广发货币市场基金

2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

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

送出日期：二〇二一年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
6 半年度财务会计报告（未经审计） 14
6.1 资产负债表 14
6.2 利润表 16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 17
6.4 报表附注 18
7 投资组合报告 40
7.1 期末基金资产组合情况 40
7.2 债券回购融资情况 41
7.3 基金投资组合平均剩余期限 41
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 42
7.6 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 43
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 43
7.8 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 43
7.9 投资组合报告附注 43
8 基金份额持有人信息 44

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 44
8.2 期末上市基金前十名持有人 45
8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 45
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 46
8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 46
9 开放式基金份额变动 46
10 重大事件揭示 46
10.1 基金份额持有人大会决议 47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 47
10.4 基金投资策略的改变 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 48
10.9 其他重大事件 48
11 备查文件目录 49
11.1 备查文件目录 49
11.2 存放地点 50
11.3 查阅方式 50

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发货币市场基金			
基金简称	广发货币			
基金主代码	270004			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2005 年 5 月 20 日			
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			
报告期末基金份额总额	37,554,332,778.52 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	广发货币 A	广发货币 B	广发货币 C	广发货币 E
下属分级基金场内简称	-	-	-	广发货币
下属分级基金的交易代码	270004	270014	005092	511920
报告期末下属分级基金的份额总额	3,287,433,246.56 份	34,253,530,551.17 份	5,580.79 份	13,363,400.00 份

注：1、广发货币市场基金 E 类份额的基金份额面值为 100 元，本报告中（除上市基金前十名持有人外）所列 E 类份额数据面值已折算为 1 元。

2、广发货币 E 类份额在上海证券交易所上市交易，扩位证券简称为“广发货币 ETF”。

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持低风险与资产流动性的基础上，追求稳定的当期收益。
投资策略	投资策略以自上而下为主，兼顾自下而上的方式。其中，自上而下是指基金管理人通过定量与定性相结合的综合分析，对利率尤其是短期利率的变化趋势进行预测，在科学、合理的短期利率预测的基础上决定本基金组合的期限结构和品种结构，构建稳健的投资组合。自下而上是指要重视具体投资对象的价值分析，同时针对市场分割及定价机制暂时失灵带来的投资机会，进行相应的套利操作，增加投资收益。
业绩比较基准	（1－利息税率）×活期存款利率
风险收益特征	1. 高安全性：本金损失的风险小，收益的波动性小； 2. 高流动性：基金投资组合本身剩余期限短，流动性高；投资人在基金交易时无需支付费用，变现成本低； 3. 稳定的收益：力争获取稳定的超过同期银行定期存款利率（税后）的收益率。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588
传真		020-89899158	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510308	100140
法定代表人		孙树明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

注：本基金的 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额的注册登记机构为广发基金管理有限公司，E 类基金份额的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）			
	广发货币 A	广发货币 B	广发货币 C	广发货币 E
本期已实现收益	37,800,837.93	343,315,828.81	67.17	159,252.39
本期利润	37,800,837.93	343,315,828.81	67.17	159,252.39
本期净值收益率	1.2249%	1.3453%	1.2182%	1.2250%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)			
	广发货币 A	广发货币 B	广发货币 C	广发货币 E
期末基金资产净值	3,287,433,246.56	34,253,530,551.17	5,580.79	13,363,400.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)			
	广发货币 A	广发货币 B	广发货币 C	广发货币 E
累计净值收益率	62.2248%	51.3637%	11.1367%	15.1826%

注：（1）本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

（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，由于本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）本基金 A、B、C 类基金份额的利润分配按日结转为对应份额，本基金 E 类基金份额持有人收益账户内的累计收益不低于 100 元时，则 100 元整数倍的累计收益将兑付为相应 E 类基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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．广发货币 A：

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.1866%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1574%	0.0002%
过去三个月	0.5778%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.4893%	0.0002%
过去六个月	1.2249%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	1.0489%	0.0006%
过去一年	2.2496%	0.0012%	0.3549%	0.0000%	1.8947%	0.0012%
过去三年	7.3427%	0.0014%	1.0656%	0.0000%	6.2771%	0.0014%
自基金合同生效起至今	62.2248%	0.0052%	17.5851%	0.0030%	44.6397%	0.0022%

2．广发货币 B：

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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

过去一个月	0.2063%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1771%	0.0002%
过去三个月	0.6380%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.5495%	0.0002%
过去六个月	1.3453%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	1.1693%	0.0006%
过去一年	2.4948%	0.0012%	0.3549%	0.0000%	2.1399%	0.0012%
过去三年	8.1177%	0.0014%	1.0656%	0.0000%	7.0521%	0.0014%
自基金合同生效起至今	51.3637%	0.0038%	7.2905%	0.0016%	44.0732%	0.0022%

3．广发货币 C：

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.1856%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1564%	0.0002%
过去三个月	0.5751%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.4866%	0.0002%
过去六个月	1.2182%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	1.0422%	0.0006%
过去一年	2.2343%	0.0012%	0.3549%	0.0000%	1.8794%	0.0012%
过去三年	7.3224%	0.0014%	1.0656%	0.0000%	6.2568%	0.0014%
自基金合同生效起至今	11.1367%	0.0023%	1.3757%	0.0000%	9.7610%	0.0023%

4．广发货币 E：

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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
过去一个月	0.1865%	0.0002%	0.0292%	0.0000%	0.1573%	0.0002%
过去三个月	0.5778%	0.0002%	0.0885%	0.0000%	0.4893%	0.0002%
过去六个月	1.2250%	0.0006%	0.1760%	0.0000%	1.0490%	0.0006%
过去一年	2.2496%	0.0012%	0.3549%	0.0000%	1.8947%	0.0012%
过去三年	7.1873%	0.0013%	1.0656%	0.0000%	6.1217%	0.0013%
自基金合同生效起至今	15.1826%	0.0020%	1.8861%	0.0000%	13.2965%	0.0020%

注：自 2010 年 10 月 28 日起，本基金的业绩比较基准由“一年期银行定期存款的税后利率：（1－利息税率）×一年期银行定期储蓄存款利率”变更为“税后活期存款利率：即（1－利息税率）×活期存款利率”。

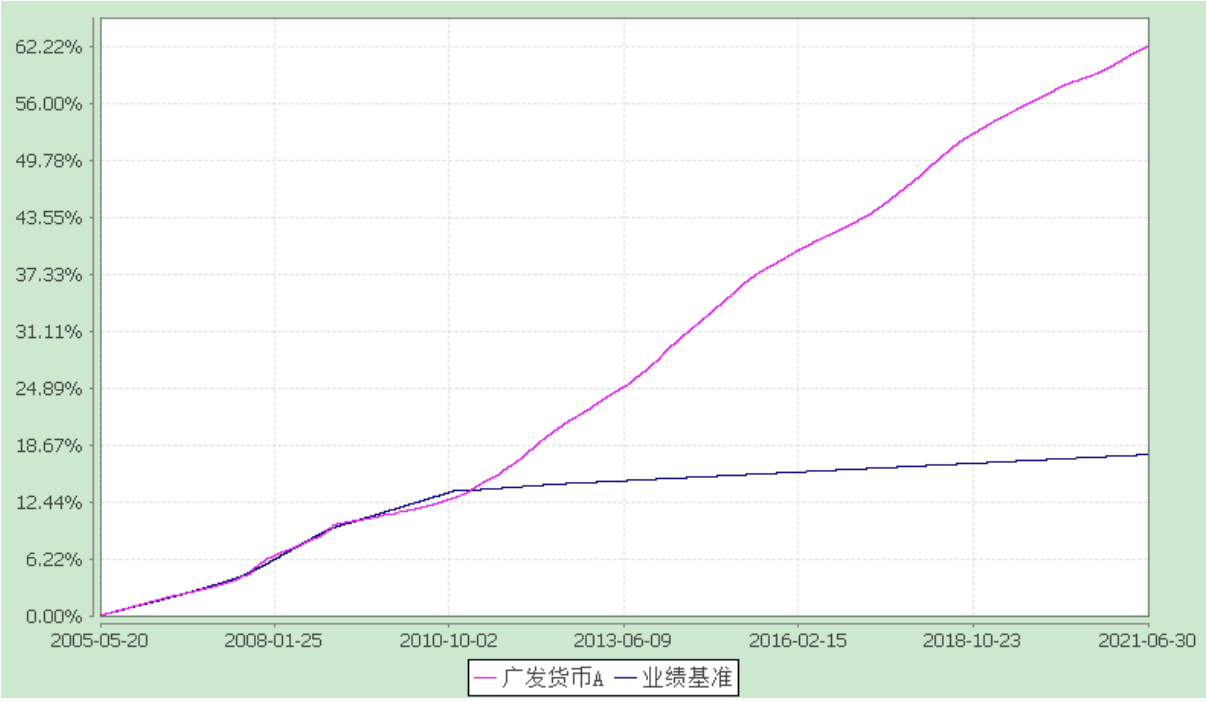
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发货币市场基金

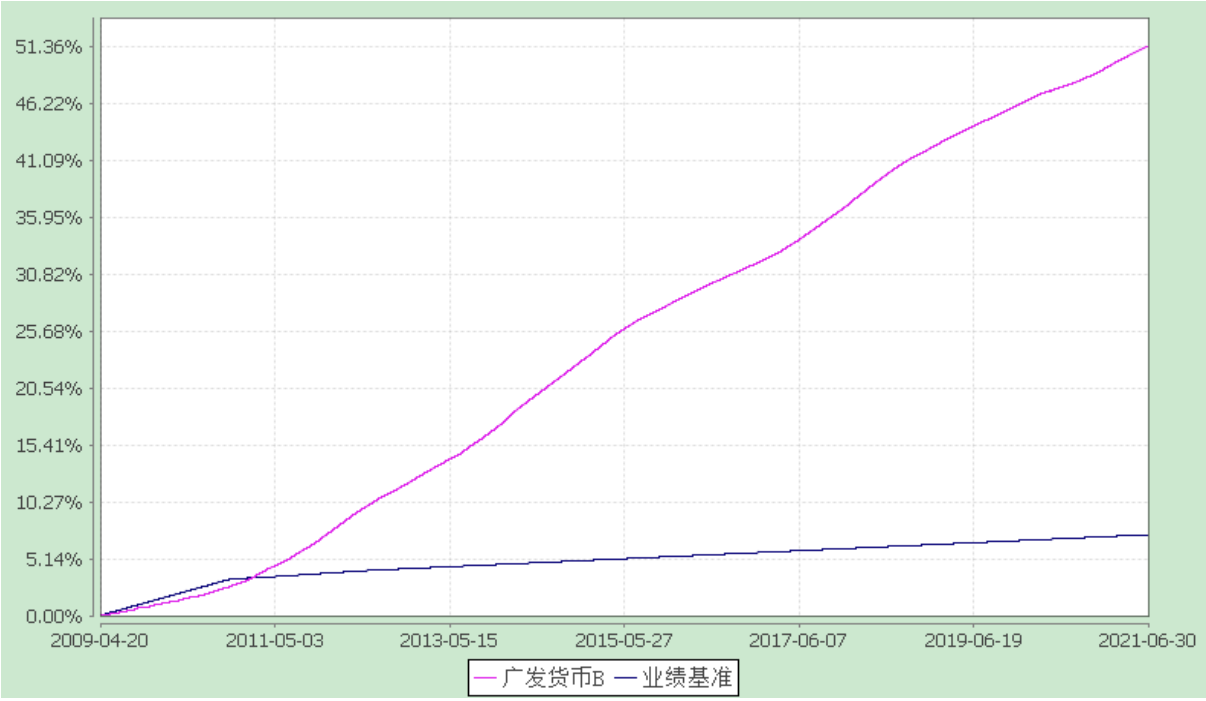
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005 年 5 月 20 日至 2021 年 6 月 30 日)

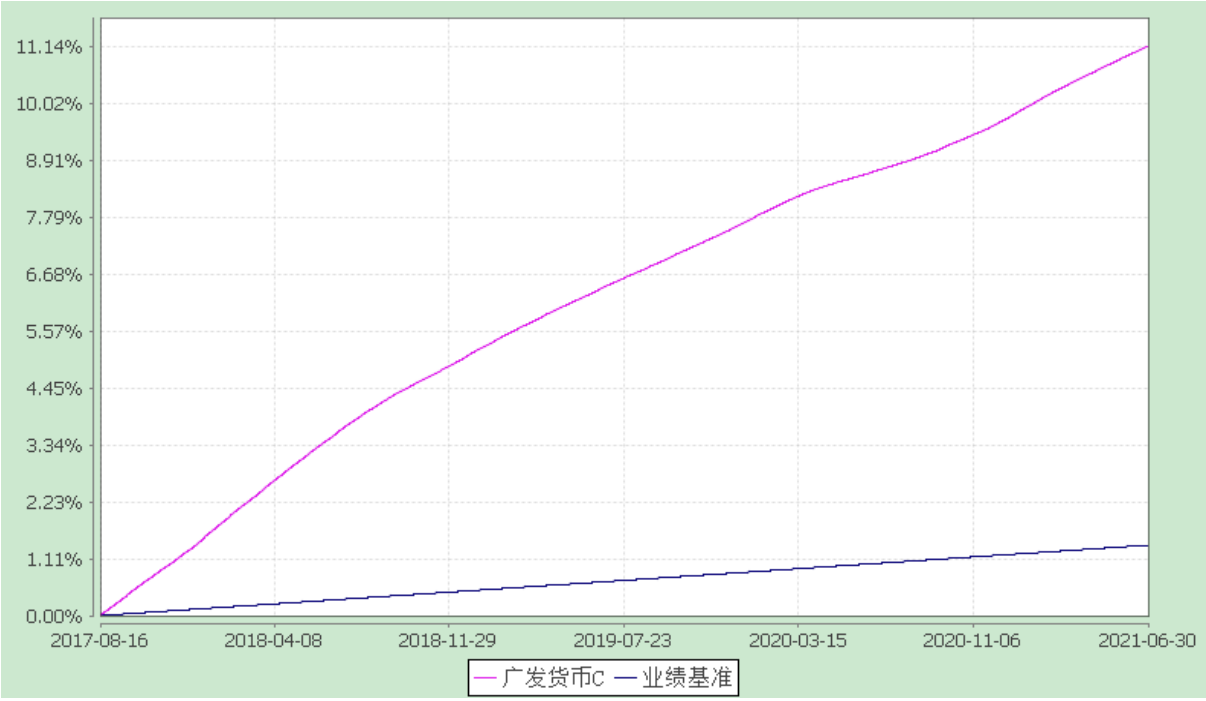
1、广发货币 A



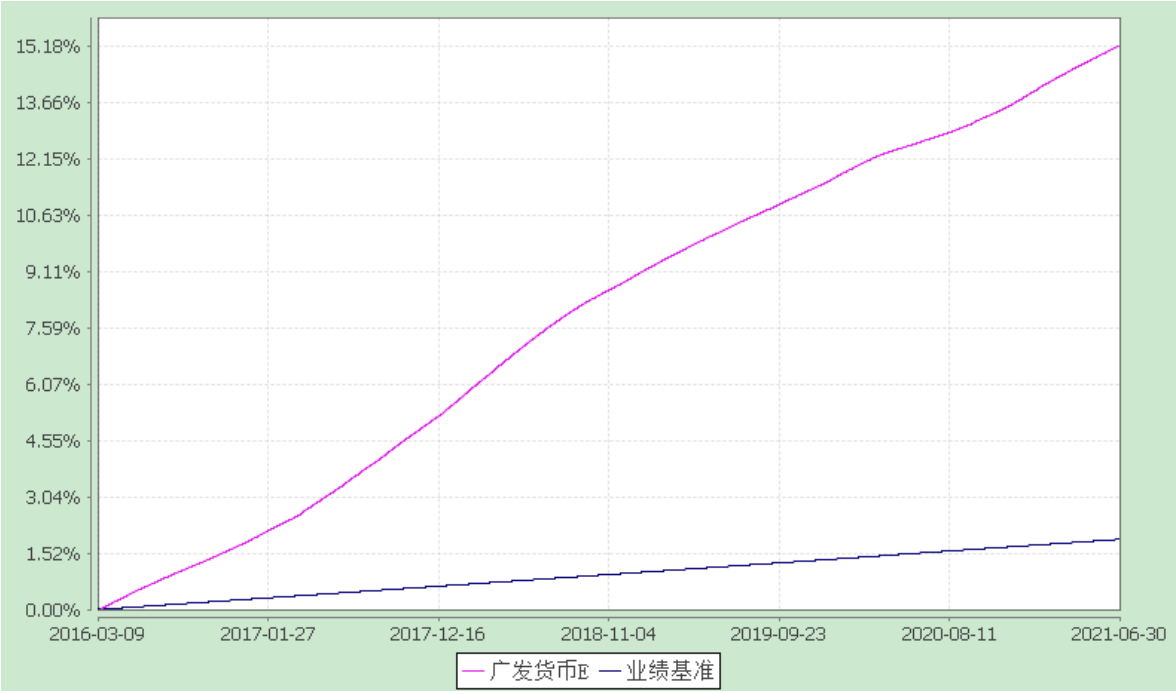
2、广发货币 B



3、广发货币 C



4、广发货币 E



注：自 2010 年 10 月 28 日起，本基金的业绩比较基准由“一年期银行定期存款的税后利率：（1－利息税率）×一年期银行定期储蓄存款利率”变更为“税后活期存款利率：即（1－利息税率）×活期存款利率”。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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；广发现金宝场内实时申赎货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的基金经理；广发添利交易型货币市场基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经理；现金投资部总经理	2010-04-29	-	21 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、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 日至 2020 年 4 月 21 日)、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 日至 2020 年 9 月 24 日)、广发景宁纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 22 日至 2020 年 12 月 21 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 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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，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

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 13 次，其中 7 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，货币市场表现整体平稳，7 天回购利率基本围绕 DR007 波动，一年期存单等资产收益呈现先快速上行、后缓步下行的趋势：1 月至 2 月中旬，存单利率快速上行的主要原因在于货币政策操作偏紧，市场出现恐慌情绪。变盘时点在春节后，权益资产快速调整导致追求稳健收益的资金涌入债市，同时货币政策传递稳定信号，资金面持续宽松，市场预期逐步修正。和去年年末的点位相比，利率债利率小幅下行，期限利差变化不大，而信用债利率下行幅度相对较大，信用利差出现明显压缩，存单利率随流动性转宽裕稳步下行。上半年，组合密切跟踪市场动向，灵活调整

持仓券种结构，有效安排杠杆和久期，做好流动性管理。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值收益率为 1.2249%，B 类基金份额净值收益率为 1.3453%，C 类基金份额净值收益率为 1.2182%，E 类基金份额净值收益率为 1.2250%，同期业绩比较基准收益率为 0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面将继续缓步下行，对债市的影响偏利多，近期国常会明确提及降准后，央行迅速落实，奠定了货币政策未来一段时间内中性偏宽松的基调，7 天回购利率仍将在政策利率附近小幅波动，一年期以内短端资产收益中枢会保持平稳，但预计整体资金面的波动会较上半年增大。未来组合将继续跟踪经济基本面、货币政策等方面的变化，增强操作的灵活性；同时注意做好持仓券种梳理，优化持仓结构，把握季末、年末等关键时点，积极配置高收益资产，争取抓住市场机会，严控风险，为投资人带来理想的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额的利润分配按日结转为对应份额，本基金 E 类基金份额持有人收益账户内的累计收益不低于 100 元时，则 100 元整数倍的累计收益将兑付为相应 E 类基金份额。本基金报告期内累计分配收益 381,275,986.30 元。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发货币市场基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发货币市场基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发货币市场基金 2021 年中期报告中财务指标、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发货币市场基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	13,365,850,560.34	3,266,486,306.28
结算备付金		3,112,273.67	952.38
存出保证金		3,872.21	-
交易性金融资产	6.4.7.2	24,511,757,956.03	5,110,811,731.77
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		24,511,757,956.03	5,110,811,731.77
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	5,031,296,106.92	2,726,510,759.77
应收证券清算款		873,402,548.26	-
应收利息	6.4.7.5	132,733,809.00	25,356,452.84
应收股利		-	-
应收申购款		852,103,298.79	195,571,336.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		44,770,260,425.22	11,324,737,539.50
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 日**	**上年度末 2020 年 12 月 31 日**
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		7,202,219,326.50	859,258,631.60
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,309,449.57	2,591,362.22
应付托管费		1,769,816.55	795,126.30
应付销售服务费		1,003,946.12	576,202.47
应付交易费用	6.4.7.7	517,901.85	150,945.04
应交税费		80,728.68	49,245.34
应付利息		2,402,009.66	69,602.93
应付利润		2,519,264.46	876,952.76
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	105,203.31	33,081,526.35
负债合计		7,215,927,646.70	897,449,595.01
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	37,554,332,778.52	10,427,287,944.49

未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		37,554,332,778.52	10,427,287,944.49
负债和所有者权益总计		44,770,260,425.22	11,324,737,539.50

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，广发货币 A 基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 3,287,433,246.56 份；广发货币 B 基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 34,253,530,551.17 份；广发货币 C 基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 5,580.79 份；广发货币 E 基金份额净值人民币 1.0000 元，基金份额总额 13,363,400.00 份；总份额总额 37,554,332,778.52 份。

6.2 利润表

会计主体：广发货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		**450,335,304.93**	**123,961,767.24**
1.利息收入		449,318,778.77	124,916,352.76
其中：存款利息收入	6.4.7.11	116,466,677.03	20,502,435.90
债券利息收入		253,187,854.95	74,817,506.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		79,664,246.79	29,596,410.53
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,016,526.16	-954,585.52
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	1,016,526.16	-954,585.52
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-	-
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-	-
减：二、费用		**69,059,318.63**	**30,481,609.12**
1．管理人报酬		21,825,420.61	14,942,197.33
2．托管费		7,275,140.24	4,527,938.51
3．销售服务费		5,184,973.54	3,706,887.70

4．交易费用	6.4.7.14	-	-
5．利息支出		34,554,527.68	7,128,481.67
其中：卖出回购金融资产支出		34,554,527.68	7,128,481.67
6．税金及附加		39,039.20	20,122.94
7．其他费用	6.4.7.15	180,217.36	155,980.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**381,275,986.30**	**93,480,158.12**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**381,275,986.30**	**93,480,158.12**

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发货币市场基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	**本期** 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	10,427,287,944.49	-	10,427,287,944.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	381,275,986.30	381,275,986.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	27,127,044,834.03	-	27,127,044,834.03
其中：1.基金申购款	63,734,553,699.51	-	63,734,553,699.51
2.基金赎回款	-36,607,508,865.48	-	-36,607,508,865.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-381,275,986.30	-381,275,986.30
五、期末所有者权益（基金净值）	37,554,332,778.52	-	37,554,332,778.52
项目	**上年度可比期间** 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	**未分配利润**	**所有者权益合计**
一、期初所有者权益（基金净值）	8,015,247,671.80	-	8,015,247,671.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	93,480,158.12	93,480,158.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	878,781,625.42	-	878,781,625.42

其中：1.基金申购款	19,132,481,672.39	-	19,132,481,672.39
2.基金赎回款	-18,253,700,046.97	-	-18,253,700,046.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-93,480,158.12	-93,480,158.12
五、期末所有者权益（基金净值）	8,894,029,297.22	-	8,894,029,297.22

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发货币市场基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监基金字[2005]60 号文《关于同意广发货币市场基金募集的批复》的批准，由广发基金管理有限公司作为发起人，于 2005 年 4 月 26 日向社会公开发行募集并于 2005 年 5 月 20 日正式成立。本基金为契约型开放式货币市场基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 2,636,630,865.77 份基金份额。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为2005年4月26日至2005年5月17日，募集资金总额为人民币2,636,630,865.77元，其中募集资金的银行存款利息为人民币 192,263.77 元，上述资金已经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。

本基金于 2009 年 4 月 20 日起实施分级，分为 A 级基金份额和 B 级基金份额；2016 年本基金增设 E 级基金份额，E 级基金份额于 2016 年 3 月 28 日在上海证券交易所上市交易。本基金于 2017 年 8 月 16 日起增设 C 级基金份额。每份 A 类基金份额 、B 类基金份额和 C 类基金份额面值为人民币 1.00 元，每份 E 类基金份额面值为 100 元人民币。本基金 A 类基金份额、B 类基金份额和 C 类基金份额在场外申购和赎回，注册登记机构为基金管理人；E 类基金份额在场内申购和赎回，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。基金分级后，在任何一个开放日，若 A 级基金份额持有人在单个基金账户中保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 级基金份额升级为 B 级基金份额，若 B 级基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 级基金份额降级为 A 级基金份额。各类基金份额单独设置基金代码，收取不同的销售服务费，A 级基金份额、B 级基金份额和 C 级基金份额公布每万份基金已实现收益和七日年化收益率，E 级基金份额公布每

百份基金已实现收益和七日年化收益率。

本基金的财务报表于 2021 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则 （以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

（2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

（3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	850,560.34
定期存款	13,365,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	1,550,000,000.00
存款期限 1-3 个月	4,415,000,000.00
存款期限 3 个月以上	7,400,000,000.00
其他存款	-
合计	13,365,850,560.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度（%）
债券	交易所市场	129,992,454.02	130,012,000.00	19,545.98	0.0001
	银行间市场	24,381,765,502.01	24,391,519,000.00	9,753,497.99	0.0260
	合计	24,511,757,956.03	24,521,531,000.00	9,773,043.97	0.0260
资产支持证券		-	-	-	-
合计		24,511,757,956.03	24,521,531,000.00	9,773,043.97	0.0260

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	5,031,296,106.92	-
合计	5,031,296,106.92	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,520.94
应收定期存款利息	77,667,944.57
应收其他存款利息	1.53
应收结算备付金利息	1,261.94
应收债券利息	52,509,037.26
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,553,042.76
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	132,733,809.00

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	517,901.85
合计	517,901.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	105,203.31
合计	105,203.31

6.4.7.9 实收基金

广发货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,574,249,284.66	2,574,249,284.66
本期申购	7,257,443,103.24	7,257,443,103.24
本期赎回（以“-”号填列）	-6,544,259,141.34	-6,544,259,141.34
本期末	3,287,433,246.56	3,287,433,246.56

广发货币 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,844,238,746.30	7,844,238,746.30
本期申购	56,467,507,529.01	56,467,507,529.01
本期赎回（以“-”号填列）	-30,058,215,724.14	-30,058,215,724.14
本期末	34,253,530,551.17	34,253,530,551.17

广发货币 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,513.53	5,513.53
本期申购	67.26	67.26
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	5,580.79	5,580.79

广发货币 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,794,400.00	8,794,400.00
本期申购	9,603,000.00	9,603,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-5,034,000.00	-5,034,000.00
本期末	13,363,400.00	13,363,400.00

注：申购含转换转入、红利再投资、级别调整入份（金）额，赎回含转换转出、级别调整出份

（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

广发货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	37,800,837.93	-	37,800,837.93
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-37,800,837.93	-	-37,800,837.93
本期末	-	-	-

广发货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	343,315,828.81	-	343,315,828.81
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-343,315,828.81	-	-343,315,828.81
本期末	-	-	-

广发货币 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	67.17	-	67.17
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-67.17	-	-67.17
本期末	-	-	-

广发货币 E

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	159,252.39	-	159,252.39
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-159,252.39	-	-159,252.39

本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	48,823.22
定期存款利息收入	116,373,993.72
其他存款利息收入	4.84
结算备付金利息收入	43,855.25
其他	-
合计	116,466,677.03

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,016,526.16
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,016,526.16

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	28,782,379,325.59
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,740,868,443.80
减：应收利息总额	40,494,355.63
买卖债券差价收入	1,016,526.16

6.4.7.13 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.14 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	65,175.76
账户维护费	18,000.00
其他	838.29
合计	180,217.36

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司
广发融资租赁(广东)有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司
广发期货有限公司	基金管理人控股股东的全资子公司

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	79,986,652.05	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	5,994,000,000.00	100.00%	5,590,000,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	21,825,420.61	14,942,197.33
其中：支付销售机构的客户维护费	2,471,578.00	1,969,844.64

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.15%（2020 年 12 月 23 日以前：0.33%）的年费率计提。

管理费的计算方法如下：

H=E ×0.15%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休

息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,275,140.24	4,527,938.51

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05%（2020 年 12 月 23 日以前：0.10%）的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E ×0.05%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	广发货币 A	广发货币 B	广发货币 C	广发货币 E	合计
广发基金管理有限公司	921,701.23	1,075,143.83	7.24	-	1,996,852.30
中国工商银行股份有限公司	1,006,937.73	7,687.05	-	-	1,014,624.78
广发证券股份有限公司	195,147.46	19,229.69	-	4,397.79	218,774.94
广发期货有限公司	1.27	-	-	-	1.27
合计	2,123,787.69	1,102,060.57	7.24	4,397.79	3,230,253.29

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E	合计
广发基金管理有限公司	742,930.01	247,636.62	159.42	-	990,726.05
广发证券股份有限公司	228,714.01	18,665.56	-	3,951.77	251,331.34

中国工商银行股份有限公司	814,047.87	3,691.66	-	-	817,739.53
合计	1,785,691.89	269,993.84	159.42	3,951.77	2,059,796.92

注：在通常情况下，本基金的销售服务费计算方法如下：

H＝E×G÷当年天数

H 为每日应计提的销售服务费

E 为前一日基金资产净值

G 为对应的销售服务费率

本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%；本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%；本基金 E 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

销售服务费每日计算，每日计提，按月支付，由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	6,713,147,000.00	735,018.07
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	27,376,451,000.00	1,228,524.45

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率

的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日				上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E	广发货币A	广发货币B	广发货币C	广发货币E
报告期初持有的基金份额	-	61,094,861.50	-	-	-	34,688,989.15	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	1,672,213,220.24	-	-	60,000,000.00	129,376,324.52	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	338,000,000.00	-	-	60,000,000.00	85,850,000.00	-	-
报告期末持有的基金份额	-	1,395,308,081.74	-	-	-	78,215,313.67	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	4.07%	-	-	-	1.25%	-	-

注：基金管理人本报告期内及上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

广发货币 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发货币 B

份额单位：份

关联方名称	广发货币B本期末 2021年6月30日		广发货币B上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发融资租赁(广东)有限公司	82,100,082.76	0.24%	93,893,136.39	1.20%

瑞元资本管理有限公司	65,597,955.66	0.19%	-	-
广发期货有限公司	5,031,924.42	0.01%	-	-

广发货币 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

广发货币 E

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	850,560.34	48,823.22	8,357,811.86	46,124.21

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

1、广发货币 A

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
37,734,298.42	69,499.20	-2,959.69	37,800,837.93	-

2、广发货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
340,229,739.13	1,443,413.32	1,642,676.36	343,315,828.81	-

3、广发货币 C

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
67.26	-	-0.09	67.17	-

4、广发货币 E

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
144,200.00	12,457.27	2,595.12	159,252.39	-

6.4.12 期末（2021 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,202,219,326.50 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
012101221	21 南电 SCP006	2021-07-01	100.02	1,054,000.00	105,421,080.00
112003061	20 农业银行 CD061	2021-07-01	99.80	1,000,000.00	99,800,000.00
112004097	20 中国银行 CD097	2021-07-01	99.71	1,000,000.00	99,710,000.00
112006115	20 交通银行 CD115	2021-07-01	99.94	500,000.00	49,970,000.00
112006232	20 交通银行 CD232	2021-07-01	99.76	500,000.00	49,880,000.00
112006250	20 交通银行 CD250	2021-07-01	99.63	500,000.00	49,815,000.00
112007095	20 招商银行 CD095	2021-07-01	99.83	1,000,000.00	99,830,000.00
112008150	20 中信银行 CD150	2021-07-01	99.78	500,000.00	49,890,000.00
112008156	20 中信银行 CD156	2021-07-01	99.79	500,000.00	49,895,000.00
112008274	20 中信银行 CD274	2021-07-01	99.78	500,000.00	49,890,000.00
112009325	20 浦发银行 CD325	2021-07-01	99.61	327,000.00	32,572,470.00
112009471	20 浦发银行	2021-07-01	99.77	1,000,000.00	99,770,000.00

	CD471				
112009482	20 浦发银行 CD482	2021-07-01	99.73	1,000,000.00	99,730,000.00
112010278	20 兴业银行 CD278	2021-07-01	99.82	1,000,000.00	99,820,000.00
112010288	20 兴业银行 CD288	2021-07-01	99.80	2,000,000.00	199,600,000.00
112010301	20 兴业银行 CD301	2021-07-01	99.76	2,000,000.00	199,520,000.00
112010320	20 兴业银行 CD320	2021-07-01	99.71	2,000,000.00	199,420,000.00
112011202	20 平安银行 CD202	2021-07-01	99.65	1,000,000.00	99,650,000.00
112011204	20 平安银行 CD204	2021-07-01	99.60	1,000,000.00	99,600,000.00
112015296	20 民生银行 CD296	2021-07-01	99.94	500,000.00	49,970,000.00
112015419	20 民生银行 CD419	2021-07-01	99.42	53,000.00	5,269,260.00
112015481	20 民生银行 CD481	2021-07-01	99.16	516,000.00	51,166,560.00
112015495	20 民生银行 CD495	2021-07-01	99.80	500,000.00	49,900,000.00
112015520	20 民生银行 CD520	2021-07-01	99.70	500,000.00	49,850,000.00
112015533	20 民生银行 CD533	2021-07-01	99.61	276,000.00	27,492,360.00
112017178	20 光大银行 CD178	2021-07-01	99.71	500,000.00	49,855,000.00
112017263	20 光大银行 CD263	2021-07-01	99.83	2,500,000.00	249,575,000.00
112017275	20 光大银行 CD275	2021-07-01	99.76	500,000.00	49,880,000.00
112020181	20 广发银行 CD181	2021-07-01	99.89	281,000.00	28,069,090.00
112020199	20 广发银行 CD199	2021-07-01	99.83	328,000.00	32,744,240.00
112103013	21 农业银行 CD013	2021-07-01	98.17	478,000.00	46,925,260.00
112106008	21 交通银行 CD008	2021-07-01	98.43	3,000,000.00	295,290,000.00
112106143	21 交通银行 CD143	2021-07-01	99.71	10,000,000.00	997,100,000.00
112109020	21 浦发银行	2021-07-01	98.41	1,500,000.00	147,615,000.00

	CD020				
112116050	21 上海银行 CD050	2021-07-01	99.20	2,689,000.00	266,748,800.00
112116053	21 上海银行 CD053	2021-07-01	99.20	2,689,000.00	266,748,800.00
112117090	21 光大银行 CD090	2021-07-01	98.40	1,066,000.00	104,894,400.00
112180584	21 成都银行 CD124	2021-07-01	98.17	1,098,000.00	107,790,660.00
112181354	21 徽商银行 CD064	2021-07-01	98.91	1,123,000.00	111,075,930.00
112182938	21 长安银行 CD016	2021-07-01	99.39	2,000,000.00	198,780,000.00
200309	20 进出 09	2021-07-01	100.01	1,127,000.00	112,711,270.00
200314	20 进出 14	2021-07-01	100.15	1,200,000.00	120,180,000.00
2103673	21 进出 673	2021-07-01	99.90	1,000,000.00	99,900,000.00
2103676	21 进出 676	2021-07-01	99.71	500,000.00	49,855,000.00
2103677	21 进出 677	2021-07-01	99.68	2,000,000.00	199,360,000.00
112004095	20 中国银行 CD095	2021-07-02	99.75	369,000.00	36,807,750.00
112009446	20 浦发银行 CD446	2021-07-02	99.09	1,000,000.00	99,090,000.00
112015419	20 民生银行 CD419	2021-07-02	99.42	947,000.00	94,150,740.00
112015533	20 民生银行 CD533	2021-07-02	99.61	724,000.00	72,117,640.00
112017190	20 光大银行 CD190	2021-07-02	99.65	800,000.00	79,720,000.00
112104011	21 中国银行 CD011	2021-07-02	98.77	3,000,000.00	296,310,000.00
112105002	21 建设银行 CD002	2021-07-02	98.57	3,000,000.00	295,710,000.00
112110029	21 兴业银行 CD029	2021-07-02	99.11	2,000,000.00	198,220,000.00
112110161	21 兴业银行 CD161	2021-07-02	98.53	3,000,000.00	295,590,000.00
112194559	21 重庆银行 CD030	2021-07-02	99.44	1,506,000.00	149,756,640.00
140221	14 国开 21	2021-07-02	100.30	700,000.00	70,210,000.00
180212	18 国开 12	2021-07-02	100.27	1,200,000.00	120,324,000.00
180412	18 农发 12	2021-07-02	100.36	300,000.00	30,108,000.00
217705	21 贴现国开 05	2021-07-02	99.94	1,014,000.00	101,339,160.00
110241	11 国开 41	2021-07-07	100.08	1,500,000.00	150,120,000.00

180313	18 进出 13	2021-07-07	100.39	782,000.00	78,504,980.00
200216	20 国开 16	2021-07-07	100.13	1,300,000.00	130,169,000.00
合计				79,447,000.00	7,900,778,090.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2021 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日

A-1	809,915,413.25	30,001,385.26
A-1 以下	-	-
未评级	2,779,261,743.68	617,528,781.54
合计	3,589,177,156.93	647,530,166.80

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
A-1	18,650,425,007.26	3,765,524,887.44
A-1 以下	1,560,353,201.55	396,862,759.24
未评级	-	-
合计	20,210,778,208.81	4,162,387,646.68

注：1、短期同业存单评级取自第三方评级机构的发行主体信用评级。

2、短期同业存单 A-1 所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 的短期同业存单，短期同业存单 A-1 以下所填列的同业存单均为主体信用评级为 AAA 以下的短期同业存单。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	250,720,986.63	-
AAA 以下	-	-
未评级	461,081,603.66	300,893,918.29
合计	711,802,590.29	300,893,918.29

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券资产。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产:					
银行存款	13,365,850,560.34	-	-	-	13,365,850,560.34
结算备付金	3,112,273.67	-	-	-	3,112,273.67
存出保证金	3,872.21	-	-	-	3,872.21
交易性金融资产	24,511,757,956.03	-	-	-	24,511,757,956.03
买入返售金	5,031,296,106.92	-	-	-	5,031,296,106.92

融资产					
应收证券清算款	-	-	-	873,402,548.26	873,402,548.26
应收利息	-	-	-	132,733,809.00	132,733,809.00
应收申购款	-	-	-	852,103,298.79	852,103,298.79
资产总计	42,912,020,769.17	-	-	1,858,239,656.05	44,770,260,425.22
负债:					
卖出回购金融资产款	7,202,219,326.50	-	-	-	7,202,219,326.50
应付管理人报酬	-	-	-	5,309,449.57	5,309,449.57
应付托管费	-	-	-	1,769,816.55	1,769,816.55
应付销售服务费	-	-	-	1,003,946.12	1,003,946.12
应付交易费用	-	-	-	517,901.85	517,901.85
应交税费	-	-	-	80,728.68	80,728.68
应付利息	-	-	-	2,402,009.66	2,402,009.66
应付利润	-	-	-	2,519,264.46	2,519,264.46
其他负债	-	-	-	105,203.31	105,203.31
负债总计	7,202,219,326.50	-	-	13,708,320.20	7,215,927,646.70
利率敏感度缺口	35,709,801,442.67	-	-	1,844,531,335.85	37,554,332,778.52
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产:					
银行存款	3,266,486,306.28	-	-	-	3,266,486,306.28
结算备付金	952.38	-	-	-	952.38
交易性金融资产	5,110,811,731.77	-	-	-	5,110,811,731.77
买入返售金融资产	2,726,510,759.77	-	-	-	2,726,510,759.77
应收利息	-	-	-	25,356,452.84	25,356,452.84
应收申购款	-	-	-	195,571,336.46	195,571,336.46
资产总计	11,103,809,750.20	-	-	220,927,789.30	11,324,737,539.50
负债:					
卖出回购金融资产款	859,258,631.60	-	-	-	859,258,631.60

应付管理人报酬	-	-	-	2,591,362.22	2,591,362.22
应付托管费	-	-	-	795,126.30	795,126.30
应付销售服务费	-	-	-	576,202.47	576,202.47
应付交易费用	-	-	-	150,945.04	150,945.04
应交税费	-	-	-	49,245.34	49,245.34
应付利息	-	-	-	69,602.93	69,602.93
应付利润	-	-	-	876,952.76	876,952.76
其他负债	-	-	-	33,081,526.35	33,081,526.35
负债总计	859,258,631.60	-	-	38,190,963.41	897,449,595.01
利率敏感度缺口	10,244,551,118.60	-	-	182,736,825.89	10,427,287,944.49

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-16,093,541.27	-3,559,261.40
	市场利率下降 25 个基点	16,123,593.98	3,566,026.47

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇资产，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所及银行间同业市场交易的固定收益品种和债券回购产品，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险的敏感性分析

本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

（1）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

（2）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层次的余额为人民币 24,511,757,956.03 元，无属于第一层次和第三层次的金额（2020 年 12 月 31 日：属于第二层次的余额为人民币 5,110,811,731.77 元，无属于第一层次和第三层次的金额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	24,511,757,956.03	54.75
	其中：债券	24,511,757,956.03	54.75
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,031,296,106.92	11.24
	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	13,368,962,834.01	29.86
4	其他各项资产	1,858,243,528.26	4.15
5	合计	44,770,260,425.22	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

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余额	10.59	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	7,202,219,326.50	19.18
	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

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。

7.3.2 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	27.69	19.18
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	18.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

3	60 天（含）—90 天	21.23	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	15.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	33.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		116.59	19.18

7.4 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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,870,030.99	0.13
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,091,290,839.88	5.57
	其中：政策性金融债	1,890,609,390.37	5.03
4	企业债券	129,992,454.02	0.35
5	企业短期融资券	1,979,786,885.21	5.27
6	中期票据	50,039,537.12	0.13
7	同业存单	20,210,778,208.81	53.82
8	其他	-	-
9	合计	24,511,757,956.03	65.27
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	112106143	21 交通银行 CD143	10,000,000.00	997,086,545.00	2.66
2	112198600	21 宁波银行 CD099	8,000,000.00	793,136,537.85	2.11
3	200309	20 进出 09	5,900,000.00	590,050,787.62	1.57
4	112181372	21 重庆农村商行 CD130	5,000,000.00	494,568,895.73	1.32
5	112121252	21 渤海银行 CD252	4,300,000.00	427,291,277.38	1.14
6	112113095	21 浙商银行 CD095	4,000,000.00	399,127,465.06	1.06
7	112181205	21 厦门银行 CD121	3,000,000.00	298,788,698.33	0.80
8	112121066	21 渤海银行 CD066	3,000,000.00	298,637,668.17	0.80
9	112193443	21 齐鲁银行 CD012	3,000,000.00	298,609,934.51	0.80
10	112194559	21 重庆银行 CD030	3,000,000.00	298,319,994.93	0.79

7.7 “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
报告期内偏离度的最高值	0.0841%
报告期内偏离度的最低值	-0.0185%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0354%

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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，渤海银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、厦门银行股份有限公司、浙商银行股份有限公司、重庆农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,872.21
2	应收证券清算款	873,402,548.26
3	应收利息	132,733,809.00
4	应收申购款	852,103,298.79
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,858,243,528.26

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发货币 A	222,608	14,767.81	584,431,596.18	17.78%	2,703,001,650.38	82.22%

广发货币 B	426	80,407,348.71	33,811,594,564.68	98.71%	441,935,986.49	1.29%
广发货币 C	5	1,116.16	0.00	0.00%	5,580.79	100.00%
广发货币 E	179	74,655.87	2,400.00	0.02%	13,361,000.00	99.98%
合计	223,218	168,240.61	34,396,028,560.86	91.59%	3,158,304,217.66	8.41%

8.2 期末上市基金前十名持有人

广发货币 E

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	李艳霞	23,453.00	17.55%
2	陈瑞兰	10,631.00	7.96%
3	林慧明	9,358.00	7.00%
4	吴建良	6,742.00	5.05%
5	黄瑞然	6,647.00	4.97%
6	李慧玲	5,755.00	4.31%
7	黎运宁	3,443.00	2.58%
8	侯蔺斐	3,377.00	2.53%
9	王绍英	3,264.00	2.44%
10	石峰	3,006.00	2.25%

注：本表统计的上市基金前十名持有人为场内 E 份额持有人,所列 E 类份额面值为 100 元。

8.3 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	2,011,953,783.28	5.36%
2	银行类机构	1,510,928,750.25	4.02%
3	基金类机构	1,395,308,081.74	3.72%
4	银行类机构	1,308,266,156.21	3.48%
5	信托类机构	1,103,767,438.34	2.94%
6	银行类机构	1,025,985,132.07	2.73%
7	银行类机构	906,542,729.48	2.41%
8	其他机构	800,918,142.12	2.13%
9	银行类机构	800,670,393.04	2.13%
10	银行类机构	800,000,000.00	2.13%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发货币 A	1,811,629.93	0.0551%
	广发货币 B	0.00	0.0000%
	广发货币 C	0.01	0.0002%
	广发货币 E	0.00	0.0000%
	合计	1,811,629.94	0.0048%

8.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发货币 A	10~50
	广发货币 B	0
	广发货币 C	0
	广发货币 E	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	广发货币 A	0
	广发货币 B	0
	广发货币 C	0
	广发货币 E	0
	合计	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发货币 A	广发货币 B	广发货币 C	广发货币 E
基金合同生效日（2005 年 5 月 20 日）基金份额总额	2,636,630,865.77	-	-	-
本报告期期初基金份额总额	2,574,249,284.66	7,844,238,746.30	5,513.53	8,794,400.00
本报告期基金总申购份额	7,257,443,103.24	56,467,507,529.01	67.26	9,603,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,544,259,141.34	30,058,215,724.14	-	5,034,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,287,433,246.56	34,253,530,551.17	5,580.79	13,363,400.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

中国工商银行股份有限公司根据工作需要，任命刘彤女士担任资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任资产托管部总经理职务。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

（1）财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；

（2）经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；

（3）具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

（4）具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

（5）能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

（6）能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

（1）对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

（2）协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	79,986,652.05	100.00%	5,994,000,000.00	100.00%	-	-

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-04
2	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-18
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
4	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-02-01
5	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-02-10
6	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投	中国证监会规定报刊及网站	2021-02-22

	资）业务的公告		
7	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-08
8	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-22
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
10	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-02
11	关于旗下部分基金继续暂停申购等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-16
12	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21
13	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-30
14	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-17
15	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-05-31
16	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-11
17	关于广发货币市场基金 C 类基金份额继续暂停申购（包含转换转入、定期定额及不定额投资）业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-25

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发货币市场基金募集的文件
2. 《广发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

11.2 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

11.3 查阅方式

1.书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，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

二〇二一年八月三十日