广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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

报告送出日期：二〇二六年十月二十七日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 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 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发现金宝场内货币
基金主代码	519858
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 12 月 2 日
报告期末基金份额总额	81,226,914.80 份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、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

	投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。	
业绩比较基准	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，长期风险收益水平低于股票型基金、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	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发现金宝场内货币 A	广发现金宝场内货币 B
下属分级基金的交易代码	519858	519859
报告期末下属分级基金的份额总额	71,239,109.93 份	9,987,804.87 份

注：广发现金宝场内货币的基金份额面值为 0.01 元，本报告中所列份额数据面值已折算为 1 元。

§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(2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日)	
	广发现金宝场内货币 A	广发现金宝场内货币 B
1.本期已实现收益	67,430.18	17,839.77
2.本期利润	67,430.18	17,839.77
3.期末基金资产净值	71,239,109.93	9,987,804.87

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期

公允价值变动收益，由于本基金采用实际利率法计算账面价值并用影子定价和偏离度加以控制的模式核算，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 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、广发现金宝场内货币 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	0.0903%	0.0001%	0.0882%	0.0000%	0.0021%	0.0001%
过去六个月	0.1885%	0.0001%	0.1755%	0.0000%	0.0130%	0.0001%
过去一年	0.4506%	0.0003%	0.3524%	0.0000%	0.0982%	0.0003%
过去三年	2.4288%	0.0011%	1.0631%	0.0000%	1.3657%	0.0011%
过去五年	5.1288%	0.0014%	1.7729%	0.0000%	3.3559%	0.0014%
过去七年	8.6711%	0.0016%	2.4836%	0.0000%	6.1875%	0.0016%
过去十年	18.4906%	0.0029%	3.5481%	0.0000%	14.9425%	0.0029%
自基金合同生效起至今	30.7094%	0.0053%	4.5534%	0.0000%	26.1560%	0.0053%

2、广发现金宝场内货币 B:

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	0.2444%	0.0001%	0.0882%	0.0000%	0.1562%	0.0001%
过去六个月	0.4956%	0.0001%	0.1755%	0.0000%	0.3201%	0.0001%
过去一年	1.0657%	0.0003%	0.3524%	0.0000%	0.7133%	0.0003%
过去三年	4.3217%	0.0011%	1.0631%	0.0000%	3.2586%	0.0011%
过去五年	8.3863%	0.0014%	1.7729%	0.0000%	6.6134%	0.0014%
过去七年	13.4152%	0.0016%	2.4836%	0.0000%	10.9316%	0.0016%
过去十年	25.9480%	0.0029%	3.5481%	0.0000%	22.3999%	0.0029%
自基金合同生效起至今	41.3655%	0.0053%	4.5534%	0.0000%	36.8121%	0.0053%

注： 本基金收益分配按日结转份额。

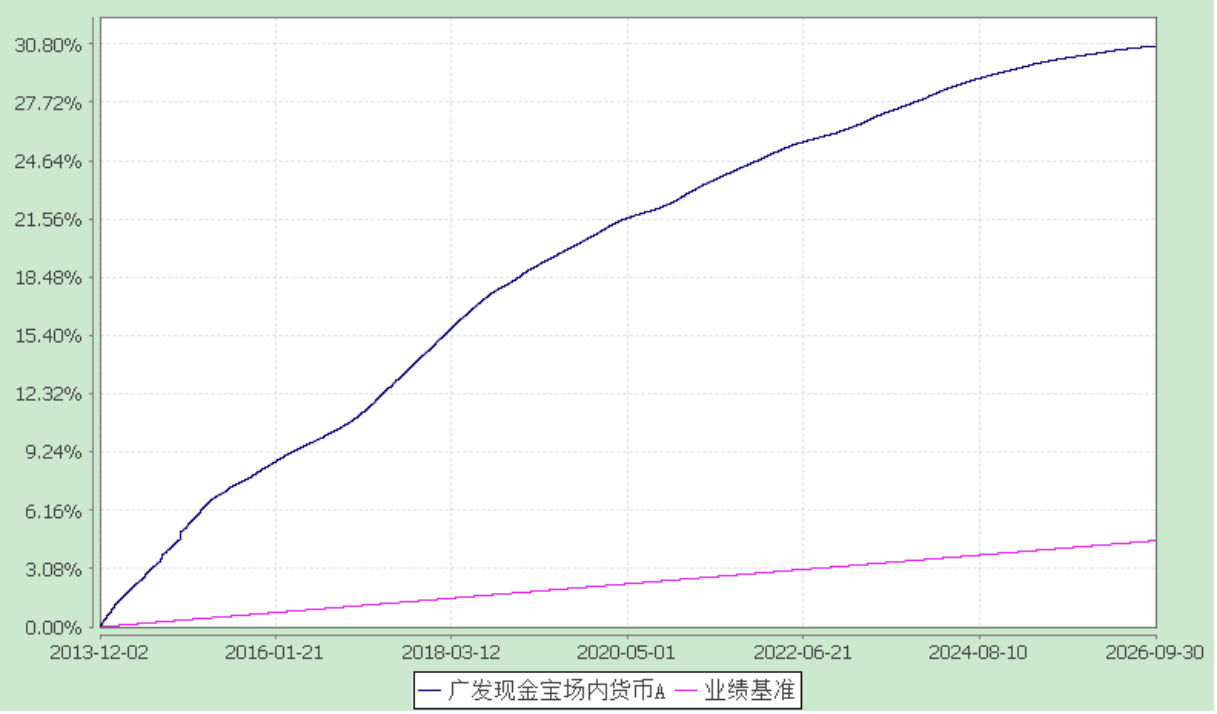
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发现金宝场内实时申赎货币市场基金

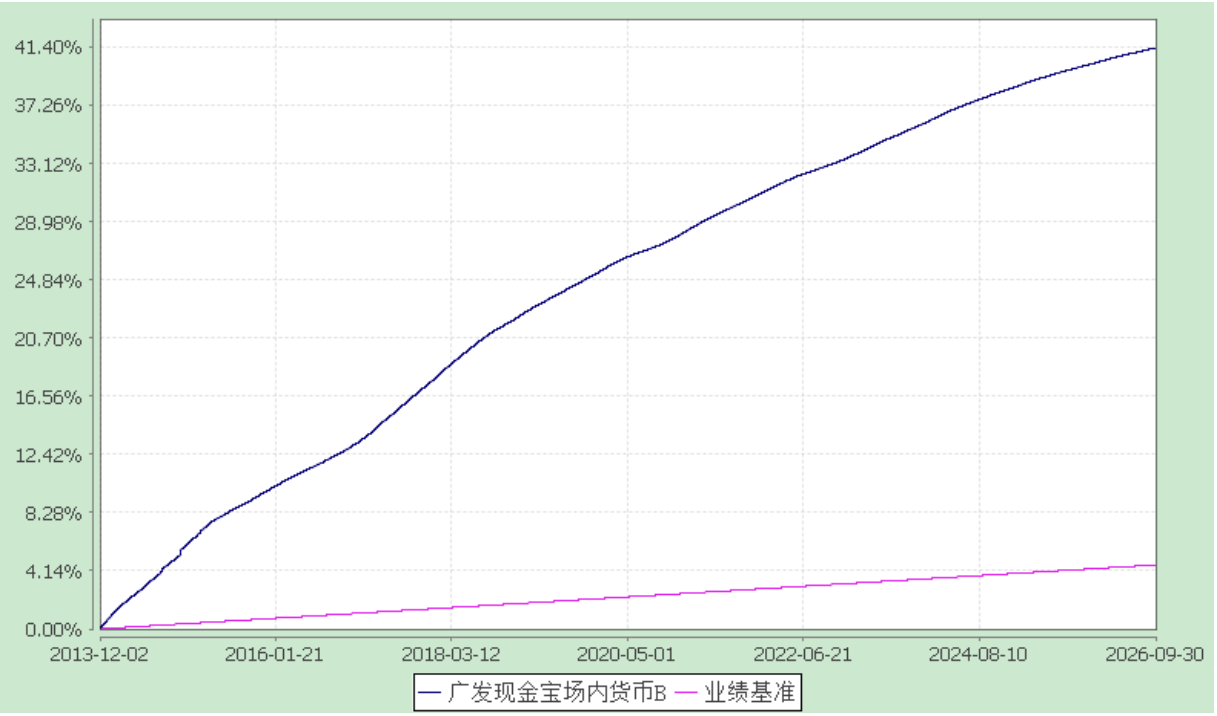
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 12 月 2 日至 2026 年 9 月 30 日)

1、广发现金宝场内货币 A：



2、广发现金宝场内货币 B：



§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		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；广发中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金的基金经理；广发现金增利货	2013-12-02	-	26.3 年	温秀娟女士，中国籍，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

	币市场基金的基金经理；公司总经理助理、固定收益投资总监、现金指数投资部总经理				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)、广发中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金基金经理(自 2023 年 12 月 12 日至 2024 年 12 月 30 日)。
曾雪兰	本基金的基金经理；广发景荣纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发天天利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；广发中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金的基金经理；广发钱袋子货币市场基金的基金经理	2016-07-22	-	16.2 年	曾雪兰女士，中国籍，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、债券研究员、基金经理助理、广发集安债券型证券投资基金基金经理(自 2017 年 2 月 6 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发理财 30 天债券型证券投资基金基金经理(自 2016 年 7 月 22 日至 2020 年 9 月 24 日)。

注：1.对基金的首任基金经理，“任职日期”为基金合同生效日/转型生效日，“离任日期”为公司公告解聘日期。对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指公司公告聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

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》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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，通过持续完善工作制度、流程和提高技术手段保证公平交易原则的实现。同时，公司还通过事后分析、监察稽核和信息披露等手段加强对公平交易过程和结果的监督。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，按照“时间优先、价格优先、比例分配、平等对待”的原则，公平分配投资指令。公司对投资交易实施全程动态监控，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；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 29 次，其中 27 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 2 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，流动性整体均衡宽松，资金面平稳，资金中枢较 6 月略有下移。7 月全月净投放约 6000 亿，月末继续开展隔夜逆回购操作。央行呵护流动性的基调不变，资金状态或处于合意区间，围绕政策利率窄幅波动。7 月下旬，MLF 增量续作，政治局会议释放偏宽松的信号。8 月资金面较 7 月略微宽松，央行首次在税期也开展了隔夜逆回购操作，月中和月末资金都呈现平稳状态，存单供需两旺，大行对季末存款做了一些前置准备。9 月进入季末月，中旬资金面略微收紧但整体依然平稳，波幅较小，下旬央行投放充足隔夜和跨月资金，削峰填谷，短端资产波动较小。

报告期内，组合根据场内流动性情况，灵活调整持仓，合理安排流动性。

展望 2026 年四季度，资金面有望继续保持均衡宽松，预计资金价格将继续围绕政策利率窄幅波动。

4.5 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 0.0903%，B 类基金份额净值收益率为 0.2444%，同期业绩比较基准收益率为 0.0882%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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	40,020,648.19	49.08
	其中：债券	40,020,648.19	49.08
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	29,703,950.05	36.42
	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	11,633,857.73	14.27
4	其他资产	190,028.54	0.23
5	合计	81,548,484.51	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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，本报告期本基金未开展债券回购融资业务。

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	37
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	37

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	75.55	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	12.27	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的	-	-

	浮动利率债		
5	120天（含）—397天（含）	12.24	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		100.06	-

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	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	20,112,220.92	24.76
	其中：政策性金融债	20,112,220.92	24.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	19,908,427.27	24.51
8	其他	-	-
9	合计	40,020,648.19	49.27
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

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)	公允价值（元）	占基金资产净值比

					例（%）
1	240214.IB	24 国开 14	200,000.00	20,112,220.92	24.76
2	112697486.IB	26 宁波银行 CD211	100,000.00	9,966,433.42	12.27
3	112608140.IB	26 中信银行 CD140	100,000.00	9,941,993.85	12.24

5.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0121%
报告期内偏离度的最低值	-0.0021%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0042%

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

本基金按照实际利率法计算金融资产的账面价值，并使用影子定价和偏离度加以控制。

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁波银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行分支行的处罚。中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,176.54
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	176,852.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	190,028.54

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发现金宝场内货币A	广发现金宝场内货币B
报告期期初基金份额总额	73,991,896.01	6,560,300.88
报告期期间基金总申购份额	57,143,927.15	6,557,986.70
报告期期间基金总赎回份额	59,896,713.23	3,130,482.71
报告期期末基金份额总额	71,239,109.93	9,987,804.87

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

本基金本报告期无需要披露的单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发现金宝场内实时申赎货币市场基金募集的文件

2.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金合同》

3.《广发现金宝场内实时申赎货币市场基金托管协议》

4.法律意见书

5.基金管理人业务资格批件、营业执照

6.基金托管人业务资格批件、营业执照

9.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道 168 号星河湾中心 28-38 层；广东省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：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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日