

2013 第四季度报告

[illegible]

1	固定收益投资	84,977,494.05	37.74
	其中：债券	84,977,494.05	37.74
	资产支持证券	--	--
2	买入返售金融资产	8,000,000.00	3.55
	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	129,646,708.48	57.58
4	其他资产	2,534,115.18	1.13
5	合计	225,158,317.71	100.00

5.2 报告期内赎回金额

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		18.16
	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	39,103,660.45	22.06
	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

本基金在报告期内未发生债券正回购。报告期内债券正回购占债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%，本报告期内，本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均久期情况

5.3.1 投资组合平均久期报告期初

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	90

报告期内投资组合平均剩余期限最低值				75
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180天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。 5.2.2 报告期内投资组合平均剩余期限分布比例				
序号	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 (%)	
1	30天以内	63.55	22.06	
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	
2	30天(含)-60天	15.80	-	
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	
3	60天(含)-90天	-	-	
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	
4	90天(含)-180天	11.28	-	
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	
5	180天(含)-397天(含)	30.45	-	
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-	
	合计	121.08	22.06	
5.4 报告期末以债券品种分类的债券投资组合				
序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例	



5.6.2 本报告期末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。		
5.6.3 本基金投资的前十名券种的发行主体在本报告期内没有出现过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、处罚的情况。		
5.6.4 其他各项资产构成		
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	1,888,915.18
4	应收申购款	645,200.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,534,115.18

5.6 开放式基金份额变动

项目	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类
本报告期期初基金份额总额	236,438,791.58	19,554,280.30
本报告期基金总申购份额	73,035,647.46	19,596,197.80
减:本报告期基金总赎回份额	148,477,278.73	32,493,199.68
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	160,997,160.31	16,257,678.42

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用自有资金(1A)申购、赎回本基金的情况。

5.8 备查文件目录

- 备查文件目录
- 中国证监会批准广发理财30天债券B类证券投资基金募集的文件
- 《广发理财30天债券B类证券投资基金基金合同》
- 《广发基金管理人内部控制开放式基金业务规程》
- 《广发理财30天债券B类证券投资基金托管协议》
- 法律意见书
- 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 基金托管人业务资格批件、营业执照
- 存管协议
- 广州海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
- 联系方式
- 书面咨询:咨询时间为每工作日8:30-11:30、13:30-17:00,投资者可免收费查询,也可网上登录本网查阅复印件;
- 网站查询:基金管理人网站: <http://www.gffund.com.cn>;
- 投资者如有其他业务有疑问题,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话0510-8261020或020-33390999,或发电邮件件: service@gffund.com。

3	120222	12月开22	300,000	27,333,000.00	16.20
4	130201	13国开01	200,000	19,998,000.00	11.86
5	0402020	04国开02	200,000	19,942,000.00	11.82

5.6 报告期内公司公允价值计量第二级公允价值计量十名以上的资产和负债为：

3	120222	12国开22	300,000	27,333,000.00	16.20
4	130201	13国开01	200,000	19,998,000.00	11.86
5	0402020	04国开02	200,000	19,942,000.00	11.82

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

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

6.8	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	
6.8.1	报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细	
6.9	本基金报告期末未持有股指期货合约	
7	本基金本报告期末未进行股指期货交易。	
6.9.2	报告期末本基金投资的国债期货交易情况	
7	本基金本报告期末未持有股指期货合约。	
6.9.3	报告期末本基金未进行股指期货交易。	
6.9.4	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	
6.9.4.1	本基金本报告期末未持有国债期货	
7	本基金本报告期末未进行国债期货交易。	
6.9.4.2	报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细	
7	本基金本报告期末未持有国债期货合约。	
6.9.4.3	本基金本报告期末未持有国债期货。	
7	本基金本报告期末未进行国债期货交易。	
6.10	投资组合报告	
6.10.1	报告期末本基金投资的前十名股票中不存在被证监会监管部门立案调查,或在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚的情况	
6.10.2	报告期末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。	
6.10.3	其他资产构成	
	名称	金额(元)
1	存出保证金	93,815.34
2	应收证券清算款	1,819,722.45
3	应收股利	-
4	应收利息	7,307,740.43
5	应收申购款	21,483.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,242,761.54
6.10.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细	
		占基金资产净值

1	113002	行权费	6,081,000.00	比例(%)	3.60
6.10.5 报告期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。					
6.6 开放式基金份额变动					
项目		广发双债添利债券A	广发双债添利债券C		
本报告期期初基金份额总额		161,247,209.12	138,474,745.90		
本报告期基金总申购份额		4,180,755.52	641,866.30		
减:本报告期基金总赎回份额		79,277,132.18	52,374,234.47		

本报告期期末基金份额总额	86,150,832.46	86,742,377.73
<p>5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细</p> <p>本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认购、申购或赎回本基金)的情况。</p> <p>5.8 备查文件目录</p> <p>8.1 备查文件目录</p> <p>1.中国证监会批准“广发双融领先债券型证券投资基金募集的文件”</p> <p>2.“广发双融领先债券型证券投资基金基金合同”</p> <p>3.“广发基金管理有限公司开放式基金业务规则”</p> <p>4.“广发双融领先债券型证券投资基金托管协议”</p> <p>5.法律意见书</p> <p>6.基金管理人业务资格批件、营业执照</p> <p>7.基金管理人业务资格批件、营业执照</p> <p>8. 存管协议</p> <p>9. 广州市天河区维多利大道1号保盈国际广场南塔31-32楼</p> <p>8.2 查阅方式</p> <p>1. 书面查阅:查询时间为每工作日上午10:30-11:30,下午17:00。投资者可免费查阅,也可按照工本费购买复印件。</p> <p>2. 网站查阅:基金管理人网站:http://www.gffunds.com。</p> <p>投资者如欲查阅或复制,可向本基金管理人“广发基金管理有限公司”,咨询电话:95528(24小时) - 83309999,或发送邮件至:service@ff-funds.com。</p>		
<p style="text-align: right;">广发基金管理有限公司</p>		