

广发集鑫债券型证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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

报告期末日期:二〇一七年四月二十二日

重要提示

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、完整性和及时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的约定，于2017年4月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配政策和基金合同的内容，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。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至3月31日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	广发集鑫债券
基金代码	000971
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月03日
报告期末基金资产总额	2,672,740,630.96元
投资目标	本基金通过合理的资产配置，力争实现基金资产的持续增值。
投资策略	本基金将密切关注宏观经济、政策、市场动态和估值水平等影响因素，通过灵活的资产配置，对部分债券品种进行优化，综合平衡收益与风险。
业绩比较基准	中债总财富(国债)指数×60%+中债企业债指数×40%
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金，低于股票型基金。
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
下属分级基金的基金简称	广发集鑫A
下属分级基金的交易代码	000971
报告期末下属分级基金的份额总额	2,669,620,799.41份
报告期末下属分级基金的资产净值	4,211,737.29份

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期(2017年1月1日至2017年3月31日)

广发集鑫债券A 广发集鑫债券C

1.主要财务指标

1.1本期已实现收益 1,114,889.89元 -271.17元

1.2本期利润 11,040,799.67元 17,764.70元

1.3期末可供分配基金份额利润 0.0041元 0.0041元

1.4期末基金资产净值 3,004,369,415.44元 4,211,737.29元

1.5期末基金份额净值 1.151元 1.151元

注:(1) 所示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示的数字。

(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。

2.基金净值表现

3.2.1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.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.05% -1.6% 0.10% 1.01% -0.03%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

2.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化与其同期业绩比较基准收益变动的比较

广发集鑫债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益的历史走势图对比图

(2014年1月27日至2017年3月31日)

2.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

3.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

4.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

5.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

6.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

7.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

8.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

9.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

10.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

11.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

12.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

13.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

14.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

15.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

16.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

17.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

18.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

19.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

20.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

21.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

22.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

23.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

24.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

25.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

26.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

27.广发集鑫债券A:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%

过去二个月 0.30% 0.06% -1.6% 0.10% 1.00% -0.06%

28.广发集鑫债券C:

阶段 净值增长(%) -0.2% 0.02% -0.6% 0.03% 0.10% -0.06%