

(上接B057版)
 法定代表人:卓砾
 联系人:王婉
 联系电话:0755-33376853
 业务传真:0755-33065516
 客服热线:4006877899
 公司网址:www.yixifund.com
 (68)名称:中环时代基金销售(北京)有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢11层1103号
 办公地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层
 法定代表人:路遥
 联系人:侯英建
 联系电话:010-65808756
 业务传真:010-65807864
 客服热线:95162,4008888160
 公司网址:www.CIFCOFUND.com
 (69)名称:万银财富(北京)基金销售有限公司
 注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号盈古大观3201
 办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盈古大观3201
 法定代表人:李招弟
 联系人:高晓锐
 联系电话:010-59393923
 业务传真:010-59393074
 客服热线:400-808-0069
 公司网址:www.wy-fund.com
 (70)名称:诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
 注册地址:上海市徐汇区飞虹路360弄9号3724室
 办公地址:上海市浦东新区陆家嘴银城中路68号时代金融中心8楼
 法定代表人:汪静波
 联系人:方成
 联系电话:021-38600735
 业务传真:021-38609777
 客服热线:400-821-5399
 公司网址:www.noah-fund.com
 (71)名称:上海天基基金销售有限公司
 注册地址:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
 办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座7楼
 法定代表人:其实
 联系人:潘世友
 联系电话:021-54609998
 业务传真:021-64385308
 客服热线:4001818188
 公司网址:www.1234567.com.cn
 (72)名称:杭州数米基金销售有限公司
 注册地址:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
 办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
 法定代表人:陈柏青
 联系人:张锐
 联系电话:021-60897840
 业务传真:0571-26697013
 客服热线:4000-766-123
 公司网址:www.fund123.cn
 (73)名称:和讯信息科技有限公司
 注册地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
 法定代表人:王莉
 联系人:吴阿鹤
 联系电话:0755-82271106-8642
 业务传真:0755-82290565
 客服热线:4009200022
 公司网址:www.hexun.com
 (74)名称:浙江金观诚财富管理有限公司
 注册地址:浙江杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼(D区)
 办公地址:浙江杭州市西湖区世贸丽晶城欧美中心1号楼(D区)
 法定代表人:陆彬彬
 联系人:邓秀男
 联系电话:0571-56028620
 业务传真:0571-56899710
 客服热线:400 068 0058
 公司网址:www.jincheng-fund.com
 (75)名称:东兴证券股份有限公司
 注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)
 办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)
 法定代表人:魏庆华
 联系人:汤漫川
 联系电话:010-66556316
 业务传真:010-66556246
 客服热线:4008889993
 公司网址:www.dzxqnet.cn
 (76)名称:北京景富财投资管理有限公司
 注册地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
 办公地址:北京市海淀区丹棱街6号1幢9层1008-1012
 法定代表人:赵荣春
 联系人:魏静
 联系电话:010-57418829
 业务传真:010-57669671
 客服热线:400-678-5095
 公司网址:www.niuji.net
 (77)名称:上海久富财富管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区莱阳路2819号1幢109室
 办公地址:上海市浦东新区民生路1403号上海信息大厦1215室
 法定代表人:赵惠
 联系人:徐金华
 联系电话:021-68685825
 业务传真:021-68682297
 客服热线:400-021-9988
 公司网址:www.jctcm.com
 (78)名称:深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
 注册地址:深圳市福田区福华路101号1006#
 办公地址:北京市西城区金融大街35号 国际企业大厦C座9层
 法定代表人:杨懿
 联系人:张燕
 联系电话:010-58325388-1588
 业务传真:010-58325282
 客服热线:400-166-1188
 公司网址:http://88.jrj.com.cn
 (79)名称:大同证券有限责任公司
 注册地址:大同市城建迎宾街15号桐城中央21层
 办公地址:山西省太原市长治路11号山西世贸中心A座12、13层
 法定代表人:董祥
 联系人:薛津
 联系电话:0351-4130322
 业务传真:0351-4137986
 客服热线:4007121212
 公司网址:www.dtsbc.com.cn
 (80)名称:中国国国际期货有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国门外光华路14号1幢1层、2层、9层、11层、12层
 办公地址:北京市朝阳区麦子店西路3号新恒基国际大厦15层
 法定代表人:王兵
 联系人:赵森
 联系电话:010-57756019
 业务传真:010-57756199
 客服热线:400-786-8868-10
 公司网址:www.chftfund.com
 (81)名称:北京恒天明泽基金销售有限公司
 注册地址:北京市经济技术开发区宏达北路10号5层5122室
 办公地址:北京市朝阳区东三环中路20号乐成中心A座23层
 法定代表人:梁毅
 联系人:陈攀
 联系电话:010-57756019
 业务传真:010-57756199
 客服热线:400-786-8868-10
 公司网址:www.chftfund.com
 (82)名称:嘉实财富管理有限公司
 注册地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
 办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、北京市朝阳区建国路1号金地中心A座6层
 法定代表人:赵学军
 联系人:景琪
 联系电话:021-20298990
 传真:021-20290110
 网址:www.harvestwm.com
 客服热线:400-021-8865
 (83)名称:北京创金启富投资管理有限公司
 注册地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
 办公地址:北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
 法定代表人:梁蓉
 联系人:张晶晶
 联系电话:010-66154828-809
 业务传真:010-88067526
 客服热线:010-66154828
 公司网址:www.5rich.com
 (84)名称:宜信普泽投资顾问(北京)有限公司
 注册地址:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
 办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
 法定代表人:程伟
 联系电话:010-52856713
 业务传真:010-85942855

客服热线:400-6099-200
 公司网址:www.yixifund.com
 (85)名称:中经北证(北京)资产管理有限公司
 公司简称:中经北证
 注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
 办公地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
 法定代表人:徐福星
 联系人:陈莹莹
 联系电话:13261320700
 业务传真:010-88381560
 客服热线:010-68998820
 公司网址:www.bzfunds.com
 (86)名称:一路财富(北京)信息科技有限公司
 公司简称:一路财富
 注册地址:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
 办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座22层
 法定代表人:吴雪秀
 联系人:刘栋栋
 联系电话:010-88312877-8009
 业务传真:010-88312099
 客服热线:400-001-1566
 公司网址:www.yilucaifu.com
 (87)名称:中经北证(北京)资产管理有限公司
 注册地址:北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
 办公地址:北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座22层
 法定代表人:徐福星
 联系人:陈莹莹
 联系电话:13261320700
 业务传真:010-88381560
 客服热线:010-68998820
 公司网址:www.bzfunds.com
 (88)名称:厦门鑫鼎盛控股有限公司
 注册地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
 办公地址:厦门市思明区鹭江道2号第一广场1501-1504
 法定代表人:林松
 联系人:李智智
 联系电话:0592-3122679
 业务传真:0592-8060771
 客服热线:0592-3122731
 公司网址:www.xdcs.com.cn
 (89)名称:北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
 注册地址:北京市延庆县康延经济开发区百泉街10号2栋236室
 办公地址:北京市朝阳区亮马桥路40号二十一世纪大厦A303
 法定代表人:王岩
 联系人:胡明会
 联系电话:010-59200865
 业务传真:010-59200800
 客服热线:400-819-9668
 公司网址:www.tdyhfund.com
 (90)名称:中信建投期货有限公司
 注册地址:重庆市渝中区中山三路107号上站大楼11-B,名义层11-A,8-B4,9-B,C
 办公地址:重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
 法定代表人:彭文彬
 联系人:刘芸
 联系电话:023-86769637
 业务传真:023-86769629
 客服热线:400-8877-780
 公司网址:www.cfc108.com.cn
 (91)名称:海基财富基金销售有限公司
 注册地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
 办公地址:上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
 法定代表人:刘健
 联系人:刘艳妃
 联系电话:021-80133827
 业务传真:021-80133413
 客服热线:400-808-1016
 公司网址:www.fundhaiyan.com
 (92)名称:北京恒久浩信投资有限公司
 注册地址:北京市怀柔区怀北镇030号
 办公地址:北京市怀柔区怀北镇030号
 法定代表人:谢亚凡
 联系人:陈冲
 联系电话:010-88580321
 业务传真:010-88580366
 客服热线:400-525-676
 公司网址:www.haofund.com
 (93)名称:北京展恒基金销售有限公司
 注册地址:北京市顺义区后沙峪裕富佳园6号
 办公地址:北京市朝阳区华严里2号民建大厦6层
 法定代表人:周振杰
 联系人:瞿飞
 联系电话:021-80133827
 业务传真:021-80133413
 客服热线:400-808-1016
 公司网址:www.fundhaiyan.com
 (94)名称:上海得利基金销售有限公司
 注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
 办公地址:上海浦东新区峨眉山路91弄61号10号楼12楼
 法定代表人:徐继伟
 联系人:张锐
 联系电话:15801816961
 客服热线:4000676266
 公司网址:www.leadfund.com.cn
 (95)名称:徽商期货有限公司
 注册地址:合肥市芜湖路258号
 办公地址:合肥市芜湖路258号
 法定代表人:吴国华
 联系人:蔡芳
 联系电话:0551-62862801
 业务传真:0551-62862801
 客服热线:4008373707
 公司网址:www.hsqh.net
 3.其他代销机构
 本基金发售期间,若新增代销机构或代销机构新增营业网点,则另行公告。
 基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
 2.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华路3号4004-56-56
 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:020-8899129
 传真:020-8899175
 联系人:李尔华
 三、出具法律意见书的律师事务所
 名称:国浩律师集团(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:020-38799346
 传真:020-38799335
 经办律师:黄贞、周娟娟
 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:洪锐明
 电话:021-61418888
 传真:021-63350003
 经办注册会计师:王明玲、吴迪
 第四部分 基金的名称
 广发天天利货币市场基金
 第五部分 基金的类型
 货币市场基金
 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。
 第七部分 基金的投资方向
 本基金的投资范围包括:
 1.现金;
 2.通知存款;
 3.短期融资券;
 4.剩余期限在397天以内(含397天)的债券;
 5.1年内(含1年)的定期存款、大额存单;
 6.期限在1年内(含1年)的债券回购;
 7.剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;
 8.期限在1年内(含1年)的中央银行票据(以下简称“央行票据”);
 9.剩余期限在397天以内(含397天)中期票据;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。
 如果法律法规或监管机构允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

第八部分 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主要力量。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,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、相关市场价格指数等等。

在分析过程中,基金管理人将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,构建期限结构的投资组合。从组合总的剩余期限结构来看,一般来说,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,预期利率下降时,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,挖掘出利率报价较低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
 在长期控制的基础上,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。在日常的基金管理过程中,本基金将紧密关注申购/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,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,将回购或债券到期进行均衡等量配置,以满足日常的基金资产实现需求。

第九部分 业绩比较基准
 本基金的业绩比较基准为人人民币活期存款利率(税后)。

本基金将定期评估管理人对本基金的评价是否准确,如果评估结果与基金合同约定的评价标准存在差异,则新的业绩比较基准将从评估日起自动生效。

如果今后法律法规发生变化,或者其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时,经基金管理人和基金托管人协商一致后,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分 风险收益特征
 本基金属于货币市场基金,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 基金投资组合报告
 广发基金管理有限公司董事会及监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、准确性完整性负责,并承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行根据本基金合同规定,于2015年8月26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、误导性陈述或重大遗漏。

本报告期内所载数据截至2015年6月30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 占基金总资产的比例(%)

1 固定收益投资 235,160,551.19 52.83

其中:债券 235,160,551.19 52.83

资产支持证券 - -

2 买入返售金融资产 85,000,447.50 19.10

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

3 衍权条款和结算备付金合计 63,582,367.51 14.29

4 其他资产 61,348,807.82 13.78