广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金

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:招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。

基金托管人招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	广发鑫裕混合
基金主代码	002134
交易代码	002134
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年3月1日
报告期末基金份额总额	413,815,803.84份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过对不同资产类别的优化配置,充分挖掘市场潜在的投资机会,力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上,判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势,分析不同政策对各类资产的市场影响,评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值,根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置,确定合适的资产配置比例,并适时进行调整。
业绩比较基准	30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§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)
1.本期已实现收益	1,045,391.35
2.本期利润	-2,588,589.60
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0063
4.期末基金资产净值	501,937,261.56
5.期末基金份额净值	1.213

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

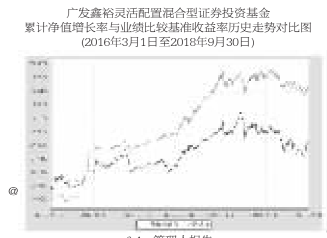
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.49%	0.29%	0.33%	0.40%	-0.82%	-0.11%

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

广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年3月1日至2018年9月30日)



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张芊	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发聚鑫债券基金的基金经理;广发集鑫债券基金的基金经理;广发集裕债券基金的基金经理;广发集丰债券基金的基金经理;广发集安债券基金的基金经理;广发集源债券基金的基金经理;公司副总经理、固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理	2016-03-01	-	17年	张芊女士,经济学和工商管理双硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国银河证券研究中心研究员,中国人保资产管理有限公司高级研究员、投资主管,工银瑞信基金管理有限公司研究员,长盛基金管理有限公司投资经理,广发基金管理有限公司固定收益部总经理,广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年11月23日至2016年12月8日)、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年12月30日至2017年2月6日)、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年12月29日至2018年1月6日)。现任广发基金管理有限公司副总经理、固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理,广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自2012年12月14日起任职)、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理(自2013年7月12日起任职)、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理(自2015年12月25日起任职)、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年3月1日起任职)、广发集裕债券型证券投资基金基金经理(自2016年5月11日起任职)、广发集丰债券型证券投资基金基金经理(自2016年11月1日起任职)、广发集安债券型证券投资基金基金经理(自2017年1月20日起任职)、广发集源债券型证券投资基金基金经理(自2017年1月20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、《广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型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

三季度,债券市场维持震荡格局,资金面总体宽松,中低评级信用利差仍有走阔压力。债券投资方面,组合延续中短久期的配置策略,重视信用风险甄别,并保持适度杠杆套息操作。展望四季度,基本面下行压力不减,货币政策将延续宽松基调,债券供给压力较三季度亦有所减轻,国内债券市场有望延续走牛。同时,我们也关注到通胀抬升以及中美利差压缩对国内债市的干扰。债券策略上,组合将保持中性久期,以中高评级信用债为主要配置方向,密切关注国内外市场环境的变化,保持操作的灵活性。权益类方面,经过前期连续调整,虽然有贸易战长期阴影,估值已进入合理区间,坚持龙头品种持仓。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发鑫裕混合净值增长率为-0.49%,同期业绩比较基准收益率为0.33%

§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	104,742,508.94	15.82
	其中:股票	104,742,508.94	15.82
2	固定收益投资	543,964,915.60	82.18
	其中:债券	543,964,915.60	82.18
	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	2,654,504.48	0.40
7	其他各项资产	10,523,220.56	1.59
8	合计	661,885,149.58	100.00

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,543,080.00	0.91
B	采矿业	5,684,732.00	1.13
C	制造业	74,616,952.42	14.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,731,545.00	0.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	6,586,963.38	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,579,236.14	2.11
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	104,742,508.94	20.87

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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	002050	三花智控	818,303	10,899,795.96	2.17
2	000988	华工科技	564,200	8,293,740.00	1.65
3	002410	广联达	299,978	8,033,410.84	1.60
4	600887	伊利股份	253,033	6,497,887.44	1.29
5	600271	航天信息	214,802	5,977,939.66	1.19
6	601966	玲珑轮胎	373,900	5,870,230.00	1.17
7	002450	康得新	415,800	5,825,358.00	1.16
8	601088	中国神华	278,800	5,684,732.00	1.13
9	600426	华鲁恒升	318,743	5,485,567.03	1.09
10	600019	宝钢股份	631,548	4,957,651.80	0.99

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(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	97,240,944.00	19.37
	其中:政策性金融债	97,240,944.00	19.37
4	企业债券	133,224,000.00	26.54
5	企业短期融资券	100,358,000.00	19.99
6	中期票据	192,442,000.00	38.34
7	可转债(可交换债)	20,699,971.60	4.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	543,964,915.60	108.37

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180204	18国开04	500,000	51,455,000.00	10.25
2	101551105	15中色MTN002	400,000	40,392,000.00	8.05
3	101760032	17陕煤MTN004	300,000	30,885,000.00	6.15
4	1480459	14石景山债	500,000	30,840,000.00	6.14
5	101453024	14中联MTN001	300,000	30,762,000.00	6.13

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	55,846.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,467,374.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,523,220.56

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132009	17中油EB	3,622,500.00	0.72
2	128027	崇达转债	1,194,300.00	0.24
3	128035	大族转债	522,000.00	0.10
4	132010	17桐昆EB	190,800.00	0.04
5	120001	16以岭EB	130,600.80	0.03
6	132012	17巨化EB	87,660.00	0.02

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002450	康得新	5,825,358.00	1.16	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	413,815,987.96
本报告期基金总申购份额	0.00
减:本报告期基金总赎回份额	184.12
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	413,815,803.84

§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影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	413,714,678.90	-	-	413,714,678.90	99.98%
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会注册广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)《广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四)《广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(五)法律意见书

(六)《广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版

9.2 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

9.3 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

广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	广发鑫隆混合	
基金主代码	002130	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年11月7日	
报告期末基金份额总额	851,905.95份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会,力求实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。	
业绩比较基准	30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率。	
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发鑫隆混合A	广发鑫隆混合C
下属分级基金的交易代码	002130	002131
报告期末下属分级基金的份额总额	769,093.58份	82,812.37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) 广发鑫隆混合A	广发鑫隆混合C
1.本期已实现收益	44,089.95	14,307.29
2.本期利润	26,307.40	5,172.64
3.加权平均基金份额本期利润	0.0192	0.0102
4.期末基金资产净值	1,041,129.18	110,361.01
5.期末基金份额净值	1.354	1.333

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.广发鑫隆混合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	1.04%	0.05%	0.33%	0.40%	0.71%	-0.35%

2.广发鑫隆混合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	0.76%	0.05%	0.33%	0.40%	0.43%	-0.35%

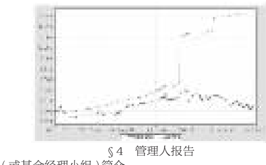
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金

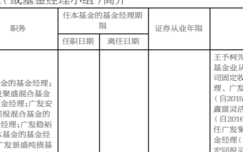
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016年11月7日至2018年9月30日)

1. 广发鑫隆混合A:



2. 广发鑫隆混合C:



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王予柯	本基金的基金经理;广发聚盛混合基金的基金经理;广发安宏回报混合基金的基金经理;广发稳裕保本基金的基金经理;广发景盛纯债基金的基金经理;广发中债7-10年国开行指数基金的基金经理;广发景丰纯债基金的基金经理;广发集富纯债基金的基金经理;广发中证10年期国开债指数基金的基金经理;广发价值回报基金的基金经理;广发汇佳定期开放债券发起式基金的基金经理;广发汇康定开发起债基金的基金经理;广发中债1-3年农发债指数基金的基金经理;广发集泰债券基金的基金经理	2016-11-07	-	11年	王予柯先生,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兼研究员、投资经理、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理(自2015年5月27日至2016年6月24日)、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月22日至2018年1月6日)。现任广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年12月25日起任职)、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年1月8日起任职)、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年6月27日起任职)、广发景盛纯债债券型证券投资基金基金经理(自2016年8月30日起任职)、广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金基金经理(自2016年9月26日起任职)、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月7日起任职)、广发景丰纯债债券型证券投资基金基金经理(自2016年11月23日起任职)、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年1月13日起任职)、广发中证10年期国开债指数证券投资基金(LOF)基金经理(自2017年11月15日起任职)、广发价值回报混合型证券投资基金基金经理(自2017年11月29日起任职)、广发汇佳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12日起任职)、广发中债1-3年农发行债券指数证券投资基金基金经理(自2018年4月24日起任职)、广发集泰债券型证券投资基金基金经理(自2018年7月26日)。

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、《广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型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

三季度,利率债收益率先下后上,整体维持震荡:其中7月债市收益率整体区间震荡,8月中旬在经历过前期极度宽松的资金利率后,央行开始暂停公开市场操作叠加地方债的巨量供给拚出,引发资金利率和长端利率的连续调整,9月下旬地方债供给放缓、美联储加息国内未跟随带来市场情绪好转,收益率小幅下行。信用债方面,中低评级信用利差和等级利差继续小幅走阔。三季度以来,本基金以中短久期利率品种及高等级信用债为主要配置方向,对股票资产暂时保持谨慎,等待机会。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发鑫隆混合A类净值增长率为1.04%,广发鑫隆混合C类净值增长率为0.76%,同期业绩比较基准收益率为0.33%

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内,本基金于2018年7月2日至2018年9月28日连续64个工作日出现了基金资产净值低于五千万的情形。

截至2018年7月26日日终,本基金出现触发基金合同自动终止的情形(即本基金基金资产净值低于5000万元人民币),本基金已于2018年7月27日进入清算期,无须召开基金份额持有人大会。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
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	1,171,255.93	99.98
7	其他各项资产	234.26	0.02
8	合计	1,171,490.19	100.00

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

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	234.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	234.26

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	广发鑫隆混合A	广发鑫隆混合C
本报告期期初基金份额总额	3,485,064.43	1,741,104.08
本报告期基金总申购份额	0.00	0.00
减:本报告期基金总赎回份额	2,715,960.85	1,658,291.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	769,093.58	82,812.37

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
个人	1	20180726-20180930	253,034.10	-	-	253,034.10	29.70%
	2	20180725-20180930	305,300.04	-	-	305,300.04	35.84%
	3	20180726-20180726	271,060.78	0.00	270,000.00	1,060.78	0.12%
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")于2016年11月7日正式成立,截至2018年7月26日日终,本基金出现触发基金合同自动终止的情形(即连续60个工作日基金资产净值低于5000万元),本基金管理人将终止《基金合同》,自2018年7月27日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序,无须召开基金份额持有人大会。有关重要事项详情可见本基金管理人于2018年7月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站(www.gffunds.com.cn)刊登的《广发基金管理有限公司关于广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)中国证监会批准广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)《广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四)《广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(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

9.2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

9.3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。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

广发钱袋子货币市场基金

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:广发银行股份有限公司
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。

基金托管人广发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	广发钱袋子	
基金主代码	000509	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年1月10日	
报告期末基金份额总额	20,860,840,695.97份	
投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的前提下,力争实现稳定的、超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济运行情况、政策形势、信用状态、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流动性特征、风险特征和估值水平特征,决定基金资产在银行存款、债券等各类资产的配置比例,并适时进行动态调整。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为: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,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、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	广发银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发钱袋子货币A	广发钱袋子货币E
下属分级基金的交易代码	000509	004796
报告期末下属分级基金的份额总额	17,600,701,299.90份	3,260,139,396.07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) 广发钱袋子货币A	广发钱袋子货币E
1.本期已实现收益	157,082,551.04	38,071,145.50
2.本期利润	157,082,551.04	38,071,145.50
3.期末基金资产净值	17,600,701,299.90	3,260,139,396.07

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、广发钱袋子货币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	0.8628%	0.0009%	0.0894%	0.0000%	0.7734%	0.0009%

2、广发钱袋子货币E:

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	0.8628%	0.0010%	0.0894%	0.0000%	0.7734%	0.0010%

注:本基金收益分配按日结转份额。

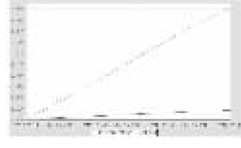
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发钱袋子货币市场基金

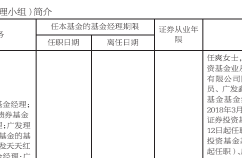
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年1月10日至2018年9月30日)

1、广发钱袋子货币A



2、广发钱袋子货币E



§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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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;广发活期宝货币基金的基金经理;广发聚利混合基金的基金经理;广发稳鑫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	2014-05-30	-	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、投资经理、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)、广发聚利混合型证券投资基金基金经理(自2015年6月8日起任职)、广发稳鑫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 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、《广发钱袋子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

三季度,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,为了对冲经济下行压力以及配合巨量的地方债顺利发行,央行7月和10月先后两次降准,并且暂未跟随美联储上调政策利率。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。本基金在报告期内操作仍以流动性为最重要考虑因素。本基金在本季度采取了逐步配置的节奏,资金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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发钱袋子A类净值增长率为0.8628%,广发钱袋子E类净值增长率为0.8628%,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	12,191,842,907.79	52.22
	其中:债券	12,191,842,907.79	52.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,933,926,445.68	21.13
	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	6,050,675,970.42	25.92
4	其他资产	171,561,470.15	0.73
5	合计	23,348,006,794.04	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		5.83
	其中:买断式回购融资		-
2	报告期末债券回购融资余额	2,469,911,135.12	11.84
	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	80
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	82
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	35

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	25.33	11.84
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	9.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	47.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	0.63	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	28.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	111.10	11.84

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	49,759,904.28	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,012,811,020.56	4.86
	其中:政策性金融债	1,012,811,020.56	4.86
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,052,864,152.68	5.05
6	中期票据	130,803,664.94	0.63
7	同业存单	9,945,604,165.33	47.68
8	其他	-	-
9	合计	12,191,842,907.79	58.44
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	111805212	18建设银行CD212	15,000,000.00	1,476,705,531.21	7.08
2	111809162	18浦发银行CD162	6,000,000.00	597,299,320.17	2.86
3	111809245	18浦发银行CD245	5,000,000.00	497,875,548.86	2.39
4	111803140	18农业银行CD140	5,000,000.00	497,669,988.57	2.39
5	111883834	18盛京银行CD373	5,000,000.00	497,474,203.22	2.38
6	111817127	18光大银行CD127	5,000,000.00	495,207,344.14	2.37
6	111818175	18华夏银行CD175	5,000,000.00	495,207,344.14	2.37
7	111899609	18广州农村商业银行CD047	5,000,000.00	495,125,723.59	2.37
8	111899709	18贵阳银行CD106	5,000,000.00	494,626,720.09	2.37
9	111883112	18锦州银行CD186	5,000,000.00	493,202,316.03	2.36
10	111886028	18徽商银行CD141	5,000,000.00	491,891,221.62	2.36

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	0.1536%
报告期内偏离度的最低值	0.0557%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1025%

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浦发银行CD162(代码:111809162)、18浦发银行CD245(代码:111809245)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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	66,041,376.13
4	应收申购款	105,520,094.02
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	171,561,470.15

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发钱袋子货币A	广发钱袋子货币E
本报告期期初基金份额总额	14,580,726,790.29	2,793,509,583.67
本报告期基金总申购份额	22,412,847,145.47	17,736,241,531.95
本报告期基金总赎回份额	19,392,872,635.86	17,269,611,719.55
报告期期末基金份额总额	17,600,701,299.90	3,260,139,396.07

§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	申购	2018-07-05	20,000,000.00	20,000,000.00	-
2	申购	2018-07-06	20,000,000.00	20,000,000.00	-
3	申购	2018-07-09	20,000,000.00	20,000,000.00	-
4	申购	2018-07-10	20,000,000.00	20,000,000.00	-
5	申购	2018-07-11	15,000,000.00	15,000,000.00	-
6	赎回	2018-07-13	-90,000,000.00	-90,000,000.00	-
7	申购	2018-07-20	371,833.65	371,833.65	-
8	申购	2018-07-20	390,884.05	390,884.05	-
9	申购	2018-07-20	497,070.23	497,070.23	-
10	申购	2018-07-20	530,048.61	530,048.61	-
11	申购	2018-07-20	530,782.23	530,782.23	-
12	申购	2018-07-20	539,571.45	539,571.45	-
13	申购	2018-07-20	2,214,252.12	2,214,252.12	-
14	申购	2018-07-20	674,243.72	674,243.72	-
15	申购	2018-07-20	688,164.70	688,164.70	-
16	申购	2018-07-20	955,664.45	955,664.45	-
17	申购	2018-07-20	963,154.14	963,154.14	-
18	申购	2018-07-20	1,255,019.16	1,255,019.16	-
19	申购	2018-07-20	1,506,488.10	1,506,488.10	-
20	申购	2018-07-20	593,612.86	593,612.86	-
21	赎回	2018-07-23	-8,000,000.00	-8,000,000.00	-
22	申购	2018-07-24	2,234,960.96	2,234,960.96	-
23	申购	2018-07-24	366,444.75	366,444.75	-
24	申购	2018-07-24	1,483,191.88	1,483,191.88	-
25	申购	2018-07-24	1,268,693.70	1,268,693.70	-
26	申购	2018-07-24	960,202.26	960,202.26	-
27	申购	2018-07-24	949,693.91	949,693.91	-
28	申购	2018-07-24	699,178.86	699,178.86	-
29	申购	2018-07-24	692,558.80	692,558.80	-
30	申购	2018-07-24	585,194.74	585,194.74	-
31	申购	2018-07-24	547,008.69	547,008.69	-
32	申购	2018-07-24	531,925.70	531,925.70	-
33	申购	2018-07-24	523,051.48	523,051.48	-
34	申购	2018-07-24	506,986.84	506,986.84	-
35	申购	2018-07-24	384,870.45	384,870.45	-
36	申购	2018-07-26	10,000,000.00	10,000,000.00	-
37	红利再投	2018-07-31	2,053,026.41	2,053,026.41	-
38	申购	2018-07-31	2,255,669.79	2,255,669.79	-
39	申购	2018-07-31	1,449,911.59	1,449,911.59	-
40	申购	2018-07-31	1,232,228.26	1,232,228.26	-
41	申购	2018-07-31	962,017.39	962,017.39	-
42	申购	2018-07-31	949,693.91	949,693.91	-
43	申购	2018-07-31	680,675.07	680,675.07	-
44	申购	2018-07-31	668,656.06	668,656.06	-
45	申购	2018-07-31	571,888.70	571,888.70	-
46	申购	2018-07-31	527,556.69	527,556.69	-
47	申购	2018-07-31	525,578.15	525,578.15	-
48	申购	2018-07-31	518,714.71	518,714.71	-
49	申购	2018-07-31	492,938.30	492,938.30	-
50	申购	2018-07-31	381,863.65	381,863.65	-
51	申购	2018-07-31	363,425.44	363,425.44	-
52	申购	2018-08-03	10,000,000.00	10,000,000.00	-
53	申购	2018-08-06	10,000,000.00	10,000,000.00	-
54	申购	2018-08-07	462,775.28	462,775.28	-
55	申购	2018-08-07	476,478.41	476,478.41	-
56	申购	2018-08-07	484,594.87	484,594.87	-
57	申购	2018-08-07	494,515.40	494,515.40	-
58	申购	2018-08-07	348,788.84	348,788.84	-
59	申购	2018-08-07	333,499.88	333,499.88	-
60	申购	2018-08-07	530,341.23	530,341.23	-
61	申购	2018-08-07	1,350,070.70	1,350,070.70	-
62	申购	2018-08-07	1,139,545.24	1,139,545.24	-
63	申购	2018-08-07	620,540.14	620,540.14	-
64	申购	2018-08-07	629,128.80	629,128.80	-
65	申购	2018-08-07	865,941.38	865,941.38	-
66	申购	2018-08-08	921,177.03	921,177.03	-
67	申购	2018-08-08	2,172,834.45	2,172,834.45	-
68	申购	2018-08-08	6,000,000.00	6,000,000.00	-
69	申购	2018-08-09	10,000,000.00	10,000,000.00	-
70	申购	2018-08-10	10,000,000.00	10,000,000.00	-
71	申购	2018-08-13	10,000,000.00	10,000,000.00	-
72	申购	2018-08-14	491,698.72	491,698.72	-
73	申购	2018-08-14	497,408.00	497,408.00	-
74	申购	2018-08-14	505,711.70	505,711.70	-
75	申购	2018-08-14	531,062.53	531,062.53	-
76	赎回	2018-08-14	-30,000,000.00	-30,000,000.00	-
77	申购	2018-08-14	655,618.20	655,618.20	-
78	申购	2018-08-14	665,695.81	665,695.81	-
79	申购	2018-08-14	889,122.88	889,122.88	-
80	申购	2018-08-14	1,199,561.29	1,199,561.29	-
81	申购	2018-08-14	1,415,521.95	1,415,521.95	-
82	申购	2018-08-14	356,305.85	356,305.85	-
83	申购	2018-08-14	348,328.89	348,328.89	-
84	申购	2018-08-14	575,147.32	575,147.32	-
85	申购	2018-08-15	2,137,788.74	2,137,788.74	-
86	申购	2018-08-15	913,916.52	913,916.52	-
87	申购	2018-08-21	328,531.40	328,531.40	-
88	申购	2018-08-21	336,009.94	336,009.94	-
89	申购	2018-08-21	457,403.77	457,403.77	-
90	申购	2018-08-21	469,313.31	469,313.31	-
91	申购	2018-08-21	477,313.20	477,313.20	-
92	申购	2018-08-21	495,068.45	495,068.45	-
93	申购	2018-08-21	542,289.52	542,289.52	-
94	申购	2018-08-21	629,542.48	629,542.48	-
95	申购	2018-08-21	635,296.73	635,296.73	-
96	申购	2018-08-21	836,777.55	836,777.55	-
97	申购	2018-08-21	1,131,948.28	1,131,948.28	-
98	申购	2018-08-21	1,350,070.70	1,350,070.70	-
99	赎回	2018-08-22	-5,000,000.00	-5,000,000.00	-
100	申购	2018-08-22	2,107,521.99	2,107,521.99	-
101	申购	2018-08-22	895,765.26	895,765.26	-
102	申购	2018-08-27	10,000,000.00	10,000,000.00	-
103	申购	2018-08-28	505,892.97	505,892.97	-
104	申购	2018-08-28	494,699.75	494,699.75	-
105	申购	2018-08-28	468,973.15	468,973.15	-
106	申购	2018-08-28	356,305.85	356,305.85	-
107	申购	2018-08-28	354,329.30	354,329.30	-
108	申购	2018-08-28	514,449.70	514,449.70	-
109	申购	2018-08-28	1,431,052.75	1,431,052.75	-
110	申购	2018-08-28	1,204,879.17	1,204,879.17	-
111	申购	2018-08-28	889,122.88	889,122.88	-
112	申购	2018-08-28	585,737.85	585,737.85	-
113	申购	2018-08-28	657,791.18	657,791.18	-
114	申购	2018-08-28	671,423.17	671,423.17	-
115	申购	2018-08-29	2,150,532.64	2,150,532.64	-
116	申购	2018-08-29	909,378.71	909,378.71	-
117	申购	2018-08-30	10,000,000.00	10,000,000.00	-
118	红利再投	2018-08-31	2,041,644.20	2,041,644.20	-
119	申购	2018-09-04	498,065.95	498,065.95	-
120	申购	2018-09-04	489,488.70	489,488.70	-
121	申购	2018-09-04	1,397,772.46	1,397,772.46	-
122	申购	2018-09-04	1,164,615.24	1,164,615.24	-
123	申购	2018-09-04	865,193.58	865,193.58	-
124	申购	2018-09-04	646,751.46	646,751.46	-
125	申购	2018-09-04	482,578.82	482,578.82	-
126	申购	2018-09-04	454,511.43	454,511.43	-
127	申购	2018-09-04	346,157.89	346,157.89	-
128	申购	2018-09-04	342,825.35	342,825.35	-
129	申购	2018-09-04	577,048.18	577,048.18	-
130	申购	2018-09-04	634,509.28	634,509.28	-
131	申购	2018-09-05	2,021,500.68	2,021,500.68	-
132	申购	2018-09-05	891,227.43	891,227.43	-
133	申购	2018-09-06	10,000,000.00	10,000,000.00	-
134	申购	2018-09-07	10,000,000.00	10,000,000.00	-
135	申购	2018-09-10	10,000,000.00	10,000,000.00	-
136	申购	2018-09-11	476,220.95	476,220.95	-
137	申购	2018-09-11	471,198.87	471,198.87	-
138	申购	2018-09-11	455,617.82	455,617.82	-
139	申购	2018-09-11	434,265.01	434,265.01	-
140	申购	2018-09-11	334,506.54	334,506.54	-
141	申购	2018-09-11	329,334.01	329,334.01	-
142	申购	2018-09-11	561,298.17	561,298.17	-
143	申购	2018-09-11	1,370,038.88	1,370,038.88	-
144	申购	2018-09-11	1,121,312.51	1,121,312.51	-
145	申购	2018-09-11	836,029.76	836,029.76	-
146	申购	2018-09-11	617,674.08	617,674.08	-
147	申购	2018-09-11	603,777.17	603,777.17	-
148	申购	2018-09-12	832,235.80	832,235.80	-
149	申购	2018-09-12	1,902,026.65	1,902,026.65	-
150	赎回	2018-09-14	-40,000,000.00	-40,000,000.00	-
151	申购	2018-09-14	10,000,000.00	10,000,000.00	-
152	申购	2018-09-18	455,104.12	455,104.12	-
153	申购	2018-09-18	461,771.11	461,771.11	-
154	赎回	2018-09-18	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
155	申购	2018-09-18	579,874.43	579,874.43	-
156	申购	2018-09-18	588,596.70	588,596.70	-
157	申购	2018-09-18	823,317.32	823,317.32	-
158	申购	2018-09-18	434,786.42	434,786.42	-
159	申购	2018-09-18	416,084.55	416,084.55	-
160	申购	2018-09-18	327,741.24	327,741.24	-
161	申购	2018-09-18	321,766.62	321,766.62	-
162	申购	2018-09-18	528,711.92	528,711.92	-
163	申购	2018-09-18	1,087,126.16	1,087,126.16	-
164	申购	2018-09-18	1,336,758.58	1,336,758.58	-
165	申购	2018-09-19	856,740.01	856,740.01	-
166	申购	2018-09-19	1,900,433.66	1,900,433.66	-
167	赎回	2018-09-21	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
168	赎回	2018-09-25	-8,000,000.00	-8,000,000.00	-
169	申购	2018-09-26	1,148,661.60	1,148,661.60	-
170	申购	2018-09-26	339,920.70	339,920.70	-
171	申购	2018-09-26	349,540.54	349,540.54	-
172	申购	2018-09-26	431,785.85	431,785.85	-
173	申购	2018-09-26	874,167.07	874,167.07	-
174	申购	2018-09-26	480,589.96	480,589.96	-
175	申购	2018-09-26	483,266.39	483,266.39	-
176	申购	2018-09-26	549,621.42	549,621.42	-
177	申购	2018-09-26	600,672.92	600,672.92	-
178	申购	2018-09-26	619,436.34	619,436.34	-
179	申购	2018-09-26	1,391,116.40	1,391,116.40	-
180	申购	2018-09-26	454,281.30	454,281.30	-
181	申购	2018-09-27	899,395.50	899,395.50	-
182	申购	2018-09-27	1,978,490.03	1,978,490.03	-
183	赎回	2018-09-28	-10,000,000.00	-10,000,000.00	-
184	红利再投	2018-09-30	1,789,417.17	1,789,417.17	-
合计			136,687,741.21	136,687,741.21	

注:申购费0元,赎回费0元。

§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钱袋子货币市场基金募集的文件;

2.《广发钱袋子货币市场基金基金合同》;

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

4.《广发钱袋子货币市场基金托管协议》;

5.法律意见书;

6.基金管理人业务资格批件、营业执照;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照;

8.《广发钱袋子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