广发理财7天债券型证券投资基金

2015 年度报告摘要

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:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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2016年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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代表其未来表现。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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发理财7天债券	
基金主代码	000037	
交易代码	000037	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月20日	
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	
报告期末基金份额总额	306,639,307.26份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
下属分级基金的交易代码	000037	000038
报告期末下属分级基金的份额总额	257,756,597.47份	48,882,709.79份

2.2 基金产品说明

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创造稳定的、高于业绩比较基准的当期收益。
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。
业绩比较基准	七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	洪渊
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年		2014年		2013年6月20日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
本期已实现收益	16,672,960.03	3,897,371.17	7,669,563.57	7,636,703.27	5,225,652.27	2,624,127.67
本期利润	16,672,960.03	3,897,371.17	7,669,563.57	7,636,703.27	5,225,652.27	2,624,127.67
本期净值收益率	4.2331%	4.5359%	5.1704%	5.0146%	2.4421%	2.4791%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末		2014年末		2013年末	
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
期末基金资产净值	257,756,597.47	48,882,709.79	398,377,200.83	75,341,708.91	105,181,669.67	0.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注:1.所述基金财务指标不包括持有人认购和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字。

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,由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.本基金每个运作期期末收益结转。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1.广发理财7天债券A:

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
过去三个月	0.7548%	0.0064%	0.3450%	0.0000%	0.4098%	0.0064%
过去六个月	1.7254%	0.0102%	0.6900%	0.0000%	1.0354%	0.0102%
过去一年	4.2331%	0.0115%	1.3688%	0.0000%	2.8643%	0.0115%
自基金合同生效起至今	12.2994%	0.0097%	3.4688%	0.0000%	8.8306%	0.0097%

2.广发理财7天债券B:

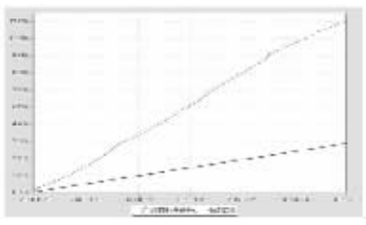
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.8288%	0.0064%	0.3450%	0.0000%	0.4838%	0.0064%
过去六个月	1.8743%	0.0102%	0.6900%	0.0000%	1.1843%	0.0102%
过去一年	4.5359%	0.0115%	1.3688%	0.0000%	3.1671%	0.0115%
自基金合同生效起至今	12.4995%	0.0099%	3.4688%	0.0000%	9.0307%	0.0099%

注:本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

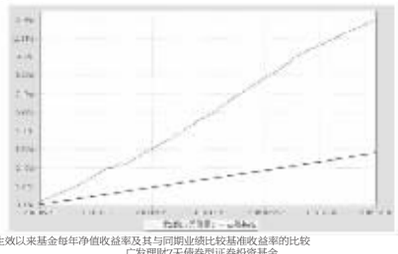
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发理财7天债券型证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年6月20日至2015年12月31日)

1.广发理财7天债券A



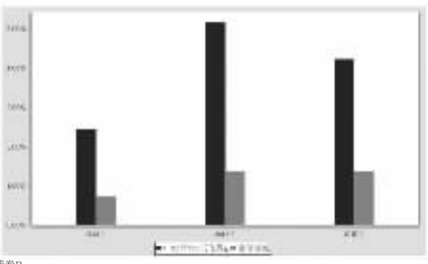
2.广发理财7天债券B



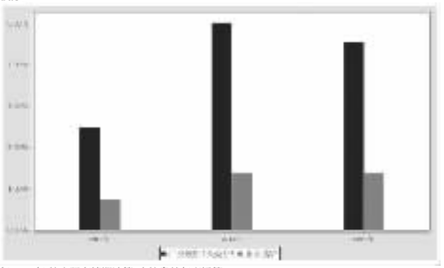
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发理财7天债券型证券投资基金
自基金合同生效以来基金净收益率与业绩比较基准收益率的对比图

1.广发理财7天债券A



2.广发理财7天债券B



注:合同生效当年(2013年)按实际存续期计算,未按日然年度折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

广发理财7天债券A:

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015年	14,959,284.74	1,860,681.98	-147,006.69	16,672,960.03	-
2014年	6,420,887.91	1,096,910.53	151,765.13	7,669,563.57	-
2013年	3,419,698.13	1,742,436.27	63,517.87	5,225,652.27	-
合计	24,799,870.78	4,700,028.78	68,276.31	29,568,175.87	-

广发理财7天债券B:

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015年	3,588,431.28	349,110.13	-40,170.24	3,897,371.17	-
2014年	6,635,618.13	948,597.46	52,487.68	7,636,703.27	-
2013年	718,986.12	1,905,141.55	0.00	2,624,127.67	-
合计	10,943,035.53	3,202,849.14	12,317.44	14,158,202.11	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91号文批准,于2003年8月5日成立,注册资本1.2688亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、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、康芙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。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理(QDII)和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和24个部门:综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外,还出资设立了广发国际资产管理有限公司(香港子公司)、瑞元资本管理有限公司、参股了广证通投资有限公司。

截至2015年12月31日,本基金管理人管理八十八只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金(LOF)、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深300指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证500指数证券投资基金(LOF)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发祥远灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证100指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克100指数证券投资基金、广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财30天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财7天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内交易时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发我袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对沖套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚宏混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生