

广发天天红发起式货币市场基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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:二〇一四年七月十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员保证本基金报告不存在虚假记载、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。

广发基金管理有限公司根据本基金合同规定，于2014年6月16日核发了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金的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。

本报告期自2014年1月1日起至6月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发天天红
基金代码	000349
交易账户	000349
基金管理方式	契约型开放式
基金份额总额	11,117,510,563.55份
报告期末基金份额总额	11,117,510,563.55份
投资目标	本基金在大类资产配置所遵循的基本原则下，力争实现稳定的、超越市场的收益。本基金为债券型基金，通过分析利率变化趋势、行业景气度、公司基本面等指标，综合考虑各类资产品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极调整。
投资策略	（一）资产配置策略 本基金在大类资产配置所遵循的基本原则下，力争实现稳定的、超越市场的收益。本基金为债券型基金，通过分析利率变化趋势、行业景气度、公司基本面等指标，综合考虑各类资产品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极调整。 影响资产配置的因素很多，影响短期半动态的因素更多，运行方式会更复杂。 （二）定期配置策略 在定期配置的基础上，寻找对投资对象的主动性和相对性的动态变化，构建合理的定期结构的投资组合。
（三）产品配置策略 在定期配置的基础上，基金经理根据对市场的深入研究，在严格控制风险和保障流动性的情况下，寻找市场上的低风险投资机会，以期获得更高的收益。 （四）个券选择策略 本基金在大类资产配置是基本前提之下的主动管理，由银行存款和大额存单的投资将是本基金关注的重点之一。 在定期配置的基础上，基金经理根据对市场的深入研究，在严格控制风险和保障流动性的情况下，寻找市场上的低风险投资机会，以期获得更高的收益。 （五）风险管理策略 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	本基金在大类资产配置所遵循的基本原则下，力争实现稳定的、超越市场的收益。本基金为债券型基金，通过分析利率变化趋势、行业景气度、公司基本面等指标，综合考虑各类资产品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极调整。 影响资产配置的因素很多，影响短期半动态的因素更多，运行方式会更复杂。 （二）定期配置策略 在定期配置的基础上，寻找对投资对象的主动性和相对性的动态变化，构建合理的定期结构的投资组合。 （三）产品配置策略 在定期配置的基础上，基金经理根据对市场的深入研究，在严格控制风险和保障流动性的情况下，寻找市场上的低风险投资机会，以期获得更高的收益。 （四）个券选择策略 本基金在大类资产配置是基本前提之下的主动管理，由银行存款和大额存单的投资将是本基金关注的重点之一。 在定期配置的基础上，基金经理根据对市场的深入研究，在严格控制风险和保障流动性的情况下，寻找市场上的低风险投资机会，以期获得更高的收益。 （五）风险管理策略 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

序号	报告期间	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
				1	2
1	本期已实现收益	—	74,601,394.35	—	—
2	本期利润	—	74,601,394.35	—	—
3	期末未分配利润	11,117,510,563.55	—	—	—
4	报告期基金份额变动	—	—	—	—
5	期末基金资产净值	11,117,510,563.55	—	—	—

(注:1)本基金合同生效日期为2013年10月22日,经法定基金成立满一年。
2)本基金在成立后六个月内,建仓期结束时各项资产配置比例符合适本基金合同有关规定。

§ 4 管理人报告

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
潘洁	本基金的基金经理;广发债券基金、广发货币基金、广发货币市场基金、广发货币基金(人民币)基金经理;广发货币基金(美元)基金经理;广发货币基金(欧元)基金经理;广发货币基金(英镑)基金经理;广发货币基金(港币)基金经理	2013-10-22	—	6	男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业证书,2008年7月进入基金行业,2012年7月加入广发基金管理有限公司,2012年7月19日起任“广发双债添利债券基金”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(人民币)”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(美元)”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(欧元)”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(英镑)”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(港币)”基金经理。
任莉	本基金的基金经理;广发债券基金、广发货币基金、广发货币市场基金、广发货币基金(人民币)基金经理;广发货币基金(美元)基金经理;广发货币基金(欧元)基金经理;广发货币基金(英镑)基金经理;广发货币基金(港币)基金经理	2013-10-22	—	6	女,中国籍,经济学学士,持有基金业执业证书,2007年1月进入基金行业,2012年7月加入广发基金管理有限公司,2012年7月19日起任“广发双债添利债券基金”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(人民币)”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(美元)”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(欧元)”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(英镑)”基金经理,2013年1月10日起任“广发货币基金(港币)”基金经理。
注:1)任职日期即“广发日期”指公司公告聘任或解聘日期。 2)任职日期即“广发日期”指公司公告聘任或解聘之日起至最近一年的日期。 3)根据《关于基金管理公司、基金托管人适用人员资格管理的规定》,本公司高级管理人员、基金经理和基金经理助理等从事投资管理工作的人员,应当取得基金从业资格,并报中国证监会派出机构备案。其他从业人员可以取得基金从业资格,并报中国证监会派出机构备案。本公司高级管理人员、基金经理和基金经理助理等从事投资管理工作的人员,应当取得基金从业资格,并报中国证监会派出机构备案。其他从业人员可以取得基金从业资格,并报中国证监会派出机构备案。	4)本公司高级管理人员、基金经理和基金经理助理等从事投资管理工作的人员,应当取得基金从业资格,并报中国证监会派出机构备案。其他从业人员可以取得基金从业资格,并报中国证监会派出机构备案。				
5)本基金采用“摊余成本法”或“影子定价”的方法对当日购买的基金份额的账面价值进行确认,持有的浮盈或浮亏将按摊余成本逐日计提,直至该浮盈或浮亏被全部冲回。	6)本基金采用“摊余成本法”或“影子定价”的方法对当日购买的基金份额的账面价值进行确认,持有的浮盈或浮亏将按摊余成本逐日计提,直至该浮盈或浮亏被全部冲回。				
7)本基金定期报告中披露的“期末基金资产净值”是指基金资产总值减去负债后的金额。	8)本基金定期报告中披露的“期末基金资产净值”是指基金资产总值减去负债后的金额。				
9)本基金定期报告中披露的“期末基金资产净值”是指基金资产总值减去负债后的金额。	10)本基金定期报告中披露的“期末基金资产净值”是指基金资产总值减去负债后的金额。				

注:1)本基金合同生效日期为2013年10月22日,经法定基金成立满一年。
2)本基金在成立后六个月内,建仓期结束时各项资产配置比例符合适本基金合同有关规定。

§ 5 投资组合报告

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)	
			1	2
1	固定收益投资	4,000,318,309.08	33.23	
2	货币市场基金	4,000,318,309.08	33.23	
3	银行存款	—	—	
4	其他金融机构存款	—	—	
5	应收证券清算款	1,213,603,500.40	10.08	
6	买入返售金融资产	—	—	
7	银行买入返售金融资产	6,762,102,647.71	56.17	
8	其他各类资产	62,479,267.07	0.52	
9	合计	12,038,171,600.00	100.00	

5.2 报告期债券到期情况

5.3 基金的分类

5.4 报告期内基金的利润分配情况

5.5 报告期末基金资产净值

5.6 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.7 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.8 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.9 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.10 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.11 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.12 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.13 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.14 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.15 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.16 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.17 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.18 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.19 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.20 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.21 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.22 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.23 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.24 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.25 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.26 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.27 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.28 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.29 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.30 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.31 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.32 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.33 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.34 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.35 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.36 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.37 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.38 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.39 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.40 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.41 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.42 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.43 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.44 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.45 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.46 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.47 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.48 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.49 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.50 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.51 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.52 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.53 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.54 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.55 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例

5.56 报告期末持有的各类资产占基金资产的比例