广发理财30天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1月14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30天债券	
基金主代码	270046	
交易代码	270046	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月14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	177,254,838.73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的份额总额	160,997,160.31份	16,257,678.42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	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1月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类
本期已实现收益	30,928,834.92	8,771,428.33
本期利润	30,928,834.92	8,771,428.33
本期净值收益率	4.0681%	4.3605%
3.1.2期末数据和指标	2013年末	
	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类
期末基金资产净值	160,997,160.31	16,257,678.42
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3累计期末指标	2013年末	
	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类
累计净值收益率	4.0681%	4.3605%

注:(1)本基金合同于2013年1月14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,由于货币市场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。

(4)本基金每个运作期期末例行收益结转(如遇节假日顺延)。

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30天债券A类:

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	1.2415%	0.0011%	0.3450%	0.0000%	0.8965%	0.0011%
过去六个月	2.4110%	0.0028%	0.6900%	0.0000%	1.7210%	0.0028%
自基金合同生效起至今	4.0681%	0.0058%	1.3200%	0.0000%	2.7481%	0.0058%

2. 广发理财30天债券B类:

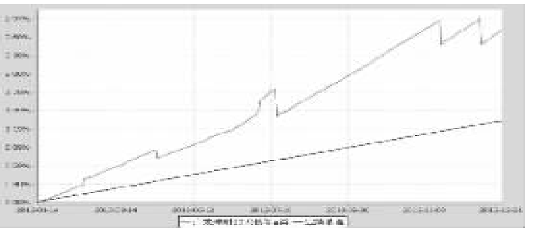
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.3156%	0.0011%	0.3450%	0.0000%	0.9706%	0.0011%
过去六个月	2.5608%	0.0028%	0.6900%	0.0000%	1.8708%	0.0028%
自基金合同生效起至今	4.3605%	0.0058%	1.3200%	0.0000%	3.0405%	0.0058%

注:本基金业绩比较基准:税后活期存款利率:即(1-利息税率)×活期存款利率。

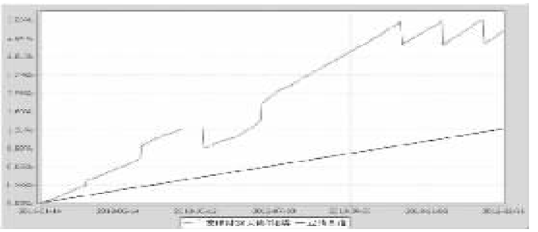
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发理财30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1月14日至2013年12月31日)

1、广发理财30天债券A类



2、广发理财30天债券B类



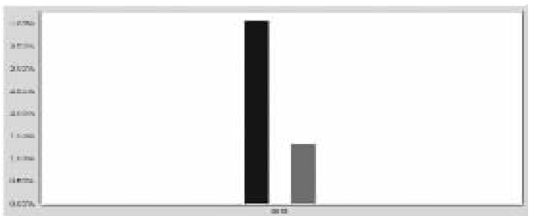
注:(1)本基金合同生效日期为2013年1月14日,至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

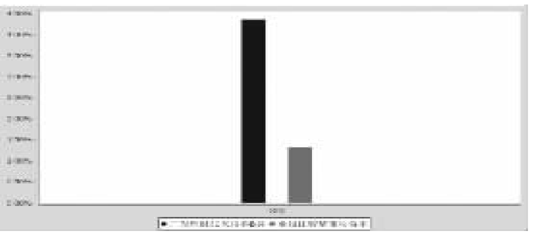
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发理财30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30天债券A类



2、广发理财30天债券B类



注:合同生效当年(2013年)按实际存续期计算,未按自然年度折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

广发理财30天债券A类:

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
2013年	16,788,235.27	13,770,283.70	370,315.95	30,928,834.92	-
合计	16,788,235.27	13,770,283.70	370,315.95	30,928,834.92	-

广发理财30天债券B类:

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
2013年	2,474,238.13	6,240,183.13	57,007.07	8,771,428.33	-
合计	2,474,238.13	6,240,183.13	57,007.07	8,771,428.33	-

§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		
温秀娟	本基金的基金经理;广发货币基金的基金经理;广发理财7天债券基金的基金经理;广发现金宝场内货币基金的基金经理	2013-01-14	-	13	女,中国籍,经济学学士,持有证券业执业证书,2000年7月至2004年10月任职于广发证券股份有限公司江门营业部,2004年10月至2008年8月在广发证券股份有限公司固定收益部工作,2008年8月11日至今在广发基金管理有限公司固定收益部工作,2010年4月29日起任广发货币基金的基金经理,2013年1月14日起任广发理财30天债券基金的基金经理,2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理,2013年12月2日起任广发现金宝场内货币基金的基金经理。

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、《广发理财30天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。本报告期内,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年货币政策悄然变调,从稳健改为稳中从紧,流动性全面收紧,货币市场经历剧烈波动。年中钱荒时回购利率达到双位数,创下新高;年底资金仍然紧张,虽然央行向市场适度注入流动性,但短期资金价格创下自6月钱荒以来的新高,1个月定期存款价格最高超过9%,短期融资券收益率普遍在6.5%以上,市场参与者态度谨慎。预计2014年资金面维持紧平衡,不排除个别时点需要央行及时注入流动性,这种紧平衡有利于货币基金收益率维持在较高的水平。

报告期内我们把握机会做高收益定存,增持了部分收益率较高的新发短融,提高组合收益率。2014年将保持良好流动性和适度久期,特别做好关键时点的流动性安排。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

广发理财30天A本报告期内收益率4.0681%,业绩比较基准回报为1.3200%;广发理财30天B本报告期内收益率4.3605%,业绩比较基准回报为1.3200%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2014年仍然是国内外货币宽松退出的一年,货币环境复杂多变。两大政策目标-降杠杆和利率市场化都会影响市场流动性,央行的态度是重点。以往市场流动性主要来源是外汇占款和自身货币增速,如果货币增速被严控,那就只能看外汇占款。但如果外汇占款增速过快,央行就会回笼资金,因此流动性的阀门掌控在央行手中。到目前为止,央行的态度还是要控制流动性,这一态度在短期内应该不会转变,但紧缩政策会不会贯彻全年,就存在不确定因素。目前1个月资金价格的中枢在5.5%以上,短融收益率普遍在5.5%以上,货币基金收益率普遍在5%以上,如果把货币基金收益率视为无风险基准利率,那理财产品和其它风险资产收益率要在6%以上,这样一方面提高了银行的资金成本,进一步推高贷款利率,另一方面直接推高企业的发债成本,按照目前国内企业的利润率来看,融资成本已经是沉重的负担,一旦资金利率超过企业承受能力,会引发连锁反应,后果应该是管理层不得不考虑的问题,因此下半年是否会适当放松也是关注的重点。

具体而言,我们将坚持货币市场基金流动性管理工具的投资目标,保持合理的组合平均剩余到期期限,在合规基础上进行组合管理,根据对利率和信用市场变化的规律的深入研究来提高组合收益。

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、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"基金收益与分配"之"(三)基金收益分配原则"的相关规定,本基金收益分配方式为红利再投资,每日分配,运作期期末例行收益结转。本基金报告期内累计分配收益 39,700,263.25 元。

§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理财30天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,广发理财30天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理财30天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,广发理财30天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理财30天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P0446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:广发理财30天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	129,646,708.48
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	84,977,494.05
其中:股票投资	-
基金投资	-
债券投资	84,977,494.05
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	-
买入返售金融资产	8,000,000.00
应收证券清算款	-
应收利息	1,888,915.18
应收股利	-
应收申购款	645,200.00
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	225,158,317.71
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	39,103,660.45
应付证券清算款	8,000,000.00
应付赎回款	-
应付管理人报酬	46,946.20
应付托管费	13,909.98
应付销售服务费	45,816.39
应付交易费用	13,305.34
应交税费	-
应付利息	3,517.60
应付利润	427,323.02
递延所得税负债	-
其他负债	249,000.00
负债合计	47,903,478.98
所有者权益:	-
实收基金	177,254,838.73
未分配利润	-
所有者权益合计	177,254,838.73
负债和所有者权益总计	225,158,317.71

注:1、报告截止日2013年12月31日,理财30天A级基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额160,997,160.31份;理财30天B级基金份额净值人民币1.0000元,基金份额总额16,257,678.42份;总份额总额177,254,838.73份。

2、本会计期间为2013年1月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:广发理财30天债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月14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1月14日(基金合同生效日)至2013年12月31日
一、收入	49,329,413.98
1.利息收入	43,853,533.02
其中:存款利息收入	21,677,161.16
债券利息收入	10,257,043.64
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	11,919,328.22
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	5,475,880.96
其中:股票投资收益	-
基金投资收益	-
债券投资收益	5,475,880.96
资产支持证券投资收益	-
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)	-
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	9,629,150.73
1. 管理人报酬	2,836,563.67
2. 托管费	840,463.33
3. 销售服务费	2,516,995.87
4. 交易费用	225.00
5. 利息支出	2,931,308.13
其中:卖出回购金融资产支出	2,931,308.13
6. 其他费用	503,594.73
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	39,700,263.25
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	39,700,263.25

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发理财30天债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月14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1月14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)	4,787,326,081.00	-	4,787,326,081.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	39,700,263.25	39,700,263.25
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)	-4,610,071,242.27	-	-4,610,071,242.27
其中:1.基金申购款	1,809,899,883.18	-	1,809,899,883.18
2.基金赎回款	-6,419,971,125.45	-	-6,419,971,125.45
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)	-	-39,700,263.25	-39,700,263.25
五、期末所有者权益(基金净值)	177,254,838.73	-	177,254,838.73

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

广发理财30天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")证监基金字[2012]1536号文《关于同意广发理财30天债券型证券投资基金募集的批复》的批准,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《广发理财30天债券型证券投资基金基金合同》("基金合同")发起,于2013年1月14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。

本基金募集期间为2013年1月7日至2013年1月10日,本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额为人民币4,787,326,081.00元,有效认购户数为19,983户。其中广发理财30天债券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3,961,758,301.85元,认购资金在募集期间的利息为人民币261,477.63元;广发理财30天债券B类基金("B类基金")扣除认购费用后的募集资金净额825,257,000.00元,认购资金在募集期间的利息为人民币49,301.52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:现金;通知存款;短期融资券;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的债券;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;期限在一年以内(含一年)的债券回购;剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的中期票据;剩余期限(或回售期限)在397天以内(含397天)的资产支持证券;中国证监会/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

本基金实施分级,在任何一个开放日,若A类基金份额持有人在单个基金账户中保留的基金份额达到或超过500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的A类基金份额升级为B类基金份额,若B类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于500万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的B类基金份额降级为A类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码,收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。本基金业绩比较基准:七天通知存款利率(税后)。

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1月14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1月14日(基金合同生效日)起至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为债券投资,在资产负债表中作为交易性金融资产列报。

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,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,取得时支付的价款中包含已宣告但尚未发放的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。

本基金对所持有的债券投资、贷款及应收款项和其他金融负债以摊余成本法进行后续计量。本会计期间内,本基金持有的债券投资的摊余成本接近其公允价值。

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

债券投资

买入银行间市场交易的债券于交易日按应付或实际支付的全部价款(不含应收利息)入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

买入央行票据和零息债券等贴现债券,于交易日按应付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

卖出银行间市场交易的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。

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

本基金的债券投资等金融资产,均以实际利率法计算的摊余成本估算公允价值。在本基金存续期间,基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度,并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元,恢复使用摊余成本估算公允价值。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。

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。每份基金份额面值为人民币1.00元。申购、赎回、转换及分红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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少,以及因类别调整而引起的广发理财30天债券A基金、广发理财30天债券B基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 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) 本基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

(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

2. 投资收益

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。

7.4.4.9 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×0.27%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×0.08%的年费率逐日计提。

3. 本基金A级基金份额和B级基金份额的销售服务费分别按前一日该级基金资产净值的0.30%和0.01%的年费率逐日计提。

4.卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产的摊余成本在回购期限内以实际利率法逐日计提

7.4.4.10 基金的收益分配政策

1.基金收益分配采用红利再投资方式;

2.本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权;

3.本基金根据每日基金收益情况,以基金净收益为基准,为投资者每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。投资者当日收益分配的计算保留到小数点后2位;

4.本基金根据每日收益情况,按当日收益全部分配,若当日净收益大于零时,为投资者记正收益;若当日净收益小于零时,为投资者记负收益;若当日净收益等于零时,当日投资者不记收益;

5.本基金每日进行收益计算并分配,累计收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式。若投资者在运作期期末累计收益支付时,累计收益为正值,则为投资者增加相应的基金份额,其累计收益为负值,则缩减投资者基金份额。投资者可通过在基金份额运作期到期日赎回基金份额获得当期运作期的基金未支付收益。对于持有超过一个运作期、在当期运作期到期日提出赎回申请的基金份额而言,除获得当期运作期的基金未支付收益外,投资者还可以获得自申购确认日(认购份额自本基金合同生效日)起至上一运作期期末的基金收益;

6.当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自下一工作日起,不享有基金的分配权益;

7.法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.11 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[2008]1号文《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》、国税函[2008]870号文《关于做好证券市场个人投资者证券交易结算资金利息所得免征个人所得税工作的通知》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,包括买卖债券的差价收入、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。

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
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
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债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2013年1月14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	17,124,700,000.00	100.00%

7.4.8.1.4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1月14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	2,836,563.67
其中:支付销售机构的客户维护费	1,205,737.25

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的0.27 %的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.27%÷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2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、公休日等,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1月14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	840,463.33

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的0.08%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.08%÷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2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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1月14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		
	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类	合计
中国工商银行股份有限公司	2,287,448.98	10,248.09	2,297,697.07
广发证券股份有限公司	16,361.56	2,751.53	19,113.09
广发基金管理有限公司	64,782.86	4,464.52	69,247.38
合计	2,368,593.40	17,464.14	2,386,057.54

注:本基金A级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.3%的年费率计提;B级基金份额的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.01%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×G÷当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

G为对应的销售服务费率

销售服务费每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首日前3个工作日内从基金资产中一次性支付给销售机构,若遇法定节假日、休息日等,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

本基金本报告期内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

广发理财30天债券A类

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。

广发理财30天债券B类

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1月14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	8,646,708.48	269,392.74

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

本基金本报告期内及无在承销期内参与关联方承销的证券。

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

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金无因认购新发/增发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

截至本报告期末2013年12月31日止,本基金无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人民币39,103,660.45 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
130214	13国开14	2014-01-02	99.69	200,000.00	19,938,000.00
041356030	13西宁特钢CP001	2014-01-02	99.81	29,000.00	2,894,490.00
041360046	13闽交运CP002	2014-01-02	99.44	170,000.00	16,904,800.00
合计				399,000.00	39,737,290.00

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,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

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二层级的余额为84,977,494.05元,无属于第一层级和第三层级的余额。

(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. 除公允价值估值外,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	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	其他各项资产	2,534,115.18	1.13
5	合计	225,158,317.71	100.00

8.2债券回购融资情况

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	12.93	
	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简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的40%。

8.3基金投资组合平均剩余期限

8.3.1投资组合平均剩余期限基本情况

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高值	194
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	10

报告期内投资组合平均剩余期限超过150天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限(天数)	原因	调整期
1	2013-04-15	153	大额赎回	2013年4月24日
2	2013-04-16	189	大额赎回	2013年4月24日
3	2013-04-17	173	大额赎回	2013年4月24日
4	2013-04-18	168	大额赎回	2013年4月24日
5	2013-04-19	167	大额赎回	2013年4月24日
6	2013-04-22	150	大额赎回	2013年4月24日
7	2013-04-23	156	大额赎回	2013年4月24日
8	2013-05-15	194	大额赎回	2013年5月30日
9	2013-05-16	193	大额赎回	2013年5月30日
10	2013-05-17	192	大额赎回	2013年5月30日
11	2013-05-20	190	大额赎回	2013年5月30日
12	2013-05-21	189	大额赎回	2013年5月30日
13	2013-05-22	182	大额赎回	2013年5月30日
14	2013-05-23	168	大额赎回	2013年5月30日
15	2013-05-24	161	大额赎回	2013年5月30日
16	2013-05-27	159	大额赎回	2013年5月30日
17	2013-05-28	158	大额赎回	2013年5月30日
18	2013-05-29	157	大额赎回	2013年5月30日

注: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150天"。因基金出现大额赎回,所以组合久期被动超过150天,已经做出调整。

8.3.2期末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	79.35	26.57
	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	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	0.00	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	0.00	0.00
	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	0.00
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		125.60	26.57

8.4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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,000,833.68	11.28
	其中:政策性金融债	20,000,833.68	11.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	64,976,660.37	36.66
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	84,977,494.05	47.94
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	130214	13国开14	200,000.00	20,000,833.68	11.28
2	041356030	13西宁特钢CP001	170,000.00	17,007,592.16	9.59
3	041360046	13闽交运CP002	170,000.00	16,970,017.30	9.57
4	041355025	13南京港CP001	100,000.00	10,000,250.02	5.64
5	041364034	13中升CP002	100,000.00	10,000,102.94	5.64
6	041358055	13华强CP001	100,000.00	9,998,505.80	5.64
7	041354002	13广汽CP001	10,000.00	1,000,192.15	0.56

8.6"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1902%
报告期内偏离度的最低值	-0.2370%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0603%

8.7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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价,即计价对象以买入成本列示,按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余期限内摊销,每日计提收益。

8.8.2本报告期内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

8.8.3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。

8.8.4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	-
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

§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
广发理财30天债券A类	2,223	72,423.37	614,028.31	0.38%	160,383,132.00	99.62%
广发理财30天债券B类	2	8,128,839.21	10,205,590.72	62.77%	6,052,087.70	37.23%
合计	2,225	79,665.10	10,819,619.03	6.10%	166,435,219.70	93.90%

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	广发理财30天债券A类	42,097.46	0.0261%
	广发理财30天债券B类	-	-
	合计	42,097.46	0.0237%

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。

§10开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类
基金合同生效日(2013年1月14日)基金份额总额	3,962,019,779.48	825,306,301.52
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	826,220,932.11	983,678,951.07
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	4,627,243,551.28	1,792,727,574.17
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末期末基金份额总额	160,997,160.31	16,257,678.42

注:本基金于本报告期间成立,基金合同生效日为2013年1月14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80,000.00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	4	-	-	-	-	新增4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	3	-	-	-	-	新增3个
东兴证券	3	-	-	-	-	新增3个
方正证券	3	-	-	-	-	新增3个
光大证券	3	-	-	-	-	新增3个
广发证券	7	-	-	-	-	新增7个
广州证券	1	-	-	-	-	新增1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	3	-	-	-	-	新增3个
国元证券	2	-	-	-	-	新增2个
海通证券	2	-	-	-	-	新增2个
红塔证券	1	-	-	-	-	新增1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	6	-	-	-	-	新增6个
华融证券	1	-	-	-	-	新增1个
华泰证券	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
申银万国	3	-	-	-	-	新增3个
世纪证券	1	-	-	-	-	新增1个
万联证券	1	-	-	-	-	新增1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	2	-	-	-	-	新增2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	4	-	-	-	-	新增4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	1	-	-	-	-	新增1个
中天证券	1	-	-	-	-	新增1个
西南证券	1	-	-	-	-	新增1个
财富里昂	1	-	-	-	-	新增1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	-	-	17,124,700,000.00	100.00%	-	-

11.8偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

广发基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日