

# 信息披露 Disclosure

## 广发钱袋子货币市场基金

### 2016 年第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日  
§ 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。  
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。

本报告书中的财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	定期存款投资	5,706,873,264.02	47.47%
其中:债券		5,706,873,264.02	47.47%
资产支持证券		-	-
2	买入返售金融资产	1,639,967,274.74	13.43
其中:质押式回购的买入返售金融资产	99,963,484.74	0.82	
3	银行存款和结算备付金合计	4,674,577,854.69	38.28
4	其他各项资产	101,279,632.13	0.83
5	合计	12,212,896,935.45	100.00

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	报告期内债券回购融资本金余额	789	-
其中:其中:逆回购融资本金	-	-	
2	买入返售金融资产	1,639,967,274.74	13.43
其中:质押式回购的买入返售金融资产	99,963,484.74	0.82	
3	银行存款和结算备付金合计	4,674,577,854.69	38.28
4	其他各项资产	101,279,632.13	0.83
5	合计	12,212,896,935.45	100.00

§ 2.2 报告期间回购融资本金情况

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资本金余额	789
其中:其中:逆回购融资本金	-	-
2	买入返售金融资产	1,639,967,274.74
其中:质押式回购的买入返售金融资产	99,963,484.74	
3	银行存款和结算备付金合计	4,674,577,854.69
4	其他各项资产	101,279,632.13
5	合计	12,212,896,935.45

注:本基金管理人本期报告内债券回购融资本金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

本基金在报告期正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

§ 3 基金投资组合平均剩余期限

§ 3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

序号	项目	天数
1	报告期末债券正回购平均剩余期限	108
2	报告期末货币市场基金余额最高值	109
3	报告期末货币市场基金余额最低值	75

报告期内货币组合平均剩余期限超过100天情况说明

本基金合同约定,“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天”,本报告期内,本基金管理人未发生超标情况。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

§ 3.2 报告期主要投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	长期限资产占基金资产净值的比例(%)	短期限资产占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	27.76	72.24
其中:剩余期限在397天以上的浮动利率债	-	-	-
2	30天(含)-90天	18.86	81.14
其中:剩余期限在397天以上的浮动利率债	-	-	-
3	60天(含)-90天	30.64	69.36
其中:剩余期限在397天以上的浮动利率债	-	-	-
4	90天(含)-180天	10.61	89.39
其中:剩余期限在397天以上的浮动利率债	-	-	-
5	180天(含)-397天(含)	24.88	75.12
其中:剩余期限在397天以上的浮动利率债	-	-	-
6	397天以上	-	100.00
其中:剩余期限在397天以上的浮动利率债	-	-	-
7	合计	112.05	873,264.02
其中:剩余期限在397天以上的浮动利率债	-	-	-

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的历史走势对比图

(2014年1月10日至2016年3月31日)

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理助理)简介

姓名 职务 在任本基金的基金经理期限 证券从业年限 离任日期 说明

王海峰 基金经理 2014-06-03 0 -

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合规情况说明

本报告期内,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取最大利益。本报告期内,基金管理人运作合法合规,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合相关法律法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易制度执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过设立科学、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施。

在投资决策的内部控制方面,公司制定制度规定投资组合的股票必须来源于具备选股股票库,重点投资的股票必须来源于沪深两市。公司建立了严格的投票授权制度,投资组合经理在其授权范围内可以自主决策,超过投票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、批次优先、综合平衡”的原则,公平分配投票权。监控稽核部根据规则通过对投资交易系统对投资交易进行实时监控及预警,检测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施。

4.3.3 相同交易日内不同账户之间反向交易的情况

本公司目前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形需要进行反向交易的,则需经公司领导严审并报批后备案。

本报告期内,上述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 报告期内存在的价格操纵行为说明

本公司不存在通过直接或间接操纵市场价格、影响证券交易价格、误导投资者等违法违规行为。

4.5 报告期内基金投资组合运作情况

2016年1季度,银行间市场资金面相对平稳,央行通过公开市场及MLF等操作保持市场流动性平衡。

年初以来,尽管SLR和MLF等操作,投放资金1万亿元,春节之后,央行首次公开市场操作,决定延续此前增加公开市场操作量的政策,央行降准预期持续升温,3月份,央行下调准备金率0.25个百分点,并公开市场操作利率降低5bp,而公开市场逆回购利率仍维持不变。从央行一季度货币政策例会内容看,货币政策取向并未变;同时,在数量型调控向价格型调控转变过程中,央行利率走廊的操作机制将进一步完善。

宏观数据来看,物价稳中有升,主要受寒潮天气和节假日因素的影响,并且近期可能延续至春末。

经济数据方面,1-2月社会消费品零售总额同比增长3.0%,增速比去年全年提高0.2个百分点。1月份,全国居民消费价格指数(CPI)同比上涨1.0%,环比上涨0.8%;工业生产者出厂价格(PPI)同比下降1.5%,环比下降0.1%。春节期间,居民消费需求旺盛,餐饮服务价格涨幅较大,带动CPI同比涨幅扩大。2月份,CPI同比上涨1.9%,环比上涨0.7%;PPI同比下降1.4%,环比下降0.2%。3月份,居民消费价格指数(CPI)同比上涨2.3%,环比上涨0.3%;PPI同比下降1.4%,环比下降0.3%。3月份,居民消费价格指数(CPI)同比涨幅扩大,主要是因为春节因素,食品价格涨幅较大,带动CPI同比涨幅扩大。

4.6 报告期内基金绩效评价结果

本报告期内,本基金净值增长率为0.7526%,同期业绩比较基准收益率为0.0885%。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

一季度,央行继续实施稳健的货币政策,保持货币信贷合理增长,促进国民经济平稳运行,确保经济稳定增长,防范化解金融风险,维护金融稳定。

二季度,随着经济企稳回升,货币政策将更加灵活,适时预调微调,促进经济平稳运行,防范化解金融风险,维护金融稳定。

三季度,随着经济企稳回升,货币政策将更加灵活,适时预调微调,促进经济平稳运行,防范化解金融风险,维护金融稳定。

4.8 备查文件目录

1.中国证监会批准基金募集的文件;2.基金合同;3.基金托管协议;4.基金招募说明书;5.基金代销协议;6.基金销售机构资料;7.基金份额发售公告;8.基金上市公告书;9.基金临时公告;10.基金半年报、年报;11.基金季度报告;12.基金半年度、年度报告提示性公告;13.基金权益登记公告;14.基金红利分红公告;15.基金转换份额公告;16.基金巨额赎回公告;17.基金暂停或者重新开放公告;18.基金估值方法、程序和参数的公告;19.基金费用计提方法、方式、标准和公告;20.基金收益分配原则和实施公告;21.基金信息披露办法;22.基金销售机构资料;23.基金份额净值公告;24.基金定期报告;25.基金半年报、年报;26.基金季度报告;27.基金临时公告;28.基金暂停或者重新开放公告;29.基金巨额赎回公告;30.基金暂停或者重新开放;31.基金暂停或者重新开放;32.基金暂停或者重新开放;33.基金暂停或者重新开放;34.基金暂停或者重新开放;35.基金暂停或者重新开放;36.基金暂停或者重新开放;37.基金暂停或者重新开放;38.基金暂停或者重新开放;39.基金暂停或者重新开放;40.基金暂停或者重新开放;41.基金暂停或者重新开放;42.基金暂停或者重新开放;43.基金暂停或者重新开放;44.基金暂停或者重新开放;45.基金暂停或者重新开放;46.基金暂停或者重新开放;47.基金暂停或者重新开放;48.基金暂停或者重新开放;49.基金暂停或者重新开放;50.基金暂停或者重新开放;51.基金暂停或者重新开放;52.基金暂停或者重新开放;53.基金暂停或者重新开放;54.基金暂停或者重新开放;55.基金暂停或者重新开放;56.基金暂停或者重新开放;57.基金暂停或者重新开放;58.基金暂停或者重新开放;59.基金暂停或者重新开放;60.基金暂停或者重新开放;61.基金暂停或者重新开放;62.基金暂停或者重新开放;63.基金暂停或者重新开放;64.基金暂停或者重新开放;65.基金暂停或者重新开放;66.基金暂停或者重新开放;67.基金暂停或者重新开放;68.基金暂停或者重新开放;69.基金暂停或者重新开放;70.基金暂停或者重新开放;71.基金暂停或者重新开放;72.基金暂停或者重新开放;73.基金暂停或者重新开放;74.基金暂停或者重新开放;75.基金暂停或者重新开放;76.基金暂停或者重新开放;77.基金暂停或者重新开放;78.基金暂停或者重新开放;79.基金暂停或者重新开放;80.基金暂停或者重新开放;81.基金暂停或者重新开放;82.基金暂停或者重新开放;83.基金暂停或者重新开放;84.基金暂停或者重新开放;85.基金暂停或者重新开放;86.基金暂停或者重新开放;87.基金暂停或者重新开放;88.基金暂停或者重新开放;89.基金暂停或者重新开放;90.基金暂停或者重新开放;91.基金暂停或者重新开放;92.基金暂停或者重新开放;93.基金暂停或者重新开放;94.基金暂停或者重新开放;95.基金暂停或者重新开放;96.基金暂停或者重新开放;97.基金暂停或者重新开放;98.基金暂停或者重新开放;99.基金暂停或者重新开放;100.基金暂停或者重新开放;101.基金暂停或者重新开放;102.基金暂停或者重新开放;103.基金暂停或者重新开放;104.基金暂停或者重新开放;105.基金暂停或者重新开放;106.基金暂停或者重新开放;107.基金暂停或者重新开放;108.基金暂停或者重新开放;109.基金暂停或者重新开放;110.基金暂停或者重新开放;111.基金暂停或者重新开放;112.基金暂停或者重新开放;113.基金暂停或者重新开放;114.基金暂停或者重新开放;115.基金暂停或者重新开放;116.基金暂停或者重新开放;117.基金暂停或者重新开放;118.基金暂停或者重新开放;119.基金暂停或者重新开放;120.基金暂停或者重新开放;121.基金暂停或者重新开放;122.基金暂停或者重新开放;123.基金暂停或者重新开放;124.基金暂停或者重新开放;125.基金暂停或者重新开放;126.基金暂停或者重新开放;127.基金暂停或者重新开放;128.基金暂停或者重新开放