广发活期宝货币市场基金招募说明书【更新】摘要

[2015年第2号]

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：兴业银行股份有限公司

时间：二〇一五年十月

【重要提示】

本基金于2014年5月22日经中国证监会证监许可［2014］519号文注册。本基金合同于2014年8月28日生效。

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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，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，风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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2015年8月28日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30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：1.2688亿元人民币

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金融创新投资控股有限公司，分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%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、总经理，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员，资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。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，证通股份有限公司监事，监事长。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。兼任全国政协委员、全国妇联常委、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。

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，海尔施生物医药股份有限公司独立董事。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，现任辽宁大学新华国际商学院教授，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、新华国际商学院党总支书记。

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，现任广州科技金融创新投资控股有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任，广州屈臣氏公司行政主管，广州市科达实业发展公司办公室主任、总经理，广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

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、总经理，中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员，资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。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。

朱平：副总经理，男，硕士，经济师，中国证券监督管理委员会第六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，广发聚祥灵活配置混合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第六届创业板发行审核委员，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。

邱春杨：副总经理，男，经济学博士，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、金融工程部总经理。

4、基金经理

温秀娟，女，中国籍，经济学学士，15年证券和基金从业经历，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，2014年3月17日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理，2014年8月28日起任广发活期宝货币市场基金的基金经理。

任爽，女，中国籍，经济学硕士，7年基金从业经历，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，2015年6月8日起任广发聚泰混合基金的基金经理。

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，权益投资一部总经理刘晓龙，研究发展部副总经理孙迪，固定收益部总经理张芊。

三、基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经国务院证券监督管理机构认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额的每万份基金已实现收益和七日年化收益率；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、国务院证券监督管理机构规定的其他职责。

四、基金管理人承诺

1、基金管理人承诺：

(1)严格遵守《基金法》及其他相关法律法规的规定，并建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《基金法》及其他法律法规行为的发生；

(2)根据基金合同的规定，按照招募说明书列明的投资目标、策略及限制进行基金资产的投资。

2、基金管理人严格按照法律、法规、规章的规定，基金资产不得用于下列投资或者活动：

(1)将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

(2)不公平地对待其管理的不同基金财产；

(3)利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

(4)向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

(5)法律法规以及中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金经理承诺：

(1)依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2)不利用职务之便为自己、代理人、代表人、受雇人或任何其他第三人谋取不当利益；

(3)不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

(4)不协助、接受委托或以其他任何形式为其他组织或个人进行证券交易。

五、基金管理人的内部控制制度

基金管理人的内部风险控制制度包括内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章等。内部控制大纲是对公司章程规定的内控原则的细化和展开，对各项基本管理制度的总揽和指导。内部控制大纲明确了内部控制目标和原则、内部控制组织体系、内部控制制度体系、内部控制环境、内部控制措施等。基本管理制度包括风险控制制度、基金投资管理制度、基金绩效评估考核制度、集中交易制度、基金会计制度、信息披露制度、信息系统管理制度、员工保密制度、危机处理制度、监察稽核制度等。部门业务规章是在基本管理制度的基础上，对各部门的主要职责、岗位设置、工作要求、业务流程等的具体说明。

根据基金管理业务的特点，公司设立顺序递进、权责统一、严密有效的四道内控防线：

1、建立以各岗位目标责任制为基础的第一道监控防线。各岗位均制定明确的岗位职责，各业务均制定详尽的操作流程，各岗位人员上岗前必须声明已知悉并承诺遵守，在授权范围内承担各自职责。

2、建立相关部门、相关岗位之间相互监督的第二道监控防线。公司在相关部门、相关岗位之间建立重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，后续部门及岗位对前一部门及岗位负有监督的责任。

3、建立以监察稽核部对各岗位、各部门、各机构、各项业务全面实施监督反馈的第三道监控防线。监察稽核部属于内核部门，直接接受总经理的领导，独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况实行严格的检查和监督。

4、建立以合规审核委员会及督察长为核心，对公司所有经营管理行为进行监督的第四道监控防线。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人基本情况

名称：兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路154号

办公地址：上海市江宁路168号

法定代表人：高建平

成立日期：1988年8月22日

批准设立机关和批准设立文号：中国人民银行总行，银复［1988］347号

组织形式：股份有限公司

注册资本：190.52336751亿元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字［2005］74号

联系人：林成

联系电话：021-52629999-212012

传真：021-62159217

兴业银行成立于1988年8月，是经国务院、中国人民银行批准成立的首批股份制商业银行之一，总行设在福建省福州市，2007年2月5日正式在上海证券交易所挂牌上市（股票代码：601166），注册资本190.52亿元。开业二十多年来，兴业银行始终坚持“真诚服务，相伴成长”的经营理念，致力于为客户提供全面、优质、高效的金融服务。根据2014年年报，截至2014年12月31日，兴业银行资产总额达4.41万亿元，股东权益2579.34亿元，全年实现归属于母公司股东的净利润471.38亿元。2014年兴业银行市场地位和品牌形象稳步提升，稳居全球银行50强（英国《银行家》杂志排名）、世界企业500强（美国《财富》杂志排名）和全球上市企业200强（美国《福布斯》杂志排名）行列。在国内外各种权威机构组织的评比中，先后荣获最佳中资银行、最佳战略创新银行、最佳绿色银行、最佳互联网金融平台银行、普惠金融实践最佳银行、最具社会责任上市公司、中华慈善突出贡献（单位）奖、中国最佳雇主等荣誉。

二、基金托管部门及主要人员情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部，下设综合管理处、市场处、委托资产管理处、科技支持处、稽核监察处、运营管理处、期货业务管理处、期货存管结算处、养老金管理中心等处室，共有员工97人，业务岗位人员均具有基金从业资格。

三、证券投资基金托管情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号：证监基金字［2005］74号。截止2015年6月30日，兴业银行已托管开放式基金46只，托管基金财产规模2005.85亿元。

四、托管业务的内部控制制度

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律、法规、规章、行政性规定、行业准则和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金资产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

兴业银行基金托管业务内部风险控制组织结构由兴业银行风险管理部、法律与合规部、审计部、资产托管部内设稽核监察处及资产托管部各业务处室共同组成。总行风险管理部、法律与合规部、审计部对托管业务风险控制工作进行指导和监督；资产托管部内设独立、专职的稽核监察处，配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核工作职权和能力。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1)全面性原则：风险控制必须覆盖基金托管部的所有处室和岗位，渗透各项业务过程和业务环节；风险控制责任应落实到每一业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责。

(2)独立性原则：资产托管部设立独立的稽核监察处，该处室保持高度的独立性和权威性，负责对托管业务风险控制工作进行指导和监督。

(3)相互制约原则：各处室在内部组织结构的设计上要形成一种相互制约的机制，建立不同岗位之间的制衡体系。

(4)定性和定量相结合原则：建立完备的风险管理指标体系，使风险管理更具客观性和操作性。

(5)防火墙原则：托管部自身财务与基金财务严格分开；托管业务日常操作部门与行政、研发和营销等部门严格分离。

(6)有效性原则。内部控制体系同所处的环境相适应，以合理的成本实现内控目标，内部制度的制订应当具有前瞻性，并应当根据国家政策、法律及经营管理的需要，适时进行相应修改和完善；内部控制应当具有高度的权威性，任何人不得拥有不受内部控制约束的权力，内部控制存在的问题应当能够得到及时反馈和纠正；

(7)审慎性原则。内控与风险管理必须以防范风险，审慎经营，保证托管资产的安全与完整为出发点；托管业务经营管理必须按照“内控优先”的原则，在新设机构或新增业务时，做到先期完成相关制度建设；

(8)责任追究原则。各业务环节都应有明确的责任人，并按规定对违反制度的直接责任人以及对负有领导责任的主管领导进行问责。

4、内部控制制度及措施

(1)制度建设：建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度。

(2)建立健全的组织管理结构：前后台分离，不同部门、岗位相互牵制。

(3)风险识别与评估：稽核监察处指导业务处室进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施。

(4)相对独立的业务操作空间：业务操作区相对独立，实施门禁管理和音像监控。

(5)人员管理：进行定期的业务与职业道德培训，使员工树立风险防范与控制理念，并签订承诺书。

(6)应急预案：制定完备的《应急预案》，并组织员工定期演练；建立异地灾备中心，保证业务不中断。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

1、直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务：

(1)广州分公司

地址：广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场南塔17楼

直销中心电话：020-89899073 020-89899042

传真：020-89899069 020-89899070

(2)北京分公司

地址：北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层

电话：010-68083368

传真：010-68083078

(3)上海分公司

地址：上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室

电话：021-68885310

传真：021-68885200

(4)网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务，具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址：www.gffunds.com.cn

本公司网址：www.gffunds.com.cn

客服电话：95105828（免长途费）或020-83936999

客服传真：020-34281105

(5)投资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2、代销机构

(1)名称：青岛银行股份有限公司

注册地址：山东省青岛市市南区香港中路68号

法定代表人：郭少泉

联系人：滕克

联系电话：0532-85709787

传真：0532-85709799

客服电话：（青岛）96588，（全国）400-66-96588

公司网站：www.qdccb.com

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：020-89188970

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、陈桂华

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：王明静、吴迪

第四部分 基金的名称

广发活期宝货币市场基金

第五部分 基金的类型

契约型开放式

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。其投资比例将遵循届时有效的法律法规和相关规定。

第八部分 基金的投资策略

一、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 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 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

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。

基金托管人中国兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年9月31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2015年6月30日。

1期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	190,405,117.75	77.81
	其中：债券	190,405,117.75	77.81
	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	50,668,392.38	20.71
4	其他各项资产	3,632,585.81	1.48
5	合计	244,706,095.94	100.00

2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	17.45
	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	36,384,781.81	17.49
	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20%的说明

本基金本报告期内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	77
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	92
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	54

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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120天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

3.2期末投资组合平均剩余期限分布比例

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（%）
30天以内	33.97	17.49
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
30天（含）—60天	14.48	–
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
60天（含）—90天	57.81	–
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
90天（含）—180天	–	–
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
180天（含）—397天（含）	9.64	–
其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	–	–
合计	115.90	17.49

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	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	10,007,062.47	4.81
	其中：政策性金融债	10,007,062.47	4.81
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	180,398,055.28	86.73
6	中期票据	–	–
7	其他	–	–
8	合计	190,405,117.75	91.54
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	–	–

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	041458064	14鲁宏桥CP001	200,000.00	20,166,313.92	9.70
2	041472011	14江阴公CP001	200,000.00	20,106,469.26	9.67
3	041468006	14阳泉CP003	200,000.00	20,103,465.65	9.67
4	071503005	15中信CP005	200,000.00	19,999,070.88	9.62
5	071517002	15东北证券CP002	200,000.00	19,998,937.50	9.61
6	071525004	15国都证券CP004	200,000.00	19,998,930.25	9.61
7	071521004	15渤海证券CP004	200,000.00	19,974,587.23	9.60
8	041561007	15开滦CP001	100,000.00	10,070,621.52	4.84
9	140443	14农发43	100,000.00	10,007,062.47	4.81
10	071502004	15国泰君安CP004	100,000.00	9,999,407.35	4.81

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	45次
报告期内偏离度的最高值	0.3935%
报告期内偏离度的最低值	0.1574%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2904%

7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.3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期末其他各项资产构成

单位：人民币元

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	3,514,265.81
4	应收申购款	118,320.00
5	其他应收款	–
6	待摊费用	–
7	其他	–
8	合计	3,632,585.81

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，投资者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2015年6月30日。

1、本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2014.8.28–2014.12.31	1.3241%	0.0038%	0.1225%	0.0000%	1.2016%	0.0038%
2015.1.1–2015.6.30	2.4948%	0.0192%	0.1760%	0.0000%	2.3188%	0.0192%
自基金合同生效起至今	3.8519%	0.0150%	0.2985%	0.0000%	3.5534%	0.0150%

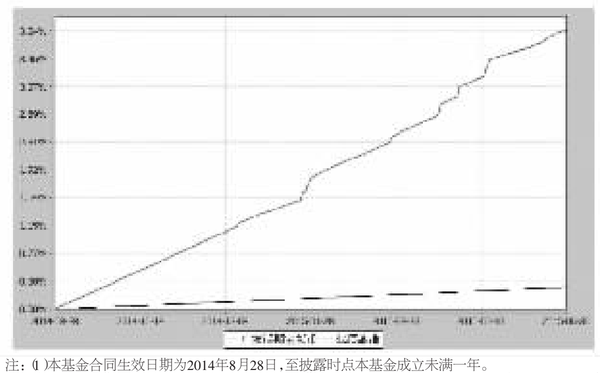
注：业绩比较基准：人民币活期存款利率（税后）。

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

广发活期宝货币市场基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2014年8月28日至2015年6月30日）



注：(1)本基金合同生效日期为2014年8月28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。

第十三部分 基金费用

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、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5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0.04%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H=E×0.04%÷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5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0.20%，计算公式如下：

H=E×0.20%÷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5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个工作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》、《公开募集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，对原《广发活期宝货币市场基金招募说明书更新》的内容进行了更新，主要更新的内容如下：

1. 在“第三部分 基金管理人”部分，更新了基金管理人的相关内容。

2、在“第四部分 基金托管人”部分，根据基金托管人人员变动及业务经营情况对基金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，增加了截至2015年6月30日的基金投资组合报告。

5、在“第十部分 基金的业绩”部分，更新了截至2015年6月30日的基金业绩。

6、根据最新公告，对“第二十二部分 其他应披露事项”内容进行了更新。

广发基金管理有限公司
二〇一五年十月十四日

广发基金管理有限公司关于增加华泰证券为旗下部分基金代销机构的公告

根据华泰证券股份有限公司（以下简称：“华泰证券”）与广发基金管理有限公司（以下简称：“本公司”）签订的代销协议，本公司决定自2015年10月14日起通过华泰证券代理销售以下基金：

基金名称	基金代码
广发纳斯达克100指数证券投资基金（人民币份额）	270042
广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金	000477
广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金	000529

投资者可在华泰证券办理上述基金的开户、申购、赎回、基金转换、定期定额投资（以下简称“定投”）业务。今后本公司发行的其它开放式基金是否适用于上述业务，本公司亦将根据具体情况另行公告，具体业务的办理请参照本公司及华泰证券的相关业务规则和流程。

同时，经华泰证券和本公司双方协商一致，决定自2015年10月14日起，对通过华泰证券申购上述指定基金的是否实施费率优惠及具体优惠措施以华泰证券的安排为准。

重要提示：

1、基金定投业务是指投资者通过本公司指定的基金销售机构提交申请，约定每期扣款时间和扣款金额，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种投资方式。

2、投资者可到华泰证券代销网站申请开办基金定投业务并约定每期固定的申购金额，每期申购金额不低于人民币100元，具体办理事宜请以华泰证券的安排为准。

3、广发纳斯达克100指数证券投资基金（人民币份额）暂不支持基金转换业务，开通转换业务的时间详见我司最新公告。

4、投资者可以通过以下方式咨询：

(1)华泰证券股份有限公司

客服热线：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(2)广发基金管理有限公司

客服电话：95105828（免长途费）

公司网站：www.gffunds.com.cn

风险提示：本公司承诺以诚实信用、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现。基金定投并不等于零存整取，不能规避基金投资所固有的风险，也不能保证投资人获得收益。本公司提醒投资人在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行负担。投资者投资基金时应认真阅读基金的《基金合同》、更新的《招募说明书》等文件。

特此公告

广发基金管理有限公司
2015年10月14日

证券代码：000875 证券简称：吉电股份 公告编号：2015-105

吉林电力股份有限公司2015年度(前三季度)业绩预告

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。

一、本期业绩预计情况

1.业绩预告期间：2015年1月1日至2015年9月30日

2.预计的经营业绩：

□亏损 □扭亏为盈 √同向上升 □同向下降

业绩预告情况表：

预告时间：2015年1月1日–2015年9月30日

项 目	本报告期	上年同期
归属于上市公司股东的净利润	比上年同期增长：441.87% – 540.39%	盈利：1,015万元
	盈利：5,500万元 – 6,500万元	
基本每股收益	盈利：约0.04元	盈利：0.01元

预告时间：2015年7月1日–2015年9月30日

项 目	本报告期	上年同期
归属于上市公司股东的净利润	亏损：1,300万元 – 2,300万元	盈利：8,065万元
基本每股收益	亏损：约0.01元	盈利：0.06元

二、业绩预告预审计情况

本业绩预告未经过注册会计师预审计。

三、业绩变动原因说明

本预告期预计实现净利润5,500万元至6,500万元，比上年同期净利润增利4,485万元至5,485万元。本报告期面对国家政策性火电电价下调的持续影响，公司通过加强内部管理、降耗提效，经营成果同比增长，主要因素：一是有效利用市场煤价下行趋势，公司加强燃料管理，综合标煤单价降低；二是新能源项目建成投产，公司盈利能力提升；三是供电煤耗等生产运营指标得到进一步优化；四是公司加强对标管理，各项成本费用得到有效控制；五是取得政府一次性供热补贴增加了公司利润水平。

公司将继续强化市场营销工作，积极推进新能源发展战略，严控成本费用支出，增强公司盈利能力和水平。

特此公告。

吉林电力股份有限公司董事会
二〇一五年十月十三日

证券代码：000856 证券简称：冀东装备 公告编号：2015-43

唐山冀东装备工程股份有限公司2015年前三季度业绩预告

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。

一、本期业绩预计情况

1.业绩预告期间：2015年1月1日--2015年9月30日

2.预计的业绩：√亏损 □扭亏为盈 □同向上升 □同向下降

3.预计的业绩情况：

项 目	本报告期（2015年1–9月）	上年同期（2014年1–9月）
归属于上市公司股东的净利润	亏损：10,000万元–10,400万元	亏损：3,032万元
基本每股收益	亏损：0.44元–0.46元	亏损：0.13元
项 目	本报告期（2015年7–9月）	上年同期（2014年7–9月）
归属于上市公司股东的净利润	亏损：2,782万元–3,182万元	亏损：727万元
基本每股收益	亏损：0.12元–0.14元	亏损：0.03元

二、业绩预告预审计情况

本次预计的业绩未经会计师事务所审计。

三、业绩变动原因说明

公司1–9月亏损的主要原因是：公司所处行业市场形势依然严峻，通过产品结构调整，业务量有所增长，但整体毛利降幅较大，影响利润下降，导致经营亏损增加。

四、其他相关说明

具体财务数据将在公司2015年三季度报告中披露，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

唐山冀东装备工程股份有限公司
董 事 会
2015年10月13日

证券代码：000403 证券简称：ST 生化 公告编号：2015-090

振兴生化股份有限公司重大资产重组进展公告

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，没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

振兴生化股份有限公司（以下简称"公司"）因筹划重大事项于2015年1月27日开市起停牌。公司于2015年4月29日发布《重大资产重组继续停牌公告》，并于同日开市起实施重大资产重组停牌。2015年5月28日，根据重大资产重组进展情况需要，公司发布了《重大资产重组延期复牌公告》。2015年7月28日，因无法在原定计划时间内披露重大资产重组预案（或报告书），公司发布了《关于筹划重大资产重组停牌期满申请继续停牌公告》，承诺将在2015年10月24日前按照《公开发行证券的公司信息披露内容与格式准则第26号–上市公司重大资产重组》的要求披露重大资产重组预案（或报告书）并申请股票复牌。

截止目前，公司及有关各方正在全力推进本次重大资产重组的各项工作，抓紧进行涉及资产的尽职调查、审计、评估等工作，并积极确定、完善交易方案。根据《上市公司重大资产重组管理办法》和深交所关于上市公司重大资产重组的有关规定，公司股票自2015年10月14日开市起继续停牌。

停牌期间，公司将充分关注该事项进展情况，并按照中国证监会和深圳证券交易所等相关规定及时履行信息披露义务，至少每五个交易日发布一次上述资产重组事项的进展公告。

公司指定的信息披露媒体为《证券时报》和巨潮资讯网，有关公司信息均以上述媒体披露为准，因有关事项尚存在不确定性，敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

振兴生化股份有限公司董事会
二〇一五年十月十三日

证券代码：002023 证券简称：海特高新 公告编号：2015-065

四川海特高新技术股份有限公司关于获得国防科学技术进步奖的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

四川海特高新技术股份有限公司（以下简称"公司"）开发研究项目"某型发动机工程"荣获中华人民共和国工业和信息化部"国防科学技术进步奖"，获奖等级为一等奖。国防科学技术进步奖是为了奖励在推动国防科学技术进步中做出突出贡献的单位和个人，鼓励自主创新，促进国防现代化建设和国民经济的发展。

本次公司获奖项目"某型发动机工程"，是公司军民深度融合中武器装备及其配套产品的科研、生产、试验及相关工作中取得的科技成果。本次项目获奖是公司不断追求技术创新的成果，是公司具备高等级技术创新能力的体现。

本次获奖是国家对公司研发团队能力和企业科技创新工作的肯定，将激励公司不断技术创新，为国防建设技术进步和经济发展继续贡献力量。

特此公告。

四川海特高新技术股份有限公司
2015年10月14日

国泰基金管理有限公司调整长期停牌股票估值方法的公告

根据中国证券监督管理委员会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证监会[2008]38 号公告）以及中国证券投资基金业协会《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》（中基协发[2013]13号）的原则和有关要求，国泰基金管理有限公司（以下简称"本公司"）与托管银行商定，决定对本公司旗下基金持有的"碧水源"（证券代码：300070）、"万达信息"（证券代码：300168）和"南山铝业"（证券代码：600219）股票进行估值调整，自2015 年10 月12日起按指数收益法进行估值。

待该股票的交易体现出活跃市场交易特征后，将恢复为采用当日收盘价格进行估值，届时将不再另行公告。

特此公告。

国泰基金管理有限公司
2015 年10月14日