广发天天利货币市场基金 2017年年度报告摘要

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年3月23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2017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	16,474,086,942.09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	广发天天利货币B	广发天天利货币E
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	607,766,389.63份	2,418,281,601.11份	13,448,038,951.35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系统管理。
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		020-83939158	(010)66594942

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	广州市海珠区暨洲大道东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	2017年			2016年			2015年		
	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E
本期已实现收益	22,835,861.84	131,867,523.10	390,989,778.53	6,088,148.44	17,775,647.38	4,561,039.93	9,773,688.17	1,093,593.34	77,051.26
本期利润	22,835,861.84	131,867,523.10	390,989,778.53	6,088,148.44	17,775,647.38	4,561,039.93	9,773,688.17	1,093,593.34	77,051.26
本期净值收益率	3.9628%	4.2119%	3.9640%	2.5205%	2.7670%	2.5221%	3.6029%	3.8515%	2.5082%
3.1.2期末数据和指标	2017年末			2016年末			2015年末		
	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E
期末基金资产净值	607,766,389.63	2,418,281,601.11	13,448,038,951.35	228,605,036.92	4,072,870,799.39	805,664,704.08	256,364,991.25	27,424,803.57	7,347,574.46
期末基金份额净值	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000	1.000

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

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:

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	1.0053%	0.0012%	0.0882%	0.0000%	0.9171%	0.0012%
过去六个月	2.0261%	0.0009%	0.1764%	0.0000%	1.8497%	0.0009%
过去一年	3.9628%	0.0012%	0.3500%	0.0000%	3.6128%	0.0012%
过去三年	10.4233%	0.0056%	1.0510%	0.0000%	9.3723%	0.0056%
自基金合同生效起至今	14.8336%	0.0056%	1.3760%	0.0000%	13.4576%	0.0056%

2. 广发天天利货币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	1.0666%	0.0012%	0.0882%	0.0000%	0.9784%	0.0012%
过去六个月	2.1496%	0.0009%	0.1764%	0.0000%	1.9732%	0.0009%
过去一年	4.2119%	0.0012%	0.3500%	0.0000%	3.8619%	0.0012%
过去三年	11.2202%	0.0056%	1.0510%	0.0000%	10.1692%	0.0056%
自基金合同生效起至今	15.9091%	0.0056%	1.3760%	0.0000%	14.5331%	0.0056%

3. 广发天天利货币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	1.0053%	0.0012%	0.0882%	0.0000%	0.9171%	0.0012%
过去六个月	2.0265%	0.0009%	0.1764%	0.0000%	1.8501%	0.0009%
过去一年	3.9640%	0.0012%	0.3500%	0.0000%	3.6140%	0.0012%
自基金合同生效起至今	9.2595%	0.0052%	0.9733%	0.0000%	8.2862%	0.0052%

注:(1)业绩比较基准:人民币活期存款利率(税后)。

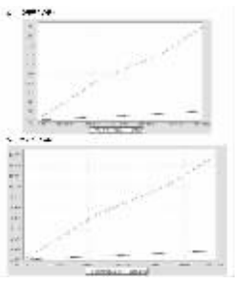
(2)本基金于2015年3月23日增加E类份额。

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

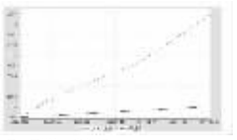
广发天天利货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年1月27日至2017年12月31日)



3.广发天天利货币E



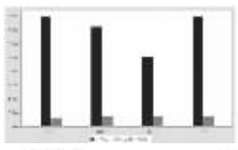
注:本基金于2015年3月23日增加E类份额。

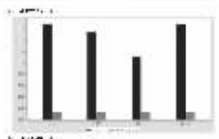
3.2.3基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

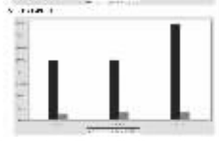
广发天天利货币市场基金

基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1.广发天天利货币A







注:(1)合同生效当年(2014年)按实际存续期计算,未按自然年度折算。

(2)本基金于2015年3月23日增加E类份额,当年(2015年)按实际存续期计算,未按自然年度折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

广发天天利货币A:

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
2017年	22,764,175.54	21,246.53	50,439.77	22,835,861.84	-
2016年	6,072,452.67	4,850.40	10,845.37	6,088,148.44	-
2015年	10,099,084.50	206,559.17	-531,955.50	9,773,688.17	-
合计	38,935,712.71	232,656.10	-470,670.36	38,697,698.45	-

广发天天利货币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
2017年	131,196,409.00	874,839.26	-203,725.16	131,867,523.10	-
2016年	17,222,088.89	22,111.33	531,447.16	17,775,647.38	-
2015年	1,155,960.95	26,544.23	-88,911.84	1,093,593.34	-
合计	149,574,458.84	923,494.82	238,810.16	150,736,763.82	-

广发天天利货币E:

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
2017年	389,344,519.05	-	1,645,259.48	390,989,778.53	-
2016年	4,461,288.15	-	99,751.78	4,561,039.93	-
2015年	76,550.63	-	500.63	77,051.26	-
合计	393,882,357.83	-	1,745,511.89	395,627,869.72	-

§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。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、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、受托管理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、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)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29个部门:权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外,还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司(香港子公司),参股了证通股份有限公司。

截至2017年12月31日,本基金管理人管理161只开放式基金,管理资产规模为2799亿元。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资和养老基金投资组合。

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		
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发聚财7天债券基金的基金经理;广发天天红基金的基金经理;广发钱袋子基金的基金经理;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;广发稳鑫保本基金的基金经理;广发鑫惠混合基金的基金经理;广发鑫益混合基金的基金经理;广发鑫利混合基金的基金经理;广发安泰混合基金的基金经理	2014-01-27	-	10年	任爽女士,经济学硕士,持有中国证券投资基金从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部交易员兼任研究员。现任广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自2012年12月12日起任职)、广发聚财7天债券型证券投资基金基金经理(自2013年6月20日起任职)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2013年10月22日起任职)、广发天天利货币市场基金基金经理(自2014年1月27日起任职)、广发钱袋子货币市场基金基金经理(自2014年6月30日起任职)、广发活期宝货币市场基金基金经理(自2014年8月28日起任职)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自2015年6月8日起任职)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年2月21日起任职)、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日起任职)、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日起任职)、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日起任职)、广发安泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月9日起任职)。

注:1."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。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

2017年国内货币市场呈现出明显的"量缩价涨"的特征:首先从量上看,银行间超储率全年基本在1.5%以下位置运行,属于历史较低位置,银行间可用资金较少;而从反映货币总供应的M2指标来看年内震荡走低,至17年底跌至8.2%的历史低位。如果看相对于名义经济增长的货币供应量情况,以M2同比增长减去实际GDP与CPI同比增长之和,这一指标年内不断收敛并在年底转负,说明相对于经济增长货币的供应量也是在缩减的;其次从价上来看,在金融去杠杆的政策基调下,央行年内多次对金融市场政策利率(OMO/MLF/SLF等操作利率)加息,利率走廊位置上移,银行之间拆借利率DR007中枢跟随抬升;非银机构方面,流动性结构性短缺的调控框架下处境尴尬,流动性分层现象较为明显,反映在融资利率波动较大、关键时点融资难度加大等。此外,在总量流动性较薄的背景下资金面应对外生冲击的能力明显下降,这使得缴税缴准、公开市场到期等冲击显性化,资金利率呈现出较明显的时点性规律。本基金在报告期内操作以流动性为最重要考虑因素。本基金在春节以及季末等关键时点均安排了大部分现金流到期,再投资收益较好,实现了收益和流动性兼顾。品种选择方面则在保障流动性的前提下进行择高配置,尽量在稳健基础上提高组合收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发天天利货币A类净值增长率为3.9628%,广发天天利货币B类净值增长率为4.2119%,广发天天利货币E类净值增长率为3.9640%,同期业绩比较基准收益率为0.3500%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来一年,预计央行会延续稳健中性的货币政策。在稳步"去杠杆"成为我国金融攻坚战重中之重的大背景下,预计货币政策很难出现边际上的改善,整体货币市场利率水平也会在高位维持。大资管新规即将出台,对整个行业以及金融资产定价的冲击预计会逐步体现。但是,未来也仍需密切关注经济形势的变化。在资管新规影响逐步消化以后,市场的关注或许会更多回到经济基本面上来。

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、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理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。合规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、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545,693,163.47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")在对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(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 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 江丽雅 洪锐明签字出具了德师报(审)字(18)第P01489号标准无保留意见的审计报告,投资者可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:广发天天利货币市场基金

报告截止日:2017年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产:	-	-
银行存款	7,761,174,765.22	2,151,242,930.35
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	8,710,018,082.09	1,468,878,652.40
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	8,710,018,082.09	1,468,878,652.40
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,707,579,688.71	1,594,448,881.67
应收证券清算款	-	-
应收利息	43,618,577.93	7,346,361.44
应收股利	-	-
应收申购款	19,677,720.82	11,484,156.88
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	18,242,068,834.77	5,233,400,982.74
负债和所有者权益	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016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	1,756,218,485.66	123,749,614.37
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,145,477.41	950,560.86
应付托管费	1,256,205.29	288,048.73
应付销售服务费	2,767,059.76	208,781.83
应付交易费用	126,619.62	50,676.16
应交税费	-	-
应付利息	964,862.85	21,552.40
应付利润	2,154,182.09	662,208.00
递延所得税负债	-	-
其他负债	349,000.00	329,000.00
负债合计	1,767,981,892.68	126,260,442.35
所有者权益:	-	-
实收基金	16,474,086,942.09	5,107,140,540.39
未分配利润	-	-
所有者权益合计	16,474,086,942.09	5,107,140,540.39
负债和所有者权益总计	18,242,068,834.77	5,233,400,982.74

注:报告截止日2017年12月31日,广发天天利货币A基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额607,766,389.63份;广发天天利货币B基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额2,418,281,601.11份;广发天天利货币E基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额13,448,038,951.35份;总份额总额16,474,086,942.09份。

7.2 利润表

会计主体:广发天天利货币市场基金

本报告期:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
一、收入	648,962,922.13	35,936,140.96
1.利息收入	641,551,458.08	35,765,271.38
其中:存款利息收入	296,919,239.49	7,035,785.82
债券利息收入	256,901,678.09	16,145,268.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	87,730,540.50	12,584,217.12
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	7,401,464.05	170,869.58
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	7,401,464.05	170,869.58
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	103,259,758.66	7,511,306.21
1. 管理人报酬	45,193,762.87	3,310,237.98
2. 托管费	13,695,079.59	1,003,102.53
3. 销售服务费	26,556,269.50	1,101,829.98
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	17,289,689.38	1,660,621.53
其中:卖出回购金融资产支出	17,289,689.38	1,660,621.53
6. 其他费用	524,957.32	435,513.19
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	545,693,163.47	28,424,835.75
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	545,693,163.47	28,424,835.75

7.3 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:2017年1月1日至2017年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017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)	5,107,140,540.39	-	5,107,140,540.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	545,693,163.47	545,693,163.47
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)	11,366,946,401.70	-	11,366,946,401.70
其中:1.基金申购款	77,782,227,081.80	-	77,782,227,081.80
2.基金赎回款	-66,415,280,680.10	-	-66,415,280,680.10
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)	-	-545,693,163.47	-545,693,163.47
五、期末所有者权益(基金净值)	16,474,086,942.09	-	16,474,086,942.09
项目	上年度可比期间 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)	291,137,369.28	-	291,137,369.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	28,424,835.75	28,424,835.75
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)	4,816,003,171.11	-	4,816,003,171.11
其中:1.基金申购款	8,418,032,269.69	-	8,418,032,269.69
2.基金赎回款	-3,602,029,098.58	-	-3,602,029,098.58
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)	-	-28,424,835.75	-28,424,835.75
五、期末所有者权益(基金净值)	5,107,140,540.39	-	5,107,140,540.39

报表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:

基金管理人负责人:孙树明,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》、《公开募集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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围包括:1、现金;2、期限在1年以内(含1年)的银行存款(包括活期存款、定期存款、通知存款、大额存单等)、债券回购、中央银行票据、同业存单;3、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、非金融企业债务融资工具(包括但不限于短期融资券、超短期融资券、中期票据)、资产支持证券;4、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)。本基金自2015年3月23日起增设E类基金份额,并自该日起接受投资者对E类基金份额的申购。

本基金的财务报表于2018年3月23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(以下简称"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2017年12月31日的财务状况以及2017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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《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》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、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;2018年1月1日起,公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为,以基金管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

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
中国银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
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
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
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
康美药业股份有限公司	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
GF International Investment Management Limited(广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注:本基金本报告期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。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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	1,627,600,000.00	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可比期间未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 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	45,193,762.87	3,310,237.98
其中:支付销售机构的客户维护费	775,150.35	254,834.40

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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	13,695,079.59	1,003,102.53

注:本基金的托管费按前一日基金资