诺安天天宝货币市场基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
送出日期:2017年3月30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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月29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。

本报告财务资料已经审计,德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了2016年度无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

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2016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	诺安天天宝货币	
基金主代码	000559	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年3月25日	
基金管理人	诺安基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	611,523,213.85份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	下属分级基金的交易代码	报告期末下属分级基金的份额总额
诺安天天宝货币A	000559	39,666,036.18份
诺安天天宝货币E	000560	71,751,403.52份
诺安天天宝货币B	000625	498,089,967.92份
诺安天天宝货币C	000818	2,015,806.23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		诺安基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	马宏	林葛
	联系电话	0755-83026688	010-66060069
	电子邮箱	info@lionfundcom.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-888-8998	95599
传真		0755-83026677	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.lionfundcom.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§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		本期已实现收益	本期利润	本期净值收益率
2016年	诺安天天宝货币A	2,062,779.83	2,062,779.83	2.1492%
	诺安天天宝货币E	1,969,087.21	1,969,087.21	2.3034%
	诺安天天宝货币B	9,197,643.72	9,197,643.72	2.7140%
	诺安天天宝货币C	109,591.18	109,591.18	2.2012%
2015年	诺安天天宝货币A	3,798,689.25	3,798,689.25	3.3203%
	诺安天天宝货币E	2,471,003.30	2,471,003.30	3.4756%
	诺安天天宝货币B	9,394,432.88	9,394,432.88	3.8905%
	诺安天天宝货币C	79,280.11	79,280.11	3.3710%
2014年3月25日(基金合同生效日)-2014年12月31日	诺安天天宝货币A	25,114,185.62	25,114,185.62	3.0694%
	诺安天天宝货币E	295,482.72	295,482.72	3.1911%
	诺安天天宝货币B	3,228,976.59	3,228,976.59	3.0449%
	诺安天天宝货币C	917,311.45	917,311.45	1.0373%

3.1.2 期末数据和指标		期末基金资产净值	期末基金份额净值
2016年末	诺安天天宝货币A	39,666,036.18	1.0000
	诺安天天宝货币E	71,751,403.52	1.0000
	诺安天天宝货币B	498,089,967.92	1.0000
	诺安天天宝货币C	2,015,806.23	1.0000
2015年末	诺安天天宝货币A	121,580,370.57	1.0000
	诺安天天宝货币E	83,379,537.36	1.0000
	诺安天天宝货币B	234,114,365.04	1.0000
	诺安天天宝货币C	766,740.13	1.0000
2014年末	诺安天天宝货币A	167,106,752.93	1.0000
	诺安天天宝货币E	17,443,983.18	1.0000
	诺安天天宝货币B	234,832,850.37	1.0000
	诺安天天宝货币C	4,579,902.45	1.0000

注:①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。

②本基金自2014年4月28日起,增加诺安天天宝B类基金份额类别;自2014年9月24日起,增加诺安天天宝C类份额。增加基金份额类别后,本基金将分设A类、E类、B类及C类四类基金份额,详情请参阅相关公告。

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

诺安天天宝货币A

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5485%	0.0029%	0.0894%	0.0000%	0.4591%	0.0029%
过去六个月	1.0610%	0.0032%	0.1789%	0.0000%	0.8821%	0.0032%
过去一年	2.1492%	0.0044%	0.3558%	0.0000%	1.7934%	0.0044%
自基金合同生效起至今	8.7803%	0.0076%	0.9849%	0.0000%	7.7954%	0.0076%

诺安天天宝货币E

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5573%	0.0029%	0.0894%	0.0000%	0.4679%	0.0029%
过去六个月	1.1380%	0.0032%	0.1789%	0.0000%	0.9591%	0.0032%
过去一年	2.3034%	0.0044%	0.3558%	0.0000%	1.9476%	0.0044%
自基金合同生效起至今	9.2371%	0.0076%	0.9849%	0.0000%	8.2522%	0.0076%

诺安天天宝货币B

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6890%	0.0029%	0.0894%	0.0000%	0.5996%	0.0029%
过去六个月	1.3421%	0.0032%	0.1789%	0.0000%	1.1632%	0.0032%
过去一年	2.7140%	0.0044%	0.3558%	0.0000%	2.3582%	0.0044%
自基金合同生效起至今	9.9694%	0.0077%	0.9518%	0.0000%	9.0076%	0.0077%

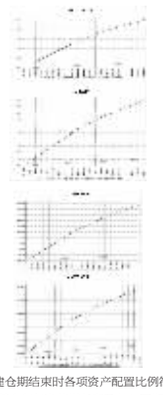
诺安天天宝货币C

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5611%	0.0029%	0.0894%	0.0000%	0.4717%	0.0029%
过去六个月	1.0963%	0.0032%	0.1789%	0.0000%	0.9074%	0.0032%
过去一年	2.2012%	0.0044%	0.3558%	0.0000%	1.8454%	0.0044%
自基金合同生效起至今	6.7422%	0.0081%	0.8069%	0.0000%	5.9353%	0.0081%

注:①本基金的利润分配方式是"每日分配,按日支付"。

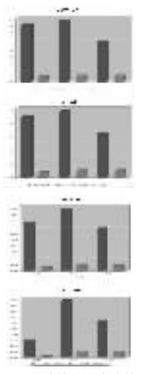
②本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



注:本基金建仓期为6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同于2014年3月25日生效,2014年本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

诺安天天宝货币A					
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
2016年	2,059,909.34	1,323.99	1,546.50	2,062,779.83	
2015年	3,807,008.81	29.82	-8,349.38	3,798,689.25	
2014年	25,091,832.25	8,069.41	14,283.96	25,114,185.62	
合计	30,958,750.40	9,423.22	7,481.08	30,975,654.70	

单位:人民币元

诺安天天宝货币E					
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
2016年	1,896,734.54	52,652.91	9,699.76	1,959,087.21	
2015年	2,356,303.98	111,837.67	2,861.65	2,471,003.30	
2014年	277,387.27	16,535.39	1,560.06	295,482.72	
合计	4,530,425.79	181,025.97	14,121.47	4,725,573.23	

单位:人民币元

诺安天天宝货币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
2016年	8,476,291.55	627,396.86	93,955.31	9,197,643.72	
2015年	9,134,822.22	268,311.94	-8,701.28	9,394,432.88	
2014年	3,098,199.06	107,150.25	23,627.28	3,228,976.59	
合计	20,709,312.83	1,002,859.05	108,881.31	21,821,053.19	

单位:人民币元

诺安天天宝货币C					
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
2016年	103,661.16	5,582.87	347.15	109,591.18	
2015年	77,083.00	2,565.97	-358.86	79,280.11	
2014年	872,321.38	44,592.73	397.34	917,311.45	
合计	1,053,065.54	52,731.57	385.63	1,106,182.74	

§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

截至2016年12月31日,本基金管理人共管理52只开放式基金:诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安先锋混合型证券投资基金、诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长混合型证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长混合型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金、诺安中小盘精选混合型证券投资基金、诺安主题精选混合型证券投资基金、诺安全球黄金证券投资基金、上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金、诺安上证新兴产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安保本混合型证券投资基金、诺安多策略混合型证券投资基金、诺安全球收益不动产证券投资基金、诺安油气能源股票证券投资基金(LOF)、诺安新动力灵活配置混合型证券投资基金、诺安中证创业成长指数分级证券投资基金、诺安汇鑫保本混合型证券投资基金、诺安双利债券型发起式证券投资基金、中小板等权重交易型开放式指数证券投资基金、诺安研究精选股票型证券投资基金、诺安纯债定期开放债券型证券投资基金、诺安鸿鹄保本混合型证券投资基金、诺安信用债券一年定期开放债券型证券投资基金、诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金、诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、诺安理财宝货币市场基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、诺安聚鑫宝货币市场基金、诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安聚利债券型证券投资基金、诺安新经济股票型证券投资基金、诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金、诺安低碳经济股票型证券投资基金、诺安中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、诺安创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、诺安先进制造股票型证券投资基金、诺安利鑫保本混合型证券投资基金、诺安景鑫保本混合型证券投资基金、诺安益鑫保本混合型证券投资基金、诺安安鑫保本混合型证券投资基金、诺安精选回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安和鑫保本混合型证券投资基金、诺安积极回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金、诺安优选回报灵活配置混合型证券投资基金。

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		
裴禹翔	诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。诺安增利债券型证券投资基金基金经理。诺安天天宝货币市场基金基金经理。诺安鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金基金经理。诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。诺安泰鑫一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。诺安纯债定期开放债券型证券投资基金基金经理。诺安稳健回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理。诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2016年2月20日	-	5	硕士,曾先后任职于华融湘江银行股份有限公司,浙江浙商证券资产管理有限公司,任投资经理。2015年12月加入诺安基金管理有限公司,任基金经理助理,从事债券投资工作。2016年2月起任诺安裕鑫收益两年定期开放债券型证券投资基金基金经理,诺安增利债券型证券投资基金基金经理及诺安天天宝货币市场基金基金经理,2016年3月起任诺安稳固收益一年定期开放债券型证券投资基金基金经理,2016年8月起任诺安优势行业灵活配置混合型证券投资基金基金经理,2016年9月起任诺安进取回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
汪波	无	2014年11月29日	2016年2月20日	4	硕士,具有基金从业资格。曾先后任职于上海银行股份有限公司,国信证券股份有限公司,从事固定收益类品种的研究、投资工作。2014年2月加入诺安基金管理有限公司,历任债券基金经理助理、现金管理组负责人。2014年4月至2016年2月诺安纯利债券型证券投资基金基金经理以及诺安双利债券型发起式证券投资基金基金经理。2014年11月至2016年2月任诺安天天宝货币市场基金基金经理,诺安理财宝货币市场基金基金经理以及诺安聚鑫宝货币市场基金基金经理。2015年1月至2016年2月任诺安货币市场基金基金经理。

注:①此处基金经理的任职日期和离职日期均为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期间,诺安天天宝货币市场基金管理人严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规,遵守了《诺安天天宝货币市场基金基金合同》的规定,遵守了本公司管理制度。本基金投资管理未发生违法违规行为。

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

根据中国证监会2011年修订的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司更新并完善了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》。制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动,同时涵盖投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

投资研究方面,公司设立全公司所有投资组合适用的证券备选库,在此基础上,不同投资组合根据其投资目标、投资风格和投资范围的不同,建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库;公司拥有健全的投资授权制度,明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分,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;公司建立了统一的研究管理平台,所有内外部研究报告均通过该研究管理平台发布,并保障该平台对所有研究员和投资组合经理开放。

交易执行方面,对于场内交易,基金管理人在投资交易系统中设置了公平交易功能,交易中心按照时间优先、价格优先的原则执行所有指令,如果多个投资组合在同一时点就同一证券下达了相同方向的投资指令,并且市价在指令限价以内,投资交易系统自动将该证券的每笔交易报单都自动按比例分拆到各投资组合;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易的交易分配,在参与申购之前,各投资组合经理独立地确定申购价格和数量,并将申购指令下达给交易中心。公司在获配额度确定后,按照价格优先的原则进行分配,如果申购价格相同,则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配;对于银行间市场交易、固定收益平台、交易所大宗交易,投资组合经理以该投资组合的名义向交易中心下达投资指令,交易中心向银行间市场或交易对手询价、成交确认,并根据"时间优先、价格优先"的原则保证各投资组合获得公平的交易机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公平交易制度总体执行情况良好,未发现违反公平交易制度的情况。此外,公司对连续四个季度期间内,公司管理的不同投资组合在日内、3日内、5日内的同向交易的交易价差进行了分析,未发现同向交易价差在上述时间窗口下出现异常的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量不存在超过该证券当日成交量的5%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

本基金在以流动性管理作为重点的同时努力提高收益。相机执择进行短融配置,灵活进行逆回购和存款运作,在流动性的关键时点,安排相应的资金到期,使资产保持较强的流动性,以满足投资者日常的申购、赎回需求。

管理人始终坚持"确保本金的安全性、资产的流动性,力争为投资者提供高于投资基准的稳定收益"的原则,注重信用风险的控制,严格执行内部债券评级制度,确保资产的安全性。在投资管理过程中,注重控制投资、交易及操作风险,对基金资产进行合理配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,本基金基金份额组合的剩余期限为53天,影子定价偏离度为-0.0116%。

本报告期诺安天天宝货币A基金份额净值收益率为2.1492%,诺安天天宝货币A的同期业绩比较基准收益率为0.3558%;诺安天天宝货币E基金份额净值收益率为2.3034%,诺安天天宝货币E的同期业绩比较基准收益率为0.3558%;诺安天天宝货币B基金份额净值收益率为2.7140%,诺安天天宝货币B的同期业绩比较基准收益率为0.3558%;诺安天天宝货币C基金份额净值收益率为2.2012%,诺安天天宝货币C的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

在"防风险、去杠杆"总基调下,央行货币政策转为稳健中性,资金面将表现为紧平衡,波动性会比较大,管理人将继续灵活进行逆回购和存款操作,在保证资产的流动性和安全性的基础上,秉持债券分散化投资的原则,通过动态调整债券资产比例,释放收益,为投资者创造更高的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人与本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部、风险控制部、固定收益事业部及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算基于投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同约定,本基金收益"每日分配,按日支付"。本基金本期实现收益为13,329,101.94元,应分配利润13,329,101.94元,已实施利润分配13,329,101.94元,符合合同约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内,本基金未出现连续二十个工作日出现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

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人—诺安基金管理有限公司 2016 年 1 月 1 日至 2016年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,除2月15日,诺安天天宝货币证券投资基金投资现金、国债、中央银行票据、政策性金融债占基金资产净值的比例低于5%,违反了《货币市场基金监督管理办法》及基金合同规定。诺安基金管理有限公司在诺安天天宝货币证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照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

本托管人认为,诺安基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)及其经办注册会计师王明静、江丽雅于2017年3月29日出具了德师报(审)字(17)第P00733号"无保留意见的审计报告"。投资者可以通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:诺安天天宝货币市场基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款	154,728,031.90	5,952,006.01
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	230,264,176.78	370,245,829.20
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	230,264,176.78	370,245,829.20
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	183,429,155.14	49,000,513.50
应收证券清算款	-	-
应收利息	4,273,531.46	2,070,395.63
应收股利	-	-
应收申购款	39,119,735.86	12,878,851.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	611,814,631.14	440,147,595.71
负债和所有者权益	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	32,189.00	54,882.73
应付托管费	48,827.58	38,226.83
应付销售服务费	17,166.15	34,682.93
应付交易费用	13,365.07	24,469.35
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	130,869.49	25,320.77
递延所得税负债	-	-
其他负债	49,000.00	129,000.00
负债合计	291,417.29	306,582.61
所有者权益:		
实收基金	611,523,213.85	439,841,013.10
未分配利润	-	-
所有者权益合计	611,523,213.85	439,841,013.10
负债和所有者权益总计	611,814,631.14	440,147,595.71

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额611,523,213.85份。其中,诺安天天宝A基金份额净值1.0000元,基金份额总额39,666,036.18 份;诺安天天宝E基金份额净值1.0000元,基金份额总额71,751,403.52份;诺安天天宝B基金份额净值1.0000元,基金份额总额498,089,967.92份;诺安天天宝C基金份额净值1.0000元,基金份额总额2,015,806.23 份。

7.2 利润表

会计主体:诺安天天宝货币市场基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一.收入	15,290,249.76	17,391,742.92
1.利息收入	13,356,217.74	10,995,068.55
其中:存款利息收入	5,463,924.33	102,660.52
债券利息收入	6,004,492.91	5,152,620.98
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	1,887,800.50	5,739,797.05
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	1,934,032.02	6,391,534.08
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,934,032.02	6,391,534.08
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
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)	-	5,140.29
减:二.费用	1,961,147.82	1,648,337.38
1. 管理人报酬	571,647.20	582,216.30
2. 托管费	533,387.40	441,993.56
3. 销售服务费	343,588.56	370,472.23
4. 交易费用	150.00	50.00
5. 利息支出	284,924.29	18,531.93
其中:卖出回购金融资产支出	284,924.29	18,531.93
6. 其他费用	227,450.37	235,073.36
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	13,329,101.94	15,743,405.54
减:所得税费用	-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	13,329,101.94	15,743,405.54

7.3 所有者权益(基金净值)变动表会计主体:诺安天天宝货币市场基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	439,841,013.10	-	439,841,013.10
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	13,329,101.94	13,329,101.94
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)	171,682,200.75	-	171,682,200.75
其中:1.基金申购款	13,702,290,210.60	-	13,702,290,210.60
2.基金赎回款	-13,530,608,009.85	-	-13,530,608,009.85
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)	-	-13,329,101.94	-13,329,101.94
五.期末所有者权益(基金净值)	611,523,213.85	-	611,523,213.85
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	423,963,488.93	-	423,963,488.93
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,743,405.54	15,743,405.54
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)	15,877,524.17	-	15,877,524.17
其中:1.基金申购款	5,242,944,880.98	-	5,242,944,880.98
2.基金赎回款	-5,227,067,356.81	-	-5,227,067,356.81
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)	-	-15,743,405.54	-15,743,405.54
五.期末所有者权益(基金净值)	439,841,013.10	-	439,841,013.10

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:

_____奥成文_____ _____薛有为_____ _____薛有为_____

基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

诺安天天宝货币市场基金(简称"本基金"),经中国证券监督管理委员会(简称"中国证监会")证监许可[2014]184号文《关于核准诺安天天宝货币市场基金募集的批复》核准,于2014年3月3日至2014年3月21日向社会进行公开募集,经毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验资,募集的有效认购金额为人民币3,639,696,827.36元,折合3,639,696,827.36份基金份额,有效认购金额产生的利息为人民币370,352.18元,折合370,352.18份基金份额于基金合同生效后归入本基金。其中A级有效认购资金人民币3,696,078,725.82元,利息转份额370,217.61元,合计人民币3,639,448,943.43元;E级有效认购资金人民币618,101.54元,利息转份额134.57元,合计人民币618,236.11元。有效认购户数为16,832户,其中A级认购户数16,802户,E级认购户数30户。与上述投入的资金相关的资产总额为货币资金人民币3,640,067,179.54元。

根据2014年4月24日公告的《诺安基金管理有限公司关于诺安天天宝货币市场基金新增基金份额类别的公告》,自2014年4月28日起,本基金增加诺安天天宝B类基金份额,分级后本基金分设A类、E类及B类三类基金份额;根据2014年9月24日公告的《诺安基金管理有限公司关于诺安天天宝货币市场基金新增基金份额类别的公告》,自2014年9月24日起,本基金增加诺安天天宝C类基金份额,分级后本基金设四类基金份额:A类、E类、B类、C类。不同级别的基金份额适用不同费率的销售服务费。本基金四类基金份额分别设置基金代码,单独公布基金万份净值收益和7日年化收益率。

本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为诺安基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。《诺安天天宝货币市场基金基金合同》、《诺安天天宝货币市场基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

本基金的财务报表于2017年3月29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

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称"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。

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2016年12月31日的财务状况以及2016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

根据财政部、国家税务总局财税[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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 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债券免征营业税或增值税。

(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
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
大恒新纪元科技股份有限公司	管理人股东
诺安基金