广发天天红发起式货币市场基金

2014 年度报告摘要

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:二〇一五年三月三十日

§1 重要提示

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。本年度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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年3月24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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2014年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发天天红
基金主代码	000389
交易代码	000389
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2013年10月22日
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
报告期末基金份额总额	18,567,401,657.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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。
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。

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	广发银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	李春磊
	联系电话	020-83936666	010-65169830
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	lichunlei@cgbchina.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	400-830-8003
传真		020-89899158	010-65169555

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2014年	2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日	-
本期已实现收益	487,412,544.64	6,461,899.32	-
本期利润	487,412,544.64	6,461,899.32	-
本期净值收益率	5.0884%	1.1184%	-
3.1.2 期末数据和指标	2014年末	2013年末	2012年末
期末基金资产净值	18,567,401,657.19	2,175,459,202.13	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-

注:(1)所述基金财务指标不包括持有人认购和交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(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,由于货币市场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)本基金利润分配按日结转份额。

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

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
过去三个月	1.1418%	0.0031%	0.0894%	0.0000%	1.0524%	0.0031%
过去六个月	2.2777%	0.0025%	0.1789%	0.0000%	2.0988%	0.0025%
过去一年	5.0884%	0.0029%	0.3549%	0.0000%	4.7335%	0.0029%
自基金合同生效起至今	6.2637%	0.0030%	0.4239%	0.0000%	5.8398%	0.0030%

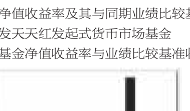
注:本基金业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

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12月31日)

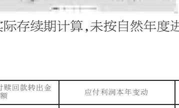


注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,至建仓期结束时各项资产配置比例均符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发天天红发起式货币市场基金

自基金合同生效以来基金净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图



注:基金合同生效当年(2013年)按实际存续期计算,未按自然年度进行折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2013年	6,056,621.50	-	405,277.82	6,461,899.32	-
2014年	485,524,277.07	-	1,888,267.57	487,412,544.64	-
合计	491,580,898.57	-	2,293,545.39	493,874,443.96	-

§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

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准,于2003年8月5日成立,注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、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。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和22个部门:综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、金融工程部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、国际业务部、营销服务部、互联网金融部(下辖深圳理财中心、杭州理财中心)、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。此外,还出资设立了广发国际资产管理有限公司(香港子公司)、瑞元资本管理有限公司。

截至2014年12月31日,本基金管理人管理五十七只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金(LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克100指数证券投资基金,广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财7天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发中债金融债指数证券投资基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币市场基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发季季利理财债券型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金和广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金,管理资产规模为1334.68亿元。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发理财年年红债券基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理;广发钱袋子货币基金的基金经理;广发聚鑫债券基金的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理;广发季季利债券基金的基金经理	2013-10-22	-	6.5年	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,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日起任广发理财年年红债券基金的基金经理,2012年9月20日起任广发双债添利债券基金的基金经理,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日起任广发聚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,2014年9月29日起任广发季季利债券基金的基金经理。
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理;广发钱袋子货币市场基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理	2013-10-22	-	6.5年	女,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,2008年7月至2012年12月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,2014年5月30日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理,2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理。

注:(1)基金经理的"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》及其配套法规、《广发天天红发起式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求最大利益,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公平交易制度和控制方法

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,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在投资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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同时同向交易,公司可以启用公平交易模块,确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则;对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息,对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释;公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析,未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况,表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3异常交易行为的专项说明

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。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价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5%的情况。

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

2014年主要经济指标震荡下行,除了2季度受政府主导的一些宏观指标(比如基建投资、货币增速等)出现反弹外,其他指标比如全年房地产和制造业投资同比增速均持续下滑。净出口增速在2-3季度有所好转,但4季度重新陷入下滑。政策方面,上半年财政和货币政策相对积极,中央支持的基建投资维持在20%的增幅;资金利率持续下降,但4季度开始,资金面维持紧平衡状态。整体来看,1季度经济下滑严重,2季度通过政策的不断宽松避免了失速风险,经济指标阶段性回暖,但3、4季度经济继续下滑。由于全年就业形势不差,政策面维持定向微刺激。

货币市场全年呈现V型走势,前十个月资金利率震荡下行,带动短融收益率持续向下,但到11月份,随着IPO的加速和债券市场的调整,货币市场利率遭受冲击,并在12月份的IPO和跨年行情中进一步恶化,货币市场收益率大幅上行,回到6、7月份的水平。

本基金在年初重点配置高收益率定存,并逐步置换入短期融资券,全年维持较高的债券仓位和较长的剩余期限,在前10个月获得较高的收益,实现了组合规模和业绩增长的良性循环。但在11月份,受制于被动释放利润以调整正偏离的监管要求,本基金再投资时机较差,组合的静态收益率有所下滑。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为5.0884%,同期业绩比较基准收益率为0.3549%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年是十二五计划的收官之年,尽管从目前来看,内外需都面临一定的考验,但从中期来看,一些积极的因素也在出现:受到库存以及成本下降的影响,企业的盈利能力有望得以修复,同时,随着银行信贷能力的释放以及再融资渠道的放开,社会融资成本有望下降,实体企业的生存条件将得以改善。政府方面,为了确保圆满完成十二五计划,中央政府将延续稳增长的措施,但对局部风险事件的容忍度预计也会增强,市场的风险偏好将进一步分化。

经济政策预计变化不大,财政政策仍会相对积极,货币政策方面可能会出现一些新的变化,预计今年货币政策不会完全采用之前不透明的、定向的创新工具,一些具备信号意义的降息、降准将会出现,但这不代表货币政策的宽松方向,更多的只是用相对公开的方式引导宽松的预期,但依然会维持中性偏紧的资金面以防范继续加杠杆。

2015年资金面的最大不确定性因素是IPO进程。2015年IPO发行速度的提高乃至下半年备案制的推出,将会加大资金面的波动率。同时,在利率市场化和金融国际化的背景下,资金的流转会加速,货币体系将面临更大的挑战。面对不确定性的加大,预计货币当局整体的政策取向不会趋紧,但阶段性的资金面紧张不可避免。面临资金利率波动加大的风险,组合流动性的重要性更为突出,剩余期限、债券仓位以及杠杆率对组合的贡献会下降。

本基金在2015年将控制债券仓位和组合的剩余期限,提高组合的流动性和变现能力,力求在资金面的大波动下获取较为稳健的收益。

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、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核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。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察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签署服务协议,由其按合同约定提供银行间同业市场交易的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

根据本基金合同第十六部分"基金的收益与分配"之"(二)基金收益分配原则"的相关规定,本基金基金收益分配方式为红利再投资,每日分配,按日支付。本基金报告期内累计分配收益487,412,544.64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

报告期内,广发银行股份有限公司在广发天天红发起式货币市场基金(以下简称"本基金")的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》等相关法律法规,以及基金合同、托管协议的有关规定,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

报告期内,托管人依据相关法律法规、基金合同、托管协议等,对本基金的资产净值计算、利润分配等数据进行了认真复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

托管人复核了本基金2014年年度报告中的主要财务指标、基金净值表现、利润分配、年度财务报表、投资组合报告等内容,未发现虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 王明静 洪锐明签字出具了德师报(审)字(15)第P0300号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:广发天天红发起式货币市场基金

报告截止日:2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:	-	-
银行存款	7,918,071,110.55	2,054,392,797.69
结算备付金	2,551,000.00	14,761.91
存出保证金	210,926.81	-
交易性金融资产	8,535,502,045.83	40,017,799.12
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	8,535,502,045.83	40,017,799.12
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	3,161,265,045.43	263,800,000.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	150,891,567.38	7,053,804.59
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	19,768,491,696.00	2,365,279,163.31
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
负债:	-	-
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,188,397,417.40	-
应付证券清算款	-	189,000,000.00
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	4,225,800.77	187,819.70
应付托管费	782,555.68	34,781.44
应付销售服务费	3,912,778.49	173,907.14
应付交易费用	178,777.82	225.00
应交税费	-	-
应付利息	950,163.26	-
应付利润	2,293,545.39	405,277.82
递延所得税负债	-	-
其他负债	349,000.00	17,950.08
负债合计	1,201,090,038.81	189,819,961.18
所有者权益:	-	-
实收基金	18,567,401,657.19	2,175,459,202.13
未分配利润	-	-
所有者权益合计	18,567,401,657.19	2,175,459,202.13
负债和所有者权益总计	19,768,491,696.00	2,365,279,163.31

注:1、报告截止日2014年12月31日,基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额18,567,401,657.19份。2、上年度会计期间为2013年10月22日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

7.2 利润表

会计主体:广发天天红发起式货币市场基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

资产	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	574,471,384.76	7,022,898.92
1.利息收入	539,207,649.99	7,022,898.92
其中:存款利息收入	328,690,845.27	6,955,201.13
债券利息收入	164,922,064.64	33,941.25
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	45,594,740.08	33,756.54
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	35,263,734.77	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	35,263,734.77	-
资产支持证券投资收益	-	-
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)	-	-
减:二、费用	87,058,840.12	560,999.60
1.管理人报酬	27,831,236.65	260,867.17
2.托管费	5,153,932.61	48,308.75
3.销售服务费	25,769,663.52	241,543.68
4.交易费用	516.36	-
5.利息支出	27,884,160.98	-
其中:卖出回购金融资产支出	27,884,160.98	-
6.其他费用	419,330.00	10,280.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	487,412,544.64	6,461,899.32
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	487,412,544.64	6,461,899.32

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发天天红发起式货币市场基金

本报告期:2014年1月1日至2014年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31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)	2,175,459,202.13	-	2,175,459,202.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	487,412,544.64	487,412,544.64
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)	16,391,942,455.06	-	16,391,942,455.06
其中:1.基金申购款	64,404,433,251.63	-	64,404,433,251.63
2.基金赎回款	-48,012,490,796.57	-	-48,012,490,796.57
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)	-	-487,412,544.64	-487,412,544.64
五、期末所有者权益(基金净值)	18,567,401,657.19	-	18,567,401,657.19
项目	上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31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)	50,201,108.00	-	50,201,108.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,461,899.32	6,461,899.32
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)	2,125,258,094.13	-	2,125,258,094.13
其中:1.基金申购款	2,325,147,653.64	-	2,325,147,653.64
2.基金赎回款	-199,889,559.51	-	-199,889,559.51
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)	-	-6,461,899.32	-6,461,899.32
五、期末所有者权益(基金净值)	2,175,459,202.13	-	2,175,459,202.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:王志伟,主管会计工作负责人:窦刚,会计机构负责人:张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发天天红发起式货币市场基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2013]1287号《关于核准广发天天红发起式货币市场基金募集的批复》核准,由广发基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《广发天天红发起式货币市场基金基金合同》("基金合同")发起,于2013年10月22日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为广发银行股份有限公司。

本基金募集期为2013年10月17日至2013年10月18日,本基金为契约型开放式、发起式基金,存续期限不定。本基金募集资金总额为人民币50,201,108.00元,有效认购户数为206户。其中,认购资金在募集期间产生的利息共计人民币1,610.00元,折合基金份额1,610.00份,按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。作为本基金的发起资金,广发基金管理有限公司在2013年10月17日通过代销机构认购10,000,000.00元,认购费用0.00元,所认购本基金份额的持有期限不低于3年。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

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》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括现金、通知存款、短期融资券(包括超级短期融资券)、1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据、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")、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,但须符合中国证监会相关规定。本基金业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

本基金的财务报表于2015年3月23日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及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。

7.4.3 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2014年12月31日的财务状况以及2014年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金于2014年7月1日开始采用财政部于2014年颁布的《企业会计准则第39号——公允价值计量》、《企业会计准则第41号——在其他主体中权益的披露》和经修订的《企业会计准则第30号——财务报表列报》,同时在本年度财务报表中开始采用财政部于2014年修订的《企业会计准则第37号——金融工具列报》。上述会计政策的采用未对本年度本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1. 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

7.4.7关联方关系

项目	与本基金的关系
广发银行股份有限公司	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(注)	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited(广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注:广发证券股份有限公司于2014年7月31日对广发基金管理有限公司进行增资, 并对其实施控制,广发基金管理有限公司由此成为广发证券股份有限公司的子公司。

除此之外,本报告期内及上年度可比期间不存在其他控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1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。

7.4.8.1.2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。

7.4.8.1.3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末无应付关联方佣金余额。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	27,831,236.65	260,867.17
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注: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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	5,153,932.61	48,308.75

注: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。

7.4.8.2.3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 2014年1月1日至2014年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
广发基金管理有限公司	25,769,663.52
合计	25,769,663.52
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
广发基金管理有限公司	234,295.93
合计	234,295.93

注: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为每日应计提的基金销售服务费

E为前一日的基金资产净值

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。

7.4.8.3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 2014年1月1日至2014年12月31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
广发银行股份有限公司	40,039,101.37	-	-	-	526,000,000.00	78,294.80
上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31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
广发银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1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 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日
基金合同生效日(2013年10月22日)持有的基金份额	-	10,000,800.00
报告期初持有的基金份额	360,817,478.25	-
报告期间申购/买入总份额	325,820,447.18	350,816,678.25
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	486,580,000.00	-
报告期末持有的基金份额	200,057,925.43	360,817,478.25
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.08%	16.59%

注:申购份额含红利转投资份额。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。

7.4.8.4.2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

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。

7.4.8.5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 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发银行股份有限公司	1,341,110.55	89,800.02	270,392,797.69	244,628.25

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

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
广发证券股份有限公司	071417001	14东北证券CP001	一级市场分销	800,000.00	80,000,000.00
广发银行股份有限公司	011473002	14鲁高速SCP002	一级市场分销	200,000.00	20,000,000.00
广发证券股份有限公司	071416003	14华泰证券CP003	一级市场分销	400,000.00	40,000,000.00
广发证券股份有限公司	071415003	14申万CP003	一级市场分销	200,000.00	20,000,000.00
广发证券股份有限公司	041462006	14南通国投CP001	一级市场分销	300,000.00	30,000,000.00
广发银行股份有限公司	041460016	14广交投CP001	一级市场分销	300,000.00	30,000,000.00
广发证券股份有限公司;广发银行股份有限公司	011481003	14淮南矿SCP003	一级市场分销	200,000.00	20,000,000.00
广发证券股份有限公司	071442005	14西部证券CP005	一级市场分销	500,000.00	50,000,000.00
上年度可比期间 2013年10月22日(基金合同生效日)至2013年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.9期末(2014年12月31日)本基金持有的流通受限证券7.4.9.1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2014年12月31日止,本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金本报告期末无持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31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人民币1,188,397,417.40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
120407	12农发07	2015-01-05	100.02	1,500,000.00	150,030,000.00
140429	14农发29	2015-01-05	100.31	1,500,000.00	150,465,000.00
041453088	14深燃气CP001	2015-01-06	100.01	300,000.00	30,003,000.00
041456055	14滨建投CP004	2015-01-06	99.96	600,000.00	59,976,000.00
071411003	14国信证券CP003	2015-01-06	99.99	1,300,000.00	129,987,000.00
011430003	14中海运SCP003	2015-01-07	99.96	300,000.00	29,988,000.00
011430005	14中海运SCP005	2015-01-07	99.88	1,000,000.00	99,880,000.00
011474006	14陕煤化SCP006	2015-01-07	99.97	1,000,000.00	99,970,000.00
041464040	14粤海CP001	2015-01-07	100.17	1,000,000.00	100,170,000.00
011409007	14国电集SCP007	2015-01-07	99.90	2,000,000.00	199,800,000.00
140345	14进出45	2015-01-07	99.64	300,000.00	29,892,000.00
120219	12国开19	2015-01-07	100.10	400,000.00	40,040,000.00
140213	14国开13	2015-01-07	100.18	500,000.00	50,090,000.00
140317	14进出17	2015-01-07	100.16	800,000.00	80,128,000.00
合计				12,500,000.00	1,250,419,000.00

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年12月31日止,本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

7.4.10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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注7.4.4.5。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2014年12月31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级的余额为8,535,502,045.83元,无属于第一、三层级的余额(2013年12月31日:第二层级40,017,799.12元,无属于第一层级和第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,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股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级,上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

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。

§8 投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

债券代码	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	8,535,502,045.83	43.18
	其中:债券	8,535,502,045.83	43.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,161,265,045.43	15.99
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	503,954,859.48	2.55
3	银行存款和结算备付金合计	7,920,622,110.55	40.07
4	其他各项资产	151,102,494.19	0.76
5	合计	19,768,491,696.00	100.00

8.2债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.91	
	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	1,188,397,417.40	6.40
	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%。

8.3基金投资组合平均剩余期限

8.3.1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	112
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	123
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180天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2015-03-27	121	大额赎回	10个工作日内
2	2015-03-28	122	大额赎回	10个工作日内
3	2015-03-28	121	大额赎回	10个工作日内
4	2015-04-02	123	大额赎回	10个工作日内
5	2015-04-03	121	大额赎回	10个工作日内

注: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。

8.3.2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	31.62	6.40
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	10.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	15.75	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	27.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	20.69	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	105.66	6.40

8.4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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,010,845,234.32	5.44
	其中:政策性金融债	1,010,845,234.32	5.44
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	7,524,656,811.51	40.53
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	8,535,502,045.83	45.97
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5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	071402010	14国泰君安CP010	2,300,000.00	229,980,324.70	1.24
2	011409007	14国电集SCP007	2,000,000.00	199,807,625.79	1.08
3	120219	12国开19	1,800,000.00	180,176,123.04	0.97
4	011461009	14五矿股SCP009	1,600,000.00	160,203,489.60	0.86
5	140429	14农发29	1,500,000.00	150,458,166.43	0.81
6	011424003	14中冶SCP003	1,500,000.00	150,281,432.82	0.81
7	120407	12农发07	1,500,000.00	150,036,438.38	0.81
8	011424006	14中冶SCP006	1,400,000.00	139,921,849.72	0.75
9	071411003	14国信证券CP003	1,300,000.00	129,984,996.13	0.70
10	011415006	14中铝业SCP006	1,100,000.00	110,136,174.46	0.59

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

序号	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	
报告期内偏离度的最高值	
报告期内偏离度的最低值	
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	

8.7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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1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。

8.8.2本报告期内本基金未持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券。

8.8.3根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查,也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.8.4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	210,926.81
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	150,891,567.38
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	151,102,494.19

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

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
1,885,347	9,848.27	656,336,808.24	3.53%	17,911,064,848.95	96.47%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2,318,788.91	0.0125%

9.3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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

9.4发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	200,057,925.43	1.08%	10,000,800.00	0.05%	三年
基金管理人高级管理人员	64,338.06	0.00%	-	-	-
基金经理等人员	684,067.89	0.00%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	200,806,331.38	1.08%	10,000,800.00	0.05%	三年

注:同时作为高级管理人员和基金经理的,列入基金管理人高级管理人员持有的发起式基金份额。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	50,201,108.00
本报告期期初基金份额总额	2,175,459,202.13
本报告期基金总申购份额	64,402,890,214.94
减:本报告期基金总赎回份额	48,010,947,759.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,567,401,657.19

§11 重大事件揭示

11.1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。

11.2 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

2014年8月8日,陈伯军因工作调动不再担任本基金管理人的副总经理。2014年9月12日,本基金管理人聘任包林生为公司副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

本基金托管人于2014年5月5日在《上海证券报》发布公告,由寻卫国先生担任广发银行股份有限公司资产托管部总经理,原总经理禄金山先生另有任用。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-

注:1、交易席位选择标准:

(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、交易席位选择流程:

(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。

11.7.2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		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
兴业证券	-	-	1,323,806,000.00	100.00%	-	-

11.8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。

§12影响投资者决策的其他重要信息

根据广发基金管理有限公司2014年度股东会第四次会议决议,公司的注册资本由人民币12000万元增加至人民币12688万元,公司股东广发证券股份有限公司认购全部新增注册资本688万元。自此,广发证券股份有限公司的持股比例由原来的48.33%增加至51.13%,其他股东的持股比例相应调整。详见2014年8月15日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和广发基金管理有限公司网站(http://www.gffunds.com.cn)上刊登的《广发基金管理有限公司关于注册资本及股东出资比例变更的公告》。

广发基金管理有限公司

二〇一五年三月三十日