广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发恒生中型股指数(LOF)	
场内简称	恒生中型	
基金主代码	501303	
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2017年9月21日	
报告期末基金份额总额	89,613,772.87份	
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。	
投资策略	本基金为指数基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,进行被动式指数化投资。	
业绩比较基准	人民币计价的恒生综合中型股指数收益率×95%+人民币活期存款收益率(税后)×5%。	
风险收益特征	本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发恒生中型股指数(LOF)A	广发恒生中型股指数(LOF)C
下属分级基金的场内简称	恒生中型	-
下属分级基金的交易代码	501303	004996
报告期末下属分级基金的份额总额	64,503,746.50份	25,110,026.37份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	广发恒生中型股指数(LOF)A	广发恒生中型股指数(LOF)C
1.本期已实现收益	-43,114.20	-39,889.90
2.本期利润	-853,961.82	-393,738.39
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0131	-0.0153
4.期末基金资产净值	58,203,206.64	22,633,508.01
5.期末基金份额净值	0.9023	0.9014

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发恒生中型股指数(LOF)A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-1.42%	1.32%	-2.55%	1.33%	1.13%	-0.01%

2、广发恒生中型股指数(LOF)C:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	-1.52%	1.32%	-2.55%	1.33%	1.03%	-0.01%

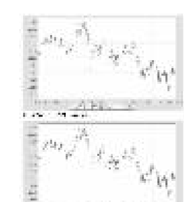
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年9月21日至2018年9月30日)

1. 广发恒生中型股指数(LOF)A:



注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李耀柱	本基金的基金经理;广发纳斯达克100ETF基金的基金经理;广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理;广发沪港深新起点股票基金的基金经理;广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)基金的基金经理;广发海外多元配置(QDII)基金的基金经理;广发科技动力股票基金的基金经理;国际业务部总经理助理	2017-09-21	-	8年	李耀柱先生,理学硕士,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中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2017年11月9日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)。现任广发基金管理有限公司国际业务部总经理助理、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年12月17日起任职)、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日起任职)、广发沪港深新起点股票型证券投资基金基金经理(自2016年11月9日起任职)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自2017年3月10日起任职)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自2017年9月21日任职)、广发海外多元配置证券投资基金(QDII)基金经理(自2018年2月8日起任职)、广发科技动力股票型证券投资基金基金经理(自2018年5月31日起任职)。
刘杰	本基金的基金经理;广发沪深300ETF联接基金的基金经理;广发中证500ETF基金的基金经理;广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理;广发沪深300ETF基金的基金经理;广发养老指数基金的基金经理;广发中小板300ETF基金的基金经理;广发中小板300联接基金的基金经理;广发中证环保ETF联接基金的基金经理;广发军工ETF基金的基金经理;广发中证军工ETF联接基金的基金经理;广发中证环保ETF基金的基金经理;广发创业板ETF基金的基金经理;广发创业板ETF联接基金的基金经理;广发量化稳健混合基金的基金经理;广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理;广发纳指100ETF基金的基金经理;广发全球农业指数(QDII)基金的基金经理;广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理;广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理;指数投资部总经理助理	2018-08-06	-	14年	刘杰先生,工学学士,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信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日至2016年1月17日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日至2018年4月25日)。现任广发基金管理有限公司指数投资部总经理助理、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日起任职)、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理(自2014年4月1日起任职)、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年8月20日起任职)、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2016年1月18日起任职)、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2016年1月25日起任职)、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2016年1月25日起任职)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日起任职)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2016年8月30日起任职)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2016年9月26日起任职)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年1月25日起任职)、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年4月25日起任职)、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2017年5月25日起任职)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自2017年8月4日起任职)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2018年4月26日起任职)、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6日起任职)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自2018年8月6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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)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。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 公平交易专项说明

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。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度,国内方面,综合受到中美贸易战、去杠杆以及近期股票质押风险等不利因素影响,整体市场的表现较欠佳,各大指数近期均已达到或接近近3年的底部区域,市场情绪较差,市场信心不足,同时市场风险也一定程度得到释放,未来机遇与挑战并存。 国际方面,由于原油价格上行、美债收益率上行、美股高波动趋势、中美摩擦等潜在风险点尚未消除,应以谨慎为主。港股方面,市场对企业盈利增速预期出现下调,这是16年企业盈利增速预期开始上调后,首次的掉头向下。虽然中报业绩的整体表现尚可,但是由于地产销售减速、去杠杆、环保、贸易战等因素,市场对未来的盈利较为悲观。管理人认为,盈利增速的下调尚在进行当中,外资对港股的观点也在不断修正,从不理解内地投资者的悲观态度,到逐步接受盈利增速下调的情况。但是,随着地方政府参与解决股权质押风险、沪伦通开通在即等积极因素汇聚,未来市场有一定修复市场情绪的可能。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的A类份额净值增长率为-1.42%,C类份额净值增长率为-1.52%,同期业绩比较基准收益率为-2.55%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	76,205,204.06	93.67
	其中:股票	76,205,204.06	93.67
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,314,848.82	5.30
7	其他各项资产	833,854.91	1.02
8	合计	81,353,907.79	100.00

注:权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为76,205,204.06元, 占基金资产净值比例94.27%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有境内股票。

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
工业	13,904,572.21	17.20
非日常生活消费品	12,143,779.05	15.02
金融	9,478,761.57	11.73
房地产	9,270,619.08	11.47
原材料	7,269,552.07	8.99
信息技术	7,147,583.08	8.84
医疗保健	7,142,683.51	8.84
公用事业	3,014,414.96	3.73
日常消费品	2,977,456.01	3.68
电信业务	1,933,478.95	2.39
能源	1,922,303.57	2.38
合计	76,205,204.06	94.27

注:(1)以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	00914	海螺水泥	44,000	1,829,416.05	2.26
2	00586	海螺创业	58,500	1,405,324.15	1.74
3	01099	国药控股	39,200	1,321,121.73	1.63
4	01211	比亚迪股份	23,000	1,137,423.37	1.41
5	02202	万科企业	44,500	1,014,186.37	1.25
6	01766	中国中车	144,000	905,996.52	1.12
7	01336	新华保险	27,100	895,441.52	1.11
8	00390	中国中铁	131,000	894,521.97	1.11
9	00868	信义玻璃	98,000	852,865.14	1.06
10	00981	中芯国际	110,500	820,658.97	1.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	569,763.04
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	256,222.41
4	应收利息	1,007.22
5	应收申购款	300.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	6,562.24
8	其他	-
9	合计	833,854.91

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发恒生中型股指数(LOF)A	广发恒生中型股指数(LOF)C
本报告期期初基金份额总额	66,386,325.85	26,849,922.01
本报告期基金总申购份额	762,761.86	691,835.57
减:本报告期基金总赎回份额	2,645,341.21	2,431,731.21
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	64,503,746.50	25,110,026.37

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

(一)中国证监会批准广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)募集的文件

(二)《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》

(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四)《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)托管协议》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)基金托管人业务资格批件、营业执照

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

广发添利交易型货币市场基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发添利货币ETF	
场内简称	广发添利	
基金主代码	511950	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2016年11月22日	
报告期末基金份额总额	4,381,105.35份	
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	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种,其预期收益和预期风险低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发添利A	广发添利B
下属分级基金的交易代码	511950	005107
报告期末下属分级基金的份额总额	515,093.50份	3,866,011.85份

注:本基金场内基金份额(A类基金份额)简称为"广发添利A",基金份额对应的面值为100.00元,场外基金份额(B类基金份额)简称"广发添利B",基金份额对应的面值为1.00元。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	广发添利A	广发添利B
1.本期已实现收益	350,504.61	32,808.41
2.本期利润	350,504.61	32,808.41
3.期末基金资产净值	51,509,350.22	3,866,011.85

注: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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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、广发添利A:

阶段	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
过去三个月	0.6846%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.5952%	0.0011%

2、广发添利B:

阶段	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
过去三个月	0.7455%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.6561%	0.0011%

注:本基金收益分配按日结转份额。

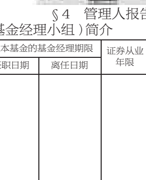
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发添利交易型货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年11月22日至2018年9月30日)

1、广发添利A



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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;广发活期宝货币基金的基金经理;广发天天红基金的基金经理;现金投资部总经理	2016-11-22	-	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)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2017年10月31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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发添利交易型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。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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,货币市场整体维持宽松态势。从量价组合上看,M2增速继续在低位震荡,回购利率R007全季都被约束在利率走廊上限之内,并且8月上旬与公开市场操作利率倒挂,市场流动性非常充裕。理解货币市场的核心在于央行,在维持流动性合理充裕的政策取向以及宽信用政策短期基本无效的背景下货币市场的宽松态势预计仍将维持。央行操作方面,在美债收益率不断创出近年来高点的情况下央行仍然动用降准这一宽松信号较强的总量手段表明,在内外均衡出现冲突时,内部稳定与增长的目标是无可置疑的首要目标。未来货币政策的焦点仍然是疏通货币到信用的传导。报告期内,组合选择在季度末、银行同业存单集中到期等时点配置资产,获取相对较高的再投资收益,提高组合收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发添利货币ETFA类净值增长率为0.6846%,广发添利货币ETFB类净值增长率为0.7455%,同期业绩比较基准收益率为0.0894%

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	42,738,003.89	77.08
	其中:债券	42,738,003.89	77.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	10,000,135.00	18.04
	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	2,468,661.21	4.45
4	其他资产	236,017.51	0.43
5	合计	55,442,817.61	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	-	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	69
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	14

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。

5.3.2 报告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	22.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	17.98	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	35.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	5.46	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	17.81	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.70	0.00

5.4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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	3,024,172.09	5.46
	其中:政策性金融债	3,024,172.09	5.46
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	39,713,831.80	71.72
8	其他	-	-
9	合计	42,738,003.89	77.18
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111813090	18浙商银行CD090	100,000.00	9,956,899.58	17.98
2	111810422	18兴业银行CD422	100,000.00	9,951,436.87	17.97
3	111814044	18江苏银行CD044	100,000.00	9,945,481.99	17.96
4	111809262	18浦发银行CD262	100,000.00	9,860,013.36	17.81
5	018002	国开1302	30,000.00	3,024,172.09	5.46

5.7"影子定价"与"摊余成本法"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次
报告期内偏离度的最高值	0.1495%
报告期内偏离度的最低值	-0.0010%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0668%

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。

5.8报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。

5.9.218兴业银行CD422(代码:111810422)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务等行为给予罚款人民币5870万元的行政处罚。

18浦发银行CD262(代码:111809262)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会针对浦发银行通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求等行为给予罚款人民币5845万元的行政处罚。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	422.87
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	136,666.26
4	应收申购款	98,928.38
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	236,017.51

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发添利A	广发添利B
本报告期期初基金份额总额	513,028.50	3,772,092.27
本报告期基金总申购份额	8,475.19	4,116,092.21
本报告期基金总赎回份额	6,410.19	4,022,172.63
报告期期末基金份额总额	515,093.50	3,866,011.85

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2018-07-31	1,351.00	135,100.00	-
2	红利再投	2018-08-31	1,211.00	121,100.00	-
3	红利再投	2018-09-30	892.00	89,200.00	-
合计			3,454.00	345,400.00	

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

一、中国证监会核准广发添利交易型货币市场基金募集的文件

二、《广发添利交易型货币市场基金基金合同》

三、《广发添利交易型货币市场基金托管协议》

四、《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

五、《广发添利交易型货币市场基金招募说明书》及其更新版

六、法律意见书

七、基金管理人业务资格批件、营业执照

八、基金托管人业务资格批件、营业执照

九、中国证监会要求的其他文件

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发现金宝场内货币	
基金主代码	519858	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年12月2日	
报告期末基金份额总额	60,761,981,248.00份	
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	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,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发宝A	广发宝B
下属分级基金的交易代码	519858	519859
报告期末下属分级基金的份额总额	39,270,678,924.00份	21,491,302,324.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	广发宝A	广发宝B
1.本期已实现收益	3,036,985.75	2,082,678.33
2.本期利润	3,036,985.75	2,082,678.33
3.期末基金资产净值	392,706,789.24	214,913,023.24

注: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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	0.7053%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.6159%	0.0011%

2、广发宝B:

阶段	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
过去三个月	0.8599%	0.0011%	0.0894%	0.0000%	0.7705%	0.0011%

注:本基金收益分配按日结转份额。

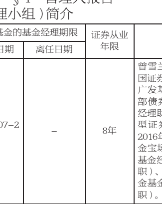
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013年12月2日至2018年9月30日)

1、广发宝A



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾雪兰	本基金的基金经理;广发理财30天债券基金的基金经理;广发集安基金的基金经理	2016-07-22	-	8年	曾雪兰女士,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债券交易员、债券研究员、基金经理助理。现任广发理财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2016年7月22日起任职)、广发集安债券型证券投资基金基金经理(2017年2月6日起任职)。
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;广发活期宝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	2013-12-02	-	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)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2017年10月31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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发现金宝场内实时申赎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。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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,货币市场整体维持宽松态势。从量价组合上看,M2增速继续在低位震荡,回购利率R007全季都被约束在利率走廊上限之内,并且8月上旬与公开市场操作利率倒挂,市场流动性非常充裕。理解货币市场的核心在于央行,在维持流动性合理充裕的政策取向以及宽信用政策短期基本无效的背景下货币市场的宽松态势预计仍将维持。央行操作方面,在美债收益率不断创出近年来高点的情况下央行仍然动用降准这一宽松信号较强的总量手段表明,在内外均衡出现冲突时,内部稳定与增长的目标是无可置疑的首要目标。未来货币政策的焦点仍然是疏通货币到信用的传导。报告期内,组合选择在季度末、银行同业存单集中到期等时点配置资产,获取相对较高的再投资收益,提高组合收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发现金宝场内货币A类净值增长率为0.7053%,广发现金宝场内货币B类净值增长率为0.8599%,同期业绩比较基准收益率为0.0894%

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	317,111,533.70	46.11
	其中:债券	317,111,533.70	46.11
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	60,013,490.02	8.73
	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	293,851,788.16	42.73
4	其他资产	16,687,678.93	2.43
5	合计	687,664,490.81	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	5.87	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	64,799,702.80	10.66
	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%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	96
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	21

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。

5.3.2 报告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	10.58	10.66
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	18.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	34.49	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	11.52	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	35.80	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	110.50	10.66

5.4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。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,953,104.20	8.22
	其中:政策性金融债	49,953,104.20	8.22
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,000,629.29	3.29
6	中期票据	-	-
7	同业存单	247,157,800.21	40.68
8	其他	-	-
9	合计	317,111,533.70	52.19
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111803138	18农业银行CD138	600,000.00	59,193,883.09	9.74
2	111809262	18浦发银行CD262	600,000.00	59,159,410.86	9.74
3	160208	16国开08	500,000.00	49,953,104.20	8.22
4	111817071	18光大银行CD071	500,000.00	49,217,489.20	8.10
5	111810422	18兴业银行CD422	400,000.00	39,805,418.25	6.55
6	111814044	18江苏银行CD044	400,000.00	39,781,598.81	6.55
7	011800780	18中电投SCP010	200,000.00	20,000,629.29	3.29

5.7"影子定价"与"摊余成本法"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次
报告期内偏离度的最高值	0.2273%
报告期内偏离度的最低值	0.0266%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1007%

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。

5.8报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。

5.9.218兴业银行CD422(代码:111810422)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务等行为给予罚款人民币5870万元的行政处罚。

18浦发银行CD262(代码:111809262)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会针对浦发银行通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求等行为给予罚款人民币5845万元的行政处罚。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	428,904.60
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	1,850,214.98
4	应收申购款	14,408,559.35
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	16,687,678.93

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发宝A	广发宝B
本报告期期初基金份额总额	30,280,136,291.00	16,775,788,065.00
本报告期基金总申购份额	135,480,895,314.00	22,341,659,646.00
本报告期基金总赎回份额	126,490,352,681.00	17,626,145,387.00
报告期期末基金份额总额	39,270,678,924.00	21,491,302,324.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发现金宝场内实时申赎货币市场基金募集的文件;

2.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》;

3.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》;

4.法律意见书;

5.基金管理人业务资格批件、营业执照;

6.基金托管人业务资格批件、营业执照;

7.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金招募说明书》及其更新版

8.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日