

信息披露

广发天天利货币市场基金

2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十四日

1.1 重要提示

本基金的董事会、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法律责任。本半年度报告已经三(三)以上独立董事同意,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2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证报告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基金更新。

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

本报告财务资料未经审计。

本报告自2018年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
基金代码	000475	000476	000477
交易对价	000475	000476	000477
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式	契约型开放式
基金合同生效日期	2013年12月27日	2013年12月27日	2013年12月27日
基金管理人	广发基金管理有限公司	广发基金管理有限公司	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	中国银行股份有限公司	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,008,796,113.68份	32,008,796,113.68份	32,008,796,113.68份
基金合同的存续期	不定期	不定期	不定期
下属分级基金的基本情况	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
下属分级基金代码	000475	000476	000477
下属分级基金资产净值	917,840,035.00元	1,136,696,743.20元	27,864,229,301.25元

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、持续的长期投资回报。		
投资策略	本基金采取买入并持有策略,在严格控制风险的前提下,通过分散化投资,投资于具有良好流动性的金融工具,以获取稳定的投资收益。		
投资范围	本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:银行存款、同业存单、债券回购、央行票据、国债、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、货币市场基金等。		
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 基金管理人及基金托管人			
名称	广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	中国银行股份有限公司
法定代表人	王凤超	王东明	王东明
注册地址	广东省广州市天河区珠江新城华夏路10号	北京市西城区金融大街25号	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广东省广州市天河区珠江新城华夏路10号	北京市西城区金融大街25号	北京市西城区金融大街25号
电话	020-66338888	010-66060000	010-66060000
网址	http://www.gffund.com	http://www.boc.cn	http://www.boc.cn

2.4 信息披露方式			
基金年度报告披露方式	年度报告全文	年度报告摘要	年度报告摘要
基金年度报告披露地点	广州市天河区珠江新城华夏路10号	广州市天河区珠江新城华夏路10号	广州市天河区珠江新城华夏路10号

3.1 主要会计数据和财务指标			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期总资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净收益	1,126.78	2,222.77	1,126.78
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.2 基金净值表现			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.3 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.4 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.5 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.6 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.7 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.8 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.9 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.10 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.11 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.12 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

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:二〇一八年八月二十四日

1.1 重要提示

本基金的董事会、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法律责任。本半年度报告已经三(三)以上独立董事同意,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2018年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证报告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基金更新。

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

本报告财务资料未经审计。

本报告自2018年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
基金代码	000475	000476	000477
交易对价	000475	000476	000477
基金运作方式	契约型开放式	契约型开放式	契约型开放式
基金合同生效日期	2013年12月27日	2013年12月27日	2013年12月27日
基金管理人	广发基金管理有限公司	广发基金管理有限公司	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	中国银行股份有限公司	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	32,008,796,113.68份	32,008,796,113.68份	32,008,796,113.68份
基金合同的存续期	不定期	不定期	不定期
下属分级基金的基本情况	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
下属分级基金代码	000475	000476	000477
下属分级基金资产净值	917,840,035.00元	1,136,696,743.20元	27,864,229,301.25元

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、持续的长期投资回报。		
投资策略	本基金采取买入并持有策略,在严格控制风险的前提下,通过分散化投资,投资于具有良好流动性的金融工具,以获取稳定的投资收益。		
投资范围	本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括:银行存款、同业存单、债券回购、央行票据、国债、地方政府债、金融债、企业债、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、货币市场基金等。		
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 基金管理人及基金托管人			
名称	广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	中国银行股份有限公司
法定代表人	王凤超	王东明	王东明
注册地址	广东省广州市天河区珠江新城华夏路10号	北京市西城区金融大街25号	北京市西城区金融大街25号
办公地址	广东省广州市天河区珠江新城华夏路10号	北京市西城区金融大街25号	北京市西城区金融大街25号
电话	020-66338888	010-66060000	010-66060000
网址	http://www.gffund.com	http://www.boc.cn	http://www.boc.cn

2.4 信息披露方式			
基金年度报告披露方式	年度报告全文	年度报告摘要	年度报告摘要
基金年度报告披露地点	广州市天河区珠江新城华夏路10号	广州市天河区珠江新城华夏路10号	广州市天河区珠江新城华夏路10号

3.1 主要会计数据和财务指标			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期总资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净收益	1,126.78	2,222.77	1,126.78
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.2 基金净值表现			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.3 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

3.4 基金业绩比较基准			
基金名称	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币C
报告期	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
本期净资产	10,126,184.62	63,479,081.36	512,413,028.00
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期净资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%
本期总资产收益率	1.1267%	2.2227%	1.1267%

房屋所有资产		-	
其他资产	64.76		
资产合计		37,680,567,588.93	10,242,068,835.30
负债和所有者权益	附注3		
		本期末	上年末
		2018年6月30日	2017年12月31日
负债：		-	
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债	64.73	-	
卖出回购金融资产款		5,545,403,556.30	1,756,218,408.48
应付证券清算款		58,881,303.92	