

广发双债添利债券型证券投资基金



金融自由化背景下银行、保险等传统债券配置机构出现重大投资方向的转换,传统债券投资机构提高对高收益资产资产的配置比例,高收益率信用债相收益突出。可转债方面,个股走势与股市类似,个别券种表现优异。尽管股市有接近10%的涨幅,但大蓝筹转债波动,基本没有绝对收益;部分中小盘个券涨幅突出。

本基金在本季度一开始即逐步降低所有债券,尤其是中低收益信用债的仓位,8月初尝试提高收益率资产的仓位,8月初开始加大转债投资。从方向上来看,这种操作方向符合市场走势,但由于仓位较低,其估值回升的弹性有限,组合净值仅受较大损失。

4.4报告期内本基金业绩表现
广发双债添利A类本报告期净值增长率为-1.81%,广发双债添利C类本报告期净值增长率为-1.91%。
5.1 报告期内本基金资产组合情况
5.1.1 权益投资
5.1.2 报告期内本基金资产组合情况
5.1.3 报告期内本基金资产组合情况
5.1.4 报告期内本基金资产组合情况
5.1.5 报告期内本基金资产组合情况
5.1.6 报告期内本基金资产组合情况
5.1.7 报告期内本基金资产组合情况
5.1.8 报告期内本基金资产组合情况
5.1.9 报告期内本基金资产组合情况
5.1.10 报告期内本基金资产组合情况
5.1.11 报告期内本基金资产组合情况
5.1.12 报告期内本基金资产组合情况
5.1.13 报告期内本基金资产组合情况
5.1.14 报告期内本基金资产组合情况
5.1.15 报告期内本基金资产组合情况
5.1.16 报告期内本基金资产组合情况
5.1.17 报告期内本基金资产组合情况
5.1.18 报告期内本基金资产组合情况
5.1.19 报告期内本基金资产组合情况
5.1.20 报告期内本基金资产组合情况
5.1.21 报告期内本基金资产组合情况
5.1.22 报告期内本基金资产组合情况
5.1.23 报告期内本基金资产组合情况
5.1.24 报告期内本基金资产组合情况
5.1.25 报告期内本基金资产组合情况
5.1.26 报告期内本基金资产组合情况
5.1.27 报告期内本基金资产组合情况
5.1.28 报告期内本基金资产组合情况
5.1.29 报告期内本基金资产组合情况
5.1.30 报告期内本基金资产组合情况
5.1.31 报告期内本基金资产组合情况
5.1.32 报告期内本基金资产组合情况
5.1.33 报告期内本基金资产组合情况
5.1.34 报告期内本基金资产组合情况
5.1.35 报告期内本基金资产组合情况
5.1.36 报告期内本基金资产组合情况
5.1.37 报告期内本基金资产组合情况
5.1.38 报告期内本基金资产组合情况
5.1.39 报告期内本基金资产组合情况
5.1.40 报告期内本基金资产组合情况
5.1.41 报告期内本基金资产组合情况
5.1.42 报告期内本基金资产组合情况
5.1.43 报告期内本基金资产组合情况
5.1.44 报告期内本基金资产组合情况
5.1.45 报告期内本基金资产组合情况
5.1.46 报告期内本基金资产组合情况
5.1.47 报告期内本基金资产组合情况
5.1.48 报告期内本基金资产组合情况
5.1.49 报告期内本基金资产组合情况
5.1.50 报告期内本基金资产组合情况
5.1.51 报告期内本基金资产组合情况
5.1.52 报告期内本基金资产组合情况
5.1.53 报告期内本基金资产组合情况
5.1.54 报告期内本基金资产组合情况
5.1.55 报告期内本基金资产组合情况
5.1.56 报告期内本基金资产组合情况
5.1.57 报告期内本基金资产组合情况
5.1.58 报告期内本基金资产组合情况
5.1.59 报告期内本基金资产组合情况
5.1.60 报告期内本基金资产组合情况
5.1.61 报告期内本基金资产组合情况
5.1.62 报告期内本基金资产组合情况
5.1.63 报告期内本基金资产组合情况
5.1.64 报告期内本基金资产组合情况
5.1.65 报告期内本基金资产组合情况
5.1.66 报告期内本基金资产组合情况
5.1.67 报告期内本基金资产组合情况
5.1.68 报告期内本基金资产组合情况
5.1.69 报告期内本基金资产组合情况
5.1.70 报告期内本基金资产组合情况
5.1.71 报告期内本基金资产组合情况
5.1.72 报告期内本基金资产组合情况
5.1.73 报告期内本基金资产组合情况
5.1.74 报告期内本基金资产组合情况
5.1.75 报告期内本基金资产组合情况
5.1.76 报告期内本基金资产组合情况
5.1.77 报告期内本基金资产组合情况
5.1.78 报告期内本基金资产组合情况
5.1.79 报告期内本基金资产组合情况
5.1.80 报告期内本基金资产组合情况
5.1.81 报告期内本基金资产组合情况
5.1.82 报告期内本基金资产组合情况
5.1.83 报告期内本基金资产组合情况
5.1.84 报告期内本基金资产组合情况
5.1.85 报告期内本基金资产组合情况
5.1.86 报告期内本基金资产组合情况
5.1.87 报告期内本基金资产组合情况
5.1.88 报告期内本基金资产组合情况
5.1.89 报告期内本基金资产组合情况
5.1.90 报告期内本基金资产组合情况
5.1.91 报告期内本基金资产组合情况
5.1.92 报告期内本基金资产组合情况
5.1.93 报告期内本基金资产组合情况
5.1.94 报告期内本基金资产组合情况
5.1.95 报告期内本基金资产组合情况
5.1.96 报告期内本基金资产组合情况
5.1.97 报告期内本基金资产组合情况
5.1.98 报告期内本基金资产组合情况
5.1.99 报告期内本基金资产组合情况
5.1.100 报告期内本基金资产组合情况

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名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
5.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
0 本基金本报告期末未持有股指期货合约。
0 本基金本报告期末未进行股指期货交易。
5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
5.9.1 本基金投资国债期货的投资政策
本基金投资国债期货以套期保值为主要目的,在构建债券投资组合时,可通过国债期货对冲利率风险。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
1.本基金本报告期末未持有国债期货。
2.本基金本报告期末未进行国债期货交易。
5.9.3 本基金投资国债期货的投资政策
1.本基金本报告期末未持有国债期货。
2.本基金本报告期末未进行国债期货交易。
5.10 投资组合报告摘要
5.10.1 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。
5.10.2 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。
5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	156,908.18
2	应收证券清算款	551,270.66
3	应收股利	-
4	应收利息	7,782,478.41
5	应收申购款	1,337,502.38
6	其他应收款	-
8	待摊费用	-
9	其他	-
9	合计	9,828,159.63

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110023	民生转债	32,858,237.40	10.66
2	113002	工行转债	29,961,782.20	9.72
3	110016	工行转债	12,227,693.40	3.97
4	113003	民生转债	4,322,760.00	1.40

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有股票。

6 开放式基金份额变动
单位:份

项目	广发双债添利债券A类	广发双债添利债券C类
本报告期期初基金份额总额	216,198,914.60	231,096,796.11
本报告期基金总申购份额	41,688,415.79	4,779,871.65
减:本报告期基金总赎回份额	96,640,121.27	98,301,921.86
本报告期末基金份额总额	161,247,209.12	138,474,745.90

7 基金管理人运用固有资金投资本基金管理基金情况
本报告期末未运用固有资金投资本基金管理基金。

8 备查文件目录
1.中国证监会批准广发双债添利债券型证券投资基金募集的文件
2.《广发双债添利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.《广发双债添利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.审计报告
9.广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

2.广发双债添利债券C类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.91%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.80%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	-1.81%	0.14%	-0.11%	0.25%	-1.70%	-0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发双债添利债券型证券投资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
0012年12月12日至2013年9月30日

1.广发双债添利债券A类:
阶段

阶段	净值增长率①
----	--------