

广发集鑫债券型证券投资基金

2014 第二季度 报告

2014年6月30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:二〇一四年七月十八日

1.1 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、准确性和完整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规定,于2014年7月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证托管人不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或保证最低收益。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。

本报告期内2014年4月1日起至6月30日止。

5.2 基金产品概况

基金名称	广发集鑫债券
基金代码	00073
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月21日
报告期末基金份额总额	36,717,930.82份

投资策略: 本基金投资于具有良好流动性的固定收益类资产,通过自上而下的资产配置,力求实现基金资产的持续稳健增值。

业绩比较基准: 中证全债指数收益率。

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。

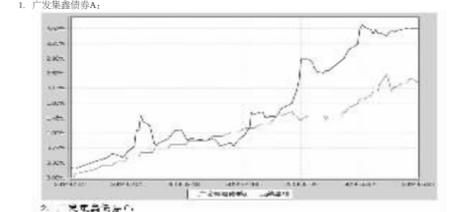
3.1 主要财务指标

项目	报告期(2014年4月1日至2014年6月30日)	广发集鑫债券A	广发集鑫债券C
1.本期已实现收益	78,615.31	-	402,464.39
2.本期利润	779,232.31	-	424,124.74
3.加权平均基金份额本期利润	0.0015	-	0.0009
4.期末基金份额净值	25,317,484.14	-	15,221,673.60
5.期末基金份额总额	1,023	-	1,020

3.2 基金净值表现

1. 广发集鑫债券A: 净值增长率: 1.29%, 业绩比较基准收益率: 0.88%, 超额收益: 0.41%。

2. 广发集鑫债券C: 净值增长率: 1.09%, 业绩比较基准收益率: 0.26%, 超额收益: 0.83%。



5.1 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	35,625,098.80	92.50
3	其中:债券	35,625,098.80	92.50
4	资产支持证券	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	1,090,000.00	2.80
7	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
8	银行存款和结算备付金合计	743,500.00	1.93
9	其他资产	1,434,679.69	3.67
10	合计	38,313,278.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家/地区	2,038,000.00	5.31
2	行业	-	-
3	行业	-	-
4	行业	-	-
5	行业	-	-
6	行业	-	-
7	行业	-	-
8	行业	-	-
9	合计	35,625,098.80	94.69

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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.4 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.5 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资产支持证券投资明细

5.5.1 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资产支持证券投资明细

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

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权证投资明细

5.6.1 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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

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五名贵金属投资明细

5.7.1 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

序号	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

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五名股指期货投资明细

5.8.1 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

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国债期货投资明细

5.9.1 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.10 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

5.10.1 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.11 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股指期货投资明细

5.11.1 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.12 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国债期货投资明细

5.12.1 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.13 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

5.13.1 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.14 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股指期货投资明细

5.14.1 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.15 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国债期货投资明细

5.15.1 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.16 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

5.16.1 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.17 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股指期货投资明细

5.17.1 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.18 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国债期货投资明细

5.18.1 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.19 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

5.19.1 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.20 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股指期货投资明细

5.20.1 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.21 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国债期货投资明细

5.21.1 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国债期货投资明细

序号	国债期货名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.22 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

5.22.1 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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	122300	13号东1	112,500	1,130,000.00	30.21
2	12286	11号东1	69,800	6,903,600.00	18.34
3	112198	14号东1	38,400	4,068,720.00	10.89
4	12296	88号东1	40,000	4,016,400.00	10.70
5	00934	13号东1	20,300	2,028,600.00	5.41

5.23 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股指期货投资明细

5.23.1 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股指期货投资明细

序号	股指期货名称	数量(元)	公允价值
----	--------	-------	------