

# 广发中债金融债指数证券投资基金

## 2015 年第 2 季度报告

2015 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一五年七月二十一日

## § 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 7 月 15 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发中债金融债指数
基金主代码	000348
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013 年 11 月 7 日
报告期末基金份额总额	6,901,908.06 份
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	本基金为指数基金，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成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，综合考虑跟踪效果、操作风险等因素构建组合，并根据本基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性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、控制跟踪误差、降低交易成本的目的。	
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准: 95%×中债-5 年期金融债指数收益率+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。本基金采用优化抽样复制策略,跟踪中债-5 年期金融债指数,具有与标的指数、以及标的指数所代表的债券市场相似的风险收益特征。	
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	
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额总额	3,769,455.11 份	3,132,452.95 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位: 人民币元

主要财务指标	报告期 (2015 年 4 月 1 日-2015 年 6 月 30 日)	
	广发中债金融债指数 A 类	广发中债金融债指数 C 类
1.本期已实现收益	276,778.16	229,933.82
2.本期利润	157,787.83	184,562.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0197	0.0141

4.期末基金资产净值	4,161,510.83	3,440,525.95
5.期末基金份额净值	1.1040	1.0983

注：(1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1、广发中债金融债指数 A 类：

阶段	净值增长率①	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	0.92%	0.15%	1.17%	0.17%	-0.25%	-0.02%

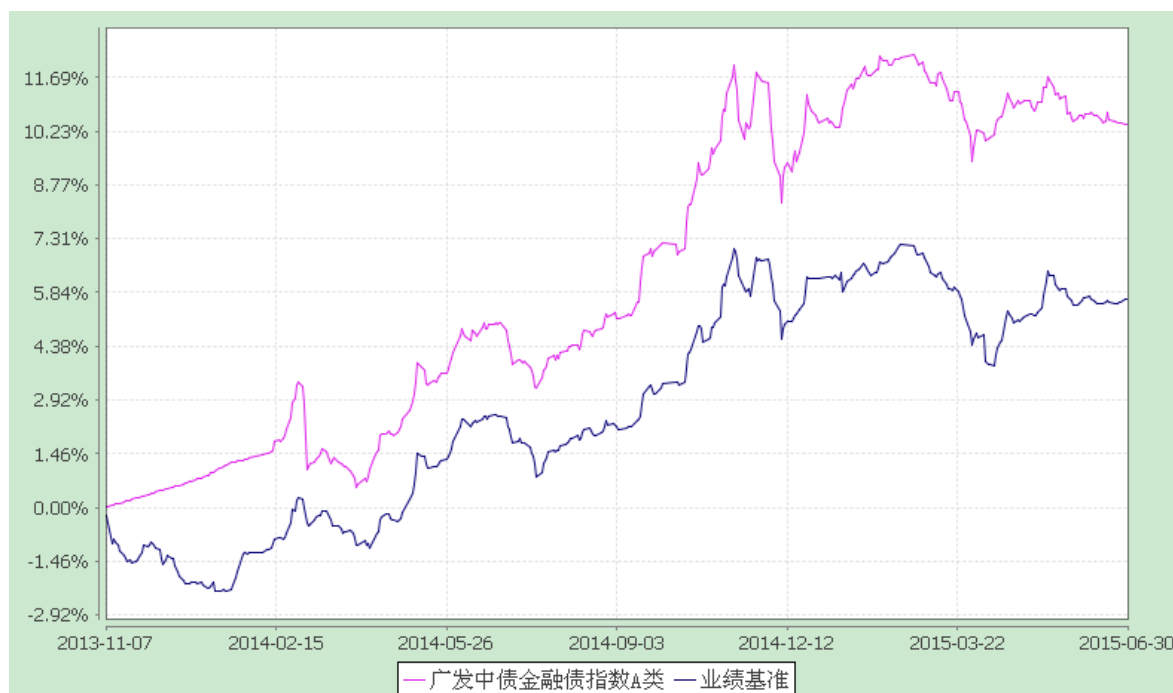
##### 2、广发中债金融债指数 C 类：

阶段	净值增长率①	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	0.82%	0.15%	1.17%	0.17%	-0.35%	-0.02%

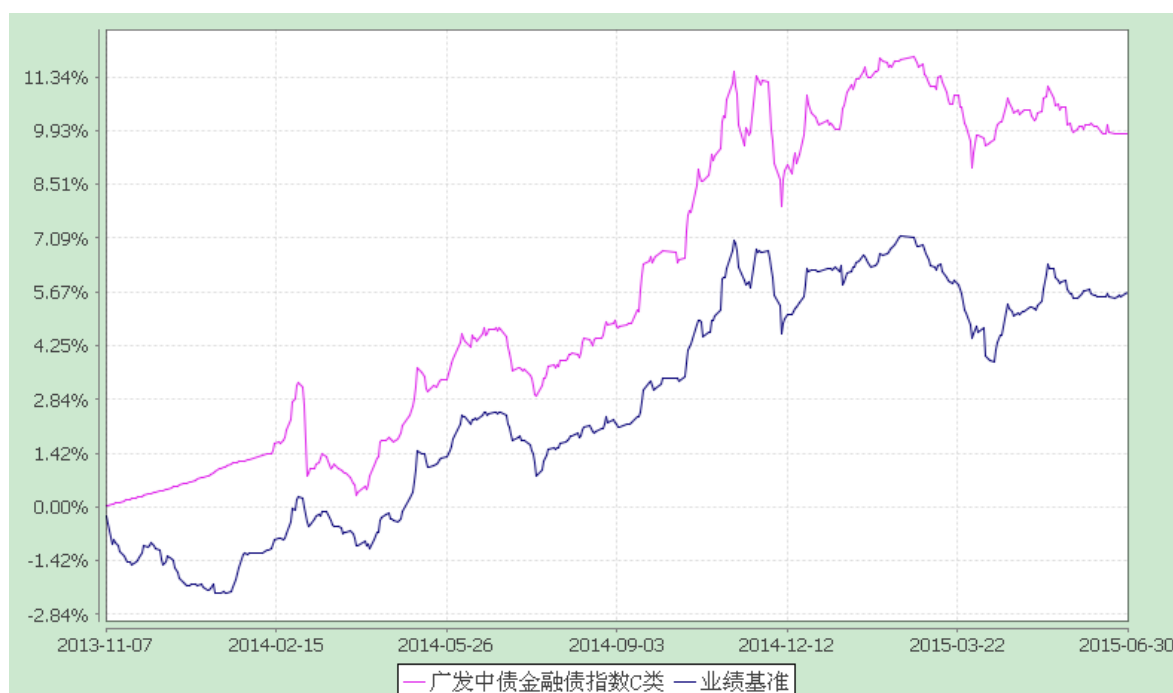
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中债金融债指数证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
 (2013 年 11 月 7 日至 2015 年 6 月 30 日)

##### 1. 广发中债金融债指数 A 类：



2. 广发中债金融债指数 C 类:



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 期限	证券从业 年限	说明
----	----	-----------------	------------	----

		任职日期	离任日期		
钟伟	本基金的基金经理；广发对冲套利混合基金的基金经理	2013-11-07	-	6 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，2015 年 2 月 6 日起任广发对冲套利混合基金的基金经理。

注：1.“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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。监察稽核部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度，债市整体表现平稳，短端收益率在央行持续的宽松政策刺激下，收益率大幅下行；中长端收益率呈“V”型走势，表现为“4月下行、5月上行、6月震荡”的盘面。

利率债方面，短端收益率持续下探，中长端收益率先下后上。4月初，虽然央行持续下调7天逆回购利率，金融、经济数据利好，但利好兑现之际，总会引来交易盘出货行情，二级市场表现不温不火，中长端收益率宽幅震荡；4月19日，央行宣布降准，政策力度超出预期，中长端收益率出现大幅下行。5月8日晚，央行宣布降息，此后一周内，以基金专户为主的配置盘力量主攻存在利差空间的券种，收益率大幅下行，5月中下旬开始，由于以基金专户为主的配置机构买入节奏放缓，市场部分交易盘获利了结，中长端收益率开始触底回调。6月份，市场表现平平，部分经济数据出现企稳回升迹象，虽然中下旬各种利好消息频出，但市场买盘并未表现出积极性，成交清淡，收益率也呈现出弱势震荡格局。

报告期内，本基金A类和C类的日均跟踪偏离度的绝对值为0.08%，符合基金合同的规定。

作为被动型的指数基金，本基金采用抽样复制的方法，选取流动性较好的政策性金融债构建投资组合，较好的跟踪了标的指数。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类份额的净值增长率为0.92%，C类份额的净值增长率为0.82%，同期业绩比较基准收益率为1.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基金后续需要终止合同，基金会变现债券资产，保持足够的流动性以应对

基金的清盘工作。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金于 2015 年 4 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日连续 62 个工作日出现资产净值低于五千万。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	8,938,838.84	96.21
7	其他各项资产	351,757.91	3.79
8	合计	9,290,596.75	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 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

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券



**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债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**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。

**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**

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。

**5.9 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持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

**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持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

**5.11 投资组合报告附注**

5.11.1 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。

5.11.2 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**5.11.3 其他各项资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	257.29
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,990.76
5	应收申购款	349,509.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	351,757.91
---	----	------------

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 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

单位：份

项目	广发中债金融债指数A类	广发中债金融债指数C类
本报告期期初基金份额总额	6,498,886.17	15,127,028.06
本报告期基金总申购份额	20,889,506.55	4,919,283.70
减：本报告期基金总赎回份额	23,618,937.61	16,913,858.81
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,769,455.11	3,132,452.95

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

#### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

### § 8 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金于 2014 年 11 月 13 日至 2014 年 12 月 31 日连续 35 个工作日出现资产净值低于五千万。

### § 9 备查文件目录

#### 9.1 备查文件目录

1. 经中国证监会注册的广发中债金融债指数证券投资基金募集的文件；

2. 《广发中债金融债指数证券投资基金基金合同》;
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;
4. 《广发中债金融债指数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。

## 9.2 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

## 9.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：[services@gf-funds.com.cn](mailto:services@gf-funds.com.cn)。

广发基金管理有限公司  
二〇一五年七月二十一日