广发天天红发起式货币市场基金招募说明书【更新】摘要

[2014年第1号]

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
时间:二〇一四年五月

【重要提示】

本基金于2013年10月10日经中国证监会证监许可[2013]1287号文核准。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。

本基金为货币市场基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书及基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2014年4月22日,有关财务数据和净值表现截止日为2014年3月31日(财务数据未经审计)。

第一部分 基金管理人

一、概况

1、名称:广发基金管理有限公司
2、住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
3、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
4、法定代表人:王志伟
5、设立时间:2003年8月5日
6、电话:020-83936666
全国统一客服热线:95105828
7、联系人:段西军
8、注册资本:1.2亿元人民币

9、股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司,分别持有本基金管理人48.33%、16.67%、16.67%、10%和8.33%的股权。

二、主要人员情况

1、董事会成员

王志伟:董事长,男,经济学硕士,高级经济师。兼任中国基金业协会公司治理专业委员会委员,广东省第十届政协委员,广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员,广东金融学会常务理事,江西财经大学客座教授。历任广发证券董事长兼党委书记、广东发展银行党组成员兼副行长,广东发展银行行长助理,广东发展银行信托投资部总经理,广东发展银行人事教育部经理,广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

林传辉:副董事长,男,大学本科学历,现任广发基金管理有限公司总经理,兼任广发国际资产管理有限公司董事长、瑞元资本管理有限公司董事长,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

孙晓燕:董事,女,硕士,现任广发证券副总裁、财务总监,兼任广发控股(香港)有限公司董事。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、投资自营部副总经理、广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

戈俊:董事,男,管理学硕士,高级经济师,现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书,兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火藤仓光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火藤仓光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏征信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都大唐线缆有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司等公司董事;兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、藤仓烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部总经理。

翟美卿:董事,女,工商管理硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人,香江集团有限公司总裁,深圳市金海马实业股份有限公司董事长,深圳香江控股股份有限公司董事长。兼任全国政协委员、全国妇联常委、中国产业发展促进会副会长、广东省工商联副主席、广东省女企业家协会会长、深圳市政协常委,香江社会救助基金会主席,深圳市深商控股集团股份有限公司董事,广东南粤银行董事,深圳龙岗国安村镇银行董事,广发证券股份有限公司监事,广发银行股份有限公司第五届监事会监事。

许冬瑾:董事,女,工商管理硕士,主管药师,现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理,兼任中国中药协会中药饮片专业委员会专家、全国中药标准化技术委员会委员、全国制药装备标准化技术委员会中药炮制机械分技术委员会副主任委员、国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中药炮制与配置工专业专家委员会副主任委员、广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂云:独立董事,男,法学博士,教授,博士生导师,现任复旦大学教授,兼任宁波大学特聘教授,上海四维乐马律师事务所兼职律师,绍兴银行独立董事。曾任复旦大学法律系副主任,复旦大学法学院副院长。

姚海鑫:独立董事,男,经济学博士、教授、博士生导师,本人现任辽宁大学新华国际商学院教授、党总支书记,兼任东北制药(集团)股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、工商管理硕士(MBA)教育中心副主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长。

罗海平:独立董事,男,经济学博士,现任中华联合保险控股股份有限公司常务副总裁,兼任中华联合财产保险股份有限公司总裁(法人代表)。曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理、中国人民保险公司湖北省分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理、中国人民保险公司汉口分公司总经理,太平保险湖北分公司总经理,太平保险公司总经理助理,太平保险公司副总经理兼纪委书记,民安保险(中国)有限公司副总裁,阳光财产保险股份有限公司总裁,阳光保险集团执行委员会委员。

2、监事会成员

余利平:监事会主席,女,经济学博士,兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理、董事长。

匡丽军:监事,女,工商管理硕士,高级涉外秘书,现任广州科技风险投资有限公司工会主席、董事会秘书、办公室主任,兼任广州市科达实业发展公司总经理。曾任广州实达实业发展公司办公室主任、广州屈臣氏公司行政主管。

吴晓辉:监事,男,工学硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分工会主席。曾任广发证券电脑中心员工,副经理,经理。

3、总经理及其他高级管理人员

林传辉:总经理,男,大学本科学历,兼任广发国际资产管理有限公司董事长、瑞元资本管理有限公司董事长,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

肖雯:副总经理,女,企业管理硕士,高级经济师,兼任广发基金管理有限公司互联网金融部总经理,中国基金业协会产品与销售委员会副主任委员。曾任珠海国际信托投资公司助理总经理、广发证券电子商务部副总经理、广发证券经纪业务总部副总经理。

朱平:副总经理,男,硕士,经济师,兼任广发基金管理有限公司量化投资部总经理,中国证券监督管理委员会第五届创业板发行审核委员会兼职委员。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理、基金科汇基金经理、易方达基金管理有限公司投资部研究负责人、广发基金管理有限公司总经理助理。

易阳方:副总经理,男,经济学硕士,经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监,广发聚丰股票型证券投资基金基金经理,广发国际资产管理有限公司董事、瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券投资自营部副经理,中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员,广发基金管理有限公司投资管理部总经理,广发基金管理有限公司总经理助理,广发制造业精选股票基金基金经理。

段西军:督察长,男,博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

陈伯军:副总经理,男,经济学博士,兼任瑞元资本管理有限公司董事,全国金融系统青年联合会第二届委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投行高级经理,广发基金管理有限公司中央交易室主管、上海分公司副总经理、市场拓展部总经理、市场总监、总经理助理。

邱春杨:副总经理,男,经济学博士,兼任广发基金管理有限公司金融工程部总经理,瑞元资本管理有限公司董事。曾任原南方证券资产管理部产品设计人员,广发基金管理有限公司机构理财部副总经理、金融工程部副总经理、产品总监。

4、基金经理

谭昌杰,男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,5年证券从业经历,2008年7月至2012年7月在广发基金管理有限公司固定收益部任研究员,2012年7月19日起任广发年年红债券基金基金经理,2012年9月20日起任广发双债添利债券型证券投资基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月10日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发集鑫债券型证券投资基金和广发天天利货币市场基金的基金经理。

任爽,女,中国籍,经济学硕士,持有证券业执业证书,5年基金从业经历,2008年7月至今在广发基金管理有限公司固定收益部兼任交易员和研究员,2012年12月12日起任广发纯债债券基金的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券型证券投资基金的基金经理,2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理,2014年1月27日起任广发天天利货币市场基金的基金经理。

5、本基金投资采取集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:

主席:公司总经理林传辉;成员:公司副总经理朱平,公司副总经理易阳方,投资总监、权益投资一部总经理陈仕德,研究发展部总经理许雪梅,固定收益部总经理张芊。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称:广发银行股份有限公司
注册地址:广州市东风东路713号
办公地址:广州市东风东路713 号
法定代表人:董建岳
设立日期:1988 年7 月8 日
批准设立机关和批准设立文号:中国人民银行银复[1988]292号
组织形式:股份有限公司
注册资本:154 亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监许可[2009]363 号
联系人:李春磊
联系电话:010-65169830
传真:010-65169555

广发银行股份有限公司成立于1988 年,是国务院和中国人民银行批准成立的我国首批股份制商业银行之一,总部设于广东省广州市,注册资本154 亿元。二十多年来,广发银行栉风沐雨,艰苦创业,以自己不断壮大的发展历程,见证了中国经济腾飞和金融体制改革的每一个脚印。

2006 年,广发银行成功重组,引入了花旗集团、中国人寿、国家电网、中信信托等世界一流的知名企业作为战略投资者。重组后,广发银行紧紧围绕"建设一流商业银行"的战略目标,注重战略规划的执行,坚持"调结构、打基础、抓创新、促发展",强化风险控制,坚持又好又快可持续发展,取得了良好的经营业绩。截至2013年12月31日,广发银行资本净额732.91亿元,资产总额14698.50亿元,本外币各项存款余额9949.27亿元,各项贷款余额7147.11亿元。。根据英国《银行家》杂志对全球1000家大银行排定的位次,广发银行已连续多年入选全球银行500强。

二、基金托管部门及主要人员情况

广发银行股份有限公司总行设资产托管部,是从事资产托管业务的职能部门,内设业务运行处、监控管理处、产品营销处和期货业务处,部门全体人员均具备本科以上学历和基金从业资格,部门经理以上人员均具备研究生以上学历。

总经理寻卫国先生具有超过十二年的银行从业经历,先后在中国工商银行和广发银行工作,熟悉我国监管制度和相关行业准则,确保托管业务安全稳健运行。2014年5月,经中国证监会核准资格,任广发银行资产托管部总经理职务。

三、证券投资基金托管情况

广发银行股份有限公司于2009年5月4日获得中国证监会、银监会核准开办证券投资基金托管业务,基金托管业务批准文号:证监许可[2009]363号。截至2012年12月,托管资产规模超1000亿元。建立了一只优秀、专业的托管业务团队,保证了托管服务水准在行业的领先地位。建立了完善的产品线,产品涵盖证券投资基金、基金公司客户特定资产管理计划、证券公司客户资产管理计划、保险资金托管、股权投资基金、产业基金、信托计划、银行理财产品、交易资金托管、专项资金托管、中介资金托管等,能为托管产品托管全面的托管服务。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、广发基金管理有限公司直销中心
地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场东裙楼4楼
直销中心电话:020-89899073 020-89899042
传真:020-89899069 020-89899070
网址: www.gffunds.com.cn

2、广发基金管理有限公司网上直销系统(网址:www.gffunds.com.cn)

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并及时公告。

二、注册登记人

名称:广发基金管理有限公司
住所:广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
法定代表人:王志伟
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
电话:020-89899129
传真:020-89899175
联系人:李尔华

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:国浩律师(广州)事务所
住所: 广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
负责人:程秉
电话:020-38799345
传真: 020-38799335
经办律师:黄贞 王志宏
联系人:程秉

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表:卢伯卿
联系人:黄晓霞
电话:021-61418888
传真:021-63350003
经办注册会计师:黄晓霞、余志亮

第四部分 基金的名称

广发天天红发起式货币市场基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式基金

第六部分 基金的投资目标

在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。

第七部分 基金的投资方向

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具,具体如下:

1、现金;
2、通知存款;
3、短期融资券(包括超级短期融资券);
4、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;
5、期限在1年以内(含1年)的债券回购;
6、剩余期限在397天以内(含397天)的债券;
7、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;
8、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据;
9、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据(以下简称"央行票据");
10、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

第八部分 基金的投资策略

一 、基金的投资策略

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。

(一)利率预期策略

影响利率走势的因素很多,影响短期利率变动的因素更多,运行方式也更为复杂。基金管理人将重点考察以下两个因素:

1、中央银行、财政部等国家宏观经济管理部门的政策意图。政府对金融市场运行的影响非常深远。国家宏观经济管理部门尤其是中央银行对经济运行形势的判断及采取的应对政策是影响市场利率走势的关键因素之一。

2、短期资金供求变化。短期资金市场参与者的头寸宽紧程度是短期利率变动的重要主导力量。短期利率随短期资金供求变化呈一定的季节波动形态。

具体而言,本基金管理人将持续跟踪反映国民经济变化的宏观经济指标,对国家经济政策进行深入分析,进而对短期利率的变化态势做出及时反应。重点关注的宏观经济指标包括:国家经济管理部门政策、预期物价指数、相关市场资金供求关系等等。

在分析方法上,本基金管理人坚持定性与定量相结合的分析方法。

(二)期限配置策略

在短期利率期限结构分析的基础上,根据对投资对象流动性和收益性的动态考察,构建合理期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看,一般说来,预期利率上涨时,将适当缩短组合的平均期限;预期利率下降时,将在法律法规允许的范围内适当延长组合的平均剩余期限。

(三)品种配置策略

在短期利率期限结构分析和品种深入分析的基础上,进行品种合理配置。当预期利率上涨时,可以增加回购资产的比重,适度降低债券资产的比重;预期利率下降,将降低回购资产的比重,增加债券资产的比重。

(四)银行定期存款及大额存单投资策略

银行定期存款及大额存单是本基金的主要投资对象,因此,银行定期存款及大额存单的投资将是本基金关注的重点之一。具体而言,在组合投资过程中,本基金将在综合考虑成本收益的基础上,尽可能的扩大交易对手方的覆盖范围,通过对这些银行广泛、耐心而细致的询价,挖掘出利率报价较高的多家银行进行银行定期存款及大额存单的投资,在获取较高投资收益的同时尽量分散投资风险,提高存款及存单资产的流动性。

(五)套利策略

在久期控制的基础上,本基金管理人将对货币市场的各个细分市场进行深入研究分析,在严格控制风险和保障流动性的前提下,寻找跨市场、跨期限、跨品种的套利投资机会,以期获得更高的收益。当然,由于交易机制的限制,目前挖掘套利投资机会的投资方法主要是用风险相当,但收益更高的品种替代收益较低的品种,或者用收益相当,风险较低的品种替代风险较高的品种。

(六)流动性管理策略

流动性好是货币市场基金的重要特征之一。在日常的投资管理过程中,本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响货币市场基金流动性管理的因素,建立组合流动性监控管理指标,实现对基金资产流动性的实时管理。

具体而言,本基金将综合平衡基金资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例,通过现金留存、银行定期存款提前支取、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高基金资产整体的流动性,也可采用持续滚动投资方法,将回购或债券的到期日进行均衡等量配置,以满足日常的基金资产变现需求。

二 、投资决策依据和投资程序

(一)投资决策依据

1、国家有关法律、法规和基金合同的有关规定。
2、宏观经济发展趋势、微观经济运行趋势和证券市场走势。

(二)投资决策程序

1、投资决策委员会制定整体投资战略。

2、固定收益部研究员根据自身或者其他研究机构的研究成果,形成利率走势预测、券种配置建议等,为债券决策提供支持。

3、固定收益基金经理小组根据投资决策委员会的投资战略,结合研究员的研究报告,拟订所辖基金的具体投资计划,包括:资产配置、目标久期、期限结构、个券选择等投资方案。

4、投资决策委员会对固定收益基金经理小组提交的方案进行论证分析,并形成决策纪要。

5、根据决策纪要,固定收益基金经理小组构造具体的投资组合及操作方案,交由中央交易部执行。

6、中央交易部按有关交易规则执行,并将有关信息反馈至基金经理小组。

7、基金绩效评估与风险管理小组重点控制基金投资组合的市场风险和流动性风险,定期进行基金绩效评估,并向投资决策委员会提交综合评估意见和改进方案。

第九部分 基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

本基金定位为现金管理工具,注重基金资产的流动性和安全性,因此采用活期存款利率(税后)作为业绩比较基准。活期存款利率由中国人民银行公布,如果活期存款利率或利息税发生调整,则新的业绩比较基准将从调整当日起开始生效。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 基金的投资组合报告

本基金管理人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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人广发银行根据本基金合同规定,于2014年5月14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。

本投资组合报告所载数据截至2014年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

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	1,449,719,353.48	23.22
	其中:债券	1,449,719,353.48	23.22
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	198,800,698.20	3.18
	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	4,566,282,844.06	73.13
4	其他各项资产	29,563,712.49	0.47
5	合计	6,244,366,608.23	100.00

2 报告期债券回购融资情况

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余额	0.58	
	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	256,049,349.97	4.28
	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%。

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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	119
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	122
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	29

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限	原因	调整期
1	2014-03-27	121	赎回	将在10个工作日内调整
2	2014-03-28	122	赎回	将在10个工作日内调整
3	2014-03-28	121	赎回	将在10个工作日内调整

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	42.09	4.28
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	5.01	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	6.79	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	31.25	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	18.72	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.85	4.28

4 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	150,007,655.98	2.51
	其中:政策性金融债	150,007,655.98	2.51
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,299,711,697.50	21.72
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,449,719,353.48	24.23
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140204	14国开04	800,000.00	80,069,638.22	1.34
2	071417001	14东北证券CP001	800,000.00	79,988,861.01	1.34
3	011416001	14华电股SCP001	800,000.00	79,894,002.91	1.34
4	140317	14进出17	700,000.00	69,938,017.76	1.17
5	041459007	14国电集CP001	600,000.00	60,078,752.78	1.00
6	041452007	14联合水泥CP001	600,000.00	60,000,139.02	1.00
7	071418002	14西南证券CP002	500,000.00	50,032,304.57	0.84
8	041469009	14京机电CP001	500,000.00	50,000,139.44	0.84
9	041451004	14粤温氏CP001	500,000.00	50,000,130.88	0.84
10	071418003	14西南证券CP003	500,000.00	49,991,853.59	0.84

6"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次
报告期内偏离度的最高值	0.0238%
报告期内偏离度的最低值	0.0002%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0092%

7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。

8 投资组合报告附注

8.1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。

8.2本报告期内本基金持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券,但不存在该类浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

8.3本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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。

8.4其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	29,563,712.49
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,563,712.49

第十二部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2014年3月31日。

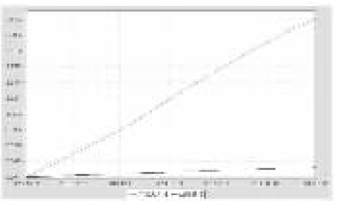
1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶 段	基金净值收益率(1)	基金净值收益率标准差(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)
2013.10.22-2013.12.31	1.1184%	0.0025%	0.0690%	0.0000%	1.0494%	0.0025%
2014.1.1-2014.3.31	1.5049%	0.0019%	0.0875%	0.0000%	1.4174%	0.0019%
2014.10.22-2014.3.31	2.6401%	0.0022%	0.1565%	0.0000%	2.4836%	0.0022%

注:(1)本基金利润分配按日结转份额。(2)本基金业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

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

广发天天红发起式货币市场基金
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10月22日至2014年3月31日)



注:1. 本基金合同生效日期为2013年10月22日,至披露时点本基金成立未满一年。

2. 本基金建仓期为基金合同生效后六个月,至披露时点本基金仍处于建仓期。

第十三部分 基金的费用

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、销售服务费;
4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
6、基金份额持有人大会费用;
7、基金的证券交易费用;
8、基金的银行汇划费用;
9、基金的授信费用(如有);
10、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.27%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.05%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为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金销售服务费

本基金的年销售服务费率为0.25%,计算公式如下:

H=E×0.25%÷当年天数
H为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费
E为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构,由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日支付。

上述"一、基金费用的种类中第4-9项费用",根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体上公告。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对《广发天天红发起式货币市场基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下:

1. 在"第三部分 基金管理人"部分,根据基金管理人的人员变动进行了更新。

2. 在"第四部分 基金托管人"部分,根据托管行人员变动情况和基金托管业务经营情况对托管人信息进行了相应更新。

3. 在"第五部分 相关服务机构"部分,增加了相关的代销机构,对原有销售机构的资料进行更新,相关事宜均已公告。

4. 在"第九部分 基金的投资"部分,更新了截至2014年3月31日的基金投资组合报告。

5. 在"第十部分 基金的业绩"部分,对截至2014年3月31日的基金业绩表现情况予以更新。

6. 根据最新公告对"第二十二部分 其他应披露的事项"进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一四年六月四日

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2014年6月4日

1.公告基本信息

基金名称	广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指可选消费ETF
基金主代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年6月3日
基金管理人名称	广发基金管理有限公司
基金托管人名称	中国银行股份有限公司
公告依据	《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

2.基金募集情况

基金募集申请获中国证监会核准的文号		证监许可[2013]1265号文
基金募集期间		自2014年5月5日 至2014年5月23日止
验资机构名称		德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
募集资金划入基金托管专户的日期		2014年5月28日
募集有效认购总户数(单位:户)		7,064
募集期间净认购金额(单位:人民币元)		838,115,352.50
认购资金在募集期间产生的利息(单位:人民币元)		40,743
募集份额(单位:份)	有效认购份额	838,115,351.00
	利息结转的份额	40,743
	合计	838,156,094.00
其中:募集期间基金管理人运用固有资金认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	-
	占基金总份额比例	-
	其他需要说明的事项	-
其中:募集期间基金管理人的从业人员认购本基金情况	认购的基金份额(单位:份)	-
	占基金总份额比例	-
募集期限届满基金是否符合法律法规规定的办理基金备案手续的条件		是
向中国证监会办理基金备案手续获得书面确认的日期		2014年6月3日

注:1、上述"募集期间净认购金额"包含所募集股票市值,因折算尾数差异直接归入基金资产的股票价值1.5元

2、本次基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费等费用由基金管理人承担,不从基金资产中支付。

3、本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0;该只基金的基金经理持有该只基金份额总量的数量区间为0。

3.其他需要提示的事项

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理申购,具体业务办理时间在申购开始公告中规定。

基金管理人自基金合同生效之日起不超过3个月开始办理赎回,具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。

本基金可在基金上市交易之前开始办理申购、赎回,但在基金申请上市期间,可暂停办理申购、赎回。

在确定申购开始与赎回开始时间后,基金管理人应在申购、赎回开放日前2日依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告申购与赎回的开始时间。

特此公告

广发基金管理有限公司
2014年6月4日

股票简称:深南电A、深南电B; 股票代码:000037、200037; 公告编号:2014-041

深圳南山热电股份有限公司重大事项继续停牌公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

深圳南山热电股份有限公司(以下简称"公司") 拟筹划非公开发行股票事宜, 该事项尚存在较大不确定性,为防止由此而引起的公司股价波动,公司股票已于2014年 1月9日开市起停牌。因相关方案仍在洽谈、筹划中,为保证公平信息披露,维护投资者利益,经申请,公司股票自2014年6月4日开市起继续停牌,待有关事项确定后公司将刊登相关公告并申请股票复牌。

敬请投资者关注公司后续发布的公告。

深圳南山热电股份有限公司
董 事 会
二〇一四年六月四日

证券代码: 000612 证券简称:焦作万方 公告编号:2014-035

焦作万方铝业股份有限公司关于重大资产重组停牌进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司于2014年5月27日发布了《焦作万方铝业股份有限公司董事会关于重大资产重组停牌公告》,公司正在筹划重大资产重组事项,公司股票自2014年5月27日开市起继续停牌。

目前,公司及有关各方正在积极推动本次重大资产重组事项的各项工作,公司董事会将在相关工作完成后召开会议,审议本次重大资产重组预案。根据深圳证券交易所的有关规定,本公司股票(股票简称"焦作万方",股票代码"000612")自2014年6月4日开市起继续停牌。

停牌期间,公司将根据事项进展情况,严格按照有关法律法规及规范性文件要求履行信息披露义务。公司将每五个交易日发布一次重大资产重组事项进展公告。待有关事项确定后公司将及时公告并复牌,敬请广大投资者关注。

特此公告。

焦作万方铝业股份有限公司
董 事 会
二〇一四年六月三日

证券代码:000933 证券简称:神火股份 公告编号:2014-031

河南神火煤电股份有限公司关于举行2013年度网上业绩说明会暨投资者网上集体接待日的公告

本公司及全体董事、监事、高级管理人员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

河南神火煤电股份有限公司2013年年度报告全文及摘要已于2014年3月28日在中国证券报、证券时报、证券日报、上海证券报和巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)披露。按照河南上市公司协会《关于举办河南上市公司2013年业绩说明会暨投资者网上集体接待日的通知》(豫上协字〔2014〕5号)要求,公司将于2014年6月5日(星期四)下午15:00-17:00举行2013年度业绩网上说明会暨投资者网上集体接待日活动,现将有关事项公告如下:

公司2013年度网上业绩说明会暨投资者网上集体接待日活动将通过深圳证券信息有限公司提供的网上平台采取网络远程的方式举行,投资者可登录河南上市公司投资者关系互动平台(http://irm.p5w.net/dqhd/henan/)参与公司本次活动。

公司出席本次活动的人员有:公司董事、总经理齐明胜先生;董事、总会计师石洪新先生;证券事务代表吴长伟先生。

欢迎广大投资者积极参与。

特此公告。

河南神火煤电股份有限公司董事会
二〇一四年六月四日

证券代码:600071 股票简称:凤凰光学 公告编号:临 2014-025

凤凰光学股份有限公司重大资产重组进展公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

目前,公司间接控股股东凤凰光学集团有限公司(简称"凤凰光学集团")、公司实际控制人江西省国资委正与中电海康集团有限公司论证、洽谈凤凰光学集团整体改制事项,由于本次凤凰光学集团改制事项会涉及公司重大资产重组相关事宜及导致公司实际控制人发生变更,方案的商讨、论证、完善还需一定的时间。鉴于该事项存在重大不确定性,为保证公平信息披露,避免造成公司股价异常波动,维护投资者利益,经公司向上海证券交易所申请,公司股票自2014年5月20日至2014年6月19日停牌。公司董事会承诺:截止2014年6月20日,公司如未能披露与中电海康集团有限公司重大资产重组预案,公司将终止重大资产重组事项并复牌。

停牌期间,公司将根据《上市公司重大资产重组管理办法》及上海证券交易所关于上市公司重大资产重组信息披露工作备忘录的有关规定,密切关注事项进展情况,及时履行信息披露义务,每五个交易日发布一次进展公告。

公司指定信息披露媒体为《中国证券报》、《上海证券报》和上海证券交易所网站(http://www.sse.com.cn),有关公司的信息均以在上述指定媒体刊登的信息为准。敬请广大投资者关注公司后续公告,注意投资风险。

特此公告。

凤凰光学股份有限公司
董事会
2014年6月4日

证券代码:000151 证券简称:中成股份 公告编号:2014-20

中成进出口股份有限公司重大合同进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

2013年3月5日本公司与埃塞俄比亚糖业公司签订了《埃塞俄比亚OMO-Kuraz2糖厂EPC建设项目合同》。合同标的为在交钥匙工程的基础上,为埃塞俄比亚糖业公司建设一座日处理12000吨甘蔗的糖厂及电站设施和部分农业灌溉基础设施,包括工程设计、货物制造与采购、建设和安装、试车和移交,合同固定总价341,176,471美元(详见公司已于2013年3月7日在《中国证券报》、《证券日报》、《证券时报》以及巨潮资讯网发布的公告)。

近日,公司收到埃塞俄比亚糖业公司支付的预付款。根据上述合同规定,合同执行条件已具备,埃塞俄比亚OMO-Kuraz2糖厂EPC建设项目开始实施。

特此公告。

中成进出口股份有限公司董事会
二〇一四年六月四日

公司简称:中水渔业 公司代码:000798 公告编号:2014-022

中水集团远洋股份有限公司董事会关于重大资产重组进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

中水集团远洋股份有限公司(以下简称"公司),因筹划重大资产重组事项,公司股票(证券简称:中水渔业,证券代码:000798)于 2014年3月31日开市起停牌;2014年4月25日发布了《关于筹划重大资产重组停牌期满申请继续停牌的公告》。停牌期间,公司按照《上市公司业务办理指南10号——重大资产重组》的有关规定已于公司2014年4月8日至2014年5月27日发布了《重大资产重组进展公告》。

自公司停牌以来, 公司控股股东中国农业发展集团有限公司及中介机构积极推动本次重大资产重组事项涉及的各项工作。截止本公告发布之日,公司本次重大资产重组具体方案正在商讨、论证中,尚存在不确定性,公司股票继续停牌。停牌期间,公司将根据资产重组事项的进展情况,及时履行信息披露义务,每五个交易日发布一次重大资产重组事项进展情况。

本公司筹划的重大资产重组事项, 尚存较大不确定性, 敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

中水集团远洋股份有限公司董事会
2014年06月04日

关于嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金延长募集时间的公告

嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证监会证监许可【2013】921号核准,本基金已于2014年5月19日开始募集,原定募集截止日为2014年6月6日。其中,网上现金认购的原定发售日期为2014年6月4日至2014年6月6日,通过发售代理机构进行网下现金认购和网下股票认购的原定发售日期为2014年5月19日至2014年6月6日。为充分满足投资者的投资需求,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》的有关规定,经本基金管理人嘉实基金管理有限公司(以下简称"本公司")与本基金托管人中国银行股份有限公司以及本基金销售代理机构协商,决定将本基金的募集期延长至2014年6月13日,并将网上现金认购的发售日期调整为2014年6月11日至2014年6月13日。

投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在本公司网站上的《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金合同》以及刊登在2014年5月16日《上海证券报》上的《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《嘉实中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告》。

投资者可通过本基金管理人网站(www.jsfund.cn)或客户服务电话400-600-8800咨询相关情况。

特此公告。

嘉实基金管理有限公司
2014年6月4日