广发货币市场基金 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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:二〇一八年三月二十七日

§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。

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

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

基金名称	广发货币市场基金			
基金简称	广发货币			
基金主代码	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	23,760,966,691.37份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E
下属分级基金的交易代码	270004	270014	005092	511920
报告期末下属分级基金的份额总额	5,543,727,825.74份	18,216,579,648.37份	546,358.26份	112,859.00份

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。自下而上是指要由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:国(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	郭明
	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

登载基金年度报告正文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	2017年				2016年				2015年			
	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E
本期已实现收益	142,198,886.74	961,193,691.19	2,269.66	1,882,958.99	175,504,753.23	3,694,324,307.75	-	3,096,320.09	428,932,237.24	2,964,605,603.69	-	-
本期利润	142,198,886.74	961,193,691.19	2,269.66	1,882,958.99	175,504,753.23	3,694,324,307.75	-	3,096,320.09	428,932,237.24	2,964,605,603.69	-	-
本期净值收益率	3.559 6%	3.807 9%	1.478 7%	3.383 5%	2.581 3%	2.827 6%	-	1.921 6%	3.695 4%	3.944 0%	-	-
3.1.2期末数据和指标	2017年末				2016年末				2015年末			
	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E
期末基金资产净值	5,543,727,825.74	18,216,579,648.37	546,358.26	11,285,900.00	7,377,328,457.19	7,076,919,757.94	-	864,316,600.00	10,638,983,749.05	173,249,172,812.41	-	-
期末基金份额净值	1.000 0	1.000 0	1.000 0	100.000 0	1.000 0	1.000 0	-	100.000 0	1.000 0	1.000 0	-	-

注:(1)本基金C类合同生效日为2017年8月16日,至报告期末不满一年。

(2)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。

(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,本期已实现收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

(4)本基金A、B、C类基金份额的利润分配按月结转为对应份额,本基金E类基金份额持有人收益账户内的累计收益不低于100元时,则100元整数倍的累计收益将兑付为相应E类基金份额。

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

广发货币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	0.9822%	0.0009%	0.0894%	0.0000%	0.8928%	0.0009%
过去六个月	1.9604%	0.0008%	0.1789%	0.0000%	1.7815%	0.0008%
过去一年	3.5596%	0.0016%	0.3549%	0.0000%	3.2047%	0.0016%
过去三年	10.1581%	0.0022%	1.0656%	0.0000%	9.0925%	0.0022%
过去五年	20.3561%	0.0028%	1.7753%	0.0000%	18.5808%	0.0028%
自基金合同生效起至今	48.0915%	0.0057%	16.2633%	0.0032%	31.8282%	0.0025%

广发货币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	1.0429%	0.0009%	0.0894%	0.0000%	0.9535%	0.0009%
过去六个月	2.0832%	0.0008%	0.1789%	0.0000%	1.9043%	0.0008%
过去一年	3.8079%	0.0016%	0.3549%	0.0000%	3.4530%	0.0016%
过去三年	10.9528%	0.0022%	1.0656%	0.0000%	9.8872%	0.0022%
过去五年	21.8065%	0.0028%	1.7753%	0.0000%	20.0302%	0.0028%
自基金合同生效起至今	37.0231%	0.0042%	6.0490%	0.0019%	30.9741%	0.0023%

广发货币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	0.9824%	0.0009%	0.0894%	0.0000%	0.8930%	0.0009%
自基金合同生效起至今	1.4787%	0.0008%	0.1332%	0.0000%	1.3455%	0.0008%

广发货币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	0.9075%	0.0007%	0.0894%	0.0000%	0.8181%	0.0007%
过去六个月	1.8292%	0.0007%	0.1789%	0.0000%	1.6503%	0.0007%
过去一年	3.3835%	0.0014%	0.3549%	0.0000%	3.0286%	0.0014%
自基金合同生效起至今	5.3700%	0.0018%	0.6388%	0.0000%	4.7312%	0.0018%

注:(1)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息:(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:国(1-利息税率)×活期存款利率"。

(2)业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

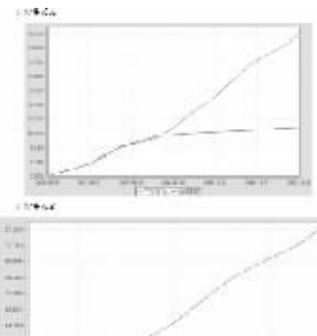
3.2.2基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

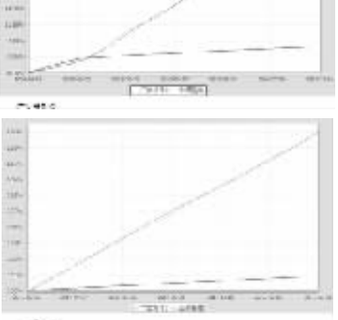
广发货币市场基金

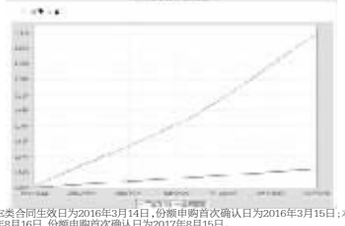
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005年5月20日至2017年12月31日)

广发货币A







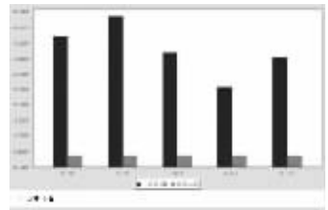
注:本基金E类合同生效日为2016年3月14日,份额申购首次确认日为2016年3月15日;本基金C类合同生效日为2017年8月16日,份额申购首次确认日为2017年8月15日。

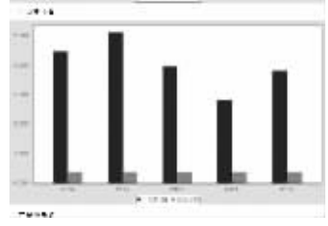
3.2.3基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发货币市场基金

基金净值收益率与业绩比较基准历年收益率对比图

广发货币A





3.3 过去三年基金的利润分配情况

广发货币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	144,687,174.47	-4,722,723.50	2,234,435.77	142,198,886.74	-
2016年	193,652,929.69	-14,397,690.61	-3,750,485.85	175,504,753.23	-
2015年	411,380,598.58	33,652,329.51	-16,100,690.85	428,932,237.24	-
合计	749,720,702.74	14,531,915.40	-17,616,740.93	746,635,877.21	-

广发货币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	822,321,476.63	166,891,491.76	-28,019,277.20	961,193,691.19	-
2016年	3,570,451,155.08	250,350,171.35	-126,477,018.68	3,694,324,307.75	-
2015年	2,593,916,320.60	229,775,783.84	140,913,499.25	2,964,605,603.69	-
合计	6,986,688,952.31	647,017,446.95	-13,582,796.63	7,620,123,602.63	-

广发货币C

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	981.07	191.56	1,097.03	2,269.66	-
合计	981.07	191.56	1,097.03	2,269.66	-

广发货币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	1,962,500.00	66,979.36	-146,520.37	1,882,958.99	-
2016年	2,669,500.00	269,708.75	157,111.34	3,096,320.09	-
合计	4,632,000.00	336,688.11	10,590.97	4,979,279.08	-

§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		
温秀娟	本基金的基金经理;广发理财30天债券基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发现金宝场内货币基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理;广发添利宝ETF基金的基金经理;广发天天红基金的基金经理;现金投资部总经理	2010-04-29	-	18年	温秀娟女士,经济学学士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理,广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理。现任广发基金管理有限公司现金投资部总经理、广发货币市场基金基金经理(自2010年4月29日起任职)、广发理财30天债券型证券投资基金基金经理(自2013年1月14日起任职)、广发理财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)、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理(自2013年12月2日起任职)、广发活期宝货币市场基金基金经理(2014年8月28日起任职)、广发添利交易型货币市场基金基金经理(自2016年11月22日起任职)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2017年10月31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,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以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

报告期内,银行间市场资金利率波动较大,呈现出一定时点性规律,具体表现在每月月中开始季节性收紧,每月下旬或月底重新回归利率走廊,而每个季度末存单和存款利率往往是3个月内最高。从央行的操作来看,货币政策维持中性,采取削峰填谷的精细化操作模式,根据市场流动性状况灵活调整回笼或投放方向。本基金遵循资金利率变化规律,将现金流安排在季度末/年末,滚动配置。报告期内,组合积极管理现金流,在季末、年末等收益率较高的时点配置资产,获取较高的再投资收益,提高组合收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发货币A类净值增长率为3.5596%,广发货币B类净值增长率为3.3835%,广发货币E类净值增长率为3.8079%,同期业绩比较基准收益率为0.3549%;广发货币C类净值增长率为1.4787%,同期业绩比较基准收益率为0.1332%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

报告期内,整体来说,央行执行稳健中性的货币政策,一季度银行间市场资金面偏紧,二季度在金融监管加强的环境下,流动性方面有所缓和,到四季度接近年底流动性非常紧张,跨年资金到6M资金利率创全年新高。宏观数据来看,2017年经济表现平稳,略超预期,整体来看地产投资下滑速度慢于市场预期。高频数据看,上游RJ/CRB商品价格指数12月上旬小幅下跌,但中旬开始再度明显上行,而反映国内大宗商品价格走势的南华工业品指数12月整体震荡走高,均指向主要工业品价格走势仍强;中游钢材、水泥价格表现依旧较为强势,尤其是水泥价格仍在持续上涨,供给限制是重要原因,不过可能也反映需求端的稳定。生产指标方面,部分指标开始企稳反弹(包括高炉开工率、发电耗煤量等),不过整体仍然处于较弱的区间,采暖季对企业生产的影响预计还将延续;下游地产销售12月30大中城市商品房销售面积同比增速跌幅较11月继续收窄,乘用车零售增速则表现较差。通胀方面,从目前高频数据的跟踪来看,12月CPI没有观察到很明显的涨价压力,综合考虑基数效应中枢可能会继续维持在1.7%附近,PPI方面虽然目前来看主要工业品的价格仍然较强,但估计难敌去年的高基数压力,预计12月PPI中枢可能会回落到4.8%附近。整体来说,四季度经济有所回落但幅度不深;2018年经济增速大概率温和回落,CPI中枢上移但PPI中枢下移。展望2018年,经济基本面平稳,去杠杆进程仍将持续,稳健中性货币政策没有全面宽松的必要性,但会守住不发生金融系统性风险的底线。短端利率可能仍保持在相对较高水平。操作上,本基金将保持适度久期和杠杆,继续做好流动性管理。

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A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额的利润分配按月结转为对应份额,本基金E类基金份额持有人收益账户内的累计收益不低于100元时,则100元整数倍的累计收益将兑付为相应E类基金份额。本基金报告期内累计分配收益1,105,277,806.58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,本基金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》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定,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基金托管人应尽的义务。

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》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

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市场基金2017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

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计了2017年12月31日的资产负债表、2017年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注,并出具了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	8,456,606,244.51	29,148,205,896.71
结算备付金	-	190,010,000.00
存出保证金	-	3,440.90
交易性金融资产	11,626,742,589.15	32,842,812,164.63
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	11,626,742,589.15	32,842,812,164.63
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	5,649,848,702.12	21,275,898,974.72
应收证券清算款	-	-
应收利息	55,803,599.60	221,359,440.37
应收股利	-	-
应收申购款	171,255,891.10	1,449,714,358.10
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	25,960,257,026.48	85,128,004,275.43
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	2,097,285,974.05	1,711,737,130.98
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	8,291,507.12	18,628,633.49
应付托管费	2,512,577.93	5,645,040.44
应付销售服务费	1,052,940.95	1,772,801.90
应付交易费用	335,408.60	847,062.36
应交税费	-	-
应付利息	1,269,722.67	387,889.92
应付利润	44,241,636.44	70,171,901.21
递延所得税负债	-	-
其他负债	33,127,526.35	249,000.00
负债合计	2,188,117,294.11	1,809,439,460.30
所有者权益:		
实收基金	23,772,139,732.37	83,318,564,815.13
未分配利润	-	-
所有者权益合计	23,772,139,732.37	83,318,564,815.13
负债和所有者权益总计	25,960,257,026.48	85,128,004,275.43

注:报告截止日2017年12月31日,货币基金A级基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额5,543,727,825.74份;货币基金B级基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额18,216,579,648.37份;货币基金C级基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额546,358.26份;货币基金E级基金份额净值人民币100.0077元,基金份额总额112,859.00份。

7.2 利润表

会计主体:广发货币市场基金

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	1,308,953,504.53	4,662,400,666.99
1.利息收入	1,317,425,072.76	4,573,971,141.77
其中:存款利息收入	610,737,489.98	2,271,576,854.62
债券利息收入	475,125,091.65	1,889,890,702.57
资产支持证券利息收入	508,931.51	-
买入返售金融资产收入	231,053,559.62	412,503,584.58
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-8,542,584.46	88,315,255.88
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-8,669,652.95	88,315,255.88
资产支持证券投资收益	127,068.49	-
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)	71,016.23	114,269.34
减:二、费用	203,675,697.95	789,475,285.92
1. 管理人报酬	100,338,823.80	459,184,854.79
2. 托管费	30,405,704.30	139,146,925.79
3. 销售服务费	13,072,227.46	30,669,226.15
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	59,353,116.94	159,869,601.31
其中:卖出回购金融资产支出	59,353,116.94	159,869,601.31
6. 其他费用	505,825.45	604,677.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,105,277,806.58	3,872,925,381.07
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	1,105,277,806.58	3,872,925,381.07

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: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)	83,318,564,815.13	-	83,318,564,815.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,105,277,806.58	1,105,277,806.58
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)	-59,546,425,082.76	-	-59,546,425,082.76
其中:1.基金申购款	190,050,937,218.77	-	190,050,937,218.77
2.基金赎回款	-249,597,362,301.53	-	-249,597,362,301.53
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)	-	-1,105,277,806.58	-1,105,277,806.58
五、期末所有者权益(基金净值)	23,772,139,732.37	-	23,772,139,732.37
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)	183,888,156,561.46	-	183,888,156,561.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,872,925,381.07	3,872,925,381.07
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)	-100,569,591,746.33	-	-100,569,591,746.33
其中:1.基金申购款	579,211,920,390.52	-	579,211,920,390.52
2.基金赎回款	-679,781,512,136.85	-	-679,781,512,136.85
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)	-	-3,872,925,381.07	-3,872,925,381.07
五、期末所有者权益(基金净值)	83,318,564,815.13	-	83,318,564,815.13

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:

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 投资附注

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》、《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《广发货币市场基金基金合同》("基金合同")等有关规定,本基金的投资范围为: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,回业存单;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。

本基金于2009年4月20日起实施分级,分为A级基金份额和B级基金份额;2016年本基金增设E级基金份额,E级基金份额于2016年3月28日在上海证券交易所上市交易。本基金于2017年8月16日起增设C级基金份额。每份A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额面值为人民币1.00元,每份E类基金份额面值为100元人民币。本基金A类基金份额、B类基金份额和C类基金份额在场外申购和赎回,注册登记机构为基金管理人;E类基金份额在场内申购和赎回,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金分级后,在任何一个交易日,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。各类基金份额单独设置基金代码,收取不同的销售服务费,A级基金份额、B级基金份额和C类基金份额公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率,E级基金份额公布每百份基金已实现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业务操作,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