

广发集利一年定期开放债券型证券投资基金

2014 第三季度报告

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：二〇一四年七月十八日

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7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，基金净值过往业绩并不预示其未来表现。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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2014年4月1日起至6月30日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	广发集利一年定期开放债券
基金代码	000627
基金运作方式	契约型定期开放
基金合同生效日	2013年8月21日
报告期末基金份额总额	13,139,727.254份

1.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	2014年4月1日-2014年6月30日	广发集利一年定期开放债券A	广发集利一年定期开放债券C
1.本期已实现收益	13,456,529.77	41,957,917.77	8,919,977.77
2.本期利润	42,234,558.68	13,903,521.87	0.0417
3.加权平均基金份额本期利润	0.0248	0.0170	0.0000
4.期末基金份额净值	1.040,642,566.52	330,848,201.28	1.023
5.期末基金资产净值	2,524,489,689.05	2,003,143,292.00	1,023

1.4 基金业绩比较基准

广发集利一年定期开放债券A类基金份额业绩比较基准：中债综合全价债券指数收益率+0.35%
广发集利一年定期开放债券C类基金份额业绩比较基准：中债综合全价债券指数收益率+0.25%

1.5 基金投资组合报告

3.1 主要资产配置

阶段	净增值率①	净增值率②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	4.25%	0.11%	0.88%	0.00%	3.37%	0.11%
过去六个月	4.16%	0.10%	0.88%	0.00%	3.28%	0.10%

3.2 基金合同生效以来基金资产净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集利一年定期开放债券A类基金份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
广发集利一年定期开放债券C类基金份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 基金合同生效以来基金资产净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集利一年定期开放债券A类基金份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
广发集利一年定期开放债券C类基金份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.5 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.6 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.7 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.8 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.9 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.10 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.11 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.12 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

与及时的分析和评估，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，超过授权权限的操作需经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易室按照“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。
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。

4.2 异常交易行为的专项说明

4.2.1 基金管理人投资行为与基金合同约定(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形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。
4.2.2 基金管理人投资行为与基金合同约定(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形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。
4.2.3 基金管理人投资行为与基金合同约定(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形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。

4.3 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.4 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.5 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.6 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.7 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.8 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.9 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.10 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.11 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.12 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.13 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.14 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.15 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.16 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.17 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.18 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

广发集鑫债券型证券投资基金

2014 第三季度报告

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：二〇一四年七月十八日

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7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，基金净值过往业绩并不预示其未来表现。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。
本报告中期财务资料未经审计。
本报告自2014年4月1日起至6月30日止。

1.2 基金产品概况

基金名称	广发集鑫债券
基金代码	000473
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年1月21日
报告期末基金份额总额	36,717,930.829份

1.3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	2014年4月1日-2014年6月30日	广发集鑫债券A	广发集鑫债券C
1.本期已实现收益	738,615.71	402,461.39	335,154.32
2.本期利润	779,349.23	424,147.24	355,202.00
3.加权平均基金份额本期利润	0.0115	0.0099	0.0100
4.期末基金份额净值	25,374,811.14	12,221,673.60	13,153,137.54
5.期末基金资产净值	24,740,390.18	11,977,540.64	12,762,849.54

1.4 基金业绩比较基准

广发集鑫债券A类基金份额业绩比较基准：中债综合全价债券指数收益率+0.35%
广发集鑫债券C类基金份额业绩比较基准：中债综合全价债券指数收益率+0.25%

1.5 基金投资组合报告

3.1 主要资产配置

阶段	净增值率①	净增值率②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	1.29%	0.08%	2.60%	0.12%	-1.31%	-0.04%
过去六个月	1.09%	0.07%	2.60%	0.12%	-1.51%	-0.05%

3.2 基金合同生效以来基金资产净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集鑫债券A类基金份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
广发集鑫债券C类基金份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.3 基金合同生效以来基金资产净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集鑫债券A类基金份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
广发集鑫债券C类基金份额净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

3.4 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.5 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.6 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.7 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.8 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.9 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.10 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.11 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.12 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.13 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

3.14 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.3 异常交易行为的专项说明
4.3.1 基金管理人投资行为与基金合同约定(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形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。
4.3.2 基金管理人投资行为与基金合同约定(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形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。
4.3.3 基金管理人投资行为与基金合同约定(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形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。

4.4 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.5 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.6 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.7 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.8 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.9 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.10 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.11 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.12 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.13 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.14 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.15 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.16 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.17 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.18 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.19 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介

4.20 基金管理人报告

1. 基金经理(或基金经理小组)简介
2. 基金经理(或基金经理小组)简介
3. 基金经理(或基金经理小组)简介