

广发钱袋子货币市场基金

[2015] 第一季度报告

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:二〇一五年四月二十日

§ 1. 重要提示

基金管理人的董事监事及董事会全体成员不存在虚假记载、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。

基金托管人和发起份额有限公司根据基金合同规定，于2015年4月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、持有人数等信息，在此基础上形成书面意见，不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告日期自2015年1月1日起至2015年3月31日。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发钱袋子
基金主代码	000509
交易代码	000509
基金份额分类	货币市场型
基金合同生效日	2014年1月10日
报告期末基金份额总额	6,022,031,425.50份
投资目标	本基金通过资产配置和持续高流动性的组合下，力争实现稳定的超额收益，同时兼顾流动性。
投资策略	本基金将深入研究国内外宏观经济运行情况、政策趋势、信用环境、货币政策变化对货币市场的影响，通过分析和判断利率走势与资金面平衡关系，结合对货币市场的深入研究，把握各货币品种的配置机会，从而选择最佳的货币品种进行配置。
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、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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期(2015年1月1日-2015年3月31日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	62,883,510.71	
2.本期利润	62,883,510.71	
3.期末基金资产净值	6,022,031,425.50	

(注)1.所列基金财务指标不包括持有人认购和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，由于货币市场基金无需摊余成本，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益即为利润。

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

阶段 净值收益率① 净值收益率② 净值收益率③ 业绩比较基准收益率④ ①-③ ②-④

过去三个月 1.187% 0.0912% 0.0875% 0.0000% 1.1002% 0.0012%

注:本基金收益分配日按每份额分。

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图”(2014年1月10日至2015年3月31日)

注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓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间	证券从业年限	说明
本基金的基金经理	陈军	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	李晓红	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	王海峰	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	周晓明	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	任晓春	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	陈军	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	李晓红	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	王海峰	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	周晓明	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	
本基金的基金经理	任晓春	2014年1月10日-2015年3月31日	7年	

注:“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券业协会的公告从行业自律协会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、《广发钱袋子货币市场基金》及其相关法律法规的规定。

基金管理人及其高级管理人员不存在利用基金财产为自己谋取私利的行为。

基金管理人及其高级管理人员不存在利用基金财产谋取不公平利益,损害基金份额持有人利益的行为。

基金管理人及其高级管理人员不存在泄露未公开信息的行为。

4.3 公平交易执行的情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合投资本公司其他投资组合未发生过反向交易的情况。

4.4 公平交易制度的执行情况

4.4.1 公平交易制度的执行情况

4.4.2 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合与本公司管理的其他投资组合未发生过反向交易的情况。

4.5 公平交易制度的执行情况

4.5.1 公平交易制度的执行情况

4.5.2 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.6 公平交易执行的情况

4.6.1 公平交易制度的执行情况

4.6.2 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7 公平交易制度的执行情况

4.7.1 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.2 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.3 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.4 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.5 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.6 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.7 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.8 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.9 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.10 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.11 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.12 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.13 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.14 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.15 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.16 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.17 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.18 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.19 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.20 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。

4.7.21 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)或同一组合投资不同交易日内进行反向交易,如果因对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,则需经公司领导层严格审批并报备监管部门。

本报告期内,本基金组合未发生过反向交易的情况。