 其中：政策性金融债            | 4,569,476,290.49  | 2.44             |
| 4  | 企业债券                 | 2,424,216,995.50  | 1.29             |
| 5  | 企业短期融资券              | 5,640,289,684.81  | 3.01             |
| 6  | 中期票据                 | -                 | -                |
| 7  | 同业存单                 | 69,771,067,392.75 | 37.26            |
| 8  | 其他                   | -                 | -                |
| 9  | 合计                   | 82,690,332,716.22 | 44.15            |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 1,561,194,402.15  | 0.83             |

8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码         | 债券名称          | 债券数量(张)       | 公允价值             | 占基金资产净<br>值比例(%) |
|----|--------------|---------------|---------------|------------------|------------------|
| 1  | 220214.IB    | 22 国开 14      | 24,500,000.00 | 2,451,853,771.78 | 1.31             |
| 2  | 112405104.IB | 24 建设银行 CD104 | 20,000,000.00 | 1,987,776,057.52 | 1.06             |
| 3  | 230214.IB    | 23 国开 14      | 13,000,000.00 | 1,304,085,294.94 | 0.70             |
| 4  | 112415230.IB | 24 民生银行 CD230 | 13,000,000.00 | 1,288,504,050.75 | 0.69             |
| 5  | 112415306.IB | 24 民生银行 CD306 | 11,500,000.00 | 1,136,445,669.54 | 0.61             |

|    |              |               |               |                  |      |
|----|--------------|---------------|---------------|------------------|------|
| 6  | 112415154.IB | 24 民生银行 CD154 | 11,000,000.00 | 1,093,504,907.48 | 0.58 |
| 7  | 112414244.IB | 24 江苏银行 CD244 | 10,000,000.00 | 997,485,442.74   | 0.53 |
| 8  | 112410306.IB | 24 兴业银行 CD306 | 10,000,000.00 | 997,030,029.43   | 0.53 |
| 9  | 112412115.IB | 24 北京银行 CD115 | 10,000,000.00 | 995,612,067.90   | 0.53 |
| 10 | 112412148.IB | 24 北京银行 CD148 | 10,000,000.00 | 992,665,221.93   | 0.53 |

## 8.7 “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                   | 0.0626% |
| 报告期内偏离度的最低值                   | 0.0085% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值        | 0.0317% |

### 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。

## 8.8 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。

## 8.9 投资组合报告附注

### 8.9.1 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。

**8.9.2** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，北京银行股份有限公司、国家开发银行、兴业银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构（含原中国银行保险监督管理委员会）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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额            |
|----|-------|---------------|
| 1  | 存出保证金 | -             |
| 2  | 应收清算款 | 478,041.12    |
| 3  | 应收利息  | -             |
| 4  | 应收申购款 | 61,153,238.73 |
| 5  | 其他应收款 | -             |
| 6  | 待摊费用  | -             |
| 7  | 其他    | -             |
| 8  | 合计    | 61,631,279.85 |

§9 基金份额持有人信息

9.1 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 A | 18,917,938 | 7,885.37  | 68,694,687.47    | 0.05%  | 149,106,323,551.90 | 99.95% |
| 广发天天红 B | 1,571,458  | 24,244.03 | 2,189,825,230.32 | 5.75%  | 35,908,651,316.86  | 94.25% |
| 合计      | 20,489,396 | 9,140.02  | 2,258,519,917.79 | 1.21%  | 185,014,974,868.76 | 98.79% |

9.2 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 | 503,918,655.58 | 0.27%  |
| 2  | 信托类机构 | 477,528,151.35 | 0.25%  |
| 3  | 其他机构  | 138,157,917.45 | 0.07%  |

|    |       |                |       |
|----|-------|----------------|-------|
| 4  | 保险类机构 | 100,147,319.74 | 0.05% |
| 5  | 基金类机构 | 81,052,306.20  | 0.04% |
| 6  | 个人    | 73,886,047.20  | 0.04% |
| 7  | 个人    | 70,553,803.07  | 0.04% |
| 8  | 个人    | 69,503,795.80  | 0.04% |
| 9  | 个人    | 66,100,100.89  | 0.04% |
| 10 | 基金类机构 | 64,736,354.89  | 0.03% |

### 9.3 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 | 广发天天红 A | 897,427.87    | 0.0006%  |
|                  | 广发天天红 B | 16,803,024.92 | 0.0441%  |
|                  | 合计      | 17,700,452.79 | 0.0095%  |

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                             | 份额级别    | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|---------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 广发天天红 A | 10~50             |
|                                | 广发天天红 B | >100              |
|                                | 合计      | >100              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                | 广发天天红 A | 0~10              |
|                                | 广发天天红 B | 0~10              |
|                                | 合计      | 0~10              |

### 9.5 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比例 | 发起份额总数        | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|------------|
| 基金管理人固有资金   | -             | -            | 10,000,800.00 | 0.01%        | 三年         |
| 基金管理人高级管理人员 | 10,164,922.50 | 0.01%        | -             | -            | -          |
| 基金经理等人员     | 991,961.08    | 0.00%        | -             | -            | -          |
| 基金管理人股东     | -             | -            | -             | -            | -          |
| 其他          | -             | -            | -             | -            | -          |
| 合计          | 11,156,883.58 | 0.01%        | 10,000,800.00 | 0.01%        | 三年         |

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                  | 广发天天红 A              | 广发天天红 B            |
|-------------------------------------|----------------------|--------------------|
| 基金合同生效日（2013 年 10 月 22 日）<br>基金份额总额 | 50,201,108.00        | -                  |
| 本报告期期初基金份额总额                        | 130,879,201,339.48   | 37,139,185,401.74  |
| 本报告期基金总申购份额                         | 2,356,748,047,350.49 | 495,472,204,102.17 |
| 减：本报告期基金总赎回份额                       | 2,338,452,230,450.60 | 494,512,912,956.73 |
| 本报告期基金拆分变动份额                        | -                    | -                  |
| 本报告期期末基金份额总额                        | 149,175,018,239.37   | 38,098,476,547.18  |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。截至本报告期末，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已连续 7 年为本基金提供审计服务，本报告年度的审计费用为 72,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

| 措施 1          | 内容         |
|---------------|------------|
| 受到稽查或处罚等措施的主体 | 广发基金管理有限公司 |

|                       |                  |
|-----------------------|------------------|
| 受到稽查或处罚等措施的时间         | 2024-07-01       |
| 采取稽查或处罚等措施的机构         | 中国证券监督管理委员会广东监管局 |
| 受到的具体措施类型             | 出具警示函            |
| 受到稽查或处罚等措施的原因         | 个别规定及制度未严格执行     |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 已整改完成            |
| 其他                    | 无                |

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金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。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易<br>单元<br>数量 | 股票交易 |                  | 应支付该券商的佣金 |                | 备注 |
|------|----------------|------|------------------|-----------|----------------|----|
|      |                | 成交金额 | 占当期股票成交总额的<br>比例 | 佣金        | 占当期佣金总量的<br>比例 |    |
| 兴业证券 | 2              | -    | -                | -         | -              | -  |
| 长江证券 | 2              | -    | -                | -         | -              | -  |

注：1、选择标准

- （1）经营行为稳健规范，合规内控制度健全，财务状况良好，在业内具有良好声誉；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；
- （3）具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；
- （4）具有较强的综合研究能力，拥有独立的研究部门及相当规模的研究团队，有完善的研究报告质量和合规保障机制，能及时向公司提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告，可以根据公司管理基金的特定要求，提供专门研究报告；
- （5）公司证券研究报告业务、内控管理、合规风控等方面未受到重大行政处罚或重大行政监管措施；
- （6）中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

#### 2、选择流程

（1）对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

(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。

3、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致，统计范围仅包括本基金。2024 年 7 月 1 日前，佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务；自 2024 年 7 月 1 日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

### 11.7.2 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 |
| 兴业证券 | 4,473,321,191.58 | 100.00%      | 418,779,929,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 长江证券 | -                | -            | -                  | -              | -    | -            |

### 11.8 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。

### 11.9 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 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-01-19 |
| 2  | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-03-29 |
| 3  | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-04-19 |
| 4  | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年              | 中国证监会规定报刊及   | 2024-07-18 |

|   |                                      |              |            |
|---|--------------------------------------|--------------|------------|
|   | 第 2 季度报告提示性公告                        | 网站           |            |
| 5 | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年中期报告提示性公告     | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-08-30 |
| 6 | 广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2024-10-25 |

## §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基金合同》
- 3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- 4.《广发天天红发起式货币市场基金托管协议》
- 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

### 12.2 存放地点

广东省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：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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇二五年三月二十九日