

014年6月30日

[illegible]

6	其中：结构性回购的公允价值金融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	655,688.03	0.48
7	其他各项资产	5,777,429.77	4.24
8	合计	136,329,598.32	100.00
5.3	报告期末按行业分类的披露投资组合		
5.3.1	本基金本报告期末未持有股票。		
5.3.2	报告期末公允价值占基金资产净值比例前两大类的前十名投资品种		
5.3.3	本基金本报告期末未持有债券。		
5.4	报告期末按债券品种分类的披露投资组合		
序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券		
2	央行票据		
3	金融债券	51,053,000.00	52.99
3	其中：政策性金融债	51,053,000.00	52.99
4	企业债券	33,445,775.00	34.71
5	公司债券	40,329,000.00	41.86

7	可转债		5,068,705.52	5.26
8	其他		-	-
9	合计		129,896,480.52	134.82

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(万)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140302	14附息02	200.000	20,794,000.00	21.58
2	140312	14附息12	200.000	20,248,000.00	21.03
3	041850027	13C国债南票CP001	100.000	10,143,000.00	10.51
4	041360051	13楚夏CP003	100.000	10,141,000.00	10.51
5	011410001	14申电投CP001	100.000	10,032,000.00	10.43

5.6 报告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。

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值计量的基金资产净值比例大于前五名证劵投资明细

本基金本报告期末未有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未有股指期货持仓；

(2) 本基金本报告期末未有股指期货交易。

5.10 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有国债期货持仓；

(2) 本基金本报告期末未有国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内基金投资的前十名证劵的发行主体在本报告期内没有出现在监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名证劵未超出基金合同规定的备选证劵库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,874.70
2	应收证劵清算款	2,449,549.10
3	应收股利	-
4	应收利息	3,312,840.07
5	应收申购款	13,165.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

序号	债券名称	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110018	国开转债	3,086,908.90	3.20
2	113002	工行转债	1,981,820.01	2.06

5.1.1.3 报告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。

§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
本报告期基金份额总额	53,560,791.98	67,993,575.21
本报告期基金总申购份额	1,539,673.30	2,280,431.41
减:本报告期基金总赎回份额	9,289,182.35	21,247,316.64
本报告期基金份额变动额	--	--
本报告期末基金份额总额	45,820,272.93	49,024,690.08

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人不在运用固有资金(1)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

1. 备查文件目录
 1. 中国证监会批准广发双债添利债券型证券投资基金募集的文件
 2. 《广发双债添利债券型证券投资基金合同》
 3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
 4. 《广发双债添利债券型证券投资基金托管协议》
 5. 法律意见书
 6. 基金管理人业务资格批件、营业执照
 7. 基金托管人业务资格批件、营业执照
 8. 2处办公地点
 - 广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔1313-13楼
 - 北京观智
 9. 投资者查询:查询时间为每天8:30-11:30、13:30-17:00,投资者可免费咨询,也可按工本费购买资料。
 10. 网站查询:基金管理人网站: <http://www.gffund.com.cn>。

投资者如有任何疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话:95168或020-83909999,或发电子邮件:

service@gffund.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一四年七月十四日

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细			
本基金本报告期末未持有债券。			
5.7 报告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。			
5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资明细			
本基金本报告期末未持有贵金属。			
5.9 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权证投资明细			
本基金本报告期末未持有权证。			
5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明			
5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细			
本基金本报告期末未持有股指期货。			
5.10.2 本基金本报告期末未进行股指期货交易。			
5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明			
5.11.1 持仓情况和交易对手名称			
本基金本报告期末未持有国债期货。			
5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细			
本基金本报告期末未进行国债期货交易。			
5.12 投资组合报告附注			
5.12.1 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票。			
5.12.2 其他资产构成			
5.12.3 其他资产构成			

在报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(1)认购、申购或买卖本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准“发源达100指数分级证券投资基金募集的文件”

2、《发源达100指数分级证券投资基金基金合同》

3、《发源达100指数分级证券投资基金托管协议》

4、法律意见书

5、基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金投资人业务资格证件、营业执照

6、基金托管人业务资格证件、营业执照

7、存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8、查阅方式

1、投资者可在每周时间为每工作日8:30-11:30、13:30-17:00,持证件可免费查阅,也可按本托管协议复印件;

2、投资者如为基金管理人及基金托管人,可致电以下电话索取: 020-67666600;

3、投资者如为本报告编制期间,可向本基金管理人、发源达基金管理有限公司, 咨询电话 0515681828 或 020-63093099, 或发电 mail 至: rvc@gf-fund.com 索取。

广发基金管理有限公司
广东·广州·海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼
