

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

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。

基金管理人：中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月22日核对了报告中的财务指标、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，保证复核报告不存在虚假记载、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未来表现。投资者有风险，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。

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

本报告中财务数据未经审计。

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

基金名称 广发现金宝场内货币基金
基金代码 010988
交易代码 010988
基金运作方式 购买赎回开放式
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
报告期末基金资产净值 47,059,924,369.05
基金份额持有人数 810,906,459,288
基金总资产的赎回金额 不定期
基金的申购赎回场所 上海证券交易所
上市日期 2013年12月21日
下属分级基金的基金简称 广发现金宝 广发现金宝
下属分级基金的交易代码 610988 010988
报告期末下属分级基金的份额总额 30,200,136,201.00份 16,775,788,065.00份

2.2 基金产品说明

投资目标 在严格控制风险、保持资金流动性的基础上，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于银行活期存款收益的投资回报。

投资策略 通过分析宏观经济形势、政策环境变化趋势，结合对资金供求状况的分析，综合运用久期分析、利率期限结构分析和收益率曲线分析等方法，在保证流动性的前提下，合理配置资产，力求在保证本金安全的前提下，实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准 固定收益类理财产品或货币市场基金

风险收益特征 适合于追求低风险、低收益的投资者。

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及运作分析

报告期内，货币市场整体维持较宽的态势，与去年四季度以及年初市场预期相比形成较大差异，实际上货币市场的走势是取决于货币收益率下行的直接原因。宏观经济方面，宏观环境并不算太差，但外需受中美贸易摩擦影响，内需受融资收缩影响整体预期较为悲观。基本面和资金面的双重利好推动下，上半年利率债市场整体走牛，收益率曲线呈陡峭下行。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，具体表现为上半年多次降准操作，不再跟随美联储上调利率，流动性宽松并导致收益率进行反向调整。如果因为对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需要公司领导严格审批并留备批文。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发现金宝场内货币A类净值增长率为1.7275%，广发现金宝场内货币B类净值增长率为2.0358%，同期间同业比较基准收益率为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，基本面因素在外部经济环境、内部调控收缩的大逻辑下继续预判短期难以乐观，这一过程中低评级主体信用的风险需要高度关注，货币政策边际转松对冲，整体来看有利利率和高等级信用利差则继续分化，央行操作方面，为了对冲信用环境偏紧带来的负面影响，货币政策转向结构性宽松，流动性宽松并导致收益率进行反向调整。下半年本组合将保持合理的杠杠比例，继续保持流动性管理。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等安排的说明

本基金设有估值委员会，按照相关法律法规的规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选择适当的估值方法。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配政策的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的有关规定，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。

4.8 托管费报告

本基金报告期内未发生托管费。

4.9 基金净值表现

4.9.1 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日至2018年6月30日)

广发现金宝 A 广发现金宝

本期已实现收益 6,030,075.60

本期未实现收益 6,030,075.60

本期已分配收益 6,030,075.60

3.00%

3.1.2期间数据和指标

报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)

广发现金宝 A 广发现金宝

期初基金份额净值 303,801,263.91

期末基金份额净值 167,769,086.00

3.00%

注：(1) 所述基金业绩效指标不包括持有认购或交易基金的各项费用，计入费用后基金业绩效水平要低于所列示数据。

(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，由于货币市场基金摊派成本法核算，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) 本基金利润分配日按日结转份额。

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. 广发宝A：

阶段 分红次数 净值收益百分比 样本加权平均收益百分比 业绩比较基准收益百分比

过去一个月 0.9344% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

过去二个月 0.9326% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

过去六个月 0.9374% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

过去一年 0.9374% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

自基金合同生效以来 0.9374% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

注：(1) 所述基金业绩效指标不包括持有认购或交易基金的各项费用，计入费用后基金业绩效水平要低于所列示数据。

(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，由于货币市场基金摊派成本法核算，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) 本基金利润分配日按日结转份额。

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动与其同期业绩比较基准收益率的比较

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势图

(2013年12月2日至2018年6月30日)

广发宝A

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

3.2.3 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. 广发宝B：

阶段 分红次数 净值收益百分比 样本加权平均收益百分比 业绩比较基准收益百分比

过去一个月 0.9349% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

过去二个月 0.9326% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

过去六个月 0.9374% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

过去一年 0.9374% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

自基金合同生效以来 0.9374% 0.0000% 0.0020% 0.0000% 0.0020% 0.0000%

注：(1) 所述基金业绩效指标不包括持有认购或交易基金的各项费用，计入费用后基金业绩效水平要低于所列示数据。

(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，由于货币市场基金摊派成本法核算，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) 本基金利润分配日按日结转份额。

3.2.4 基金合同生效以来基金的累计净值

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

3.2.5 基金业绩效指标

3.2.6 基金业绩效指标

3.2.7 基金业绩效指标

3.2.8 基金业绩效指标

3.2.9 基金业绩效指标

3.2.10 基金业绩效指标

3.2.11 基金业绩效指标

3.2.12 基金业绩效指标

3.2.13 基金业绩效指标

3.2.14 基金业绩效指标

3.2.15 基金业绩效指标

3.2.16 基金业绩效指标

3.2.17 基金业绩效指标

3.2.18 基金业绩效指标

3.2.19 基金业绩效指标

3.2.20 基金业绩效指标

3.2.21 基金业绩效指标

3.2.22 基金业绩效指标

3.2.23 基金业绩效指标

3.2.24 基金业绩效指标

3.2.25 基金业绩效指标

3.2.26 基金业绩效指标

3.2.27 基金业绩效指标

3.2.28 基金业绩效指标

3.2.29 基金业绩效指标

3.2.30 基金业绩效指标

3.2.31 基金业绩效指标

3.2.32 基金业绩效指标

3.2.33 基金业绩效指标

3.2.34 基金业绩效指标

3.2.35 基金业绩效指标

3.2.36 基金业绩效指标

3.2.37 基金业绩效指标

3.2.38 基金业绩效指标

3.2.39 基金业绩效指标

3.2.40 基金业绩效指标

3.2.41 基金业绩效指标

3.2.42 基金业绩效指标

3.2.43 基金业绩效指标

3.2.44 基金业绩效指标

3.2.45 基金业绩效指标

3.2.46 基金业绩效指标

3.2.47 基金业绩效指标

3.2.48 基金业绩效指标

3.2.49 基金业绩效指标

3.2.50 基金业绩效指标