

广发中债金融债指数证券投资基金

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告截止日期:2015年3月31日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人承诺不以虚假记载、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法律责任。本报告期末(即2015年3月31日)基金资产净值21,286,730.92元,基金份额持有人1,007,936.69份,基金份额净值为21.12元,报告期内基金净值变动率为-0.12%,基金份额持有人人数为1,007,936.69人。

2.1 基金基本情况

基金名称	广发中债金融债指数	
基金代码	000348	
交易代码	000348	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日期	2013年11月13日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
期末基金份额总额	25,584,264.71份	
基金净值增长率	不定期	
下属分级基金名称	广发中债金融债指数	广发中债金融债指数

2.2 基金业绩说明

报告期净值增长率	基金业绩比较基准	
本报告期	0.90% -0.12%	0.90% -0.04%

2.3 基金管理人及相关基金托管人

基金管理人	基金托管人
广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
法定代表人:张磊	法定代表人:王长林
总经理:孙树刚	副行长:李庆功
注册地址:广东省珠海市横琴新区宝成路6号104室-3348	注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号

3. 主要财务指标、基金净值表现及风险指标

3.1 回报数据和基金净值表现

期间	2014年	2013年11月13日至2014年12月31日	广发中债金融债指数	广发中债金融债指数
本报告期净值增长率	1,332,580.77	1,244,842.51	1,508,144.16	2,782,414.71
业绩比较基准	1,701,560.91	1,243,842.53	1,508,144.16	2,782,414.71

3.2 基金净值表现

期间	本报告期净值增长率	业绩比较基准	跟踪误差
过去三个月	3.05%	0.17%	2.74%
过去六个月	5.49%	0.28%	3.79%
过去一年	8.02%	0.25%	8.49%
自基金合同生效以来	10.66%	0.23%	6.21%

1. 广发中债金融债指数基金



注:基金净值增长率以同期同类基金业绩比较基准为基准进行计算。跟踪误差计算公式为:跟踪误差=基金净值增长率-业绩比较基准收益率。

1. 广发中债金融债指数基金

项目	本期	上期
资产	2014年12月31日	2014年12月31日
货币: 964,369.35	587,422,310.84	
银行存款: 464,000.00		
结算备付金: 1,356.12		
交易性金融资产: 32,028,000.00		
应收款项: 32,028,000.00		
基金投资收益: 2,300,000.00		
其他金融资产: 1,000,622.50		
应收利息: 1,094,099.38	3,604,366.34	
其他应收款: 117,138.80		
其他资产: 28,149,922.00	591,026,688.28	
资产总计: 38,769,586.15	591,026,688.28	

2. 广发中债金融债指数基金

项目	本期	上期
负债	2014年12月31日	2014年12月31日
应付账款: 394,662.62	33,057.81	
应付利息: 10,619,664.15	381,360.68	
其他负债: 28,149,922.00	557,248,417.99	
负债总计: 394,662.62	33,057.81	
所有者权益: 38,374,923.53	557,993,630.47	

1. 广发中债金融债指数基金

项目	本期	上期
营业收入: 586,294,436.19	430,889.41	590,645,324.60
公允价值变动损益: 430,889.41	430,889.41	430,889.41
投资收益: 291,402,176.84	-4,231,635.56	567,023,107.94
其他业务收入: 21,802,717.47	10,935,555.28	36,995,719.97
公允价值变动损益: -812,142,548.19	-16,875,190.84	-820,953,570.03
其他收益: 25,584,264.71	2,567,629.29	28,149,922.00

1. 广发中债金融债指数基金

项目	本期	上期
期间费用: 586,294,436.19	430,889.41	590,645,324.60
销售费用: 430,889.41	430,889.41	430,889.41
管理费用: 229,696.95	229,696.95	229,696.95
其他费用: 4,705,849.83	4,705,849.83	4,705,849.83

注:基金费用与去年同期相比,本期费用支出有所增加,主要系本报告期基金资产规模扩大,基金管理费用相应增加所致。

2014 年度 报告摘要

2014年度 报告摘要
2014年12月31日

7.1 重要提示
7.1.1 重要提示
7.1.2 基金概况
7.1.3 基金管理人及基金托管人

7.2 基金业绩说明
7.2.1 净值表现
7.2.2 基金业绩比较基准
7.2.3 基金管理人及基金托管人

7.3 基金净值表现
7.3.1 净值表现
7.3.2 基金业绩比较基准
7.3.3 基金管理人及基金托管人

7.4 基金管理人及基金托管人
7.4.1 基金管理人
7.4.2 基金托管人
7.4.3 基金管理人及基金托管人

7.5 基金业绩说明
7.5.1 净值表现
7.5.2 基金业绩比较基准
7.5.3 基金管理人及基金托管人

7.6 基金管理人及基金托管人
7.6.1 基金管理人
7.6.2 基金托管人
7.6.3 基金管理人及基金托管人

7.7 基金业绩说明
7.7.1 净值表现
7.7.2 基金业绩比较基准
7.7.3 基金管理人及基金托管人

7.8 基金管理人及基金托管人
7.8.1 基金管理人
7.8.2 基金托管人
7.8.3 基金管理人及基金托管人

7.9 基金业绩说明
7.9.1 净值表现
7.9.2 基金业绩比较基准
7.9.3 基金管理人及基金托管人

7.10 基金管理人及基金托管人
7.10.1 基金管理人
7.10.2 基金托管人
7.10.3 基金管理人及基金托管人

7.11 基金业绩说明
7.11.1 净值表现
7.11.2 基金业绩比较基准
7.11.3 基金管理人及基金托管人

7.12 基金管理人及基金托管人
7.12.1 基金管理人
7.12.2 基金托管人
7.12.3 基金管理人及基金托管人

7.13 基金业绩说明
7.13.1 净值表现
7.13.2 基金业绩比较基准
7.13.3 基金管理人及基金托管人

7.14 基金管理人及基金托管人
7.14.1 基金管理人
7.14.2 基金托管人
7.14.3 基金管理人及基金托管人

注:本基金A类基金份额认购服务费、C类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值值的0.30%费率计提,计算方法如下:
H= E×R÷365
H为基金份额每日计提的销售服务费
E为基金份额前一日净值
R为基金份额认购费率

7.1 基金概况
7.1.1 基金名称
7.1.2 基金代码
7.1.3 基金管理人及基金托管人

项目	2014年11月1日至2014年12月31日	2014年11月1日至2014年12月31日
基金份额总额	25,584,264.71	25,584,264.71
基金份额持有人	1,007,936.69	1,007,936.69

7.2 基金业绩说明
7.2.1 净值表现
7.2.2 基金业绩比较基准
7.2.3 基金管理人及基金托管人

项目	本期	上期
资产	2014年12月31日	2014年12月31日
货币: 964,369.35	587,422,310.84	
银行存款: 464,000.00		
结算备付金: 1,356.12		
交易性金融资产: 32,028,000.00		

7.3 基金净值表现
7.3.1 净值表现
7.3.2 基金业绩比较基准
7.3.3 基金管理人及基金托管人

项目	本期	上期
负债	2014年12月31日	2014年12月31日
应付账款: 394,662.62	33,057.81	
应付利息: 10,619,664.15	381,360.68	
其他负债: 28,149,922.00	557,248,417.99	

7.4 基金管理人及基金托管人
7.4.1 基金管理人
7.4.2 基金托管人
7.4.3 基金管理人及基金托管人

7.5 基金业绩说明
7.5.1 净值表现
7.5.2 基金业绩比较基准
7.5.3 基金管理人及基金托管人

7.6 基金管理人及基金托管人
7.6.1 基金管理人
7.6.2 基金托管人
7.6.3 基金管理人及基金托管人

7.7 基金业绩说明
7.7.1 净值表现
7.7.2 基金业绩比较基准
7.7.3 基金管理人及基金托管人

7.8 基金管理人及基金托管人
7.8.1 基金管理人
7.8.2 基金托管人
7.8.3 基金管理人及基金托管人

7.9 基金业绩说明
7.9.1 净值表现
7.9.2 基金业绩比较基准
7.9.3 基金管理人及基金托管人

7.10 基金管理人及基金托管人
7.10.1 基金管理人
7.10.2 基金托管人
7.10.3 基金管理人及基金托管人

7.11 基金业绩说明
7.11.1 净值表现
7.11.2 基金业绩比较基准
7.11.3 基金管理人及基金托管人

7.12 基金管理人及基金托管人
7.12.1 基金管理人
7.12.2 基金托管人
7.12.3 基金管理人及基金托管人

7.13 基金业绩说明
7.13.1 净值表现
7.13.2 基金业绩比较基准
7.13.3 基金管理人及基金托管人

7.14 基金管理人及基金托管人
7.14.1 基金管理人
7.14.2 基金托管人
7.14.3 基金管理人及基金托管人