广发活期宝货币市场基金 2018年半年度报告摘要

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于2018年8月22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2018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	广发活期宝货币
基金主代码	000748
交易代码	000748
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年8月28日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	23,868,802,483.11份
基金合同存续期	不定期

下属分级基金的基金简称	广发活期宝A	广发活期宝B
下属分级基金的交易代码	000748	003281
报告期末下属分级基金的份额总额	2,878,990,231.76份	20,989,812,251.35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,力争实现稳定的、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	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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	曾薏燕
	联系电话	020-83936666	021-52629999-212040
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	0152392@cib.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95561
传真		020-89899158	021-62535823

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(2018年1月1日-2018年6月30日)	
	广发活期宝A	广发活期宝B
本期已实现收益	53,662,319.91	413,997,763.91
本期利润	53,662,319.91	413,997,763.91
本期净值收益率	2.1285%	2.2215%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	广发活期宝A	广发活期宝B
期末基金资产净值	2,878,990,231.76	20,989,812,251.35
期末基金份额净值	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. 广发活期宝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	0.3342%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.3050%	0.0004%
过去三个月	1.0429%	0.0006%	0.0885%	0.0000%	0.9544%	0.0006%
过去六个月	2.1285%	0.0007%	0.1760%	0.0000%	1.9495%	0.0007%
过去一年	4.3787%	0.0006%	0.3849%	0.0000%	4.0238%	0.0006%
过去三年	11.1870%	0.0068%	1.0656%	0.0000%	10.1214%	0.0068%
自基金合同生效起至今	15.4698%	0.0087%	1.3640%	0.0000%	14.1058%	0.0087%

2. 广发活期宝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	0.3499%	0.0004%	0.0292%	0.0000%	0.3207%	0.0004%
过去三个月	1.0907%	0.0006%	0.0885%	0.0000%	1.0022%	0.0006%
过去六个月	2.2215%	0.0007%	0.1760%	0.0000%	2.0455%	0.0007%
过去一年	4.5761%	0.0006%	0.3849%	0.0000%	4.2212%	0.0006%
自基金合同生效起至今	7.7518%	0.0021%	0.6485%	0.0000%	7.1033%	0.0021%

注:业绩比较基准:人民币活期存款利率(税后)。

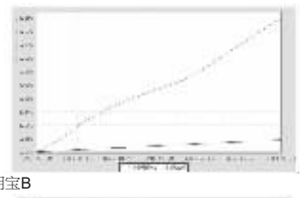
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发活期宝货币市场基金

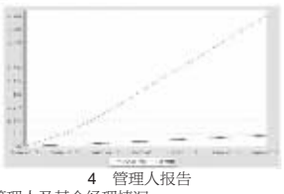
累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2014年8月28日至2018年6月30日)

广发活期宝A



广发活期宝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30个部门:宏观策略部、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2018年6月30日, 本基金管理人管理一百七十五只开放式基金,管理资产规模为3600亿元。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合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		
温秀娟	本基金的基金经理;广发货币基金的基金经理;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;广发添利货币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	2014-08-28	-	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)、广发天天红基金的基金经理(自2017年10月31日起任职)。
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发天天红基金的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理;广发钱袋子基金的基金经理;广发聚泰混合基金的基金经理;广发稳健保本基金的基金经理;广发鑫惠定开债基金的基金经理;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;广发安盈混合基金的基金经理	2014-08-28	-	10年	任爽女士,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任研究员、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日至2018年3月20日)。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5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18日起任职)、广发稳健保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年3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日起任职)、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、《广发活期宝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,投资的债券必须来自公司债券库。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。金融工程与风险管理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

上半年,货币市场整体维持较宽松的态势,与去年四季度以及年初市场预期相比形成较大差异,央行操作方面,为了对冲信用环境偏紧带来的负面冲击货币政策转向结构性宽松,具体表现为一季度用多种方式呵护流动性、二季度内两次降准操作、不再跟随美联储上调政策利率、流动性相关措辞变为合理充裕等。由于央行态度是决定流动性的核心变量,预计年内流动性整体仍将维持宽松态势。需要注意的是,货币政策转向极度宽松的概率较低,杠杆需求、缴准缴税等冲击仍将干扰货币市场。本基金在报告期内操作仍以流动性为最重要考虑因素。本基金在每个季度采取了逐步配置的节奏,资金流运用根据整体资金供需以及收益率绝对水平进行调节。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,广发活期宝货币A类净值增长率为2.1255%,广发活期宝货币B类净值增长率为2.2215%, 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

展望下半年,预计宽松的货币政策将会得以延续,资金面在央行的呵护下会再下一个台阶。而信用方面,目前来看央行、银保监会已经采取了一些措施努力创造一个宽信用的环境,预计整体信用环境在宽松的货币政策下会出现边际的改善。但是此次宽信用的背景以及金融机构的处境已经和前两次发生了较大的改变, 因此信用偏好的提升程度尚需观察。预计下半年仍会出现一些冲击性的事件影响资本市场预期的调整。

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467,660,083.82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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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:广发活期宝货币市场基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		-	-
银行存款	6.4.7.1	7,040,853,083.79	6,431,068,135.61
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	14,142,484,213.95	20,932,658,634.35
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,142,484,213.95	20,932,658,634.35
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,849,470,949.89	1,767,893,231.84
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	45,574,320.27	50,205,384.35
应收股利		-	-
应收申购款		46,776,540.67	45,917,095.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,125,159,108.57	29,227,742,481.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017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		2,244,314,357.81	708,484,595.98
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,932,023.36	4,162,510.86
应付托管费		781,872.90	1,110,002.92
应付销售服务费		657,370.43	557,081.66
应付交易费用	6.4.7.7	225,849.17	163,021.45
应交税费		61,507.49	-
应付利息		1,407,810.40	595,154.94
应付利润		5,766,726.49	11,731,912.81
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	209,107.41	361,115.90
负债合计		2,256,356,625.46	727,165,396.52
所有者权益:		-	-
实收基金	6.4.7.9	23,868,802,483.11	28,500,577,085.47
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		23,868,802,483.11	28,500,577,085.47
负债和所有者权益总计		26,125,159,108.57	29,227,742,481.99

注:报告截止日2018年6月30日,广发活期宝货币A基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额2,878,990,231.76份;广发活期宝货币B基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额20,989,812,251.35份;总份额总额23,868,802,483.11份。

6.2 利润表

会计主体:广发活期宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		510,994,235.82	282,980,361.33
1.利息收入		513,218,331.18	283,022,906.81
其中:存款利息收入	6.4.7.11	104,087,281.44	225,136,028.80
债券利息收入		308,965,995.99	31,823,056.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		100,175,046.75	26,063,821.96
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-2,226,119.36	-51,349.88
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	-2,226,119.36	-51,349.88
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
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)	6.4.7.13	2,024.00	8,804.40
减:二、费用		43,334,152.00	17,239,926.29
1. 管理人报酬		15,940,324.06	12,080,722.17
2. 托管费		4,250,753.05	2,489,386.20
3. 销售服务费		3,469,658.45	815,071.79
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		19,400,604.08	1,596,477.67
其中:卖出回购金融资产支出		19,400,604.08	1,596,477.67
6. 税金及附加		15,423.86	-
7. 其他费用	6.4.7.15	257,388.50	258,268.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		467,660,083.82	265,740,435.04
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		467,660,083.82	265,740,435.04

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发活期宝货币市场基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018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)	28,500,577,085.47	-	28,500,577,085.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	467,660,083.82	467,660,083.82
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)	-4,631,774,602.36	-	-4,631,774,602.36
其中:1.基金申购款	38,033,842,879.59	-	38,033,842,879.59
2.基金赎回款	-42,665,617,481.95	-	-42,665,617,481.95
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)	-	-467,660,083.82	-467,660,083.82
五、期末所有者权益(基金净值)	23,868,802,483.11	-	23,868,802,483.11
项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017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)	6,333,467,284.88	-	6,333,467,284.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	265,740,435.04	265,740,435.04
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)	8,383,078,273.54	-	8,383,078,273.54
其中:1.基金申购款	13,211,813,861.83	-	13,211,813,861.83
2.基金赎回款	-4,828,735,588.29	-	-4,828,735,588.29
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)	-	-265,740,435.04	-265,740,435.04
五、期末所有者权益(基金净值)	14,716,545,558.42	-	14,716,545,558.42

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:孙树明,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

广发活期宝货币市场基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2014]519号文《关于核准广发活期宝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 《广发活期宝货币市场基金基金合同》("基金合同") 发起,于2014年8月28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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金募集期为2014年8月25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201,441,748.46元,有效认购户数为426户。其中, 认购资金在募集期间产生的利息共计人民币4,000.11元,折合基金份额4,000.11份,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》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,具体如下:1、现金;2、通知存款;3、短期融资券(包括超级短期融资券);4、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;5、期限在1年以内(含1年)的债券回购;6、剩余期限在397天以内(含397天)的债券;7、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;8、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据;9、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称"央行票据");10、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活期存款利率(税后)。

本基金的财务报表于2018年8月22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。

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2018年6月30日的财务状况以及2018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。

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

本报告期内不存在其他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

关联方名称	与本基金的关系
兴业银行股份有限公司	托管人
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

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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,940,324.06	12,080,722.17
其中:支付销售机构的客户维护费	621,533.42	-

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提(2017年3月17日以前:0.27%)。管理费的计算方法如下:

H=E× 0.15 %÷ 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5 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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,250,753.05	2,489,386.20

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.04%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E× 0.04%÷ 当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,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托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,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 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发活期宝A	广发活期宝B	合计
广发基金管理有限公司	6,121.86	935,513.52	941,635.38
兴业银行股份有限公司	389.44	-	389.44
合计	6,511.30	935,513.52	942,024.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发活期宝A	广发活期宝B	合计
广发基金管理有限公司	1,906.62	612,203.08	614,109.70
兴业银行股份有限公司	-	-	-
合计	1,906.62	612,203.08	614,109.70

注:本基金A 基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提;B 级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提计算公式如下:

H=E× 0.20 %÷ 当年天数

H为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令, 经基金托管人复核后于次月首日起 5个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构,由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

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

本期 2018年1月1日至2018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
兴业银行股份有限公司	19,861,444.62	-	-	-	2,683,301,000.00	600,438.05
上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
兴业银行股份有限公司	60,479,326.03	299,839,687.10	-	-	-	-

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

广发活期宝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本基金的情况。

广发活期宝B

份额单位:份

关联方名称	广发活期宝B本期末 2018年6月30日		广发活期宝B上年度末 2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金份额的比例
广发证券股份有限公司	211,116,876.03	1.01%	601,803,143.61	2.25%
兴业银行股份有限公司资金营运中心	701,219,985.01	3.34%	-	-
广发乾和投资有限公司	176,286,176.43	0.84%	-	-

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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
兴业银行股份有限公司	853,083.79	141,572.73	559,138.53	39,751,083.45

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

6.4.8.6 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。

6.4.9期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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2018年6月30日止, 本基金无因认购新发/增发证券