广发理财7天债券型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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:二〇一四年四月二十一日

§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规定,于2014年4月16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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发理财7天债券	
基金主代码	000037	
交易代码	000037	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月20日	
报告期末基金份额总额	307,985,947.07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当期收益。	
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	七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
下属两级基金的交易代码	000037	000038
报告期末下属两级基金的份额总额	92,004,943.37份	215,981,003.70份

§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(2014年1月1日-2014年3月31日)	
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
1.本期已实现收益	1,626,609.92	1,357,887.26
2.本期利润	1,626,609.92	1,357,887.26
3.期末基金资产净值	92,004,943.37	215,981,003.70

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

1、广发理财7天债券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	1.2817%	0.0026%	0.3375%	0.0000%	0.9442%	0.0026%

注:本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

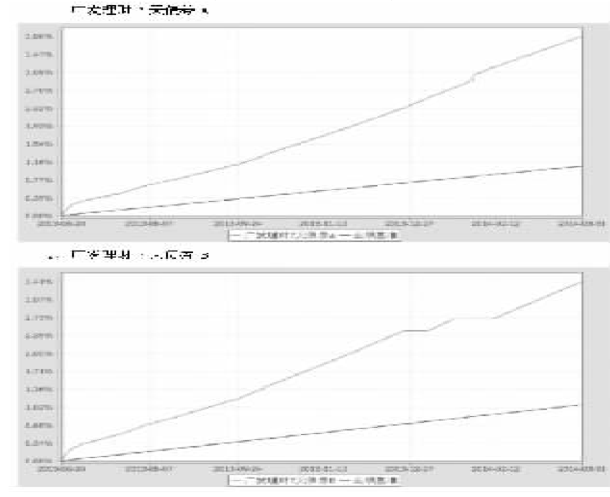
2、广发理财7天债券B:

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	0.9123%	0.0029%	0.3375%	0.0000%	0.5748%	0.0029%

注:本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

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

广发理财7天债券型证券投资基金
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6月20日至2014年3月31日)



注:(1)本基金合同生效日期为2013年6月20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14个交易日,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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;广发货币基金的基金经理;广发理财30天债券基金的基金经理;广发现金宝场内货币基金的基金经理	2013-06-20	-	13	女,中国籍,经济学学士,持有基金业执业证书,2000年7月至2004年10月任职于广发证券股份有限公司江门营业部,2004年10月至2008年8月在广发证券股份有限公司固定收益部工作,2008年8月11日至今在广发基金管理有限公司固定收益部工作,2010年4月29日起任广发货币基金的基金经理,2013年1月14日起任广发理财30天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12月2日起任广发现金宝场内货币基金的基金经理。
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发天天红货币基金的基金经理	2013-06-20	-	5	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。

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.基金经理助理的"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3.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 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》及其配套法规、《广发理财7天债券型证券投资基金基金合同》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。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。监察稽核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

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

第一季度货币市场利率走势较为平稳,央行及时在1月中下旬向市场注入资金,安然度过春节这个流动性关键时点。春节后资金面宽松,7天回购利率回落到3%以下,短期融资券的收益率也从高位回落,AAA级收益率区间在5.2-5.5%,比前期高位下降80个BP。

报告期内资产配置重点仍然是高收益的定期存款,同时增配短期融资券以获取价差收益。第二季度流动性将较一季度紧张,我们将继续保持良好流动性和适度久期,特别做好关键时点的流动性安排。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内广发理财7天A收益率为1.2817%,广发理财7天B收益率为0.9123%,同期业绩比较基准为0.3375%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

第一季度经济数据疲软,PMI指数徘徊在50,GDP增速预计下降到7.5%,仍处于政府可接受区间,而且美国和欧洲的经济持续好转,有利外贸出口,因此出台大规模刺激政策的可能性不高。预计第二季度货币政策会延续平稳基调,央行以公开市场操作来调控流动性,虽然第二季度会有缴税、外汇占款等因素影响流动性,但央行的操作将具有前瞻性和弹性,即使个别时点性资金紧张,全面出现钱荒的概率不大,货币市场利率将在合理区间运行。

具体而言,我们将坚持货币市场基金流动性管理工具的投资目标,保持合理的组合平均剩余到期期限,在合规基础上进行组合管理,根据对利率和信用市场变化的规律的深入研究来提高组合收益。

§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	40,006,619.83	12.18
	其中:债券	40,006,619.83	12.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	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	280,224,734.46	85.29
4	其他资产	8,313,669.82	2.53
5	合计	328,545,024.11	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

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	6.44	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	19,981,670.01	6.49
	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40%的说明

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	96
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	111
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

报告期内投资组合平均剩余期限超过127天情况说明

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127天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

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	15.01	6.49
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.29	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	29.22	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	45.46	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)	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.98	6.49

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(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	9,992,674.66	3.24
	其中:政策性金融债	9,992,674.66	3.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	30,013,945.17	9.75
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	40,006,619.83	12.99
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.5 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	041359055	13雏鹰CP001	100,000.00	10,008,888.72	3.25
2	041354043	13南产控CP001	100,000.00	10,004,990.43	3.25
3	041356030	13西宁特钢CP001	100,000.00	10,000,066.02	3.25
4	070205	07国开05	100,000.00	9,992,674.66	3.24

5.6"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	0.0874%
报告期内偏离度的最低值	-0.0546%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0541%

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 根据公开市场信息,报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.8.4 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	2,278,669.82
4	应收申购款	6,035,000.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	8,313,669.82

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
报告期期初基金份额总额	105,181,669.67	-
报告期期间基金总申购份额	240,177,605.83	440,269,291.53
报告期期间基金总赎回份额	253,354,332.13	224,288,287.83
报告期期末基金份额总额	92,004,943.37	215,981,003.70

§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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发理财7天债券型证券投资基金募集的文件
2.《广发理财7天债券型证券投资基金基金合同》
3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
4.《广发理财7天债券型证券投资基金托管协议》
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

8.2 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

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,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。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一四年四月二十一日

广发聚优灵活配置混合型证券投资基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月16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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发聚优灵活配置混合
基金主代码	000167
交易代码	000167
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月11日
报告期末基金份额总额	3,078,310,217.06份
投资目标	本基金力争在股票、债券和现金等大类资产的灵活配置与稳健投资下,获取长期、持续、稳定的合理回报。
投资策略	(一)资产配置策略 本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法,在股票、债券和现金等资产类之间进行相对灵活的适度配置。 (二)股票投资策略 本基金股票投资采用备选库制度,本基金的备选库包括一级库和二级库。 一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围,入选条件主要是根据广发企业价值评估体系,通过研究,筛选出基本面良好的股票进入一级库。具体而言,广发企业价值评估系统对企业价值的考察重点包括企业财务状况、经营管理状况、竞争力优势及所处行业环境。 二级股票库为本基金的风格库。本基金坚持价值投资理念,理性分析中国证券市场的特点和运行规律,选股方面坚持自下而上,在扎实深入的公司研究基础上,买入并长期持有投资价值高、成长性好、发展潜力大的上市公司的股票,将中国经济长期增长的潜力最大程度地转化为投资者的长期稳定收益。 (三)债券投资策略 在债券投资上,本基金将坚持稳健投资原则,对各类债券品种进行配置。本基金将通过自上而下的宏观分析以及对个券相对价值的比较,发现和确认市场失衡,把握投资机会;在良好控制利率风险及市场风险、个券信用风险的前提下,为投资者获得稳定的收益。 (四)金融衍生品投资策略 (1)股指期货投资策略 本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的期货合约,并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判,以及对股指期货合约的估值定价,与股票现货资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作,由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时,将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征,对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险,以改善投资组合的风险收益特性。 (2)权证投资策略 权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于基金资产增值。 根据有关规定,本基金投资权证遵循下述投资比例限制: 1)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的千分之五。 2)本基金持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的百分之三。 3)本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证,不超过该权证的百分之十。 若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。
业绩比较基准	沪深300指数×50%+中证全债指数×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§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 (2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	17,272,691.76
2.本期利润	126,004,660.86
3.加权平均基金份额本期利润	0.0503
4.期末基金资产净值	3,314,835,771.15
5.期末基金份额净值	1.077

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

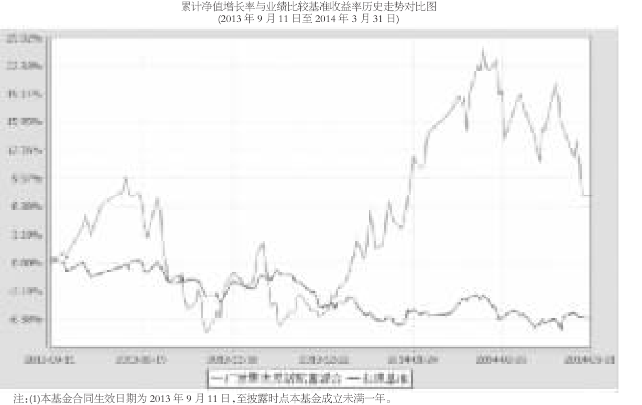
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差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	9.34%	2.00%	-2.61%	0.60%	11.95%	1.40%

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

广发聚优灵活配置混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年9月11日至2014年3月31日)



注:(1)本基金合同生效日期为2013年9月11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6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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		
刘明月	本基金的基金经理;广发聚瑞股票基金的基金经理;广发新经济股票基金的基金经理;权益投资一部副总经理	2013-09-11	-	9	男,中国籍,金融学硕士,持有基金业执业资格证书,2004年7月至2007年2月任广发基金管理有限公司研究发展部研究员,2007年2月至2009年5月先后任广发基金管理有限公司研究发展部副总经理、机构投资部总经理,2009年6月16日起任广发聚瑞股票基金的基金经理,2013年2月6日起任广发新经济股票基金的基金经理,2013年9月11日起任广发聚优灵活配置混合基金的基金经理,2014年1月21日起任广发基金管理有限公司权益投资一部副总经理。

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》及其配套法规、《广发聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。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。监察稽核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

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场回顾:

第1季度市场整体表现为震荡,基本持平。各行业表现不一,相对来说银行、券商、保险、地产表现稳定略微上涨,煤炭、有色等行业表现较差,医药、TMT、大众消费品、环保等行业表现较好。这种市场表现的原因是对宏观经济增速不悲观、却对改革红利预期较高和对经济转型成功有一定信心、同时流动性总体还是松紧适度;结果自然是受益经济结构调整的部分行业仍有好表现。

操作回顾:

广发聚优第1季度配置方向仍为稳定增长类行业,重点配置了医药、TMT、传媒、节能减排、偏国内消费的行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

聚优第1季度净值增长率为9.34%,而基准增长率为-2.61%,跑赢基准。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

目前国内宏观政策为稳增长、调结构、促改革,新的环境变化是改革趋势比以前更确定、力度比以前更大。通胀压力目前还不大,国内商品房市场调控政策仍维持,支持刚需,流动性相关政策松紧可控。国内经济基调是稳增长、调结构、加强市场化改革,目前来看我国宏观经济基本稳定向下但可控,结构调整将会有一定成效。

国内房地产调控和外围经济不佳对国内经济的影响还是长期的,尽管大多投资者对未来经济走势比较悲观,但是改革力度在加大、结构调整在加强、防经济过度下滑的后手还比较多,所以个人观点,中长期来看没必要太悲观。

预期低估值的价值股存在一定的机会,但长期还是看好大内需、经济结构调整受益的行业。

§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	权益投资	3,025,362,317.29	88.73
	其中:股票	3,025,362,317.29	88.73
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	351,519,324.71	10.31
7	其他各项资产	32,933,041.27	0.97
8	合计	3,409,814,683.27	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	238,650,634.07	7.20
C	制造业	1,526,899,213.83	46.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,477,992.77	0.32
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	71,741,668.00	2.16
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,041,297,941.20	31.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	108,162,110.62	3.26
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	27,828,556.80	0.84
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	304,200.00	0.01
	合计	3,025,362,317.29	91.27

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300147	香雪制药	8,843,866	229,498,322.70	6.92
2	300273	和佳股份	6,341,263	211,037,232.64	6.37
3	002410	广联达	5,667,693	206,247,348.27	6.22
4	300253	卫宁软件	1,800,598	198,065,780.00	5.98
5	300157	恒泰艾普	8,724,093	178,756,665.57	5.39
6	300212	易华录	3,191,844	150,016,668.00	4.53
7	002065	东华软件	2,857,201	115,316,632.36	3.48
8	002390	信邦制药	2,396,950	115,293,295.00	3.48
9	300287	飞利信	1,830,426	106,164,708.00	3.20
10	002019	鑫富药业	3,483,282	100,144,357.50	3.02

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,866,215.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	75,200.50
5	应收申购款	30,991,625.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,933,041.27

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300273	和佳股份	211,037,232.64	6.37	重大事项
2	002019	鑫富药业	100,144,357.50	3.02	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,620,848,178.48
本报告期基金总申购份额	2,937,614,024.07
减:本报告期基金总赎回份额	2,480,151,985.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,078,310,217.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2014-02-18	24,529,844.64	30,001,000.00	-
合计			-	-	

注:申购手续费为固定费用1000元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发聚优灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;
2.《广发聚优灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;
3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
4.《广发聚优灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;
5.《广发聚优灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版;
6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;
7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 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

8.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,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。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一四年四月二十一日

广发天天红发起式货币市场基金

2014 第一季度 报告

2014年3月31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
报告送出日期:二〇一四年四月二十一日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年4月16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2014年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	5,984,143,269.56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。 (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。 (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。 (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。 (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。 (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。
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	广发银行股份有限公司

§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(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	76,930,010.63
2.本期利润	76,930,010.63
3.期末基金资产净值	5,984,143,269.56

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。

3.2 基金净值表现

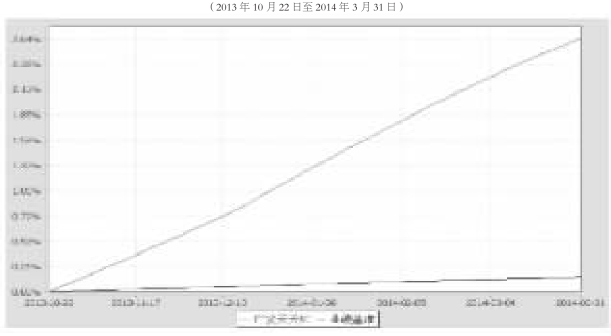
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	1.5049%	0.0019%	0.0875%	0.0000%	1.4174%	0.0019%

注:本基金利润分配按日结转份额。

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。

§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		
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;广发集鑫债券的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理	2013-10-22	-	5	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	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	2013-10-22	-	5	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。

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 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》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。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。监察稽核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

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2014年1季度,经济基本面出现明显衰退迹象,2月通胀率一度跌破2%,宏观数据方面出现了增长和通胀的双回落。在这样的背景下,央行一改之前偏紧的货币操作,通过扩大SLO的使用范围、对回购利率进行窗口指导等方式维稳资金面,资金利率创出近一年内的新低。

尽管中长期债券收益率出现明显回调,但对于一年期以内的货币市场工具,其收益率的反弹幅度较小。同时,受到央行主动收紧资金面力度减弱,以及对于同业业务窗口指导加强的影响,银行对于同业定存的需求明显减弱,即使在传统的季末,同业定存利率也没有出现明显回升。同业定存利率的下降进一步提高了货币基金对于短融等短期债券的配置力度,货币市场工具收益率持续下行。

本基金在1季度初投资了较多的高收益定存,实现了基金规模和收益率的双向正循环。在春节后,随着定存收益率的下行,本基金逐步提高债券仓位,在市场收益率下行阶段积累了一定的盈利,有助于本基金的后续操作。但由于之前预判季末的资金利率较高,将定存的到期期限集中在3月中下旬,事后来看,季末资金利率比原本设想的要宽松得多,导致本组合在3月底的再投资收益率偏低,组合收益率相对市场不再具备明显优势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发天天红本报告期净值增长率为1.5049%,业绩比较基准收益率为0.0875%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1季度经济下滑的趋势已经相对明显,2季度最大的看点在于各级政府出台的稳增长措施的方向和力度。受到房地产市场需求偏弱的影响,地方政府的财政压力较大,难以再次出现08年时期的大扩张;中央政府层面,预计财政政策会向几个重点领域专项展开,比如民生、铁路和棚户区改造等,大面积铺开的概率很小。货币政策方面,由于财政政策宽松的余地有限,在维稳的政策基调下,货币政策的从紧空间不会很大,资金面有望继续维持中性乃至略微偏松的状态。

本基金规模已经稳定在50亿元以上,且主要以个人投资者为主,基金规模相对稳定,有利于本基金的后续操作。本基金将合理安排定存的到期时间,同时比较定存和高等级短融的收益率,选择综合收益率相对较高的品种。对于债券仓位,一方面会保证组合持仓债券较高的信用等级以确保较强的变现能力,另一方面,也要控制债券仓位,并充分利用杠杆操作的方式应对赎回以及增厚组合收益。

§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	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

5.2 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%。

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	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

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	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

5.4 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	-	-

5.5 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

5.6"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%

5.7 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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 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。

5.8.4 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

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,175,459,202.13
报告期期间基金总申购份额	9,938,063,553.55
报告期期间基金总赎回份额	6,129,379,486.12
报告期期末基金份额总额	5,984,143,269.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	赎回	2014-01-03	100,000,000.00	100,000,000.00	0.00%
2	赎回	2014-01-24	80,000,000.00	80,000,000.00	0.00%
3	红利再投	2014-01-31	1,479,665.95	1,479,665.95	0.00%
4	红利再投	2014-02-28	907,559.76	907,559.76	0.00%
5	红利再投	2014-03-31	828,950.59	828,950.59	0.00%
合计			-	-	

注:红利再投为每月合计的广发天天红基金红利再投的交易份额及交易金额。

§8 报告期末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	184,033,654.55	3.08%	10,000,800.00	0.17%	三年
基金管理人高级管理人员	6,836,826.05	0.11%	-	-	-
基金经理等人员	3,601,323.79	0.06%	-	-	-
基金管理人股东	324,395,978.53	5.42%	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	518,867,782.92	8.67%	10,000,800.00	0.17%	三年

§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天天红发起式货币市场基金募集的文件;
2.《广发天天红发起式货币市场基金合同》;
3.《广发天天红发起式货币市场基金托管协议》;
4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
5.《广发天天红发起式货币市场基金招募说明书》及其更新版;
6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;
7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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

9.3 查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,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。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一四年四月二十一日