广发货币市场基金

2012 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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年三月二十七日

§ 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	广发货币
基金主代码	270004
交易代码	270004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年5月20日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	27,591,978,207.81份
基金合同存续期	不定期

2.2基金产品说明

投资目标	在保持低风险与资产流动性的基础上，追求稳定的当期收益。
投资策略	投资策略以自上而下为主，兼顾自下而上的方式。其中，自上而下是指基金管理人通过定量与定性相结合的综合分析，对利率尤其是短期利率的变化趋势进行预测，在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的期限结构和品种结构，构建稳健的投资组合。自下而上是指要重视具体投资对象的价值分析，同时针对市场分割及定价机制暂时失灵带来的投资机会，进行相应的套利操作，增加投资收益。
业绩比较基准	根据本基金的投资对象和投资目标，业绩比较基准为税后活期存款利率；即(1-利息税率)×活期存款利率。
风险收益特征	本基金具有高安全性、高流动性和稳定的收益，力争获取稳定的超过同期银行活期存款利率(税后)的收益率。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	赵会军
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828，020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798

2.4信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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、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	2012年		2011年		2010年	
	广发货币A	广发货币B	广发货币A	广发货币B	广发货币A	广发货币B
本期已实现收益	650,175,126.55	869,720,525.78	200,574,908.98	232,028,152.51	13,064,253.89	34,233,483.72
本期利润	650,175,126.55	869,720,525.78	200,574,908.98	232,028,152.51	13,064,253.89	34,233,483.72
本期基金份额净值收益率	4.2452%	4.4946%	4.1593%	4.4071%	1.7904%	2.0347%
3.1.2期末数据和指标	2012年末		2011年末		2010年末	
	广发货币A	广发货币B	广发货币A	广发货币B	广发货币A	广发货币B
期末基金资产净值	15,114,541,379.68	12,477,436,828.13	10,034,278,739.42	9,367,018,972.35	830,536,723.46	2,068,574,574.83
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：(1)自2009年4月20日起，本基金实行销售服务费分级收费方式，分设两级基金份额：A级基金份额和B级基金份额。详情请参阅相关公告。

(2)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。

(3)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。

(4)本基金利润分配按月结转份额。

3.2基金净值表现

3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 广发货币A：

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
过去三个月	0.9635%	0.0020%	0.0894%	0.0000%	0.8741%	0.0020%
过去六个月	1.8508%	0.0016%	0.1796%	0.0000%	1.6712%	0.0016%
过去一年	4.2452%	0.0028%	0.4260%	0.0002%	3.8192%	0.0026%
过去三年	10.5244%	0.0041%	2.7537%	0.0021%	7.7707%	0.0020%
过去五年	15.7072%	0.0071%	8.7086%	0.0036%	6.9986%	0.0035%
自基金成立起至今	23.0448%	0.0068%	14.4880%	0.0031%	8.5568%	0.0037%

自2010年10月28日起，本基金的业绩比较基准由原先的“一年期银行定期存款的税后利率：(1-利息税率)×一年期银行定期储蓄存款利率”变更为“税后活期存款利率：即(1-利息税率)×活期存款利率”。

2. 广发货币B：

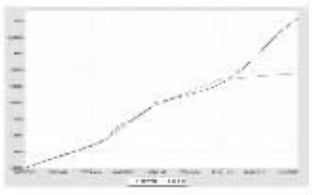
阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0243%	0.0020%	0.0894%	0.0000%	0.9349%	0.0020%
过去六个月	1.9733%	0.0016%	0.1796%	0.0000%	1.7937%	0.0016%
过去一年	4.4946%	0.0028%	0.4260%	0.0002%	4.0686%	0.0026%
过去三年	11.3188%	0.0041%	2.7537%	0.0021%	8.5651%	0.0020%
自基金成立起至今	12.4937%	0.0053%	4.2737%	0.0023%	8.2200%	0.0030%

自2010年10月28日起，本基金的业绩比较基准由原先的“一年期银行定期存款的税后利率：(1-利息税率)×一年期银行定期储蓄存款利率”变更为“税后活期存款利率：即(1-利息税率)×活期存款利率”。

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

广发货币市场基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2005年5月20日至2012年12月31日）

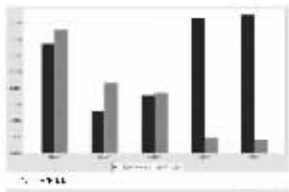
1、广发货币A



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

1、广发货币A



广发货币B 2009年按实际存续期计算，未按整个自然年度折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

1、广发货币A

金额单位：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
2012年	575,704,142.11	68,432,829.29	6,038,155.15	650,175,126.55	-
2011年	151,699,409.75	28,719,205.60	20,156,293.63	200,574,908.98	-
2010年	11,483,660.31	1,322,165.10	258,428.48	13,064,253.89	-
合计	738,887,212.17	98,474,199.99	26,452,877.26	863,814,289.42	-

2、广发货币B

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
2012年	746,299,942.21	120,345,054.30	3,075,529.27	869,720,525.78	-
2011年	170,293,343.95	43,514,932.28	18,219,876.28	232,028,152.51	-
2010年	28,680,059.00	4,459,686.94	1,093,737.78	34,233,483.72	-
合计	945,273,345.16	168,319,673.52	22,389,143.33	1,135,982,162.01	-

§ 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1.2亿元人民币。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洲科技风险投资有限公司。公司拥有公募基金、企业年金投资管理人、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19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、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、量化投资部、机构理财部、市场拓展部、电商及客服部、国际业务部。此外，还设立了北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司、深圳理财中心、杭州理财中心和香港子公司（广发国际资产管理有限公司）。

截至2012年12月31日，本基金管理人管理二十八只开放式基金---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、广发亚太（除日本）精选股票证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本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和广发纯债债券型证券投资基金，管理资产规模为1131.06亿元。同时，公司还管理着多个企业年金基金、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	2010-04-29	-	12	女，中国籍，经济学学士，持有证券业执业证书，2000年7月至2004年10月任职于广发证券股份有限公司江门营业部，2004年10月至2008年8月在广发证券股份有限公司固定收益部工作，2008年8月11日至今在广发基金管理有限公司固定收益部工作，2010年4月29日起任广发货币基金的基金经理。

注：(1)基金经理的“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，为基金持有人谋求最大利益，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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；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。

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

4.3.3异常交易行为的专项说明

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

2012年货币政策偏宽松，年内分别下调两次存款准备金率和两次存贷款基准利率。受此影响，整体货币供应较充足，货币市场利率逐步下滑，一年内利率产品和信用产品收益率也在年内创出低点，一年期AAA短期融资券收益率最低达到3.2%。但年底关键时点效应明显，银行类机构纷纷压缩信用头寸和融券规模，资金面紧张。7天回购利率上升到4.5%，1个月回购利率更是接近5%。AAA短期融资券收益率持续上升，高点收益率接近4.5%，跟一年期金融债的利差扩大到120个基点，投资价值突出。

年初我们拉长久期，高配高收益的定期存款，锁定收益。年底把握资金利率上行机会，调整组合，增配短期融资券，提高组合收益率。债券组合以高等级短期融资券为主，保持组合流动性和规避信用风险。2013年我们仍然保持合理久期，银行存款比例维持在60%以上，并继续增配高等级短期融资券。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

报告期内广发货币A收益率为4.2452%，广发货币B收益率为4.4946%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2013年是新一届政府的开局第一年，预计整体货币政策基调以平稳为主，操作手段仍然主要依赖逆回购或者存款准备金等数量化工具。目前国内经济表现平稳，在可接受范围内运行，全年gdp增长预计在7.5%-8.5%之间，基建投资随着信贷的投放和地方债的融资发行而继续得到支持，房地产市场的回稳升温也有利于进一步的项目开工。虽然从2013年起银行开始执行更严格的资本监管，但股市和债市的融资渠道通畅，银行应能通过外部融资来满足监管要求，银行仍有能力和动力继续通过信贷来扩张规模，全年信贷规模应能在8万亿以上。物价是个不太确定的因素，整体物价水平仍在高位，这制约了货币政策的调整空间。外部经济的看点主要在于美国是否会提前收紧货币政策，和欧洲的复苏步伐是否能超预期。综合以上因素，我们判断国内货币政策调整的幅度不会太大，主要以数量工具为主，应有二次的降准空间。

2013年对货币基金而言仍然是较好的投资年份，在央行仍然采取以逆回购为主的措施来维持市场流动性的过程中，整体流动性不会泛滥，可投资品种收益率保持较高的收益率，我们的策略是在保持流动性的基础上做好大类资产配置，赚取资本利得和利息收入。

具体而言，我们将坚持货币市场基金流动性管理工具的投资目标，保持合理的组合平均剩余到期期限，在合规基础上进行组合管理，根据对利率和信用市场变化的规律的深入研究来提高组合收益。

4.6管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，加强内部风险的控制与防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，独立地开展监察稽核工作，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内，基金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控，对投资证券的研究、决策和交易，以及会计核算和相关信息披露工作进行了重点检查和合规性审核，确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则，保障了基金运作过程中的合法合规。

4.7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。

4.8管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同第十五部分《基金收益与分配》之“（三）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，按月支付。本基金报告期内累计分配收益1,519,895,652.33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

2012年，本托管人在对广发货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年，广发货币市场基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和7日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作基本按照有关法律法规、基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发货币基金2012年年度报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

天健审〔2013〕7-54号

广发货币市场基金全体持有人：

我们审计了后附的广发货币市场基金（以下简称广发货币）财务报表，包括2012年12月31日的资产负债表，2012年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表，以及财务报表附注。

6.1管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是广发货币的基金管理人广发基金管理有限公司管理层的责任，这种责任包括：(1)按照企业会计准则和中国证券投资基金业协会于2012年11月16日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；(2)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。

6.2注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

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审计意见

我们认为，广发货币的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券投资基金业协会于2012年11月16日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制，公允反映了广发货币2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况。

天健会计师事务所（特殊普通合伙）　注册会计师 杨克晶 禤文欣
杭州市西溪路128号新湖商务大厦9层
2013-03-25

§ 7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体：广发货币市场基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	19,644,657,628.75	13,838,055,426.09
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	11,454,353,286.42	6,565,409,405.12
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	11,454,353,286.42	6,565,409,405.12
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	142,500,413.75	894,001,901.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	277,388,769.50	165,612,340.72
应收股利	-	-
应收申购款	944,239,904.97	974,446,094.42
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	32,463,140,003.39	22,437,525,167.35
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011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	4,803,583,735.35	2,983,663,804.49
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	9,546,057.17	5,906,484.56
应付托管费	2,892,744.59	1,789,843.78
应付销售服务费	3,541,047.35	2,227,018.57
应付交易费用	271,807.18	145,773.95
应交税费	-	-
应付利息	574,070.59	918,272.76
应付利润	50,458,256.96	41,344,572.54
递延所得税负债	-	-
其他负债	294,076.39	231,684.93
负债合计	4,871,161,795.58	3,036,227,455.58
所有者权益：		
实收基金	27,591,978,207.81	19,401,297,711.77
未分配利润	-	-
所有者权益合计	27,591,978,207.81	19,401,297,711.77
负债和所有者权益总计	32,463,140,003.39	22,437,525,167.35

注：报告截止日2012年12月31日，广发货币A基金份额净值人民币1.0000元，基金份额总额15,114,541,379.68份；广发货币B基金份额净值人民币1.0000元，基金份额总额12,477,436,828.13份；总份额总额27,591,978,207.81份。

7.2利润表

会计主体：广发货币市场基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	1,814,686,887.92	513,315,181.40
1.利息收入	1,717,944,175.32	499,825,545.40
其中：存款利息收入	1,253,061,443.99	209,514,286.13
债券利息收入	401,006,108.81	137,847,734.22
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	63,876,622.52	152,463,525.05
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	96,731,396.21	13,464,636.00
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	96,731,396.21	13,464,636.00
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)	11,316.39	25,000.00
减：二、费用	294,791,235.59	80,712,119.91
1.管理人报酬	119,170,125.57	32,688,229.06
2.托管费	36,112,159.28	9,905,523.75
3.销售服务费	41,685,843.17	12,252,995.27
4.交易费用	1,168.00	150.00
5.利息支出	97,071,568.09	25,434,294.62
其中：卖出回购金融资产支出	97,071,568.09	25,434,294.62
6.其他费用	750,371.48	430,927.21
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	1,519,895,652.33	432,603,061.49
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	1,519,895,652.33	432,603,061.49

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发货币市场基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31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)	19,401,297,711.77	-	19,401,297,711.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,519,895,652.33	1,519,895,652.33
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)	8,190,680,496.04	-	8,190,680,496.04
其中：1.基金申购款	224,470,943,758.74	-	224,470,943,758.74
2.基金赎回款	-216,280,263,262.70	-	-216,280,263,262.70
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)	-	-1,519,895,652.33	-1,519,895,652.33
五、期末所有者权益(基金净值)	27,591,978,207.81	-	27,591,978,207.81
	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
一、期初所有者权益(基金净值)	2,899,111,298.29	-	2,899,111,298.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	432,603,061.49	432,603,061.49
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)	16,502,186,413.48	-	16,502,186,413.48
其中：1.基金申购款	110,122,640,146.89	-	110,122,640,146.89
2.基金赎回款	-93,620,453,733.41	-	-93,620,453,733.41
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)	-	-432,603,061.49	-432,603,061.49
五、期末所有者权益(基金净值)	19,401,297,711.77	-	19,401,297,711.77

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王志伟，主管会计工作负责人：林传辉，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”）证监基金字〔2005〕60号文《关于同意广发货币市场基金募集的批复》的批准，由广发基金管理有限公司作为发起人，于2005年4月26日向社会公开发行募集并于2005年5月20日正式成立。本基金为契约型开放式货币市场基金，存续期限不定，首次设立募集规模为2,636,630,865.77份基金份额。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为2005年4月26日至2005年5月17日，募集资金总额为人民币2,636,630,865.77元，其中募集资金的银行存款利息为人民币192,263.77元，上述资金业经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。

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》等有关规定和《广发货币市场基金基金合同》（“基金合同”）的有关规定，本基金的投资范围为：现金，一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单，剩余期限在三百九十七天以内（含三百九十七天）的债券，期限在一年以内（含一年）的债券回购，期限在一年以内（含一年）的中央银行票据，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。

本基金于2009年4月20日实施分级，基金分级后，在任何一个开放日，若A级基金份额持有人在单个基金账户中保留的基金份额达到或超过500万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的A级基金份额升级为B级基金份额，若B级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于500万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的B级基金份额降级为A级基金份额。两级基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。本基金的业绩比较基准：(1-利息税率)×活期存款利率。

本基金的财务报表于2013年3月25日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金执行企业会计准则、中国证券投资基金业协会于2012年11月16日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会于2010年2月8日颁布的证监公公告〔2010〕5号《证券投资基金信息披露XBRL模板3号<年度报告和半年度报告>》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合企业会计准则和中国证券投资基金业协会于2012年11月16日修订的《证券投资基金会计核算业务指引》规定的要求，真实、完整地反映了本基金2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4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。

7.4.5会计差错更正的说明

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

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、国家税务总局关于金融机构利息收入有关税收政策的通知》、国税函〔2008〕870号文《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税收优惠项目列示如下：

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。

7.4.7关联方关系

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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东（注）
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广发国际资产管理有限公司（GF International Investment Management Limited）	基金管理人全资子公司

注：原基金管理人股东香江投资有限公司于2012年5月10日更名为“深圳市前海香江金融控股集团有限公司”。除此之外，本报告期内及上年度可比期间不存在其他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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1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。

7.4.8.1.2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。

7.4.8.1.3债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	325,700,000.00	100.00%	330,000,000.00	100.00%

7.4.8.1.4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。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	119,170,125.57	32,688,229.06
其中：支付销售机构的客户维护费	24,143,692.17	7,740,953.43

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的0.33 %的年费率计提。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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	36,112,159.28	9,905,523.75

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.1%