广发天天利货币市场基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 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

报告送出日期：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 5
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
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 15
5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
6 半年度财务会计报告（未经审计） 16
6.1 资产负债表 16
6.2 利润表 17
6.3 净资产变动表 18
6.4 报表附注 20
7 投资组合报告 39
7.1 期末基金资产组合情况 39
7.2 债券回购融资情况 39
7.3 基金投资组合平均剩余期限 40
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 40
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 41
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 41
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 42
7.9 投资组合报告附注 42
8 基金份额持有人信息 42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 42
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 43

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 43
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 44
9 开放式基金份额变动 44
10 重大事件揭示 44
10.1 基金份额持有人大会决议 44
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 44
10.4 基金投资策略的改变 45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 45
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 45
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 45
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 48
10.9 其他重大事件 48
11 影响投资者决策的其他重要信息 48
12 备查文件目录 49
12.1 备查文件目录 49
12.2 存放地点 49
12.3 查阅方式 49

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发天天利货币市场基金		
基金简称	广发天天利货币		
基金主代码	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	115,300,614,430.27 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	212,262,021.81 份	5,081,048.41 份	115,083,271,360.05 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积极管理。
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	项军	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com

客户服务电话	95105828	95566
传真	020-34281105	010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广东省广州市海珠区琶洲大道168号星河湾中心28-38层；广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	葛长伟	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路 3018 号 2603-2622 室

3 主要财务指标和基金净值表现

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	**报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）**		
	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	1,106,441.06	30,593.75	560,719,822.21
本期利润	1,106,441.06	30,593.75	560,719,822.21
本期净值收益率	0.4860%	0.6057%	0.4861%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**		
	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	212,262,021.81	5,081,048.41	115,083,271,360.05
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2026 年 6 月 30 日)**		
	广发天天利货币 A	广发天天利货币 B	广发天天利货币 E
累计净值收益率	35.6250%	39.7154%	29.0444%

注：（1）本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

（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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于本基金采用实际利率法计算账面价值并用影子定价和偏离度加以控制的模式核算，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

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	0.2369%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.1496%	0.0003%
过去六个月	0.4860%	0.0002%	0.1748%	0.0000%	0.3112%	0.0002%
过去一年	1.0027%	0.0002%	0.3537%	0.0000%	0.6490%	0.0002%
过去三年	4.0996%	0.0009%	1.0644%	0.0000%	3.0352%	0.0009%
过去五年	7.9131%	0.0010%	1.7741%	0.0000%	6.1390%	0.0010%
过去七年	12.5025%	0.0013%	2.4848%	0.0000%	10.0177%	0.0013%
过去十年	24.3694%	0.0026%	3.5494%	0.0000%	20.8200%	0.0026%
自基金合同生效起至今	35.6250%	0.0042%	4.4107%	0.0000%	31.2143%	0.0042%

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①-③	②-④

		②		准差④		
过去三个月	0.2969%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.2096%	0.0003%
过去六个月	0.6057%	0.0002%	0.1748%	0.0000%	0.4309%	0.0002%
过去一年	1.2455%	0.0002%	0.3537%	0.0000%	0.8918%	0.0002%
过去三年	4.8522%	0.0009%	1.0644%	0.0000%	3.7878%	0.0009%
过去五年	9.2166%	0.0010%	1.7741%	0.0000%	7.4425%	0.0010%
过去七年	14.4092%	0.0013%	2.4848%	0.0000%	11.9244%	0.0013%
过去十年	27.3894%	0.0026%	3.5494%	0.0000%	23.8400%	0.0026%
自基金合同生效起至今	39.7154%	0.0042%	4.4107%	0.0000%	35.3047%	0.0042%

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	0.2369%	0.0003%	0.0873%	0.0000%	0.1496%	0.0003%
过去六个月	0.4861%	0.0002%	0.1748%	0.0000%	0.3113%	0.0002%
过去一年	1.0029%	0.0002%	0.3537%	0.0000%	0.6492%	0.0002%
过去三年	4.1002%	0.0009%	1.0644%	0.0000%	3.0358%	0.0009%
过去五年	7.9141%	0.0010%	1.7741%	0.0000%	6.1400%	0.0010%
过去七年	12.5040%	0.0013%	2.4848%	0.0000%	10.0192%	0.0013%
过去十年	24.3756%	0.0026%	3.5494%	0.0000%	20.8262%	0.0026%
自基金合同生效起至今	29.0444%	0.0035%	4.0024%	0.0000%	25.0420%	0.0035%

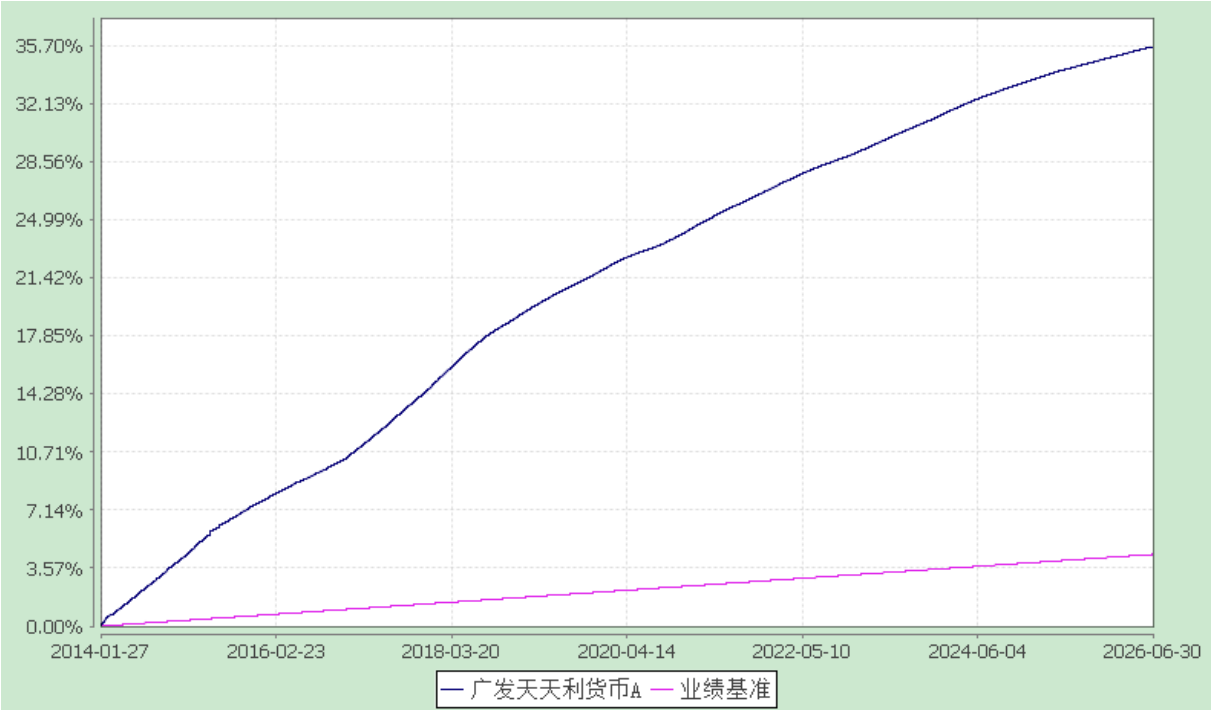
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发天天利货币市场基金

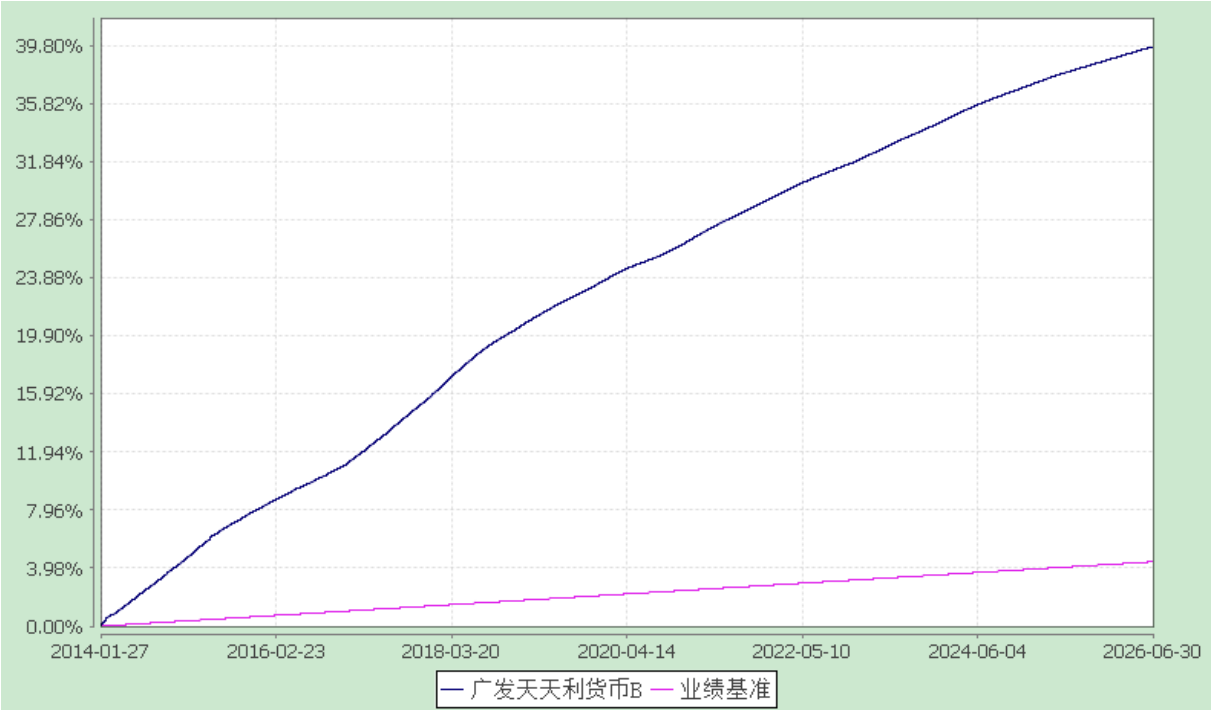
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 1 月 27 日至 2026 年 6 月 30 日)

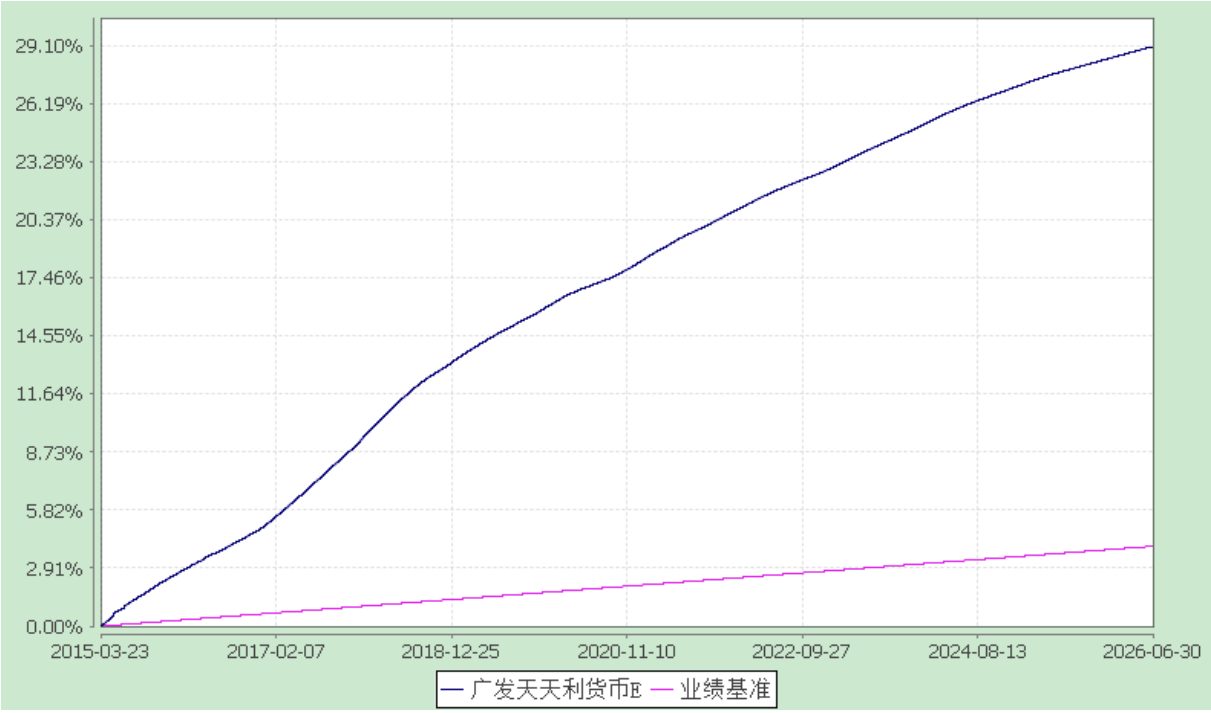
广发天天利货币 A



广发天天利货币 B



广发天天利货币 E



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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、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、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、QDII、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

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；广发天天红发起式货币	2014-01-27	-	18 年	任爽女士，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部交易员兼研究员、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资

	市场基金的基金经理；广发钱袋子货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的基金经理；现金指数投资部副总经理				基金基金经理(自 2016 年 11 月 16 日至 2018 年 3 月 20 日)、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 日至 2018 年 11 月 9 日)、广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2012 年 12 月 12 日至 2019 年 1 月 8 日)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 3 月 21 日至 2019 年 3 月 26 日)、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 日至 2019 年 10 月 29 日)、广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 27 日至 2019 年 10 月 29 日)、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 日至 2020 年 4 月 21 日)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 12 月 9 日至 2020 年 5 月 28 日)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 8 日至 2020 年 7 月 1 日)、广发景宁纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 22 日至 2020 年 12 月 21 日)、广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 3 月 21 日至 2021 年 10 月 14 日)。
曾雪兰	本基金的基金经理；广发现金宝场内实时申赎货币市场基金的基金经理；广发景荣纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发添利交	2020-12-22	-	16 年	曾雪兰女士，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员、债券研究员、基金经理助理、广发集安债券型证券投资基金基金经理(自 2017 年 2 月 6 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发理财 30 天债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 7 月 22 日至 2020 年 9 月 24 日)。

	易型货币市场基金的基金经理；广发中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理；广发钱袋子货币市场基金的基金经理				
周卓熙	本基金的基金经理；广发添利交易型货币市场基金的基金经理；广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经理	2021-05-06	-	10.8 年	周卓熙先生，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益管理总部债券交易员。

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，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，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 77 次，其中 76 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2026 年上半年，短端收益率曲线整体震荡下行。分阶段看，一季度趋势下行，二季度先下后上。一季度，银行间流动性较为宽松，资金利率中枢逐月下行。央行 MLF 和买断式逆回购等长期限资金

整体看均为净投放，呵护态度明显。银行负债需求较弱，存单发行需求弱于往年同期，短端资产在资金宽松和资产供给少的作用下，收益率持续下行。二季度，流动性整体宽松，二季度初信贷需求偏弱，同业存单发行依然为净到期状态，短端利率继续下行。5 月央行净回笼中长期资金，同时大行下调同业活期利率，形成一定负债缺口，存单一级供给好转。5 月下旬至 6 月，随着公开市场和买断式逆回购持续净回笼呈现收敛，资金利率中枢向政策利率回归。6 月资金价格继续向政策利率回归，全月短端利率上行，季末央行转为净投放，资金预期趋于稳定。

报告期内，本基金密切跟踪市场流动性和政策变化，灵活调整持仓结构，保持合理的久期和杠杆水平。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值收益率为 0.4860%，B 类基金份额净值收益率为 0.6057%，E 类基金份额净值收益率为 0.4861%，同期业绩比较基准收益率为 0.1748%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，资金面整体宽松基调有望延续，但资金中枢较二季度边际抬升。叠加内生稳定性或有所降低，在超储率低的场景下，央行操作对于流动性的边际影响显著。银行同业负债需求较一季度和二季度初有明显好转，短端利率或进入阶段性区间震荡。需关注下一阶段稳增长政策是否加码、央行货币政策操作和资金利率中枢变化。

本组合将密切关注基本面和政策变化，合理安排到期现金流，根据流动性变化摆布久期和杠杆水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、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投资品种的估值数据。

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，定期支付。本基金报告期内累计分配收益 561,856,857.02 元。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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 托管人对本中期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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	60,548,668,717.17	47,976,421,772.37
结算备付金		6,760,054.18	900,376.85
存出保证金		142,860.93	32,043.11
交易性金融资产	6.4.7.2	38,964,403,381.70	58,109,994,697.80
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		38,964,403,381.70	58,109,994,697.80
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	22,444,380,794.82	20,990,107,402.20
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		10,300,000.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		429,949.80	96,872.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		121,975,085,758.60	127,077,553,164.37
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		6,600,710,990.01	11,033,239,004.51
应付清算款		10,236,861.92	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		31,359,128.80	32,444,008.02

应付托管费		4,751,383.15	4,915,758.79
应付销售服务费		23,755,913.89	24,577,764.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		55,947.40	36,447.93
应付利润		2,712,578.93	3,228,117.95
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	888,524.23	1,016,138.41
负债合计		6,674,471,328.33	11,099,457,240.57
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	115,300,614,430.27	115,978,095,923.80
未分配利润	6.4.7.9	-	-
净资产合计		115,300,614,430.27	115,978,095,923.80
负债和净资产总计		121,975,085,758.60	127,077,553,164.37

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 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 212,262,021.81 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 5,081,048.41 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 115,083,271,360.05 份；总份额总额 115,300,614,430.27 份。

6.2 利润表

会计主体：广发天天利货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		**992,568,671.28**	**1,071,923,846.28**
1．利息收入		558,919,491.74	498,944,890.38
其中：存款利息收入	6.4.7.10	451,267,615.51	195,114,816.20
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		107,651,876.23	303,830,074.18
其他利息收入		-	-
2．投资收益（损失以“-”填列）		433,649,029.54	572,978,955.90
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-	-
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	433,649,029.54	572,978,955.90
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-

股利收益	6.4.7.17	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3．公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
4．汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5．其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	150.00	-
减：二、营业总支出		**430,711,814.26**	**383,523,670.26**
1．管理人报酬		189,603,957.09	183,593,351.49
2．托管费		28,727,872.26	55,634,348.96
3．销售服务费		143,633,332.36	139,067,977.28
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		68,458,738.43	5,001,949.81
其中：卖出回购金融资产支出		68,458,738.43	5,001,949.81
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7．税金及附加		47,185.95	27,786.28
8．其他费用	6.4.7.21	240,728.17	198,256.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**561,856,857.02**	**688,400,176.02**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**561,856,857.02**	**688,400,176.02**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		561,856,857.02	688,400,176.02

6.3 净资产变动表

会计主体：广发天天利货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	115,978,095,923.80	-	115,978,095,923.80
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	115,978,095,923.80	-	115,978,095,923.80
三、本期增减变动额（减少以“－”号填列）	-677,481,493.53	-	-677,481,493.53

（一）、综合收益总额	-	561,856,857.02	561,856,857.02
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-677,481,493.53	-	-677,481,493.53
其中：1.基金申购款	513,281,505,248.82	-	513,281,505,248.82
2.基金赎回款	-513,958,986,742.35	-	-513,958,986,742.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-561,856,857.02	-561,856,857.02
四、本期期末净资产	115,300,614,430.27	-	115,300,614,430.27
项目	**上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	107,711,936,870.58	-	107,711,936,870.58
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	107,711,936,870.58	-	107,711,936,870.58
三、本期增减变动额（减少以“–”号填列）	6,289,230,215.07	-	6,289,230,215.07
（一）、综合收益总额	-	688,400,176.02	688,400,176.02
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	6,289,230,215.07	-	6,289,230,215.07
其中：1.基金申购款	472,938,884,860.91	-	472,938,884,860.91
2.基金赎回款	-466,649,654,645.84	-	-466,649,654,645.84
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产	-	-688,400,176.02	-688,400,176.02

减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	114,001,167,085.65	-	114,001,167,085.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 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》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为人民币 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。

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资

基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》,财政部、国家税务总局财税〔2002〕128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2008〕132 号文《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》、财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2014〕81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕127 号《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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〕2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、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》，财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、2025 年第 11 号《关于黄金有关税收政策的公告》（自 2025 年 11 月 1 日起施行）、

2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》、2026 年第 12 号《关于明确增值税应税交易销售额计算口径的公告》，国税发明电〔2002〕47 号《黄金交易增值税征收管理办法》（自 2025 年 11 月 1 日起废止）及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

（1）增值税、城建税、教育费附加及地方教育附加

资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，暂（可选择）适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入及金融同业往来利息收入免征增值税，通过上海黄金交易所、上海期货交易所交易标准黄金，未发生实物交割的，免征增值税。但自 2025 年 8 月 8 日（含当日）起，新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，免征增值税直至债券到期。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税、个人所得税

对基金从境内证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对从境内公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，自 2015 年 9 月 8 日起暂免征收个人所得税。目前暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。前述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对通过港股通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，由 H 股公司根据中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提供的投资者名册，按照 20%的税率代扣个人所得税；通过港股通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

（3）印花税

境内证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳，自 2023 年 8 月 28 日起减半征收。基金通过港股通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	4,278,935,884.26
等于：本金	4,273,120,670.97
加：应计利息	5,815,213.29
定期存款	56,269,732,832.91
等于：本金	56,120,000,000.00
加：应计利息	149,732,832.91
其中：存款期限 1 个月以内	7,932,346,221.67
存款期限 1-3 个月	27,206,375,718.42
存款期限 3 个月以上	21,131,010,892.82
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	60,548,668,717.17

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	1,263,825,734.87	1,263,184,794.54	-640,940.33	-0.0006
	银行间市场	37,700,577,646.83	37,707,221,265.43	6,643,618.60	0.0058
	合计	38,964,403,381.70	38,970,406,059.97	6,002,678.27	0.0052
资产支持证券		-	-	-	-
合计		38,964,403,381.70	38,970,406,059.97	6,002,678.27	0.0052

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-

银行间市场	22,444,380,794.82	-
合计	22,444,380,794.82	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	790,955.96
其中：交易所市场	-
银行间市场	790,955.96
应付利息	-
预提费用	97,568.27
合计	888,524.23

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

广发天天利货币 A		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	243,049,161.78	243,049,161.78
本期申购	94,079,883.91	94,079,883.91
本期赎回（以“-”号填列）	-124,867,023.88	-124,867,023.88
本期末	212,262,021.81	212,262,021.81

金额单位：人民币元

广发天天利货币 B		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,050,433.88	5,050,433.88
本期申购	5,452,333.68	5,452,333.68

本期赎回（以“-”号填列）	-5,421,719.15	-5,421,719.15
本期末	5,081,048.41	5,081,048.41

金额单位：人民币元

广发天天利货币 E		
项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,729,996,328.14	115,729,996,328.14
本期申购	513,181,973,031.23	513,181,973,031.23
本期赎回（以“-”号填列）	-513,828,697,999.32	-513,828,697,999.32
本期末	115,083,271,360.05	115,083,271,360.05

注：申购含转换转入、红利再投资、级别调整入份（金）额，赎回含转换转出、级别调整出份（金）额。

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发天天利货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,106,441.06	-	1,106,441.06
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-1,106,441.06	-	-1,106,441.06
本期末	-	-	-

单位：人民币元

广发天天利货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	30,593.75	-	30,593.75
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-30,593.75	-	-30,593.75
本期末	-	-	-

单位：人民币元

广发天天利货币 E

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	560,719,822.21	-	560,719,822.21
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-560,719,822.21	-	-560,719,822.21
本期末	-	-	-

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	77,604,287.78
定期存款利息收入	373,652,545.76
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	10,431.42
其他	350.55
合计	451,267,615.51

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期内无买卖股票差价收入。

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	423,070,869.28
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	10,578,160.26
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	433,649,029.54

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	93,098,393,278.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	92,983,991,567.63
减：应计利息总额	103,823,550.87
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	10,578,160.26

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	150.00
合计	150.00

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日

审计费用	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	133,859.90
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	240,728.17

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	1,718,588,773.95	91.88%	1,225,688,294.84	100.00%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30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	-	-	165,215,759,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 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末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	189,603,957.09	183,593,351.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	94,768,746.78	91,749,705.50
应支付基金管理人的净管理费	94,835,210.31	91,843,645.99

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

约定年费率为 0.33%。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	28,727,872.26	55,634,348.96

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日的基金资产净值×约定年费率/当年天数。

自 2025 年 8 月 14 日起，约定年费率由 0.10%调整为 0.05%。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E	合计
广发基金管理有限公司	11,730.64	-	357,858.52	369,589.16
中国银行股份有限公司	162,777.23	-	-	162,777.23
广发证券股份有限公司	5,328.45	-	-	5,328.45
广发期货有限公司	-	-	-	-
合计	179,836.32	-	357,858.52	537,694.84
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	广发天天利货币A	广发天天利货币B	广发天天利货币E	合计
广发基金管理有限公司	13,466.22	525.08	399,432.06	413,423.36
中国银行股份有限公司	243,356.05	-	-	243,356.05
广发证券股份有限公司	6,159.22	-	-	6,159.22
广发期货有限公司	13.81	-	-	13.81
合计	262,995.30	525.08	399,432.06	662,952.44

注：本基金的销售服务费按前一日各类基金份额资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日销售服务费＝前一日各类基金份额资产净值×约定年费率/当年天数。

A 类基金份额、B 类基金份额、E 类基金份额的约定年费率分别为 0.25%、0.01%、0.25%。

如涉及费率优惠，相关费率优惠安排以本基金管理人发布的最新公告为准。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2026年1月1日至2026年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	30,151,056.58	1,296,140,570.21	19,795,000,000.00	5,510,185.76	25,466,855,000.00	1,408,064.44
上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日						
银行间市场	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

交易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行股份有限公司	-	98,345,901.64	-	-	-	-

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发天天利货币 A

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发天天利货币 B

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

广发天天利货币 E

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	5,587,880,721.31	87,919,873.60	2,789,514,293.53	37,520,805.22

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

1、广发天天利货币 A

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
1,108,201.99	-	-1,760.93	1,106,441.06	-

2、广发天天利货币 B

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
30,614.53	-	-20.78	30,593.75	-

3、广发天天利货币 E

单位：人民币元

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	本期利润分配合计	备注
561,233,579.52	-	-513,757.31	560,719,822.21	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 6,590,410,990.01 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
112517257.IB	25 光大银行 CD257	2026-07-01	99.32	2,000,000.00	198,646,816.51
112517258.IB	25 光大银行 CD258	2026-07-01	99.32	1,000,000.00	99,319,070.04
112517266.IB	25 光大银行 CD266	2026-07-01	99.27	1,000,000.00	99,267,047.30

112517270.IB	25 光大银行 CD270	2026-07-01	99.24	1,000,000.00	99,236,773.89
112603085.IB	26 农业银行 CD085	2026-07-01	99.54	1,889,000.00	188,023,302.24
112603120.IB	26 农业银行 CD120	2026-07-01	99.43	10,000,000.00	994,338,237.31
112605106.IB	26 建设银行 CD106	2026-07-01	99.50	4,123,000.00	410,226,449.35
112612019.IB	26 北京银行 CD019	2026-07-01	99.84	3,000,000.00	299,527,360.28
112612067.IB	26 北京银行 CD067	2026-07-01	99.18	5,000,000.00	495,910,887.43
112617015.IB	26 光大银行 CD015	2026-07-01	99.82	2,500,000.00	249,545,122.34
112618031.IB	26 华夏银行 CD031	2026-07-01	99.83	5,000,000.00	499,132,933.89
112618092.IB	26 华夏银行 CD092	2026-07-01	99.56	10,000,000.00	995,621,078.97
112622010.IB	26 邮储银行 CD010	2026-07-01	99.65	12,000,000.00	1,195,813,663.63
210208.IB	21 国开 08	2026-07-01	102.54	3,300,000.00	338,381,438.00
240204.IB	24 国开 04	2026-07-01	101.40	3,100,000.00	314,328,909.13
240214.IB	24 国开 14	2026-07-01	100.68	2,100,000.00	211,422,691.80
250431.IB	25 农发 31	2026-07-01	101.23	7,000,000.00	708,595,575.64
合计				74,012,000.00	7,397,337,357.75

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 10,300,000.00 元，于 2026 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，建立了由董事会及其下设的合规及风险管理委员会、

经营管理层及其下设的风险控制委员会、风险管理职能部门、各业务部门四个层级构成的风险管理组织架构。在职责分工中，董事会及其下设的合规及风险管理委员会负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；经营管理层及其下设的风险控制委员会负责讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；各业务部门、风险管理职能部门以及合规稽核部下设的稽核审计组构成公司风险管理三道防线，共同发挥事前识别与防范、事中监测与控制、事后监督与评价功能，通过相互协作，分层次、多方面、持续性地监测和管理公司面临的各类风险。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成损失的风险。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	401,201,503.39	422,581,359.86
A-1 以下	-	-
未评级	1,295,727,050.62	933,587,142.73
合计	1,696,928,554.01	1,356,168,502.59

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	34,152,652,071.10	56,211,851,230.96
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	34,152,652,071.10	56,211,851,230.96

注：1、短期同业存单评级取自第三方评级机构的发行主体信用评级。

2、短期同业存单 A-1 所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 的短期同业存单，短期同业存单 A-1 以下所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 以下的短期同业存单。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	1,440,795,105.67	275,587,041.99
AAA 以下	-	-
未评级	1,674,027,650.92	266,387,922.26
合计	3,114,822,756.59	541,974,964.25

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据、未有第三方机构评级的中期票据和公司债券。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，对组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析，通过独立的风险管理部门对投资组合的流动性风险进行评估与监测。

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回需求相匹配。本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具，基金管理人持续监测本基金持有资产的流动性水平。本期末，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资标的为具有良好流动性的金融工具。同时，基金管理人持续监测本基金开放期内投资者的申购赎回情况，保持基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人每日通过“影子定价”机制对本基金的基金资产净值的公允性进行评估，并对本基金面临的市场风险进行监控。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合面临的利率风险，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	60,548,668,717.17	-	-	-	60,548,668,717.17
结算备付金	6,760,054.18	-	-	-	6,760,054.18
存出保证金	142,860.93	-	-	-	142,860.93
交易性金融资产	38,964,403,381.70	-	-	-	38,964,403,381.70
买入返售金融资产	22,444,380,794.82	-	-	-	22,444,380,794.82
应收清算款	-	-	-	10,300,000.00	10,300,000.00
应收申购款	-	-	-	429,949.80	429,949.80
资产总计	121,964,355,808.80	-	-	10,729,949.80	121,975,085,758.60
负债					
卖出回购金融资产款	6,600,710,990.01	-	-	-	6,600,710,990.01
应付清算款	-	-	-	10,236,861.92	10,236,861.92
应付管理人报酬	-	-	-	31,359,128.80	31,359,128.80
应付托管费	-	-	-	4,751,383.15	4,751,383.15
应付销售服	-	-	-	23,755,913.89	23,755,913.89

务费					
应交税费	-	-	-	55,947.40	55,947.40
应付利润	-	-	-	2,712,578.93	2,712,578.93
其他负债	-	-	-	888,524.23	888,524.23
负债总计	6,600,710,990.01	-	-	73,760,338.32	6,674,471,328.33
利率敏感度缺口	115,363,644,818.79	-	-	-63,030,388.52	115,300,614,430.27
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	47,976,421,772.37	-	-	-	47,976,421,772.37
结算备付金	900,376.85	-	-	-	900,376.85
存出保证金	32,043.11	-	-	-	32,043.11
交易性金融资产	58,109,994,697.80	-	-	-	58,109,994,697.80
买入返售金融资产	20,990,107,402.20	-	-	-	20,990,107,402.20
应收申购款	-	-	-	96,872.04	96,872.04
资产总计	127,077,456,292.33	-	-	96,872.04	127,077,553,164.37
负债					
卖出回购金融资产款	11,033,239,004.51	-	-	-	11,033,239,004.51
应付管理人报酬	-	-	-	32,444,008.02	32,444,008.02
应付托管费	-	-	-	4,915,758.79	4,915,758.79
应付销售服务费	-	-	-	24,577,764.96	24,577,764.96
应交税费	-	-	-	36,447.93	36,447.93
应付利润	-	-	-	3,228,117.95	3,228,117.95
其他负债	-	-	-	1,016,138.41	1,016,138.41
负债总计	11,033,239,004.51	-	-	66,218,236.06	11,099,457,240.57
利率敏感度缺口	116,044,217,287.82	-	-	-66,121,364.02	115,978,095,923.80

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-35,798,839.35	-42,055,066.79
	市场利率下降 25 个基点	35,890,502.53	42,131,824.19

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种和债券回购产品，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日
第一层次	-
第二层次	38,964,403,381.70
第三层次	-
合计	38,964,403,381.70

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金

融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	38,964,403,381.70	31.94
	其中：债券	38,964,403,381.70	31.94
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	22,444,380,794.82	18.40
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	60,555,428,771.35	49.65
4	其他各项资产	10,872,810.73	0.01
5	合计	121,975,085,758.60	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	8.01	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	6,600,710,990.01	5.72
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	89
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	71

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	30.31	5.73
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	10.22	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	22.11	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	11.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	31.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		105.62	5.73

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-

3	金融债券	2,433,446,927.72	2.11
	其中：政策性金融债	1,572,728,614.57	1.36
4	企业债券	1,263,825,734.87	1.10
5	企业短期融资券	1,094,296,243.60	0.95
6	中期票据	20,182,404.41	0.02
7	同业存单	34,152,652,071.10	29.62
8	其他	-	-
9	合计	38,964,403,381.70	33.79
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	112605128.IB	26 建设银行 CD128	15,000,000.00	1,491,595,891.97	1.29
2	112622010.IB	26 邮储银行 CD010	12,000,000.00	1,195,813,663.63	1.04
3	112605106.IB	26 建设银行 CD106	12,000,000.00	1,193,964,926.57	1.04
4	112616015.IB	26 上海银行 CD015	10,000,000.00	998,424,534.24	0.87
5	112692860.IB	26 上海农商银行 CD001	10,000,000.00	996,641,679.20	0.86
6	112693729.IB	26 上海农商银行 CD005	10,000,000.00	995,957,556.38	0.86
7	112618092.IB	26 华夏银行 CD092	10,000,000.00	995,621,078.97	0.86
8	112603120.IB	26 农业银行 CD120	10,000,000.00	994,338,237.31	0.86
9	112615106.IB	26 民生银行 CD106	8,500,000.00	838,688,678.50	0.73
10	250431.IB	25 农发 31	7,000,000.00	708,595,575.64	0.61

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0253%
报告期内偏离度的最低值	0.0011%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0121%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金按照实际利率法计算金融资产的账面价值，并使用影子定价和偏离度加以控制。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，华夏银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行或其分支行的处罚。华夏银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中国农业发展银行、中国农业银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	142,860.93
2	应收清算款	10,300,000.00
3	应收利息	-
4	应收申购款	429,949.80
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	10,872,810.73

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发天天利货币 A	232,595	912.58	2,870,150.10	1.35%	209,391,871.71	98.65%
广发天天利货币 B	1	5,081,048.41	0.00	0.00%	5,081,048.41	100.00%
广发天天利货币 E	14,453,833	7,962.13	0.00	0.00%	115,083,271,360.05	100.00%
合计	14,686,429	7,850.83	2,870,150.10	0.00%	115,297,744,280.17	100.00%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	个人	22,658,285.53	0.02%
2	个人	21,168,407.79	0.02%
3	个人	19,701,047.86	0.02%
4	个人	18,494,188.98	0.02%
5	个人	17,392,441.32	0.02%
6	个人	16,902,074.02	0.01%
7	个人	16,832,859.89	0.01%
8	个人	15,255,482.25	0.01%
9	个人	15,021,939.80	0.01%
10	个人	14,840,098.93	0.01%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发天天利货币 A	32,285.12	0.0152%
	广发天天利货币 B	0.00	0.0000%
	广发天天利货币 E	932,931.02	0.0008%
	合计	965,216.14	0.0008%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发天天利货币 A	0
	广发天天利货币 B	0
	广发天天利货币 E	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	广发天天利货币 A	0
	广发天天利货币 B	0
	广发天天利货币 E	0~10
	合计	0~10

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发天天利货币 A	广发天天利货币 B	广发天天利货币 E
基金合同生效日（2014 年 1 月 27 日）基金份额总额	3,876,744,129.16	129,505,530.00	-
本报告期期初基金份额总额	243,049,161.78	5,050,433.88	115,729,996,328.14
本报告期基金总申购份额	94,079,883.91	5,452,333.68	513,181,973,031.23
减：本报告期基金总赎回份额	124,867,023.88	5,421,719.15	513,828,697,999.32
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	212,262,021.81	5,081,048.41	115,083,271,360.05

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2026 年 2 月 14 日发布公告，自 2026 年 2 月 13 日起，傅友兴先生离任公司副总经理。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国投证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
华源证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	减少 1 个
国信证券	2	-	-	-	-	-
国联民生	3	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-

山西证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	5	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	减少 1 个
东方证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	-	-	-	-	-

注：1、选择标准

（1）财务状况良好，经营行为稳健规范，在业内具有良好声誉；

（2）内控与合规体系健全，相关制度和流程持续完善，风险控制能力较强；

（3）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金证券交易需要；

（4）具有较强的综合研究能力，有完善的研究报告质量保障机制，能及时提供宏观、行业及市场走向、个股分析报告；

（5）具有广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务；

（6）中国证监会要求的或公司认为应当具备的其他条件。

2、选择流程

（1）对拟合作券商进行准入评估。本基金管理人根据上述标准对拟合作券商是否符合准入条件进行评估并确定合作券商。

（2）协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议并通知基金

托管人。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国投证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	1,718,588,773.95	91.88%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券(中国)	-	-	-	-	-	-
万联证券	151,965,326.45	8.12%	7,596,300,000.00	100.00%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-01-22
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-03-30
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-04-22
4	广发基金管理有限公司关于旗下部分货币基金份额在部分销售渠道暂停申购（含定期定额和不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-21
5	广发基金管理有限公司关于修订旗下部分基金托管协议清算交收条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-21
6	广发基金管理有限公司关于旗下部分货币基金在联储证券股份有限公司恢复申购（含定期定额和不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-27
7	关于旗下部分货币基金在湖南银行股份有限公司恢复申购（含定期定额和不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-05-29
8	关于旗下部分货币基金在国联民生证券股份有限公司恢复机构投资者申购（含转换转入、定期定额和不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026-06-03

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20％的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地保障基金份额持有人利益，根据有关法律法规及本基金基金合同、托管协议的规定，本基金管理人经与基金托管人协商一致，自 2026 年 5 月 22 日起调整本基金托管协议中的申购赎回资金交收安排。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于修订旗下部分基金托管协议清算交收条款的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1．中国证监会核准广发天天利货币市场基金募集的文件
2．《广发天天利货币市场基金基金合同》
3．《广发天天利货币市场基金托管协议》
4．《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
5．法律意见书

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日