

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

发现金宝场内实时申赎货币市场基金

2015 半年度报告摘要

定资产投资增速仍低。制造业景气度弱,6月全国GDP低于预期的0.4,与往年相比属于中偏低水平;工业增速乏力,六、七、八月工业增速连续3个月下降,0.8%、0.7%、0.7%,央行在二季度降准,但并没有有效的降低实体经济融资成本,理财产品收益率在高位水平。央行从年初以来宽松的货币政策造成了股市市场的牛市,沪指一度站上5000点高位,但去杠杆导致9月以来连续暴跌。一方面央行为了维护金融稳定和化解产能过剩问题,降低实体经济融资成本,货币政策在宽松可预期;同时,政府还等继续推行地方政府债务置换计划,央行通过多种手段提供流动性支持。另一方面,市场风险偏好下降,再加上监管趋严,大批打板和短线资金涌入债券市场,可预期货币市场基金整体规模会上升。2008年金融危机后,美国股市市场基金经历周期思考和借鉴。总的来说,下半年货币利率预期走低,受股市和IPO影响,货币市场基金规模有望扩大。

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,保持合理的组合仓位,保持合理的期限,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调整组合仓位。

4.6 管理人对于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,经公司管理层的批准后方可实施。估值委员会的成员包括:公司分管研发、估值和估值信息、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融、法律部负责人、监察稽核部负责人、基金会计核算负责人。估值委员会定期召开会议和例行工作,在发生了影响估值准确性和程序的有效性且适用的估值方法,以保持其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行,并确保估值与核算一致。投资研究人员持续关注市场变化,证券发行机构重大事件等可能对估值产生影响的事项,向估值委员会提出建议,确保估值的公平、合理。估值委员会成员均具备相关涉及及模型的技术支持。监察稽核部负责定期核查估值程序和方法,确保估值委员会各项决策均得以有效执行。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,为基金估值的客观、独立、基金管理人参与估值的估值委员会,若有在对相关投资品种估值有充分公允的情况,可同估值委员会提出意见和建议,各方不存在任何重大估值冲突,一切以估值委员会决议为准。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估值品种的估值数据。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配政策的说明
本基金基金合同"基金收益分配"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,每月分配,按日支付。本基金报告期内利润分配情况:31,642,034.77元。

5 托管人报告
报告期内,本基金托管人在对广发发现金宝场内实时申赎货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》、《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相关规定,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各项义务。

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
报告期内,广发发现金宝场内实时申赎货币市场基金的托管人——广发基金管理有限公司在广发发现金宝场内实时申赎货币市场基金的投资运作、每份基金份额收益7日年化收益率、基金净值变动、基金估值核算等方面,严格按照《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他法律法规的要求执行。

5.3 托管人对本半年度报告中基金净值等信息的真实、准确和完整发表意见
本托管人依法对广发发现金宝场内实时申赎货币市场基金的投资运作、基金净值变动、基金估值核算等方面进行了核查,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
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年6月30日, 2014年12月31日, 上年度末余额. Rows include 资产, 负债和所有者权益, 货币资金, 交易性金融资产, etc.

6.2 利润表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 营业收入, 公允价值变动收益, 投资收益, etc.

6.3 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.4 现金流量表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 经营活动产生的现金流量, 投资活动产生的现金流量, etc.

6.5 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.6 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.7 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.8 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.9 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.10 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.11 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.12 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.13 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.14 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.15 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.16 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.17 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.18 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

6.19 所有者权益变动表
单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 基金资产净值, 未分配利润, 所有者权益合计, etc.

本基金未发生违约情况。
7.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

Table with columns: 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(%). Rows include 1, 20天以内, 2, 20天以上-30天, etc.

7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 债券品种, 摊余成本, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1, 国家债券, 2, 央行票据, etc.

7.5 期末按摊余成本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

Table with columns: 序号, 债券代码, 债券名称, 债券余额, 摊余成本, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1, 140210, 14国债01, etc.

7.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值偏离
金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 报告期内偏离度的绝对值, 报告期内偏离度的最大值, etc.

7.7 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
金额单位:人民币元

Table with columns: 序号, 资产支持证券代码, 资产支持证券名称, 公允价值, 占基金资产净值比例(%). Rows include 1, 140210, 14国债01, etc.

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前12个月内受到行政处罚,且没有受到监管部门公开谴责或处罚的情况。

7.8.2 报告期内本基金未持有债券回购业务。

7.8.3 报告期内本基金未持有权证。

7.8.4 报告期内本基金未持有股指期货。

7.8.5 报告期内本基金未持有国债期货。

7.8.6 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.7 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.8 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.9 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.10 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.11 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.12 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.13 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.14 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.15 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.16 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.17 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.18 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.19 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.20 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.21 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.22 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.23 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.24 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.25 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.26 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.27 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.28 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.29 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.30 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.31 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.32 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.33 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.34 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.35 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.36 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.37 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.38 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.39 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.40 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.41 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.42 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.43 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.44 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.45 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.46 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.47 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.48 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.49 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.50 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.51 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.52 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.53 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.54 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.55 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.56 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.57 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.58 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.59 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.60 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.61 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.62 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.63 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.64 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.65 报告期内本基金未持有其他金融工具。

7.8.66 报告期内本基金未持有其他金融工具。

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

Table with columns: 项目, 2015年1月1日至2015年6月30日, 2014年1月1日至2014年6月30日. Rows include 3.1.1 本期利润总额, 3.1.2 本期净利润, etc.

3.1.3 期末资产总额

3.1.4 期末负债总额

3.1.5 期末所有者权益总额

3.1.6 期末基金份额总额

3.1.7 期末基金资产净值

3.1.8 期末基金份额净值

3.1.9 期末基金份额持有人数量

3.1.10 期末基金份额持有人户数

3.1.11 期末基金份额持有人平均持有基金份额

3.1.12 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.13 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.14 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.15 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.16 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.17 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.18 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.19 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.20 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.21 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.22 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.23 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.24 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.25 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.26 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.27 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.28 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.29 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.30 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.31 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.32 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.33 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.34 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.35 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.36 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.37 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.38 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.39 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.40 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.41 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.42 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.43 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.44 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.45 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.46 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.47 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.48 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.49 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.50 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.51 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.52 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.53 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.54 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.55 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.56 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.57 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.58 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.59 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.60 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.61 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.62 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.63 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.64 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.65 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.66 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.67 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.68 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.69 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.70 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.71 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.72 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.73 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.74 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.75 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.76 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.77 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.78 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.79 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.80 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.81 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.82 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.83 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.84 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.85 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.86 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.87 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.88 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.89 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间

3.1.90 期末基金份额持有人平均持有基金份额的时间