广发天天利货币市场基金

【2015】半年度报告摘要

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年八月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发天天利货币		
基金主代码	000475		
交易代码	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	410,813,285.19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类	广发天天利货币B类	广发天天利货币E类
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	390,530,254.73份	20,216,491.02份	66,539.44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	段西军	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95566
传真		020-83889158	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§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(2015年1月1日-2015年6月30日)		
	广发天天利货币A类	广发天天利货币B类	广发天天利货币E类
本期已实现收益	5,051,641.39	490,270.81	253.32
本期利润	5,051,641.39	490,270.81	253.32
本期净值收益率	2.1329%	2.2539%	1.0518%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)		
	广发天天利货币A类	广发天天利货币B类	广发天天利货币E类
期末基金资产净值	390,530,254.73	20,216,491.02	66,539.44
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000

注:(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。 (2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。 (3)本基金利润分配按日结转份额。 (4)本基金于2015年3月23日增加E类份额。

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类:

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2776%	0.0146%	0.0288%	0.0000%	0.2488%	0.0146%
过去三个月	1.0039%	0.0140%	0.0873%	0.0000%	0.9166%	0.0140%
过去六个月	2.1329%	0.0113%	0.1736%	0.0000%	1.9593%	0.0113%
过去一年	4.2635%	0.0089%	0.3500%	0.0000%	3.9135%	0.0089%
自基金合同生效起至今	6.2121%	0.0080%	0.4986%	0.0000%	5.7135%	0.0080%

2. 广发天天利货币B类:

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2973%	0.0146%	0.0288%	0.0000%	0.2685%	0.0146%
过去三个月	1.0644%	0.0140%	0.0873%	0.0000%	0.9771%	0.0140%
过去六个月	2.2539%	0.0113%	0.1736%	0.0000%	2.0803%	0.0113%
过去一年	4.5132%	0.0089%	0.3500%	0.0000%	4.1632%	0.0089%
自基金合同生效起至今	6.5648%	0.0080%	0.4986%	0.0000%	6.0662%	0.0080%

3. 广发天天利货币E类:

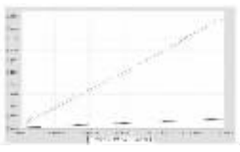
阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.2774%	0.0146%	0.0288%	0.0000%	0.2486%	0.0146%
过去三个月	1.0021%	0.0140%	0.0873%	0.0000%	0.9148%	0.0140%
自基金合同生效起至今	1.0518%	0.0136%	0.0949%	0.0000%	0.9569%	0.0136%

注:(1)业绩比较基准:人民币活期存款利率(税后)。(2)本基金于2015年3月23日增加E类份额。

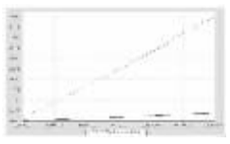
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发天天利货币市场基金
累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2014年1月27日至2015年6月30日)

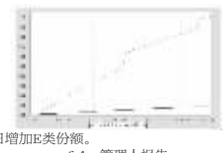
广发天天利货币A类



广发天天利货币B类



广发天天利货币E类



注:本基金于2015年3月23日增加E类份额。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准,于2003年8月5日成立,注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)和特定客户资产管理等业务资格。本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和24个部门:综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、互联网金融部(下辖杭州理财中心)、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。此外,还出资设立了广发国际资产管理有限公司(香港子公司)、瑞元资本管理有限公司。截至2015年6月30日,本基金管理人管理七十五只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金(LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克100指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财7天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发中债金融债指数证券投资基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金和广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金,管理资产规模为2262.47亿元。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发理财年年红债券基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理;广发天天红货币基金的基金经理;广发钱袋子货币基金的基金经理;广发集鑫债券基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理;广发聚安混合基金的基金经理;广发聚宝混合基金的基金经理;广发聚康混合基金的基金经理	2014-01-27	-	7年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至2012年7月在广发基金管理有限公司固定收益部任研究员,2012年7月19日起任广发理财年年红债券基金的基金经理,2012年9月20日至2015年5月26日任广发双债添利债券基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月10日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年1月27日至2015年5月26日任广发集鑫债券型证券投资基金,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年9月29日至2015年4月29日任广发季季利债券基金的基金经理,2015年1月29日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理,2015年3月25日起任广发聚安混合基金的基金经理,2015年4月9日起任广发聚宝混合基金的基金经理,2015年6月1日起任广发聚康混合基金的基金经理。
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发天天红货币基金的基金经理;广发钱袋子货币市场基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理;广发聚泰混合基金的基金经理	2014-01-27	-	7年	女,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至今在广发基金管理有限公司固定收益部兼任交易员和研究员,2012年12月12日起任广发纯债债券基金的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理,2014年5月30日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理,2015年6月8日起任广发聚泰混合基金的基金经理。

注:"任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。 2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》及其配套法规、《广发天天利货币市场基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金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,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警, 实现投资风险的事中风险控制;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

本报告期内,央行始终保持宽松的货币政策,采取各项措施引导货币市场收益率下行。央行于2月份降准0.5%,4月份大幅降准1%,3月、5月、6月则各降息一次。公开市场操作方面,央行逐步引导7天逆回购利率大幅下行。货币市场资金整体较为宽松,虽然期间仍面临IPO、春节季末半年末等时点性的影响,但整体市场收益率仍是大幅下行的态势。报告期内,本基金在确保足够流动性的前提下,在关键时点安排较多现金到期,并尽可能提高了组合的久期,赚取了一定的资本利得。对于存款和短期融资券,则采取收益择高配置的原则,兼顾收益和流动性风险。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发天天利A类净值增长率为2.1329%,广发天天利B类净值增长率为2.2539%,同期业绩比较基准收益率为0.1736%, 广发天天利E类净值增长率为1.0518%, 同期业绩比较基准收益率为0.0949%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

央行在上半年始终保持宽松的货币政策,采取各项措施引导货币市场收益率下行。经济基本面继续疲弱, 但股市取得了较大幅度的涨幅。股市的赚钱效应以及IPO发行提速对货币市场资金造成一定的分流,而六月开始股市的调整使得这个过程发生了逆转。展望未来,预计货币政策仍会延续宽松态势。股市调整以及IPO暂停使得较多增量资金进入债券和货币市场,初期会导致收益率快速下行,但要关注股市企稳以及IPO可能重启以后引发的回流冲击影响。从基本面来看,三季度预计财政政策继续发力,稳增张是否会导致资金流出货币市场、信用扩张能否增长仍是持续关注的重点。我们将继续在保证合理流动性的前提下,综合运用货币市场工具安排到期现金流,在合规的基础上进行组合管理,争取为投资者获得稳健的投资回报。

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、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行,并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素,向估值委员会提出估值建议,确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查,确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立,基金经理不参与估值的具体流程,但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况,可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按合同约定提供银行间同业市场交易的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"基金的收益与分配"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5,542,165.52元。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在广发天天利货币市场基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核, 未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:广发天天利货币市场基金
报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产:	-	-
银行存款	62,754,367.51	49,702,051.35
结算备付金	828,000.00	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	235,160,551.19	196,293,893.89
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	235,160,551.19	196,293,893.89
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	85,000,447.50	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	2,370,475.84	3,507,407.18
应收股利	-	-
应收申购款	58,978,331.98	524,433.14
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	445,092,174.02	249,027,785.56
负债和所有者权益	**本期末 2015年6月30日**	**上年度末 2014年12月31日**
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	33,861,663.07	32,599,711.10
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	72,657.77	78,651.07
应付托管费	22,017.50	23,833.61
应付销售服务费	52,006.96	52,491.62
应付交易费用	18,727.62	15,592.90
应交税费	-	-
应付利息	1,499.14	7,096.57
应付利润	27,344.44	640,530.40
递延所得税负债	-	-
其他负债	222,972.33	319,000.00
负债合计	34,278,888.83	33,736,907.27
所有者权益:	-	-
实收基金	410,813,285.19	215,290,878.29
未分配利润	-	-
所有者权益合计	410,813,285.19	215,290,878.29
负债和所有者权益总计	445,092,174.02	249,027,785.56

6.2 利润表

会计主体:广发天天利货币市场基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月27日(基金合同生效日)至2014年6月30日
一.收入	6,927,778.34	35,007,686.84
1.利息收入	5,902,436.27	34,539,261.98
其中:存款利息收入	1,718,426.60	31,754,381.00
债券利息收入	2,871,385.93	2,134,420.76
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,312,623.74	650,460.22
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,025,342.07	468,424.86
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,025,342.07	468,424.86
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-	-
减:二.费用	1,385,612.82	3,963,297.01
1. 管理人报酬	444,317.58	1,849,197.37
2. 托管费	134,641.72	560,362.86
3. 销售服务费	309,539.23	1,043,596.81
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	327,122.06	326,313.47
其中:卖出回购金融资产支出	327,122.06	326,313.47
6. 其他费用	169,992.23	183,826.52
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	5,542,165.52	31,044,389.81
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	5,542,165.52	31,044,389.81

注:本基金合同生效日为2014年1月27日,上年度可比期间不完整。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发天天利货币市场基金
本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	215,290,878.29	-	215,290,878.29
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	5,542,165.52	5,542,165.52
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	195,522,406.90	-	195,522,406.90
其中:1.基金申购款	1,409,889,927.43	-	1,409,889,927.43
2.基金赎回款	-1,214,367,520.53	-	-1,214,367,520.53
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-5,542,165.52	-5,542,165.52
五.期末所有者权益(基金净值)	410,813,285.19	-	410,813,285.19
项目	**上年度可比期间 2014年1月27日(基金合同生效日)至2014年6月30日**		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	4,006,249,659.16	-	4,006,249,659.16
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	31,044,389.81	31,044,389.81
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-3,727,479,519.08	-	-3,727,479,519.08
其中:1.基金申购款	3,507,096,640.41	-	3,507,096,640.41
2.基金赎回款	-7,234,576,159.49	-	-7,234,576,159.49
四.本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-31,044,389.81	-31,044,389.81
五.期末所有者权益(基金净值)	278,770,140.08	-	278,770,140.08

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:王志伟,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》、《证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》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。根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围包括:1、现金; 2、通知存款; 3、短期融资券; 4、剩余期限在397天以内(含397天)的债券; 5、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单; 6、期限在1年以内(含1年)的债券回购; 7、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券; 8、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称"央行票据"); 9、剩余期限在397天以内(含397天)中期票据; 10、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金业绩比较基准为人民币活期存款利率(税后)。本基金于2015年3月23日增加E类份额。本基金的财务报表于2015年8月28日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2015年6月30日的财务状况以及2015年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下: 1. 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。 2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。 3. 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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

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

6.4.7.2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
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1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。

6.4.8.1.2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。

6.4.8.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月27日(基金合同生效日)至2014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	248,900,000.00	100.00%	600,000,000.00	100.00%

6.4.8.1.4应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比区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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月27日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	444,317.58	1,849,197.37
其中:支付销售机构的客户维护费	152,296.51	1,383,587.20

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×0.33%÷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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月27日(基金合同生效日)至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	134,641.72	560,362.86

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×0.1%÷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。

6.4.8.2.3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 2015年1月1日至2015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类	广发天天利货币B类	广发天天利货币E类	合计
广发基金管理有限公司	22,572.91	70.73	-	22,643.64
中国银行股份有限公司	95,445.99	323.44	-	95,769.43
广发证券股份有限公司	9,335.83	65.95	-	9,401.78
合计	127,354.73	460.12	-	127,814.85
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月27日(基金合同生效日)至2014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类	广发天天利货币B类	广发天天利货币E类	合计
广发基金管理有限公司	18,376.55	59.88	-	18,436.43
中国银行股份有限公司	928,195.67	13,381.75	-	941,577.42
广发证券股份有限公司	4,399.28	27.40	-	4,426.68
合计	950,971.50	13,469.03	-	964,440.53

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