

广发货币市场基金

[2017]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:中信银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对董事会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。
基金托管人的董事会对董事会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。
基金合同由广发基金管理有限公司根据本基金合同规定，于二〇一七年三月二十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，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
基金管理人承诺在本报告书中诚实守信、勤勉尽责的履行管理运用基金资产的职责，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。

本报告期自2017年1月1日至至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金名称	广发货币
基金代码	270004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月20日
报告期末基金份额总额	15,661,303,963份
投资目标	在保持资产流动性的基础上,由稳定的当期收益。

投资策略(以基金合同、《货币市场基金管理规定》、本基金合同等有关法律法规为依据):
投资管理的原则和方法:稳健、稳定的资金投资原则。本基金的投资管理遵循以下原则:
1)安全性原则:本基金将主要投资于货币市场工具,风险较低,流动性强,稳定性较高的货币市场工具。
2)流动性原则:本基金将主要投资于货币市场工具,流动性强,稳定性较高的货币市场工具。
3)收益性原则:本基金将主要投资于货币市场工具,力求在保持资产流动性的基础上,由稳定的当期收益。

投资组合分析(以基金合同、《货币市场基金管理规定》、本基金合同等有关法律法规为依据):
投资组合分析:截至报告期末,广发货币的资产配置情况如下表所示:

投资组合分析		
序号	项目	金额(元)
1	固定收益投资	5,431,852,791.25
2	货币市场工具	5,431,852,791.25
3	其他资产	-
4	买入返售金融资产	4,259,236,088.00
5	其中:质押式回购	-
6	银行存款和结算备付金合计	7,602,881,026.05
7	其他资产	132,864,731.02
8	合计	17,466,769,759.10
	占基金总资产的比例(%)	31.12

投资组合比例(以基金合同、《货币市场基金管理规定》、本基金合同等有关法律法规为依据):
投资组合比例:截至报告期末,广发货币的资产配置情况如下表所示:

投资组合比例		
序号	项目	占比(%)
1	货币市场基金	12.7%
2	买入返售金融资产	24.83%
3	银行存款和结算备付金合计	43.60%
4	其他资产	0.76%
5	合计	100.00%

投资回报率(以基金合同、《货币市场基金管理规定》、本基金合同等有关法律法规为依据):
投资回报率:截至报告期末,广发货币的资产配置情况如下表所示:

投资回报率		
序号	项目	占比(%)

投资回报率:截至报告期末,广发货币的资产配置情况如下表所示:

1	广发货币A	广发货币B	广发货币
2	270004	511920	4116,414,589.29

报告期末广发货币的份额总额:4116,414,589.29份,单位净值:0.9996,309.66份,0.92,962,000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

报告期2017年1月1日至2017年3月31日		
广发货币	广发货币	广发货币
32,110,532.72	224,300,209.72	765,694.03
32,110,532.72	224,300,209.72	765,694.03
4,116,414,589.29	11,444,066,309.66	83,295,200.00

注:报告期的债券投资余额占基金净资产的比例为报告期内每日每只货币基金的债券投资余额占该基金净资产的比例之和,即报告期的债券投资余额=报告期的债券投资总额/报告期的基金净资产。

本期实现的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,本期利润为本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)减去本期发生的各项费用后的余额。

风险报酬特征

本基金具有高流动性、低风险的特征,适合机构投资者。

基金管理人

广发基金管理有限公司

下属二级基金的基金简称

广发货币A

下属二级基金的交易代码

270004

报告期末广发货币的份额总额:4116,414,589.29份,单位净值:0.9996,309.66份,0.92,962,000份。

§ 4 财务会计

4.1 主要财务指标

4.1.1 报告期内基金主要财务指标及同比增减变动情况

1) 广发货币A

报告期主要财务指标

报告期主要财务指标