广发集利一年定期开放债券型证券投资基金

2013 年度 报告摘要

2013年12月31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
报告送出日期:二〇一四年三月三十一日

§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2014年3月25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2013年8月21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	广发集利一年定期开放债券	
基金主代码	000267	
交易代码	000267	
基金运作方式	契约型定期开放式	
基金合同生效日	2013年8月21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	1,319,727,276.43份	
下属分级基金的基金简称	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
下属分级基金的交易代码	000267	000268
报告期末下属分级基金的份额总额	986,118,789.80份	333,608,486.63份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类品种,不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购或股票增发。本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征,在符合本基金相关投资比例规定的前提下,决定组合的久期水平、期限结构和类属配置,并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的投资收益。
业绩比较基准	银行一年期定期存款税后利率+0.5%。 其中,银行一年期定期存款利率是指中国人民银行公布的金融机构一年期人民币存款基准利率。
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率低于股票型基金、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	赵会军
	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	2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31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
本期已实现收益	14,251,729.58	4,335,238.31
本期利润	-9,371,432.54	-3,648,094.19
加权平均基金份额本期利润	-0.0095	-0.0109
本期加权平均净值利润率	-0.95%	-1.09%
本期基金份额净值增长率	-1.00%	-1.10%
3.1.2期末数据和指标	2013年末	
	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
期末可供分配利润	-9,371,432.54	-3,648,094.19
期末可供分配基金份额利润	-0.0095	-0.0109
期末基金资产净值	976,747,357.26	329,960,392.44
期末基金份额净值	0.990	0.989
3.1.3累计期末指标	2013年末	
	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
基金份额累计净值增长率	-1.00%	-1.10%

注:(1)本基金合同2013年8月21日生效,至披露时点未满一年。
(2)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。
(3)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。
(4)期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现
3.2.1 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. 广发集利一年定期开放债券A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.30%	0.08%	0.89%	0.00%	-2.19%	0.08%
自基金合同生效起至今	-1.00%	0.07%	1.29%	0.00%	-2.29%	0.07%

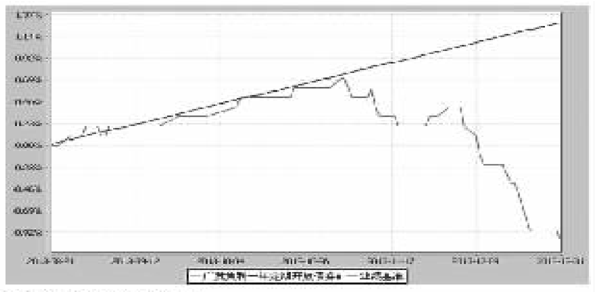
2. 广发集利一年定期开放债券C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-1.40%	0.09%	0.89%	0.00%	-2.29%	0.09%
自基金合同生效起至今	-1.10%	0.08%	1.29%	0.00%	-2.39%	0.08%

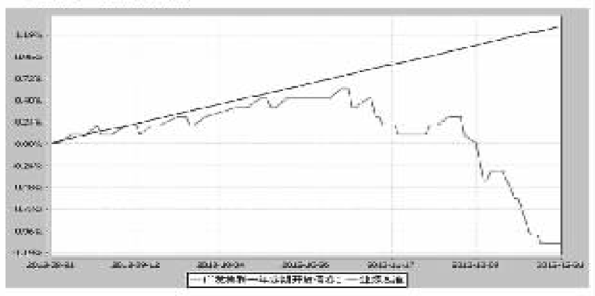
1、本基金业绩比较基准为,银行一年期定期存款税后利率+0.5%。
2、业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集利一年定期开放债券型证券投资基金
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年8月21日至2013年12月31日)

1、广发集利一年定期开放债券A



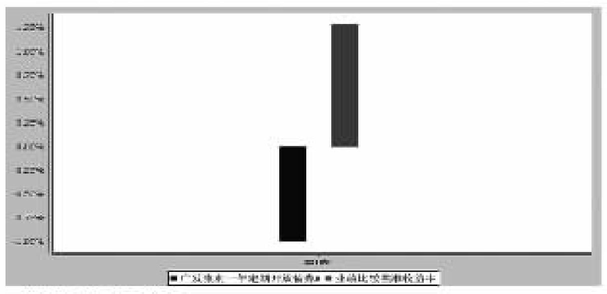
2. 广发集利一年定期开放债券C:



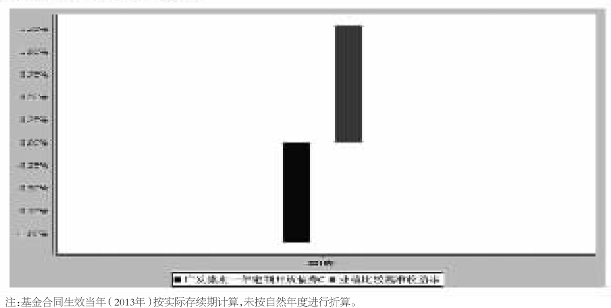
注:(1)本基金合同生效日期为2013年8月21日,至披露时点本基金成立未满一年。
(2)本基金建仓期为基金合同生效后6个月,至披露时点本基金仍处于建仓期。
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发集利一年定期开放债券型证券投资基金
自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、广发集利一年定期开放债券A



2. 广发集利一年定期开放债券C



注:基金合同生效当年(2013年)按实际存续期计算,未按自然年度进行折算。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金自合同生效日(2013年8月11日)至报告期末未进行利润分配。

§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1.2亿元人民币。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、康美药业股份有限公司和广州科技风险投资有限公司。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19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、金融工程部、研究发展部、投资管理部、固定收益部、机构投资部、数量投资部、量化投资部、机构理财部、市场拓展部、电商及客服部、国际业务部。此外,还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以及北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司、深圳理财中心、杭州理财中心。

截至2013年12月31日,本基金管理人管理四十五只开放式基金---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、广发亚太(除日本)精选股票证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥保本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、广发中债金融债指数证券投资基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实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和广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金, 管理资产规模为1204.01亿元。同时,公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
代宇	本基金的基金经理;广发聚财信用债券基金的基金经理;广发聚利债券基金的基金经理;广发聚鑫债券基金的基金经理	2013-08-21	-	8	女,中国籍,金融学硕士,持有证券业执业资格证书,2005年7月至2011年6月先后任广发基金管理有限公司固定收益部研究员及交易员、国际业务部研究员、机构投资部专户投资经理,2011年7月调入固定收益部任投资人员,2011年8月5日起任广发聚利债券基金的基金经理,2012年3月13日起任广发聚财信用债券基金的基金经理,2013年6月5日起任广发聚鑫债券基金的基金经理,2013年8月21日起任广发集利一年定期开放债券基金的基金经理。

注:(1)基金经理的"任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。
(2)证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发集利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.3.1公平交易制度和控制方法

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,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,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同时同向交易,公司可以启用公平交易模块,确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控, 保证分配结果符合公平交易的原则;对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息,对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释; 公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析,未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况,表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2013年,债券市场先涨后跌,跌幅较大,10年国债收益率创04年以来新高。

国内实体经济在第1季度有温和改善,体现在房地产销售数据和投资增速同比回升明显,PMI指数也连续处于50以上。但是复苏仅是昙花一现,3月PMI等景气数据体现出旺季不旺的特征,紧接着第2季度经济迅速走弱,复苏动能进一步衰减。整个上半年,伴随经济乏力的是通胀整体低位运行,经济通缩的迹象有所显现。

下半年,国内外经济基本面出现好转,主要得益于中国强劲的政府基建投资、房地产投资带来的指标向好。中采和汇丰PMI都创出新高,其中11月中采数据与10月持平,为全年最高的51.4。资本市场继续对之前过度悲观的预期做出修正,股市震荡,债市继续下跌。

鉴于基本面的有利支撑,债券市场在上半年总体上涨,信用债保持了相对利率债的强势。而下半年,随着经济基本面的转变,央行的操作又转而坚持中性偏紧。利率债投标收益率屡次继续创出新高,带动利率债二级市场价格下跌,同时信用债供给也大增,信用利差出现回归,信用债和利率债都大幅下跌。

截止12月31日,中债综合净价指数下跌4.65%;分品种看,中债国债总净价指数下跌6.48%;中债金融债净价指数下跌5.8%;中债企业债净价指数下跌3.84%

可转债表现跟随股市,先涨后跌。全年录得负收益。中证转债指数下跌1.42%。

货币市场在2013年全年偏紧, 下半年紧过上半年,6月20日还发生了业内瞩目的钱荒事件。银行间七天回购利率从3%-4%的平台上升到4%-6%。期间,央行持续传达偏紧的政策意图,市场预期不稳定。

作为新基金,我们在建仓初期偏谨慎,配置少量债券和些许银行协议存款,但是仍然在第四季度出现了负收益。之后我们进行了仓位调整,力争为新的一年做好开局。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

广发集利一年定期开发债基A类本报告期收益率为-1%,业绩比较基准收益率为1.29%;广发集利一年定期开发债基C类本报告期收益率为-1.1%,业绩比较基准收益率为1.29%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年,我们认为债券市场可能不再纯粹单边下跌,而是出现振荡,具备波段机会,至于是否出现反转行情,尚需密切跟踪经济基本面的变化,尤其是信用风险事件的演化。

2013年4季度,债市出现了相对较大幅度的调整。从经济基本面和资金面来看,相较上个季度没有明显变化,所以债市的表现维持弱势。同时,原本因为票息较高受到青睐的信用债,在第4季度集中补跌。

新的一年我们认为债券面临的环境并不十分有利。首先,经济基本面和资金面发生方向性变化的可能性较小,所以债市不具备变局的基础;其次,也是最主要的因素,是近两年社会融资快速增长令人担忧。债券的价格归根到底是由债券的供需决定的。从供给来看,审计本身只是对既有的债务一个确认,对市场冲击不会太大。但是整个社会的融资需求膨胀较快,政府对债务的态度依然不算明确。从需求来看,在非标融资旺盛的情况下,债券投资需求明显受到挤压。目前对于非标的行政管制,并没有起到明显的效果。简单来说,非标的主要融资方,也就是地方投融资平台和房地产,对利率相对不是很敏感,而非标的购买方,比如银行,又因为存款不稳定甚至流失,对利润有很高的诉求。行政的控制起到效果尚有待时日,那么有可能标债市场还会承压一段时间。

但是鉴于利率整体水平在去年有较大幅度的抬升,出现波段操作机会的可能性很大。

最大的不确定性来自于央行的态度,去年央行偏紧的思路一直比较坚定,但是今年开年宏观数据不容乐观,央行是保持一贯的思路,还是会有所调整,其选择足以左右市场。

我们将继续密切关注基本面和政策面的变化,捕捉投资机会,力保组合净值平稳增长。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会,按照相关法律法规和证监会的相关规定,负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序,并选取适当的估值方法,经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括:公司分管投研、估值的副总经理、督察长、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行,并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素,向估值委员会提出估值建议,确保估值的公允性。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查,确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立,基金经理不参与估值的具体流程,但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况,可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突,一切以维护基金持有人利益为准则。本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司签署服务协议,由其按合同约定提供银行间同业市场交易的债券品种的估值数据。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中"基金的收益与分配"之"(三)基金收益分配原则"的相关规定,自合同生效日(2013年08月21日)至报告期末未进行利润分配,符合合同规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对广发集利一年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,广发集利一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发集利一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,广发集利一年定期开放债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发集利一年定期开放债券型证券投资基金2013年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师 郭新华 郭增光签字出具了德师报(审)字(14)第P0468号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:广发集利一年定期开放债券型证券投资基金
报告截止日:2013年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年12月31日
资 产:	-
银行存款	952,984,918.16
结算备付金	13,173,463.36
存出保证金	94,297.79
交易性金融资产	846,764,641.60
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	846,764,641.60
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	96,000,264.00
应收证券清算款	-
应收利息	14,356,829.07
应收股利	-
应收申购款	-
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,923,374,413.98
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日
负 债:	-
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	614,407,955.33
应付证券清算款	-
应付赎回款	-
应付管理人报酬	782,352.45
应付托管费	223,529.29
应付销售服务费	112,902.85
应付交易费用	6,565.12
应交税费	-
应付利息	1,026,359.24
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	107,000.00
负债合计	616,666,664.28
所有者权益:	-
实收基金	1,319,727,276.43
未分配利润	-13,019,526.73
所有者权益合计	1,306,707,749.70
负债和所有者权益总计	1,923,374,413.98

注:1.报告截止日2013年12月31日,广发集利一年定期开放债券A基金份额净值人民币0.990元,基金份额总额986,118,789.80份;广发集利一年定期开放债券C基金份额净值人民币0.989元,基金份额总额333,608,486.63份;总份额总额1,319,727,276.43份。
2.本会计期间为2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

7.2 利润表
会计主体:广发集利一年定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	-4,758,490.47
1.利息收入	35,137,639.30
其中:存款利息收入	16,709,286.41
债券利息收入	17,623,882.07
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	804,470.82
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-8,289,635.15
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	-8,289,635.15
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-31,606,494.62
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	-
减:二、费用	8,261,036.26
1.管理人报酬	3,347,074.18
2.托管费	956,306.95
3.销售服务费	483,222.80
4.交易费用	40,351.05
5.利息支出	3,262,186.88
其中:卖出回购金融资产支出	3,262,186.88
6.其他费用	171,894.40
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-13,019,526.73
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-13,019,526.73

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:广发集利一年定期开放债券型证券投资基金
本报告期:2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,319,727,276.43	-	1,319,727,276.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-13,019,526.73	-13,019,526.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,319,727,276.43	-13,019,526.73	1,306,707,749.70

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:
基金管理人负责人:王志伟,主管会计工作负责人:窦刚,会计机构负责人:张晓章

7.4 报表附注
7.4.1基金基本情况

广发集利一年定期开放债券型证券投资基金("本基金")经中国证券监督管理委员会("中国证监会")证监许可[2013]839号《关于核准广发集利一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发集利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2013年8月21日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为2013年7月29日 至2013年8月16日,本基金为契约型开放式,以定期开放方式运作,存续期限不定,根据认购费用收取方式不同将基金份额分为不同类别。本基金募集资金总额为人民币1,319,727,276.43元,有效认购户数为7,118户。其中广发集利一年定期开放债券A类基金("A类基金")扣除认购费用后的募集资金净额为人民币985,931,790.88元,认购资金在募集期间的利息为人民币186,998.92元;广发集利一年定期开放债券C类基金("C类基金")的募集资金净额333,565,498.03元,认购资金在募集期间的利息为人民币42,988.60元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转债)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、集合债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款税后利率+0.5%。

本基金的财务报表于2014年3月25日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称"企业会计准则")及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4重要会计政策和会计估计
7.4.4.1会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。本会计期间为2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日止。

7.4.4.2记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类
1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益;应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的,才能终止确认该金融负债或其一部分。

1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产
(1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价,于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本;股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票,于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例,计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

(2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益,上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

(3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账,相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证),在除权日按照持有的股数及获赠比例,计算确定增加的权证数量,成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证, 于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

2. 贷款及应收款项
买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

3. 其他金融负债
卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账,相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时,应采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。

具体投资品种的估值方法如下:
(1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会2008年9月12日发布的证监会公告[2008]38号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定,若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的,经基金管理人估值委员会同意,可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法),调整最近交易市价,确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资,按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值,在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票,于同一股票上市后按交易所上市的同一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票,若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,以估值日证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价为公允价值;若在证券交易所上市的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按中国证监会相关规定处理。

(2) 债券投资

交易所上市实行净价交易的债券按估值日证券交易所上市的收盘价为公允价值。交易所上市但未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含债券应收利息后的净价为公允价值。未上市流通的债券按成本估值。

全国银行间同业市场交易的债券采用估值技术确定公允价值。

同一债券同时在两个或两个以上市场交易的,按债券所处的市场分别确定公允价值。

(3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前,采用估值技术确定公允价值,如估值技术难以可靠计量,则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前,采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量,则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权,以及停止交易但未行权的权证,采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值,基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级可分为:

第1层级:同类资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价;
第2层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除市场报价以外的有关资产或负债的输入值估值;
第3层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且目前可执行该种法定权利,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例,损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量
1. 利息收入
(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。
(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内,按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额,逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后,逐日确认债券利息收入。
(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息收入。
2. 投资收益
(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。
(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。
(3) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。
(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。
3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

7.4.4.10费用的确认和计量
1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.70%的年费率逐日计提。
2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值×0.20%的年费率逐日计提。
3. 本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的0.40%年费率计提。
4. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。
5. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息支出。

7.4.4.11基金的收益分配政策

1.封闭期间(指基金红利发放日处于封闭期),基金收益分配采用现金方式;开放期间(指基金红利发放日处于开放期),基金收益分配方式分为现金分红与红利再投资, 投资人可选择获取现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资,如投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金红利;如投资者在同一销售机构选择的分红方式不同,基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准;

2.在符合有关基金分红条件的前提下,本基金收益每季度最少分配一次,本基金每年收益分配次数最多为12次,每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的30%,若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配;

3.基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

4.由于本基金A类基金份额不收取销售服务费,而C类基金份额收取销售服务费,各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权;

5.法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度,本基金整体为一个报告分部,且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及 计量基础一致。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.5.1会计政策变更的说明
本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。
7.4.5.2会计估计变更的说明
本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。
7.4.5.3差错更正的说明
本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1. 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不缴纳营业税。

2. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税,个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事A股买卖,自2008年9月19日起,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,受让方不再缴纳证券(股票)交易印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技风险投资有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited(广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司(注)	基金管理人控股子公司

注:广发基金管理有限公司于2013年6月14日在珠海设立控股子公司瑞元资本管理有限公司。
除此之外,本报告期内不存在其他控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易
7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易
7.4.8.1.1股票交易
本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。
7.4.8.1.2权证交易
本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。
7.4.8.1.3债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	756,969,257.40	100.00%

7.4.8.1.4债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	6,766,100,000.00	100.00%

7.4.8.1.5应支付关联方的佣金
本基金本报告期内无应支付关联方的佣金,本报告期末无应付关联方佣金余额。
7.4.8.2关联方报酬
7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,347,074.18
其中:支付销售机构的客户维护费	1,888,468.93

注:本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.70%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×0.70%÷当年天数
H为每日应计提的基金管理费
E为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	956,306.95

注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.20%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

7.4.8.2.3销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
中国工商银行股份有限公司	-	459,452.45	459,452.45
广发证券股份有限公司	-	2,055.59	2,055.59
广发基金管理有限公司	-	3,998.85	3,998.85
合计	-	465,506.89	465,506.89

注:本基金A类基金份额不收取销售服务费,C类基金份额的销售服务费年费率为0.40%。
C类份额基金销售服务费按前一日C类份额基金资产净值的0.40%年费率计提。计算方法如下:
H=E×0.40%÷当年天数
H为C类基金份额每日应计提的销售服务费
E为C类份额前一日基金资产净值
销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产一次性支付给基金管理人,经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本报告期内本基金无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
7.4.8.4各关联方投资本基金的情况
7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。
7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
广发集利一年定期开放债券A
本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。
广发集利一年定期开放债券C
本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。
7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年8月21日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	72,984,918.16	255,161.15

注:本基金的部分银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率或约定利率计息。
7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。
7.4.9期末(2013年12月31日)本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。
7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票
本基金本报告期末无持有暂时停牌等流通受限股票。
7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券
7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额483,107,955.33元,是以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
138028	13沧州建投债	2014-01-02	97.79	200,000.00	19,558,000.00
1380312	13湛江基投债	2014-01-02	96.58	500,000.00	48,290,000.00
1280386	12绍城投债	2014-01-02	95.97	500,000.00	47,985,000.00
1280417	12兴锦债	2014-01-02	97.90	500,000.00	48,950,000.00
1280361	12盐城城南债	2014-01-02	96.98	100,000.00	9,698,000.00
1280325	12唐山南湖债	2014-01-02	98.10	700,000.00	68,670,000.00
1380336	13丹投债02	2014-01-02	96.61	115,000.00	11,110,150.00
1280396	12张经开发债	2014-01-02	96.91	300,000.00	29,073,000.00
1380321	13郴高科债	2014-01-02	96.98	500,000.00	48,490,000.00
1380271	13乳山国资债	2014-01-03	96.27	300,000.00	28,881,000.00
1280353	12寿光债	2014-01-03	96.35	500,000.00	48,175,000.00
1380291	13塔城债	2014-01-03	97.26	80,000.00	7,780,800.00
1280361	12盐城城南债	2014-01-03	96.98	100,000.00	9,698,000.00
1380336	13丹投债02	2014-01-06	96.61	35,000.00	3,381,350.00
1380248	13铜城投债	2014-01-06	96.06	600,000.00	57,636,000.00
合计				5,030,000.00	487,376,300.00

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币131,300,000.00元,于2014年1月14日、2014年3月19日、2014年3月26日及2014年3月27日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
1.公允价值
(1)不以公允价值计量的金融工具
不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值接近于公允价值。
(2)以公允价值计量的金融工具
(i)金融工具公允价值计量的方法
本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注7.4.4.5。
(ii)各层级金融工具公允价值
于2013年12月31日,本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为146,197,744.10 元,属于第二层级的余额为700,566,897.50 元,无属于第三层级的余额。
(iii)公允价值所属层级间的重大变动
对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第二层级或第三层级,上述事项解除时将相关股票和债券的公允价值列入第一层级。
(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额
无。
2.除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8投资组合报告

8.1期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	846,764,641.60	44.02
	其中:债券	846,764,641.60	44.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	96,000,264.00	4.99
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	966,158,381.52	50.23
7	其他各项资产	14,451,126.86	0.75
8	合计	1,923,374,413.98	100.00

8.2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。
8.3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。
8.4报告期内股票投资组合的重大变动
8.4.1累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细
本基金本报告期内未持有股票。
8.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细
本基金本报告期内未持有股票。
8.4.3买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
本基金本报告期内未持有股票。
8.5期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	846,764,641.60	64.80
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	846,764,641.60	64.80

8.6期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	126011	08石化债	1,030,810	102,472,822.10	7.84
2	1280325	12唐山南湖债	700,000	68,670,000.00	5.26
3	1380291	13塔城债	700,000	68,082,000.00	5.21
4	1380266	13蚌埠城投债	700,000	67,676,000.00	5.18
5	1380271	13乳山国资债	700,000	67,389,000.00	5.16

8.7期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。
8.8 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贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属投资。
8.9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。
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细
(1)本基金本报告期末未持有股指期货。
(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。
8.11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)本基金本报告期内未进行国债期货交易。
8.12 投资组合报告附注
8.12.1本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现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、处罚的情形。
8.12.2报告期内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。
8.12.3期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	94,297.79
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,356,829.07
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,451,126.86

8.12.4期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
8.12.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发集利一年定期开放债券A	4,542	217,111.14	25,496,527.89	2.59%	960,622,261.91	97.41%
广发集利一年定期开放债券C	2,608	127,917.36	-	-	333,608,486.63	100.00%
合计	7,150	184,577.24	25,496,527.89	1.93%	1,294,230,748.54	98.07%

9.2期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发集利一年定期开放债券A	99,405.58	0.0101%
	广发集利一年定期开放债券C	-	-
	合计	99,405.58	0.0075%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0;
本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份(含)。

§10开放式基金份额变动

单位:份

项目	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
基金合同生效日(2013年8月21日)基金份额总额	986,118,789.80	333,608,486.63
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-	-
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	986,118,789.80	333,608,486.63

注:本基金于本报告期间成立,基金合同生效日为2013年8月21日。

§11重大事件揭示

11.1基金份额持有人大会决议
本报告期内未召开基金份额持有人大会。
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
本报告期内,基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。
11.4 基金投资策略的改变
本报告期内本基金投资策略未发生改变。
11.5为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内,因业务发展需要,广发基金管理有限公司第四届董事会第二十六次会议表决方案(五)通过关于聘请2013年度基金审计机构的议案,本基金改聘德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)。本报告期,本基金应支付德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计费64,000.00元。该事务所为本基金提供审计服务1年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
11.7.1基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	5	-	-	-	-	新增5个
北京高华	1	-	-	-	-	新增1个
渤海证券	1	-	-	-	-	新增1个
德邦证券	1	-	-	-	-	新增1个
第一创业证券	1	-	-	-	-	新增1个
东北证券	2	-	-	-	-	新增2个
东方证券	2	-	-	-	-	新增2个
东海证券	1	-	-	-	-	新增1个
东吴证券	2	-	-	-	-	新增2个
东兴证券	3	-	-	-	-	新增3个
方正证券	4	-	-	-	-	新增4个
光大证券	3	-	-	-	-	新增3个
广发证券	7	-	-	-	-	新增7个
广州证券	2	-	-	-	-	新增2个
国都证券	1	-	-	-	-	新增1个
国海证券	1	-	-	-	-	新增1个
国金证券	1	-	-	-	-	新增1个
国联证券	1	-	-	-	-	新增1个
国盛证券	1	-	-	-	-	新增1个
国泰君安	4	-	-	-	-	新增4个
国信证券	4	-	-	-	-	新增4个
国元证券	2	-	-	-	-	新增2个
海通证券	2	-	-	-	-	新增2个
宏源证券	3	-	-	-	-	新增3个
华安证券	1	-	-	-	-	新增1个
华宝证券	1	-	-	-	-	新增1个
华创证券	1	-	-	-	-	新增1个
华福证券	2	-	-	-	-	新增2个
华融证券	1	-	-	-	-	新增1个
华泰联合	4	-	-	-	-	新增4个
江海证券	1	-	-	-	-	新增1个
联讯证券	2	-	-	-	-	新增2个
民生证券	1	-	-	-	-	新增1个
南京证券	1	-	-	-	-	新增1个
平安证券	4	-	-	-	-	新增4个
齐鲁证券	3	-	-	-	-	新增3个
瑞银证券	1	-	-	-	-	新增1个
厦门证券	1	-	-	-	-	新增1个
山西证券	1	-	-	-	-	新增1个
申银万国	3	-	-	-	-	新增3个
世纪证券	1	-	-	-	-	新增1个
万联证券	2	-	-	-	-	新增2个
西部证券	1	-	-	-	-	新增1个
湘财证券	1	-	-	-	-	新增1个
新时代证券	1	-	-	-	-	新增1个
信达证券	2	-	-	-	-	新增2个
兴业证券	4	-	-	-	-	新增4个
银河证券	3	-	-	-	-	新增3个
英大证券	1	-	-	-	-	新增1个
长城证券	1	-	-	-	-	新增1个
长江证券	3	-	-	-	-	新增3个
招商证券	3	-	-	-	-	新增3个
浙商证券	1	-	-	-	-	新增1个
中航证券	1	-	-	-	-	新增1个
中金公司	2	-	-	-	-	新增2个
中投证券	3	-	-	-	-	新增3个
中信建投	4	-	-	-	-	新增4个
中信证券	3	-	-	-	-	新增3个
中银国际	1	-	-	-	-	新增1个
中原证券	2	-	-	-	-	新增2个
东莞证券	1	-	-	-	-	新增1个
中信证券(浙江)	1	-	-	-	-	新增1个
财富证券	2	-	-	-	-	新增2个
中天证券	1	-	-	-	-	新增1个
财富里昂	1	-	-	-	-	新增1个
川财证券	2	-	-	-	-	新增2个
华鑫证券	2	-	-	-	-	新增2个
民族证券	1	-	-	-	-	新增1个
首创证券	1	-	-	-	-	新增1个
上海证券	1	-	-	-	-	新增1个
太平洋证券	2	-	-	-	-	新增2个

注:1、交易席位选择标准:
(1)财务状况良好,在最近一年内无重大违规行为;
(2)经营行为规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
(3)具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源,满足投资组合进行证券交易的需要;
(4)具有较强的研究和行业分析能力,能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告,并能根据基金投资的特殊要求,提供专门的研究报告;
(5)能积极为公司投资业务的开展,提供良好的信息交流和客户服务;
(6)能提供其他基金运作和管理所需的服务。
2、交易席位选择流程:
(1)对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估,确定选用交易单元的券商。
(2)协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。

11.7.2基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	756,969,257.40	100.00%	6,766,100,000.00	100.00%	-	-

广发基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日