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 报告送出日期:二〇一五年三月三十日

§1 重要提示

31 重要提示 基金管理人的董事会、董事保证本报告所教资料不存在虚假过费,课度性练述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性和个别及在部份法律责任、本年度报告已经三分之二以上独立董事等字同意,并由董事长发发。基金任营人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,于2015年3月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现,和同分配情况的多合计程度,没有性格学内容,保证政场将本存在建筑建筑,读与性性流波者在一边漏基全管理人系法以通生信用。则最后营的原则管理和运用基金管产,但不保证基金一定盈利。基金的过去电线并不代表生来表现。投资有风险,投资者在作出投资决定的行倒阅读本基金的招募说明书及其更新。本年审报朱磁家继信年度报告正文,投资者欲了新详细内容,应阅读年度报告正文。

2.1 基金基本情况	2		§ 2 基金简介		
基金简称			广发中	倚金融俯指数	
基金主代码				000348	
交易代码				000348	
基金运作方式			契约	5型开放式	
基金合同生效日			2013	8年11月7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	行股份有限公司	
报告期末基金份额总	10		25,5	54,264.71()	
基金合同存续期				不定期	
下属分级基金的基金	简称		广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类	
下属分级基金的交易	代码		000348	000349	
报告期末下属分级基	金的份額总額		4,885,513.79%	20,668,750.9269	
2.2 基金产品说明	月				
投资目标	本	基金通过指数化投	·资,实现对标的指数的有效跟踪,谋求基金资产的长期增值。		
投资策略	券	,或选择非成份券作	主要采用优化抽样复制的方法,投资于标的指数中具有代表性和流动性的感份券和备选或化 作为情代,结合考虑跟踪效果,操作风险等因素构造组合,并根据本基金资产规模。日常申阜 使以及银行间债券交易特性等,对标的指数的久期等指标进行匹配,达到复制标的指数,控制 成本的目的。		
业绩比较基准	95	%×中债-5年期金融	t债指数收益率+5%×银行活期存款利率(税	后)。	
风险收益特征	本	基金是债券型基金	·,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金。		
2.3 基金管理人和	口基金托管人				
项	B		基金管理人	基金托管人	
名称			广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司	
	姓名		段西军	王永民	
信息披露负责人	联系电话		020-83936666	010-66594896	
	电子邮箱		dxj@gffunds.com.cn	feid@bankofehina.com	
客户服务电话		95105828,020-83936999	95566		
传真			020-89899158	010-66594942	
2.4 信息披露方式					
登载基金年度报告摘		阿阿址	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		

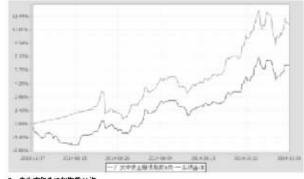
登载基金年度报告摘引	要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com	http://www.gffunds.com.cn			
基金年度报告备置地;			道东1号保利国际广场南塔31-33档	Ri C		
		要财务指标、基金净值表	现及利润分配情况			
3.1 主要会计数据	5和财务指标			金额单位:人民市		
3.1.1期间数据和指	2014	4年	2013年11月7日(基金合同生	效日)至2013年12月31日		
标	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类		
本期已实现收益	1,332,988.77	2,144,914.67	1,568,474.68	2,782,414.73		
本期利润	1,701,560.91	2,824,842.53	1,568,474.68	2,782,414.73		
加权平均基金份額 本期利润	0.0552	0.0939	0.0077	0.0073		
本期加权平均净值 利润率	5.38%	9.03%	0.77%	0.72%		
本期基金份額净值 增长率	9.62%	9.29%	0.77%	0.73%		
3.1.2期末数据和指	2014	年末	2013年末			
标	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类		
期末可供分配基金 份額利润	0.0736	0.0700	0.0077	0.0073		
期末基金资产净值	5,396,538.52	22,753,383.48	204,922,584.77	385,722,740.83		
期末基金份額净值	1 1046	1 1009	1 0077	1.0073		

注:(1)所述無金财务指称不包括特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。 (2)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)扣赊相关费用后的余额,本期利润为 本期已实现收益加上本期公允价度变成收益。 (3)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款低数(为期未余额,不是当期发生

3.2.1 基金份额净值 1. 广发中债金融价	朝业绩比较基准收	益率的比较
	DV desirate has see the say are	JULIANUL SERVICE VALUE

阶段	份額净值增长率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	3.05%	0.37%	2.74%	0.26%	0.31%	0.11%
过去六个月	5.40%	0.28%	3.70%	0.20%	1.70%	0.08%
过去一年	9.62%	0.25%	8.49%	0.17%	1.13%	0.08%
自基金合同生效起至 今	10.46%	0.23%	6.21%	0.17%	4.25%	0.06%
2. 广发中债金融(贵指数C类:					
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	3.12%	0.37%	2.74%	0.26%	0.38%	0.11%
过去六个月	5.37%	0.28%	3.70%	0.20%	1.67%	0.08%
过去一年	9.29%	0.25%	8.49%	0.17%	0.80%	0.08%
自基金合同生效起至	10.09%	0.23%	6.21%	0.17%	3.88%	0.06%

2.业頭比较基础是根据基金合同天十资产监置比例的规定的建的。 3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值龄长率变动及其与同职业绩比较基准收益率变动的比较 广发中储金融值指数证券投资基金 自基金合同生效以来份额累计净值增长等业绩此较基本概益率的历史走势对比图 (2013年11月7日至2014年12月31日)

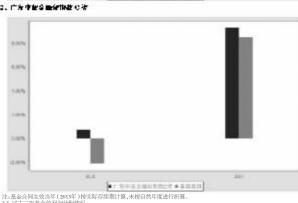


2. 广東中保益 帰飯貯蔵 0 英 一ア大学は上海学覧を:大一上は正常

注: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本基金合同有关规定。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 广发中债金融债指数证券投资基金 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. 广发中枢企务配付款 4.美





注:基金合同生效当中(2013年/1927年) 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11月7日)至报告期末未进行利润分配。 & 4 管理人报告

4.1.2 基金经	理(或基金经理小组	1)及基金经理助	力理的简介		
姓名	III Ar	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	14/07
处名	职务	任职日期	高任日期	IE3FA(3E4FR	说明
钟伟	本基金的基金经理	2013-11-07	=	5.5年	男,中国籍,数学博士,持有基金业执业资格证书, 2009 年7 月至2013年11月先后在广发基金管理 有限公司金融工程部,数量投资部任研究员,2013 年11月7日起任广发中债金融债指数基金的基金 经理。

注;(1)基金经理的"任职日期"和"高职日期"指公司公告聘任或解聘日期。 (2)证券从业的含义建从行业协会(证券业从业人员资格管理办法)的相关规定。 4. 管理人对报告期内本基金连信建筑守信馆的说明 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、《广发中债金融债指数证券投资基金基

广发中债金融债指数证券投资基金

2014 年度 报告摘要

2014年12月31日

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

2. 2.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 4.31 公平交易倾取和控制方法 公司通过建立好学。躺倚的投资决策体系,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

7.1 资产负债表 会计主体: "发中债金融债指数证券投资基金 将告龄 i 日: 2014年12月31日

资产	本期末 2014年12月31日	上年度末 2013年12月31日
资产:	-	
银行存款	964,369.35	587,422,319.9
结算备付金	464,000.00	
存出保证金	1,356.12	
交易性金融资产	32,028,000.00	
其中:股票投资	-	
基金投资	-	
债券投资	32,028,000.00	
资产支持证券投资	_	
贵金属投资	_	
衍生金融资产	_	
买人返售金融资产	2,300,000.00	
应收证券清算款	1,800,622.50	
应收利息	1,094,099.38	3,604,366.3
应收股利	=	
应收申购款	117,138.80	
递延所得税资产	-	
其他资产	_	
资产总计	38,769,586.15	591,026,686.2
负债和所有者权益	本期末 2014年12月31日	上年度末 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	9,999,865.00	
应付证券清算款	-	
应付赎回款	191,923.67	
应付管理人报酬	9,576.93	200,195.6
应付托管费	2,394.23	50,048.9
应付销售服务费	5,647.22	98,058.2
应付交易费用	2,777.20	
应交税费	_	
应付利息	12,833.28	
应付利润	_	
递延所得税负债	-	
其他负债	394,646.62	33,057.8
负债合计	10,619,664.15	381,360.6
所有者权益:	_	
实收基金	25,554,264.71	586,294,436.1
未分配利润	2,595,657.29	4,350,889.4
所有者权益合计	28,149,922.00	590,645,325.6
负债和所有者权益总计	38,769,586.15	591,026,686.2

金融價值数A基金份额净值人民币1.1009元。基金份额总额20,668,750.92份;总份额总额25,554,264.71份;2013年12月51日,发中债金融價值數A基金份额净值人民币1.007元,基金份额总额203,354,110.09份;广发中债金融價值數C基金份额净值人民币1.007元,基金

年度会计期间为2013年11月7日(基金合同生效日)起至2013年12月31日止。

項目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年11月7日(基金合同生效日)至 2013年12月31日	
一、收入	5,772,499.80	5,002,119.6	
1.利息收入	3,829,849.81	5,002,119.6	
其中:存款利息收入	1,405,529.56	5,002,119.6	
债券利息收入	2,137,738.44		
资产支持证券利息收入	-		
买人返售金融资产收入	286,581.81		
其他利息收入	-		
2.投资收益(损失以 "填列)	742,926.70		
其中:股票投资收益	=		
基金投资收益	-		
债券投资收益	742,926.70		
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)	1,048,500.00		
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	=		
5.其他收入(损失以"号填列)	151,223.29		
减:二、费用	1,246,096.36	651,230.2	
1.管理人报酬	256,191.74	348,207.€	
2.托管费	64,047.95	87,051.5	
3.销售服务费	95,672.18	170,561.5	
4.交易费用	7,631.65		
5.利息支出	229,696.95		
其中:卖出回购金融资产支出	229,696.95		
6.其他费用	592,855.89	45,408.8	
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	4,526,403.44	4,350,889.4	
诚:所得税费用	-		
四、净利润(净亏损以""号填列)	4,526,403.44	4,350,889.4	

項目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日					
96.0	实收基金	未分配利润	所有者权益合计			
、期初所有者权益(基金净值)	586,294,436.19	4,350,889.41	590,645,325.60			
、本期经营活动产生的基金净值变 数(本期利润)	-	4,526,403.44	4,526,403.44			
、本期基金份额交易产生的基金净 (变动数(净值减少以"-"号填列)	-560,740,171.48	-6,281,635.56	-567,021,807.04			
中:1.基金申购款	251,402,176.71	10,593,555.28	261,995,731.99			
基金赎回款	-812,142,348.19	-16,875,190.84	-829,017,539.03			
《本期向基金份额持有人分配利润 生的基金净值变动(净值减少以"-" 填列)	=	-	-			
、期末所有者权益(基金净值)	25,554,264.71	2,595,657.29	28,149,922.00			
項目	上年度可比期间 2013年11月7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			
、期初所有者权益(基金净值)	586,294,436.19	-	586,294,436.19			
、本期经营活动产生的基金净值变 数(本期利润)	-	4,350,889.41	4,350,889.4			
、本期基金份额交易产生的基金净 [变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-			
中:1.基金申购款	-	-	-			
基金赎回款	-	-	-			
《本期向基金份额持有人分配利润 生的基金净值变动(净值减少以"-" 填列)	-	-	-			
、期末所有者权益(基金净值)	586.294.436.19	4.350.889.41	590,645,325,60			

本报告页码(序号) 从7.1至74、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;襄刚。会计机构负责人;张晓章 7-4 报规附注 7-41 基金基本情况 "安中债金融债指数证券投资基金集除的批复 批准。由基金发起人"发基金管理看价之可依据(中华人民共和国证券投资基金 法)、证券投资基金库管理的走入。人会格坝市场投资者提外。是投资营营有效大力。法等全域企和(中华人民共和国证券投资基金 投资基金基金合同)("基金合同")发起。于2013年11月7日募集成立。本基金的基金管理人为"发基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

1920年或金基金信用》(T基金合同")发起。17-201年11月日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司、基金托管人为中国银行股份有限公司。本基金募集期为2013年10月8日至2013年11月4日。本基金为契约型开放式基金,存转期限不定,聚集资金企制为人民币586.204.4619元,有效从即等效为1.531户。广发中债金融债的数基金企业基金("水基金",产加险从购费用后的募集资金净的人民币503.305.154.5元,认购资金在募集期间的利息为人民币48.955.5元;"发中债金融债指数基金之基金("次基金"),11部认购费用后的募货资金净服32.905.971.1元,从财金全在募集期间的利息为人民币203.305.154.5元,认购资金在募集期间产生的利息报金合同的有关约定计人基金的物特有人的基金账户。本基金募集资金经缴助华央全计师事务所得探普通合人的检查。据据(中华人民共和国运步投资基金产)。12年为代金产营业的基金产业、发展、12年发生,1

7.42 会计报表的编制基础 本基金的粉料免费按照的张正子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 于基金行业字条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 "过来务操作。 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明 本基金龄务标符合企业会计准则和中国证金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 年年12月31日及2013年12月31日的财务状况以及2014年度及2013年11月7日(基金合同生效日)至2013年12月31日止期间的经营成 1年公全场在实验的

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。可比期间的会计年度为2013年11月7日(基金合同生效日)至

列收。 本基金持有的各类应收款项、买人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

以公允价值计量目其变动计人当期损益的金融资产

1.以公允价值计量且其变动时、当期报益的金融资产 ()股票投资 买人股票于交易日按股票的公允价值人账、相关交易费用直接计人当期报益。 因股权分置效率而获得的非涨温酸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 的收据运业股和公份会种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运股或转增比例,计 能增加的股票开发易日确认股票投资收益。实出股票按移动加权平均法结转成本。 (2) 债券特登

李出設兩字交易日輸出限票投资收益。 突出股票按移如加收平均达后47000.4年。 2) 伯券投资 次人债券子交易日按债券的公允价值。基。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 购买日止的利润作为应收利息单独转算。 企组及认见新发行的分离交易可控除债券,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 原于债券部分的成本。 另一次,并需报和零息债券税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 2000.41

买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。
(5) 较证投资
买人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。
获赚的权证包括危股权问。在除权日按照持有的股级及获赠比例、计算确定增加的权证数量,成本为零。
程度投入膨胀设分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
"确定应归属于权证部分的成本。 卖出权证于交易日相从权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。 2. 贷款及应收货间。

是你企业企业 这售金融资产 达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。 这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入金额。 买入返售金融资产于返售日

"HIEDPHYSIONISM" 数十交易日按照应收成实际收割的金额人账 相关交易费用计入初始输入金额。卖出回购金融资产数于回购交额组余额指挥。 "种心融价输的估值原则 7.4.4 在证据环中心融价输的估值原则 7.4.4 在证据环中心理论品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值,估值日光市价,且最近交易日后经济环境未发生重 变化且证券发行的标准大业生物证法,如估值日五市价,采用市价确定公允价值,估值日光市价,且最近交易日后经济环境未发生重 变化且证券发行的标准大业生物证的。如估值日上市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化促进券发行机构发生了影响证券 2. 对存在活跃市场的投资品种,如估值日上市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化促进券发行机构发生了影响证券 记录中种、使储在招值额处计值。信任日总基金资产多用价,确定公允价值。 3. 当货房品中环存在还跃环境,且其整合估值服务时,但是公允价值。 3. 当货房品中环存在还跃环境,且其整合估值服务对向压发验产净查值影响在0.25%以上或基金管理人借查员 只核投资品种的估值方达和下。

学育程票的积极增强成本。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证券交易所上市市实行净价交易的债券报价值的净价分公价价值。未上市流通的债券按成本估值。
每国银行河间业市场交易的债券采用估值技术确定公允价值。
同一债券明估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) 以证投资
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。
范围及以股份资度与司申收债券所获得的权证主事取得用。至定交易所上市交易前、采用估值技术确定公允价值。
如估值技术则按成本计量。
因持有股票而享有价配股权,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。
对确简证报表明按上达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是最低度经少公价值的价格。

如有确值证据表明按上定方法不能客家已被交易任金融工具的公价值。基金管理人特積据具体情况与基金托管人商定后确定最级足缺公价值的物格。
定量据是联公允价值的物格。
成为公价值的物格。
成为公价值的物格。
成为公价值的增加,在一个企业。
有一层次数,但是在计量上链缘取得参加的资产或价值在活跃时场上未经现整的现价。
第一层次数,低是在计量上链缘取得参加的资产或价值在活跃时场上未经现整的现价。
第二层次数,低是在计量上链缘取得参加的资产或价值在活跃时场上未经现整的现价。
第二层次数,优是是计关资产或价值的不可观察输入值。
第二层次数,优是是计关资产或价值的不可观察输入值。
第二层次数,优是是计关资产或价值的不可观察输入值。
第二层次数,优是是计关资产或价值的不可观察输入值。
第二层次数,优是是计关资产或价值的还有一个企业。
第一层次数,位是是对关于或负值的还是仅利,目前可执行该种法定仅利,同时本基金计划以净额结算或同时变现金融资产负债表的对策。
24.46、实现实现金融资产和金融价值以相互抵销后的金额在资产负债表内对示。除此以外、金融资产和金融价值。在资产负债表的对外交价量。
24.47、实现金。
24.

关权选至为对外交行选定的物所可以的证额。 中時、原則、中學及紅利神及安古。此時失改。在它與可分的工工还各交份網以 比別。

7.4.8 提至平在全 指益平產金指申時、赎回、转人、转出及红利再投资等事项等效基金份额变动时,相关款项中包含的未分配利润。 根据交易申请 日料期分配余外壳产制的企业,是不实现部分各自占基金净值的比例,指益平准金分为已实现描述平准金和未实现超益平准金。 据益平准金子基金申编编从已提及全额回编从日以,并于期条金额转入和调分配(未均配)等。 1. 有息收入(用头的编队和计量 1. 有息收入(用头的编队和计量 1. 有息收入(用头的编队的计量 1. 有息收入(用头的编队及在转为省债券制度,按约等的明那价值和职面利率计算的利息和验适用情况下由债券发行企业代 1. 的能息债务价值券利息收入在转为省债券制度,按约等的原那价值和职面利率计算的利息和验适用情况下由债券发行企业代 1. 优惠的人员和保护和企业分配,是一个企业分配。 1. 至人及是金融资产收入及还有金融资产的摊金成本在还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 7. 则实用合同利率计算确定利息收入。

(3) 杂人改售金融股产"私人农块人心的严重规则,约7年74年。

) 别采用信用料干算编定的建筑。

2. 投资收益

(1) 联票报价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股票投资成本的差额确认。
(3) 衍生工具投资效量于交易日按卖出的券交易目的成交总额扣除应持转的债券投资成本有的萎缩确认。
(4) 化养成人开除足口按上出价量的分组泵出代例计算必多额指除由上市公司代和代徵的个人所得税后的净额确认。
(4) 化养成人开除足口按上市公司运售的分组泵出代例计算必多额销除由上市公司代和代徵的个人所得税后的净额确认。
(5) 作业主要处据之计后值日按以允分价值并度且其变动计、丛明损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认,并于积少金融资产/价值类出被发制的目标以允分价值计算且其实动计、丛明超级的一届基金资产等值、20.40%的平费率还计提。
(7.44.10 期价值从10.40%的一日基金资产等值、20.40%的平费率还计提。
2.本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产等值、20.40%的年费率还计提。
3.本基金次基金份额不收取销售服务费、次基金份额价值服务费按价一日次份额基金资产净值的0.30%年费率计提。
4.以公允价值计量且其实过计人当期报金的金融资产的交易费用发生却按照确定的金额计人交易费用。
5.实出回购金融产产支出按实出回购金融资产数的金融资产的交易费用发生却按照确定的金额计人交易费用。
5.实出回购金融产产支出按实出回购金融资产数的金额方等的转录成本在回购期内以实际利率注度日计提、指合同利率计算确定规则。20.20%,20

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 差错史正的说明 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 程面

/ 4.6 於以 根限附近部。国家税务总局财税[2004]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 投资基金的收改货的通知)。财税[2005]103号文(关于按及分置试点应靠有关税收改策问题的通知)。财税[2004]78号文(财政部、国家 经券金局关于企业所得接着于任建政策的通知)。2008年9月18日(七海、深圳市委务局所关于做好证券交易市花税能证为方法侧整工 作的通知)。财税[2012]85号文(关于安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、主要税项两户如下;

作、主要税的研究如下;
1.以发行基金为式票集价金、不属于营业税值收范围、不整纳营业税。
2.对证券投资基金为式票集价金、不属于营业税值收范围、不整纳营业税。
2.对证券投资基金为式票集价金、不属于营业税值收范围、不整纳营业税。
2.对证券投资基金从工票集价市中取得的吸收。人居还实费股票,债券的总统价收入,股权的股息,红和收入,债券的利息收入及其他收入,包不整纳企业所得税。
3.2013年1月日日间,对基金股份的股票股息,红利收入,由上市公司市高基金支付上述收入时代和代量20%的个人所得税,上市公司租赁,持股利用公司市代和代金财产,就按20%计算运动投资价格。
自2013年1月日日间,对基金股份所得额。自2013年1月日后,对基金从公开发行和附上市场取得的上市公司股票,持股利原位个月均少估个1月的。是这些工资所等是被付上金财务的产价,且企业工作工作。即被250%计入应,将股价等额,持股利限报过。1年的"自300%"的发现,在100%的发生计位"人分所得税"。
4.对盖金股份的货币则,在100%的发生,在100%的发生计位"人分所得税"。
4.对盖金股份的货币则以及100%的发生,在100%的发生,

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	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(注)	基金管理人母公司、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	基金管理人控股子公司

》)"安证券股份有限公司的子公司。 除此之外,本报告期及上年度可比期间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。 7.48 本报告期及上年度可比则间的关联方交易 7.48.1 油之法形交易将止选行的交易 7.48.1 油之法形交易将止选行的交易 本基金本报告期内及上年度可比期间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 本基金本报告期内及上年度可比期间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

关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年11月7日(基金合同生效日)至2013年12月31日	
大峽刀名称	成交金額	占当期债券成交总 額的比例	成交金額	占当期债券成交总 額的比例
广发证券股份有限公司	6,472,064.10	100.00%	-	-
7.4.8.1.4 债券回购交易				金额单位:人民币
关联方名称	本期 2014年1月1日至2014年12月31日		上年度可比期间 2013年11月7日(基金合同生效日	
大駅刀右柳	成交金額	占当期债券回购成 交总额的比例	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	856,800,000.00	100.00%	-	-
7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金 本基金本报告期内及上年度可		佣金,本报告期末	及上年度末无应付关联方佣金	余额。

金额单位:人民币元

7.4.8.2 大联方报酬 7.4.8.2.1 基金管理费		单位:人民而元
項目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年11月7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	256,191.74	348,207.65
其中:支付销售机构的客户维护费	76,922.14	-
共中:文刊前曹机构的各户组扩展		_

7.4.8.2.2 基金托管费		单位:人民币
項目	本期 2014年1月1日至2014年12月31日	上年度可比期间 2013年11月7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	64,047.95	87,051.90
注:本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10 H=E×0.10 %+ 当年天数 H为每日应计梯的基金托管费	%的年费率计提。托管费的计算方法	如下:

日为每日应计据的基金件管费 起为前一日的基金符字档 基金托管费告日计算,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。 7-88.23.销售服务费

获得销售服务费的各关联方名	本明 2014年1月1日至2014年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费				
称					
	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类	合计		
中国银行股份有限公司	=	52,530.67	52,530.		
广发证券股份有限公司	-	36.23	36.		
广发基金管理有限公司	-	30,742.18	30,742.		
合计	-	83,309.08	83,309.		
获得销售服务费的 名关联方名	2013年11月	上年度可比期间 17日(基金合同生效日)至2013年12月31日			
称	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类	合计		
中国银行股份有限公司	-	113,796.68	113,796.		
广发证券股份有限公司	=	16.52	16.		
广发基金管理有限公司	-	287.49	287.		
合计	-	114,100.69	114,100.		

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按前一日C类基金份额资产净值的0.30 %年费率计提; 计算方法如下;

第方法证下: H=E×030%+当年天数 H为C壳基金价需每日应过程的销售服务费 E分C类金分份编与日本金货产净值 基金销售服务费每日计据,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令,经基金托管人复核后于次月 少工作自均从基金财产中一次性则出,由注册蛋记机协付收,注册蛋记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。宏 法注节度日之休日等、支付日期编述。 74483与关环方进行被们间设证场的债券含回购交易

						单位:人民
		2014年1月1日	本期 至2014年12月31日			
银行间市场交易的	債券交易金額		基金逆回购		基金正回购	
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国银行股份有限 公司	-	10,697,189.32	-	-	20,000,000.00	9,520.5
·	201	上年 13年11月7日(基金台	度可比期间 同生效日)至2013年	12月31日	•	
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金	80	基金逆	回胸	基金正回	购
	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国银行股份有限 公司	-	-	-	-		-

7-8.4 各关联方投资本基金的情况 7-8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 本报告期内及上年度可比期间基金管理人云运用固有资金投资本基金的情况。 7-8.4.2 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。

一发中情企圖術指数表 本报告期末及上年度末元端基金管理人之外的其他宋乾力投资本基金的情况。 "及中能量越南特数之荣 本报告期末及上年度末元端基金管理人之外的其他宋敦力投资本基金的情况。 74.8.5 由来表为保管的银行产就会截逐是期产生的相处收入

债券代码 债券名称 回购到期日 140210 14因开10 2015-01-07 7. 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购 截至本报告期末2014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实出回购证券款,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进具 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,其账而价值接近于公允价值。

(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工具 (2)以公允价值计量的金融工具 (2)以公允价值计量的金融工具 (3)全融工具公允价值计量的方法 本基金对以公允价值进行与统计量协会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 是是级、公允价值计量层势全则附注7.44.5。 (a)各层级金融工具公允价值 于2014年19月31日,本基金特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32,028,000.00元,无属于第一层级及第三层级的余额。 (4)公允价值万属层级间的重大变动 对于证券交易所上的金融工具处。 (4)公允价值万属层级间的重大变动 对于证券交易所上的金融平和债券。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。本基金分别于停槽日至交易 恢复活跃日期间、支易不活跃期间及废售期间将相关股票和债券的公允价值则入第一层级或第三层级,上还事项制除时将相关股票 和债券的公允价值则入第一层级。 (4)第二层级公允价值实额和债券。若由现重大事项停牌、交易不活跃,或属于非公开发行等情况。本基金分别于停槽日至交易 恢复活跃日期间、支易不活跃期间及废售期间将用关股票和债券的公允价值则入第一层级。

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

序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	Ξ	
	其中:股票	=	
2	固定收益投资	32,028,000.00	82.6
	其中:债券	32,028,000.00	82.6
	资产支持证券	-	
3	贵金属投资	-	
4	金融衍生品投资	-	
5	买人返售金融资产	2,300,000.00	5.9
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
6	银行存款和结算备付金合计	1,428,369.35	3.6
7	其他各项资产	3,013,216.80	7.7
8	合计	38,769,586.15	100.0

8.2 期末按行业分类的股票投资组合 本基金本报告期末末特有股票 8.3 期末按公允价值占基金资产单值比例大小排序的前十名股票投资押细 本基金本报告期末末特有股票 8.4 报告期内处理投资组合的重大变动 8.41 累计买人金额担出制的基金资产净值2%或前20名的股票用细 本基金本报告期末末特有股票 8.42 累计实出金额担出制初基金资产净值2%或前20名的股票用细 本基金本报告制率由来未特有股票

投资组合报告附注 1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,也未出现在报告编制日前一句 受到公开谴责、处罚的情形。8.12.2本报告期内,基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

		単位:人民市
序号	名称	金額
1	存出保证金	1,356.12
2	应收证券清算款	1,800,622.50
3	应收股利	=
4	应收利息	1,094,099.38
5	应收申购款	117,138.80
6	其他应收款	=
7	待擁费用	-
8	其他	=
9	合计	3,013,216.80

			持有人结构						
份額級别	持有人户数(户	_{V(口)} 户均持有的基金份	机构投资者		个人投资者				
	10 11 70 110	が 額	持有任	分額	占总份额比例	持有份額		占总份额比 例	
广发中债金融债指数A类	191	25,578.61		48,070.41	0.98%		4,837,443.38	99.02%	
广发中债金融债指数C类	199	103,863.07	11.	,092,760.59	53.67%		9,575,990.33	46.33%	
合计	390	65,523.76	11.	,140,831.00	43.60%		14,413,433.71	56.40%	
9.2 期末基金管理人的	1从业人员持	有本基金的情况							
項目		份額級别			持有份額总数	(份)	占据	金总份额比例	
基金管理人所有从业人员持有本基金		广发中债金融债指数A类			0.00		0.0000%		
		广发中债金融债指数C类		0.00			0.0000%		
			合计		0.00			0.0000%	
9.3期末基金管理人的	从业人员持有	本开放式基金份额总	量区间的恒	青况					
项目		份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)						
		广发中债金融债指数A类		0					
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金		广发中债金融债指数C类		0					
		合计		0					
		广发中债金融债指数A	类			0			
本基金基金经理持有本开放式基金		广发中债金融债指数C	25			0			
		A-14		^					

	1.1 71		v	
	§ 10 开放式基	金份额变动		
			单位:	分
項目	广发中债金融	t债指数A类	广发中债金融债指数C类	
k金合同生效日(2013年11月7日)基金份額总額		203,354,110.09	382,940,326.10	
(报告期期初基金份额总额)		203,354,110.09	382,940,326.10	
x报告期基金总申购份額		189,887,827.21	61,514,349.50	
t,本报告期基金总赎回份額		388,356,423.51	423,785,924.68	
x报告期基金拆分变动份额		-	=	
(报告期期末基金份額总額		4,885,513.79	20,668,750.92	

11.1基金份额持有人大会决议 本报告期内来召开基金份额持有人大会。 11.2 基金管理人,基金件管人,卷4.1性全人,基金件管从的专门基金杆管部门的重大人事变动 2014年8月8日,除价军因工作调动不再担任本基金管理人的副总经理。2014年9月12日,本基金管理人聘任包林生为公司副总经

§ 11 重大事件揭示

2014年3月8日,陈作年因工作则动术再担任本基金管理人的副总经理。2014年9月12日,本基金 和关本明显向中国证券投资盈金业协会卷集。 12014年2月14日中国银行股份有限公司公告,自2014年2月13日起,陈四清先生担任本行行长。 13. 涉及基金管理人基金的要决产,基金任管业外的诉讼 本报告期内未发金投资额格的交变 本报告期内本基金投资额格不发生改变。 11.5对基金进行审计的设计师审多所情况 本报告期内本基金物清的会计师审多所情况 本报告期内本基金物清的会计师事多所未完 在16. 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,并够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,并够入及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。 11.7 基金相用服务公司安易单元的各关情况

11.7 基金租用证 11.7.1基金租用证		元的有关情况 元进行股票投资及佣金3	2付情况		金	:额单位:人區
	交易单元	股票交易		应支付该券商的佣金		
券商名称	数量	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	备注
广发证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
Fast how how also						DALL she ()

海道正考

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连顺行为;
(2)经营行为规范,内控制度维急,在业内有良好的声誉;
(3)具备校选作所需的成、变金、余龄的库位资源。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,准确地的公司提供关于宏观,行业,市场及个股的高质量报告,并能根据基金投资的转乘要求,提供使们的扩张程管;
(5)能积极分公司投资业务的开展,提供良好的信息交流和客户服务;
(6)能股根分公司投资业务的开展,提供良益企业和企业分别,在成功企业分别,在成功企业分别,在成功企业分别,在成功企业分别,在成功企业分别,在成功企业公司。

10 用經歷中於歐亞並出下中年至月間的限分。 2.交易斯位连续報酬: (1) 对交易单元能选等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及单元的参编。 (2) 的汉签署及南欧托管人、本基金管理人与被选择的参商签订交易单元租用协议,并通知基金托管人。 (1) 12 基金租用服务公司支管单元进行降低率投资价价配。

6.472,064.10 100.00% 856,800,000.00 100 \$ 12 影响投资者决策的其他重要信息