

广发双债添利债券型证券投资基金

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
报告送出日期：二〇一五年一月二十一日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构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2015年1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预示其未来表现。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。
本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	广发双债添利债券
基金代码	270044
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年9月20日
报告期末基金余额	686,153,536.09元
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求基金资产的长期增值，力争为基金份额持有人提供高于业绩比较基准的收益。
投资策略	1. 大类资产配置策略 本基金通过深入研究利率走势、收益曲线变化趋势和信用风险变化情况，并结合各大类资产的估值水平和风险收益特征，在符合相应投资比例的前提下，动态调整资产类别配置比例。 2. 固定收益类资产投资策略 本基金采用“自上而下”的债券资产配置和“自下而上”的“券种选择相结合”的固定收益类资产投资策略。在自上而下策略中，主要依据利率预期和信用风险偏好，确定各类型固定收益品种的权重，并在符合相应投资比例的前提下，动态调整资产类别配置比例。 3. 权益类资产投资策略 本基金采用“自下而上”的个股投资策略，主要依据个股的估值水平、成长性、行业地位、公司治理、财务状况等因素，在符合相应投资比例的前提下，动态调整资产类别配置比例。
业绩比较基准	中债总财富指数收益率×45%+中证全指指数收益率×55%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币型基金。
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
下属分级基金名称	广发双债添利债券A类 广发双债添利债券C类
下属分级基金的交易代码	270044 270045
报告期末下属分级基金资产总额	659,304,346.95元 26,847,201.54元

3.1 主要财务指标

§3 主要财务指标和基金净值表现	
主要财务指标	单位：人民币元
	2014年10月1日至2014年12月31日
	广发双债添利债券A类 广发双债添利债券C类
1.本期已实现收益	4,899,900.67 1,743,401.34
2.本期利润	-22,557,008.62 10,952,467.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0332 0.0205
4.期末基金资产净值	1,081,402,036.9 332,846,275.96
5.期末基金份额净值	1.064 1.055

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值。

(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

1. 广发双债添利债券A类：

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	本基金比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	2.11%	0.34%	19.56%	0.89%	-17.45%	-0.55%

2. 广发双债添利债券C类：

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	本基金比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	2.03%	0.34%	19.56%	0.89%	-17.53%	-0.55%

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的比较

广发双债添利债券型证券投资基金

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的比较

2012年9月20日至2014年12月31日

1. 广发双债添利债券A类：

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	25,779,500.00	3.33
2	央行票据	25,779,500.00	3.33
3	金融债券	46,734,344.87	6.37
4	企业债券	46,734,344.87	6.37
5	中期票据	46,734,344.87	6.37
6	其他	931,948,844.87	93.59
7	合计	931,948,844.87	93.59

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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。

5.5 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) 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.6 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) 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.7 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.10 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.12 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.13 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.14 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.15 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.16 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.18 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.19 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.20 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.21 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.22 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.23 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.24 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.25 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.26 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.27 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.28 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.29 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.30 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.31 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.32 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.33 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.34 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.35 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.36 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.37 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.38 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.39 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.40 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.41 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.42 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.43 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.44 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.45 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.46 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.47 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.48 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.49 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.50 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.51 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

广发理财30天债券型证券投资基金

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
报告送出日期：二〇一五年一月二十一日

§1 重要提示
基金管理人、基金托管人及基金服务机构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2015年1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预示其未来表现。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。
本报告自2014年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况	
基金名称	广发理财30天债券
基金代码	270046
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月14日
报告期末基金余额	23,183,274.33元
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提供稳定的收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外宏观经济形势、货币市场利率走势、市场资金供求状况、信用风险状况的基础上，动态调整资产类别配置比例，在符合相应投资比例的前提下，动态调整资产类别配置比例。
业绩比较基准	中证全指指数收益率×45%+中债总财富指数收益率×55%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币型基金。
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
下属分级基金名称	广发理财30天债券A类 广发理财30天债券B类
下属分级基金的交易代码	270046 270047
报告期末下属分级基金资产总额	23,183,274.33元 28,271,881.97元

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值。

(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

1. 广发理财30天债券A类：

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	本基金比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	1.2207%	0.0072%	0.3456%	0.0000%	0.8751%	0.0072%

2. 广发理财30天债券B类：

阶段	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益③	本基金比较基准收益④	①-③	②-④
过去三个月	1.2947%	0.0072%	0.3456%	0.0000%	0.9491%	0.0072%

注：本基金每日计算当日收益并开账，并在定期报告期末披露。

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的比较

广发理财30天债券型证券投资基金

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的比较

2013年9月14日至2014年12月31日

1. 广发理财30天债券A类：

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	25,779,500.00	3.33
2	央行票据	25,779,500.00	3.33
3	金融债券	46,734,344.87	6.37
4	企业债券	46,734,344.87	6.37
5	中期票据	46,734,344.87	6.37
6	其他	931,948,844.87	93.59
7	合计	931,948,844.87	93.59

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 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。

5.5 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) 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.6 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) 本基金本报告期末未持有国债期货。

5.7 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.10 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.11 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.12 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.13 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.14 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.15 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.16 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.17 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.18 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.19 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.20 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.21 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.22 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.23 报告期末本基金投资的资产支持证券明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5