广发货币市场基金

[2015] 半年度报告摘要

2015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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年八月二十八日

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。本半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2015年8月21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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至6月30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	65,357,113,137.24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
下属分级基金的交易代码	270004	270014
报告期末下属分级基金的份额总额	9,560,762,666.57份	55,796,350,470.67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	蒋松云
	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

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区晋渊大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

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(2015年1月1日-2015年6月30日)	
	广发货币A	广发货币B
本期已实现收益	292,267,588.51	999,585,198.78
本期利润	292,267,588.51	999,585,198.78
本期净值收益率	2.1577%	2.2792%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
	广发货币A	广发货币B
期末基金资产净值	9,560,762,666.57	55,796,350,470.67
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:(1)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。

(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
过去一个月	0.3062%	0.0017%	0.0292%	0.0000%	0.2770%	0.0017%
过去三个月	0.9759%	0.0019%	0.0885%	0.0000%	0.8874%	0.0019%
过去六个月	2.1577%	0.0022%	0.1760%	0.0000%	1.9817%	0.0022%
过去一年	4.5166%	0.0018%	0.3549%	0.0000%	4.1617%	0.0018%
过去三年	13.6804%	0.0024%	1.0653%	0.0000%	12.6151%	0.0024%
自基金合同生效起至今	37.3360%	0.0063%	15.3737%	0.0033%	21.9623%	0.0030%

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
过去一个月	0.3260%	0.0017%	0.0292%	0.0000%	0.2968%	0.0017%
过去三个月	1.0366%	0.0019%	0.0885%	0.0000%	0.9481%	0.0019%
过去六个月	2.2792%	0.0022%	0.1760%	0.0000%	2.1032%	0.0022%
过去一年	4.7670%	0.0018%	0.3549%	0.0000%	4.4121%	0.0018%
过去三年	14.4989%	0.0024%	1.0653%	0.0000%	13.4336%	0.0024%
自基金合同生效起至今	26.3115%	0.0048%	5.1594%	0.0021%	21.1521%	0.0027%

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)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。

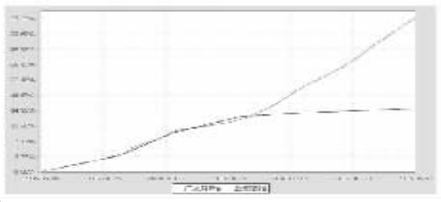
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发货币市场基金

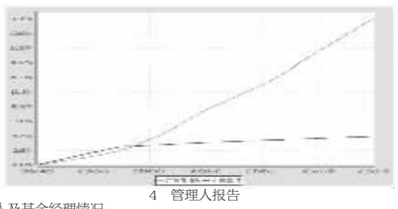
累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2005年5月20日至2015年6月30日)

广发货币A



广发货币B



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、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24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、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、互联网金融部(下辖杭州理财中心)、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。此外,还出资设立了广发国际资产管理有限公司(香港子公司)、瑞元资本管理有限公司。

截至2015年6月30日,本基金管理人管理七十五只开放式基金---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、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置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、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财7天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发中债金融债指数证券投资基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金和广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金,管理资产规模为2262.47亿元。同时,公司还管理着多个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;固定收益部副总经理	2010-04-29	-	14年	女,中国籍,经济学学士,持有基金执业证书,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,2013年1月14日起任广发理财30天债券基金的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理,2013年12月2日起任广发现金宝场内货币基金的基金经理,2014年3月17日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理。

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公平交易制度的执行情况

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。监察稽核部风险控制岗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;稽核岗通过对投资、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

2015年上半年债券市场整体呈现出慢牛行情。短端收益率在央行货币政策宽松背景下持续下探,中长端则处于箱体震荡走势,各品种收益率曲线陡峭化。

一季度,债市先涨后跌。年初,央行时隔一年重启逆回购操作,宽松加码迎来一波牛市行情;之后,降准、降息等利好预期落地,交易盘获利回吐,同时虽然央行两次下调逆回购利率、MLF增量续作,2月外汇占款终结下滑势头,但一级招标结果收益率接连刷新高、股市大涨行情分流资金、IPO打新节奏密集影响资金面,中长端收益率转为震荡上行。第二季度央行依然维持稳健偏松的货币政策,在4月20日下调存款准备金率1个百分点,5月11日下调存贷款利率0.25个百分点;6月28日下调存贷款利率0.25个百分点并定向降准。隔夜回购利率从3.0%下降到1%附近,7天利率从4%跌落到2.5%附近,一年AAA短期融资券收益率也普遍下降150个基点。

报告期内我们增配收益率较高短期融资券,把握ipo时点做高收益的存款,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净值增长率为2.1577%,广发货币B净值增长率为2.2792%,同期业绩比较基准收益率为0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面看,第二季度国内经济依然疲弱,预期6月PPI环比仍为负,CPI市场预期中值在1.3%附近,固定资产投资增速仍低。制造业景气度弱,6月全国50.2低于预期的50.4,与往年相比属于中等偏低水平;工业增长乏力,六大电厂发电耗煤增速由5月的-0.8%大幅下滑至-9.9%。央行在2季度降息降准,但并没有有效的降低实体经济融资成本,理财产品收益率仍在较高水平。央行从年初以来宽松的货币政策促成了股票市场的牛市,沪市一度站上5000点高位,但去杠杆导致的6月以来连续暴跌。一方面央行为了维护金融稳定和继续刺激经济回暖、降低实体融资成本,货币政策的放松可期;同时,政府还将继续推出地方政府债务置换计划,央行也会通过各种手段提供流动性支持。另一方面,市场风险偏好急剧下降,再加上新股暂停,大批打新和避险资金涌入债券市场,可预期货币市场基金整体规模急剧上升。2008年金融危机后,美国货币市场基金的经历值得思考和借鉴。总的来说,下半年货币利率预期走低,受股市和IPO影响,货币市场基金规模可能急剧变化。

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,严格控制流动性和信用风险,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、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,按月支付。本基金报告期内累计分配收益1,291,852,787.29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》、《货币市场基金管理暂行规定》、《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。

5.3 托管人对本半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2015年半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:广发货币市场基金

报告截止日:2015年6月30日

单位:人民币元

姓名	本期末 2015年6月30日	
资产:		-
银行存款		33,830,537,795.13
结算备付金		31,601,000.00
存出保证金		-
交易性金融资产		25,389,527,488.75
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		25,389,527,488.75
资产支持证券投资		-
衍生金融资产		-
买入返售金融资产		8,391,438,424.78
应收证券清算款		298,469,906.85
应收利息		391,047,722.10
应收股利		-
应收申购款		396,477,430.01
递延所得税资产		-
其他资产		-
资产总计		68,729,099,767.62
负债和所有者权益		
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		
应付托管费		
应付销售服务费		
应付交易费用		
应交税费		
应付利息		
应付利润		
递延所得税负债		
其他负债		
负债合计		
所有者权益:		
实收基金		
未分配利润		
所有者权益合计		
负债和所有者权益总计		68,729,099,767.62

注:报告截止日2015年6月30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9,560,762,666.57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55,796,350,470.67份;总份额总额65,357,113,137.24份。

6.2 利润表

会计主体:广发货币市场基金

本报告期:2015年1月1日至2015年6月30日

单位:人民币元

姓名	本期 2015年1月1日至2015年6月30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)	36,552,460,793.83	-	36,552,460,793.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,291,852,787.29	1,291,852,787.29
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)	28,804,652,343.41	-	28,804,652,343.41
其中:1.基金申购款	227,092,042,585.06	-	227,092,042,585.06
2.基金赎回款	-198,287,390,241.65	-	-198,287,390,241.65
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)	-	-1,291,852,787.29	-1,291,852,787.29
五、期末所有者权益(基金净值)	65,357,113,137.24	-	65,357,113,137.24
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30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)	26,345,151,008.86	-	26,345,151,008.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,123,730,968.83	1,123,730,968.83
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)	6,657,586,788.15	-	6,657,586,788.15
其中:1.基金申购款	156,887,022,311.52	-	156,887,022,311.52
2.基金赎回款	-150,229,435,523.37	-	-150,229,435,523.37
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)	-	-1,123,730,968.83	-1,123,730,968.83
五、期末所有者权益(基金净值)	33,002,737,797.01	-	33,002,737,797.01

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:王志伟,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。

本基金的财务报表于2015年8月28日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及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。

6.4.3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2015年6月30日的财务状况以及2015年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

6.4.7关联方关系

6.4.7.1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

本基金本报告期内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。

6.4.7.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

项目	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	基金管理人母公司、代销机构

6.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1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。

6.4.8.1.2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。

6.4.8.1.3债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	9,783,300,000.00	100.00%	6,907,200,000.00	100.00%

6.4.8.1.4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末无应付关联方佣金余额。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	96,327,496.58	74,011,215.13
其中:支付销售机构的客户维护费	13,650,732.53	9,824,211.42

注:基金管理费按前一日基金资产净值的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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	29,190,150.49	22,427,640.93

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%的年费率计提。

计算方法如下:

H = E ×0.1%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,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托管人。若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

6.4.8.2.3 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 2015年1月1日至2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发货币A	广发货币B	合计
广发基金管理有限公司	901,788.12	1,733,797.74	2,635,585.86
中国工商银行股份有限公司	4,067,534.03	92,434.28	4,159,968.31
广发证券股份有限公司	1,149,282.39	27,946.15	1,177,228.54
合计	6,118,604.54	1,854,178.17	7,972,782.71
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发货币A	广发货币B	合计
广发基金管理有限公司	1,937,551.47	1,249,151.02	3,186,702.49
中国工商银行股份有限公司	3,876,536.10	74,108.55	3,950,644.65
广发证券股份有限公司	1,619,393.76	41,996.71	1,661,390.47
合计	7,433,481.33	1,365,256.28	8,798,737.61

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。

C类份额基金销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.40%÷当年天数

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算,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销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产一次性支付给基金管理人,经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

6.4.8.3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

获得销售服务费的各关联方名称						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额					
	基金买入		基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额
中国工商银行股份有限公司	-		-	-	-	19,851,820,000.00
上年度可比期间 2014年1月1日至2014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					
	基金买入		基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额
中国工商银行股份有限公司	-		624,882,568.09	-	-	11,005,790,000.00

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年6月30日	
	广发货币A	广发货币B	广发货币A	广发货币B
基金合同生效日(2005年5月20日)持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	257,750,293.04	-	35,368,673.11
期间申购/买入总份额	-	52,999,385.56	-	777,839,962.98
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	310,749,678.60	-	597,743,478.94
期末持有的基金份额	-	-	-	215,465,157.15
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	0.94%

注:基金管理人本报告期内及上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.8.4.2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

广发货币A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资广发货币A的情况。

广发货币B

份额单位:份

关联方名称	广发货币B本期末 2015年6月30日		广发货币B上年度末 2014年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
瑞元资本管理有限公司	28,335,348.45	0.05%	11,493,248.64	0.05%
广发证券资产管理(广东)有限公司	368,317,040.37	0.66%	82,444,320.98	0.35%
广发证券股份有限公司	8,300,298,188.48	14.88%	-	-
广发期货有限公司	280,541,488.17	0.50%	-	-

6.4.8.5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 2015年1月1日至2015年6月30日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国工商银行股份有限公司	305,537,795.13	25,420,706.10	1,507,027,204.87	153,038,576.69

注:本基金的部分银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.8