

# 广发集利一年定期开放债券型证券投资基金

## 2016 年半年度报告摘要

2016 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：二〇一六年八月二十六日

## 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 2016 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                    |                  |
|-----------------|--------------------|------------------|
| 基金简称            | 广发集利一年定期开放债券       |                  |
| 基金主代码           | 000267             |                  |
| 交易代码            | 000267             |                  |
| 基金运作方式          | 契约型定期开放式           |                  |
| 基金合同生效日         | 2013 年 8 月 21 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       |                  |
| 报告期末基金份额总额      | 1,773,726,357.21 份 |                  |
| 基金合同存续期         | 不定期                |                  |
| 下属两级基金的基金简称     | 广发集利一年定期开放债券 A     | 广发集利一年定期开放债券 C   |
| 下属两级基金的交易代码     | 000267             | 000268           |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,452,441,479.36 份 | 321,284,877.85 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。  |
| 投资策略   | 本基金主要投资于固定收益类品种，不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产，也不参与一级市场新股申购或股票增发。本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。 |
| 业绩比较基准 | 银行一年期定期存款税后利率+0.5%  |
| 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。  |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目          |      | 基金管理人                 | 基金托管人               |
|-------------|------|-----------------------|---------------------|
| 名称          |      | 广发基金管理有限公司            | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 段西军                   | 洪渊                  |
|             | 联系电话 | 020-83936666          | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | dxj@gffunds.com.cn    | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 95105828,020-83936999 | 95588               |
| 传真          |      | 020-89899158          | 010-66105798        |

## 2.4 信息披露方式

|                      |                                 |
|----------------------|---------------------------------|
| 登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址 | http://www.gffunds.com.cn       |
| 基金半年度报告备置地点          | 广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日） |                |
|---------------|--------------------------------------|----------------|
|               | 广发集利一年定期开放债券 A                       | 广发集利一年定期开放债券 C |
| 本期已实现收益       | 60,203,941.49                        | 12,543,047.82  |
| 本期利润          | 31,965,340.79                        | 6,317,049.11   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0220                               | 0.0197         |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.93%                                | 1.73%          |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.92%                                | 1.75%          |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2016 年 6 月 30 日)                |                |
|               | 广发集利一年定期开放债券 A                       | 广发集利一年定期开放债券 C |
| 期末可供分配利润      | 125,371,271.50                       | 26,371,497.28  |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0863                               | 0.0821         |
| 期末基金资产净值      | 1,645,991,226.39                     | 362,671,567.70 |
| 期末基金份额净值      | 1.133                                | 1.129          |

注：（1）所述基金财务指标不包括持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）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孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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

广发集利一年定期开放债券 A

| 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

|            |        |       |       |       |        |       |
|------------|--------|-------|-------|-------|--------|-------|
| 过去一个月      | 1.07%  | 0.05% | 0.17% | 0.00% | 0.90%  | 0.05% |
| 过去三个月      | -0.33% | 0.17% | 0.51% | 0.00% | -0.84% | 0.17% |
| 过去六个月      | 1.92%  | 0.14% | 1.01% | 0.00% | 0.91%  | 0.14% |
| 过去一年       | 9.51%  | 0.13% | 2.15% | 0.00% | 7.36%  | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 37.99% | 0.22% | 8.48% | 0.00% | 29.51% | 0.22% |

广发集利一年定期开放债券 C

| 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   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 1.07%    | 0.07%       | 0.17%      | 0.00%         | 0.90%  | 0.07% |
| 过去三个月      | -0.42%   | 0.17%       | 0.51%      | 0.00%         | -0.93% | 0.17% |
| 过去六个月      | 1.75%    | 0.14%       | 1.01%      | 0.00%         | 0.74%  | 0.14% |
| 过去一年       | 9.16%    | 0.13%       | 2.15%      | 0.00%         | 7.01%  | 0.13% |
| 自基金合同生效起至今 | 36.39%   | 0.22%       | 8.48%      | 0.00%         | 27.91% | 0.22% |

(1) 本基金业绩比较基准为，银行一年期定期存款税后利率+0.5%。

(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

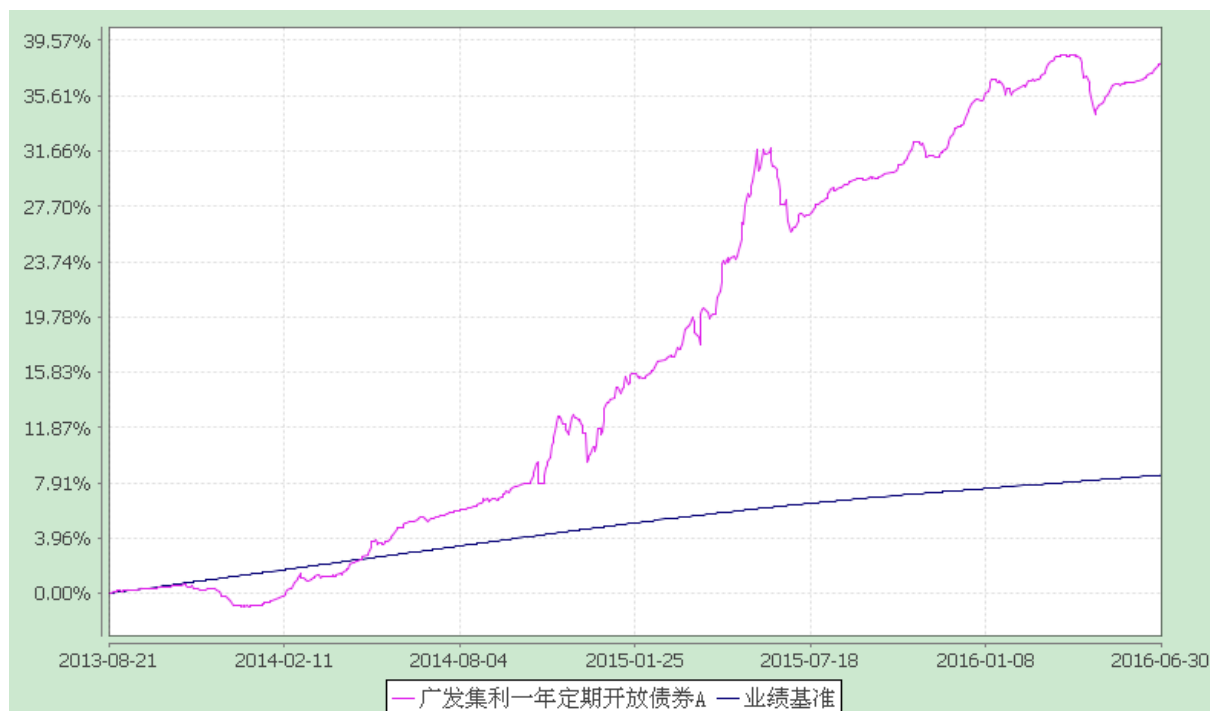
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集利一年定期开放债券型证券投资基金

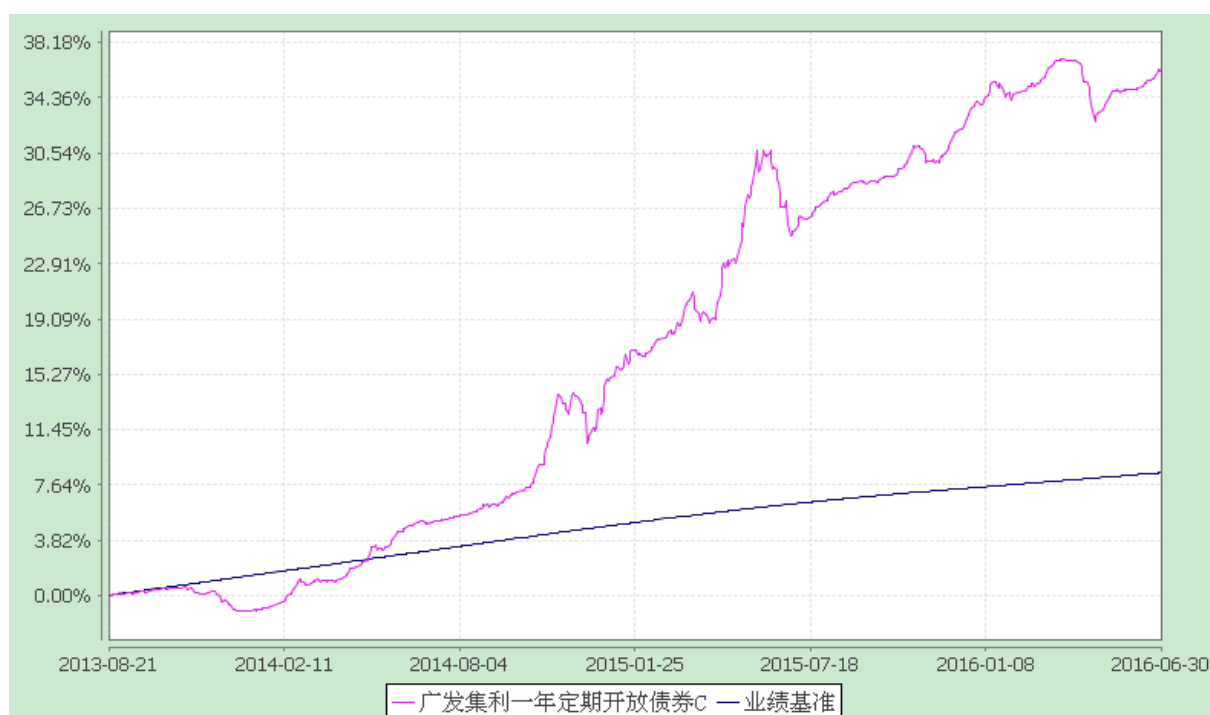
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 8 月 21 日至 2016 年 6 月 30 日)

广发集利一年定期开放债券 A



广发集利一年定期开放债券 C



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金、社保基金境内投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 25 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、北京办事处。此外，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理九十八只开放式基金---广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基

金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚康混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金，管理资产规模为 2341 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介



| 姓名 | 职务  | 任本基金的基金经理<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明   |
|----|---|----------------------|------|------------|--|
|    |   | 任职日期                 | 离任日期 |            |  |
| 代宇 | 本基金的基金经理；广发聚利债券基金的基金经理；广发聚财信用债券基金的基金经理；广发聚鑫债券基金的基金经理广发成长优选混合基金的基金经理；广发聚惠混合基金的基金经理；广发安泰回报混合基金的基金经理；广发安心回报混合基金的基金经理；广发双债添利债券基金的基金经理；固定收益部副总经理 | 2013-08-21           | -    | 11 年       | 女，中国籍，金融学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2005 年 7 月至 2011 年 6 月先后任广发基金管理有限公司固定收益部研究员及交易员、国际业务部研究员、机构投资部专户投资经理，2011 年 7 月调入固定收益部任投资人员，2011 年 8 月 5 日起任广发聚利债券基金的基金经理，2012 年 3 月 13 日起任广发聚财信用债券基金的基金经理，2013 年 6 月 5 日至 2015 年 7 月 23 日任广发聚鑫债券基金的基金经理，2013 年 8 月 21 日起任广发集利一年定期开放债券基金的基金经理，2015 年 2 月 17 日起任广发成长优选混合基金的基金经理，2015 年 4 月 15 日起任广发聚惠混合基金的基金经理，2015 年 5 月 14 日起任广发安泰回报混合基金和广发安心回报混合基金的基金经理，2015 年 5 月 27 日起任广发双债添利债券基金的基金经理，2016 年 4 月 26 日起任固定收益部副总经理。 |

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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、《广发集利一年定期开放债券型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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年上半年，债券市场从此前的趋势行情走向区间震荡。1 月份，债市在需求大于供给的作用下延续上涨，10 年国开一度触及 3.00%，但随后信贷高增和央行货币不再大幅宽松的影响下，收益率缓慢上行，此时信用利差仍在持续压缩；4 月后，受营改增、信用违约事件频发影响，市场出现调整，特别是基金遭遇赎回，造成利率债和信用债齐跌；直到 5 月营改增补丁出台，城投提前偿还取消、铁物资风波得到后续处理，债市恐慌情绪才有所缓解，利率债收益率也较此前小幅下行。6 月初，10 年国开债利率在 3.30-3.40% 左右震荡，10 年国债利率也回到 3.00% 以上；中下旬，市场虽然对 MPA 考核仍存警惕，但受到美联储加息节奏放缓、英国脱欧事件影响，避险情绪大幅提升，债券市场情绪回暖，收益率出现大幅下行。

期间，5 月初的权威人士专访是整个上半年债市行情转折的关键：“权威人士专访”代表着中

央高层对于经济形势的权威定调。专访对于经济增长、经济引擎、结构性改革、经济风险点、政策预期管理等重要问题都表明了态度。概括来看，这次的官方发言对于债市而言，极大得缓解了市场之前对于经济好转、通胀高位的担忧，结合 4 月进出口双双回落，衰退式顺差再现，债券市场情绪阶段性回暖。但从基本面来看，权威人士对 L 型经济形势的肯定意味着经济下行空间不大，从而短期内债券收益率进一步下探空间有限；并且当前的供给压力、信用风险、货币政策趋于中性等利空因素尚未得到有效改善，债市中短期或延续震荡格局。需要谨慎关注去产能过程中，信用风险的超预期蔓延：既要防范个券地雷和信用利差走扩，也要警惕市场可能出现的抛压对利率品种的牵连。

截至 6 月 30 日，中债综合净价指数下跌 0.63%。分品种看，中债国债总净价指数下跌 0.22%；中证金融债净价指数下跌 0.85%；中证企业债净价指数下跌 0.76%。

我们在上半年的纯债操作是缩短久期，精心挑选信用债品种，逐步降低杠杆，提升资质。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发集利定期开放债基 A 类净值增长率为 1.92%，广发集利定期开放债基 C 类净值增长率为 1.75%，同期业绩比较基准收益率为 1.01%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望第 2016 年下半年，我们认为债券市场可能陷于波动，杠杆的收益变薄，久期也很难带来超额收益。

2016 年第 2 季度，我们对债市市场的快速下跌和缓慢上涨记忆犹新，更值得引起注意的是不同债券品种在整个上半年的涨跌一致性都不如前两年那么明显，不仅是利率债和信用债有时候会稍有方向相左，金债和国债的同向性也在减。一方面，这说明债市参与者多元化程度在加深，一些新的衍生品工具也在潜移默化影响着市场，另一方面，也从侧面反映出债市的在目前的点位上分歧严重，比较纠结。展望 2016 年下半年，银行理财产品的收益率下降如此缓慢，依旧成为横亘在债券的收益率下的最大暗礁。3-4 季度将迎来低评级和过剩产能债券到期高峰，在信用风险频发的背景下如此低的信用利差，也使得信用债的投资处于食之无味的无奈的境地。最后，出人意料的脱欧事件，对人民币汇率也将产生深远的影响，进而加剧了资本市场的不确定性。

综上，我们坚持之前的判断，认为债市进入箱体波动的局面，杠杆套息面临的风险大过之前，久期能带来超额收益也变得不稳定，操作中应注意把握波段和节奏，否则收益极易受到市场波动的侵蚀。从国内来看，通胀重新成为关注的焦点，6-7 月席卷全国的高强度降雨，对 CPI 必将产生影响，进而大大影响债市预期。从全局来看，随着脱欧的确定，汇率的波动注定会成为资本市场

的焦点，极大左右了市场走势，需要密切跟踪。

股市在上半年涨跌互现，下半年有可能有更多的结构性机会。可转债市场正在慢慢丰富起来，我们认为可以根据不同产品的风险收益属性差别配置。

下半年我们计划保持杠杆，合理调控久期，梳理结构。同时密切关注市场机会的变化，择机调整策略，力保组合净值平稳增长。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，2016年1月20日广发集利一年定期开放债券 A 类每 10 份基金份额分配 0.320 元，广发集利一年定期开放债券 C 类每 10 份基金份额分配 0.310 元，2016 年 4 月 15 日广发集利一年定期开放债券 A 类每 10 份基金份额分配 0.280 元，广发集利一年定期开放债券 C 类每 10 份基金份额分配 0.270 元。截至 2016 年 6 月 30 日，广发集利一年定期开放债券 A 类可供分配利润为 125,371,271.50 元，广发集利一年定期开放债券 C 类可供分配利润为 26,371,497.28 元。本基金已于 2016 年 7 月 18 日实施了 2016 年度第 2 季度的利润分配，上述利润分配符合合同规定。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发集利一年定期开放债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发集利一年定期开放债券型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发集利一年定期开放债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发集利一年定期开放债券型证券投资基金对基金份额持有人进行了 2 次利润分配，分配金额为 105781010.39 元。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发集利一年定期开放债券型证券投资基金 2016 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：广发集利一年定期开放债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产         | 本期末<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2015 年 12 月 31 日 |
|------------|------------------------|--------------------------|
| <b>资产：</b> | -                      | -                        |
| 银行存款       | 435,049.59             | 8,858,937.28             |
| 结算备付金      | 16,039,092.64          | 12,978,045.09            |
| 存出保证金      | 29,820.13              | 123,628.67               |
| 交易性金融资产    | 3,297,698,825.60       | 3,970,970,584.12         |
| 其中：股票投资    | -                      | -                        |
| 基金投资       | -                      | -                        |

|                   |                                |                                  |
|-------------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 债券投资              | 3,297,698,825.60               | 3,970,970,584.12                 |
| 资产支持证券投资          | -                              | -                                |
| 贵金属投资             | -                              | -                                |
| 衍生金融资产            | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产          | -                              | -                                |
| 应收证券清算款           | -                              | -                                |
| 应收利息              | 69,199,672.51                  | 79,565,028.93                    |
| 应收股利              | -                              | -                                |
| 应收申购款             | -                              | -                                |
| 递延所得税资产           | -                              | -                                |
| 其他资产              | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>       | <b>3,383,402,460.47</b>        | <b>4,072,496,224.09</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>本期末<br/>2016 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2015 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债:</b>        | -                              | -                                |
| 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         | 1,372,251,431.00               | 1,992,312,758.35                 |
| 应付证券清算款           | -                              | -                                |
| 应付赎回款             | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬           | 1,144,122.01                   | 1,218,447.03                     |
| 应付托管费             | 326,892.01                     | 348,127.71                       |
| 应付销售服务费           | 118,059.47                     | 125,773.21                       |
| 应付交易费用            | 27,194.12                      | 31,459.90                        |
| 应交税费              | -                              | -                                |
| 应付利息              | 674,006.27                     | 1,934,243.31                     |
| 应付利润              | -                              | -                                |
| 递延所得税负债           | -                              | -                                |
| 其他负债              | 197,961.50                     | 364,000.00                       |
| <b>负债合计</b>       | <b>1,374,739,666.38</b>        | <b>1,996,334,809.51</b>          |
| <b>所有者权益:</b>     | -                              | -                                |
| 实收基金              | 1,773,726,357.21               | 1,773,726,357.21                 |
| 未分配利润             | 234,936,436.88                 | 302,435,057.37                   |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>2,008,662,794.09</b>        | <b>2,076,161,414.58</b>          |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>3,383,402,460.47</b>        | <b>4,072,496,224.09</b>          |

注：报告截止日 2016 年 6 月 30 日,广发集利一年定期开放债券 A 基金份额净值人民币 1.133 元,基金份额总额 1,452,441,479.36 份；广发集利一年定期开放债券 C 基金份额净值人民币 1.129 元,基金份额总额 321,284,877.85 份；总份额总额 1,773,726,357.21 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发集利一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                         | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至<br>2016 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至<br>2015 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|--|---|
| <b>一、收入</b>                | <b>69,804,080.96</b>                     | <b>57,637,009.84</b>                          |
| 1.利息收入                     | 96,713,775.81                            | 28,644,437.60                                 |
| 其中：存款利息收入                  | 165,785.82                               | 90,029.50                                     |
| 债券利息收入                     | 96,547,989.99                            | 28,545,489.34                                 |
| 资产支持证券利息收入                 | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入                 | -  | 8,918.76                                      |
| 其他利息收入                     | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 7,529,904.56                             | 35,064,768.40                                 |
| 其中：股票投资收益                  | -  | -   |
| 基金投资收益                     | -  | -   |
| 债券投资收益                     | 7,529,904.56                             | 35,064,768.40                                 |
| 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）      | -34,464,599.41                           | -6,072,196.16                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 25,000.00                                | -   |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>31,521,691.06</b>                     | <b>12,079,127.72</b>                          |
| 1. 管理人报酬                   | 7,049,184.73                             | 1,904,057.18                                  |
| 2. 托管费                     | 2,014,052.76                             | 544,016.34                                    |
| 3. 销售服务费                   | 727,558.26                               | 449,693.48                                    |
| 4. 交易费用                    | 12,223.14                                | 3,436.18                                      |
| 5. 利息支出                    | 21,500,530.19                            | 8,975,180.76                                  |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 21,500,530.19                            | 8,975,180.76                                  |
| 6. 其他费用                    | 218,141.98                               | 202,743.78                                    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>38,282,389.90</b>                     | <b>45,557,882.12</b>                          |
| 减：所得税费用                    | -  | -   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>38,282,389.90</b>                     | <b>45,557,882.12</b>                          |

## 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发集利一年定期开放债券型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日      |                 |                  |
|--|--|-----------------|------------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,773,726,357.21                           | 302,435,057.37  | 2,076,161,414.58 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 38,282,389.90   | 38,282,389.90    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -  | -               | -                |
| 其中：1.基金申购款                             | -  | -               | -                |
| 2.基金赎回款                                | -  | -               | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -105,781,010.39 | -105,781,010.39  |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,773,726,357.21                           | 234,936,436.88  | 2,008,662,794.09 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日 |                 |                  |
|  | 实收基金                                       | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 476,661,067.33                             | 58,670,700.58   | 535,331,767.91   |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 45,557,882.12   | 45,557,882.12    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -  | -               | -                |
| 其中：1.基金申购款                             | -  | -               | -                |
| 2.基金赎回款                                | -  | -               | -                |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -25,624,000.48  | -25,624,000.48   |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 476,661,067.33                             | 78,604,582.22   | 555,265,649.55   |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章



## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发集利一年定期开放债券型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2013]839号《关于核准广发集利一年定期开放债券型证券投资基金募集的批复》核准,由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发集利一年定期开放债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2013年8月21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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为2013年7月29日至2013年8月16日,本基金为契约型开放式基金,以定期开放方式运作,存续期限不定,根据认购费用收取方式不同将基金份额分为不同类别。本基金募集资金总额为人民币1,319,727,276.43元,有效认购户数为7,118户。其中广发集利一年定期开放债券A类基金(“A类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额为人民币985,931,790.88元,认购资金在募集期间的利息为人民币186,998.92元;广发集利一年定期开放债券C类基金(“C类基金”)的募集资金净额333,565,498.03元,认购资金在募集期间的利息为人民币42,988.60元。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具,包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、可转债(含可分离交易可转债)、短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、集合债券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。本基金业绩比较基准为银行一年期定期存款税后利率+0.5%。

本基金的财务报表于2016年8月22日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及中国证监会发布的关于基金行业实务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金行业实务操作。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]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《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实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》、财税[2015]101 号《关于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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券

免征营业税和增值税。

3.对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

4.对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，其中股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之前的，暂减按 25%计入应纳税所得额，股权登记日在 2015 年 9 月 8 日之后的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

5.对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

6.对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

7.基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免予缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内不存在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。

### 6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称        | 与本基金的关系                    |
|--------------|----------------------------|
| 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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人、代销机构                 |
| 广发证券股份有限公司   | 基金管理人母公司、代销机构              |

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

### 6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                  | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                  |
|------------|----------------------------|------------------|---------------------------------|------------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期债券成交总额的<br>比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 132,363,479.52             | 100.00%          | 244,814,960.31                  | 100.00%          |

### 6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月30日 |                    | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |                    |
|------------|----------------------------|--------------------|---------------------------------|--------------------|
|            | 成交金额                       | 占当期债券回购成交总额的<br>比例 | 成交金额                            | 占当期债券回购成交总额的<br>比例 |
| 广发证券股份有限公司 | 19,494,287,000.00          | 100.00%            | 8,742,505,000.00                | 100.00%            |

### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

## 6.4.8.2 关联方报酬

### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016年1月1日至2016年6月 | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月 |
|----|-------------------------|------------------------------|
|----|-------------------------|------------------------------|

|                 | 30日          | 30日          |
|-----------------|--------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 7,049,184.73 | 1,904,057.18 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,632,694.42 | 720,449.10   |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，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管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   | 上年度可比期间              |
|----------------|----------------------|----------------------|
|                | 2016年1月1日至2016年6月30日 | 2015年1月1日至2015年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,014,052.76         | 544,016.34           |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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 3 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。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称   | 本期                   |
|------------------|----------------------|
|                  | 2016年1月1日至2016年6月30日 |
|                  | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |
| 广发基金管理有限<br>公司   | 84,305.71            |
| 中国工商银行股份<br>有限公司 | 375,787.23           |
| 广发证券股份有限         | 48,618.33            |

|                  |                                 |
|------------------|---------------------------------|
| 公司               |                                 |
| 合计               | 508,711.27                      |
| 获得销售服务费的各关联方名称   | 上年度可比期间<br>2015年1月1日至2015年6月30日 |
|                  | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |
| 广发基金管理有限<br>公司   | 3,861.54                        |
| 中国工商银行股份<br>有限公司 | 443,186.52                      |
| 广发证券股份有限<br>公司   | 266.35                          |
| 合计               | 447,314.41                      |

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年费率为 0.40%。

C 类份额基金销售服务费按前一日 C 类份额基金资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计算，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期                   |           | 上年度可比期间              |           |
|--------------|----------------------|-----------|----------------------|-----------|
|              | 2016年1月1日至2016年6月30日 |           | 2015年1月1日至2015年6月30日 |           |
|              | 期末余额                 | 当期利息收入    | 期末余额                 | 当期利息收入    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 435,049.59           | 28,192.53 | 28,462,869.39        | 33,282.38 |

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.9 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 245,999,431.00 元。

金额单位：人民币元

| 债券代码    | 债券名称           | 回购到期日      | 期末估值<br>单价 | 数量（张）        | 期末估值总额         |
|---------|----------------|------------|------------|--------------|----------------|
| 1180101 | 11 宁交通债        | 2016-07-04 | 110.08     | 300,000.00   | 33,024,000.00  |
| 1282531 | 12 乌城投<br>MTN1 | 2016-07-04 | 104.97     | 142,000.00   | 14,905,740.00  |
| 1380010 | 13 太仓城投<br>债   | 2016-07-04 | 85.33      | 200,000.00   | 17,066,000.00  |
| 1380034 | 13 泰山债         | 2016-07-04 | 85.61      | 1,000,000.00 | 85,610,000.00  |
| 1380301 | 13 株城发债        | 2016-07-04 | 108.40     | 200,000.00   | 21,680,000.00  |
| 1480109 | 14 长沙土开<br>债   | 2016-07-04 | 109.51     | 800,000.00   | 87,608,000.00  |
| 合计      |                |            |            | 2,642,000.00 | 259,893,740.00 |

###### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 1,126,252,000.00 元，于 2016 年 7 月 1 日至 2016 年 7 月 26 日期间先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.10 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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2)以公允价值计量的金融工具

##### (I)金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的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量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

##### (ii)各层级金融工具公允价值

于 2016 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第一层级的余额，属于第二层级的余额为 3,297,698,825.60 元，无属于第三层级的余额(2015 年 12 月 31 日：无属于第一层级的余额，第二层级 3,920,974,617.00 元，第三层级 49,995,967.12 元)。

##### (iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，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，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

##### (iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

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。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目     | 金额               | 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 | 3,297,698,825.60 | 97.47         |



|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：债券             | 3,297,698,825.60 | 97.47  |
|   | 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      | 16,474,142.23    | 0.49   |
| 7 | 其他各项资产            | 69,229,492.64    | 2.05   |
| 8 | 合计                | 3,383,402,460.47 | 100.00 |

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

## 7.3 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。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值             | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | -                | -            |
|    | 其中：政策性金融债 | -                | -            |
| 4  | 企业债券      | 3,013,816,825.60 | 150.04       |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 283,882,000.00   | 14.13        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | -                | -            |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 3,297,698,825.60 | 164.17       |

#### 7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码    | 债券名称        | 数量(张)     | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------|-------------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 122770  | 11 国网 01    | 1,500,000 | 163,500,000.00 | 8.14         |
| 2  | 1480279 | 14 银城投<br>债 | 1,000,000 | 108,450,000.00 | 5.40         |
| 3  | 122465  | 15 广越 01    | 1,000,000 | 101,920,000.00 | 5.07         |
| 4  | 1480232 | 14 临淄债      | 800,000   | 88,128,000.00  | 4.39         |
| 5  | 127173  | 15 津铁投      | 800,000   | 87,688,000.00  | 4.37         |

#### 7.7 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。

#### 7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 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。

### 7.10 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。

### 7.11 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 29,820.13     |
| 2  | 应收证券清算款 | -             |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 69,199,672.51 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 69,229,492.64 |

#### 7.12.4 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。

#### 7.12.5 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。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别           | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额  | 持有人结构          |        |                  |        |
|----------------|----------|------------|----------------|--------|------------------|--------|
|                |          |            | 机构投资者          |        | 个人投资者            |        |
|                |          |            | 持有份额           | 占总份额比例 | 持有份额             | 占总份额比例 |
| 广发集利一年定期开放债券 A | 6,941    | 209,255.36 | 474,674,181.22 | 32.68% | 977,767,298.14   | 67.32% |
| 广发集利一年定期开放债券 C | 3,796    | 84,637.74  | 9,515,570.93   | 2.96%  | 311,769,306.92   | 97.04% |
| 合计             | 10,737   | 165,197.57 | 484,189,752.15 | 27.30% | 1,289,536,605.06 | 72.70% |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 25,870.73 | 0.0015%  |

### 8.3 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情况

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 本报告期基金总申购份额   | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 1,773,726,357.21 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。

相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿损失。该案尚在浙江省义乌市人民法院审理中。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

2016 年 4 月 18 日，本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书（【2016】34 号）。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改，进一步梳理了股票入库的流程，并强化了研究报告的跟踪要求。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|----|------|-----------|----|
|      |    |      |           |    |

|        | 单元数量 | 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 |        |
|--------|------|------|--------------|----|------------|--------|
| 安信证券   | 5    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 北京高华   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 渤海证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 上海华信   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 财富证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 川财证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 德邦证券   | 0    | -    | -            | -  | -          | 减少 1 个 |
| 第一创业证券 | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 东北证券   | 4    | -    | -            | -  | -          | 新增 2 个 |
| 东方证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 东莞证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 东海证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 东吴证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 东兴证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 方正证券   | 6    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 光大证券   | 3    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 广发证券   | 7    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 广州证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 国都证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 国海证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 国金证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 国联证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 国盛证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 国泰君安   | 4    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 国信证券   | 4    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 国元证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 海通证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 宏源证券   | 3    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 华安证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 华宝证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 华创证券   | 4    | -    | -            | -  | -          | 新增 1 个 |
| 华福证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 华融证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 华泰证券   | 6    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 华鑫证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 江海证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 联讯证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 民生证券   | 2    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 民族证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 南京证券   | 1    | -    | -            | -  | -          | -      |
| 平安证券   | 4    | -    | -            | -  | -          | -      |

|       |   |   |   |   |   |        |
|-------|---|---|---|---|---|--------|
| 瑞银证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 上海证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 申银万国  | 3 | - | - | - | - | -      |
| 世纪证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 首创证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 太平洋证券 | 2 | - | - | - | - | -      |
| 天风证券  | 3 | - | - | - | - | 新增 2 个 |
| 万联证券  | 4 | - | - | - | - | -      |
| 西部证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 西南证券  | 2 | - | - | - | - | -      |
| 湘财证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 新时代证券 | 1 | - | - | - | - | -      |
| 信达证券  | 3 | - | - | - | - | 新增 1 个 |
| 兴业证券  | 4 | - | - | - | - | -      |
| 银河证券  | 3 | - | - | - | - | -      |
| 英大证券  | 2 | - | - | - | - | -      |
| 长城证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 长江证券  | 3 | - | - | - | - | -      |
| 招商证券  | 3 | - | - | - | - | -      |
| 浙商证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 中金公司  | 2 | - | - | - | - | -      |
| 中泰证券  | 4 | - | - | - | - | 新增 2 个 |
| 中天证券  | 1 | - | - | - | - | -      |
| 中投证券  | 3 | - | - | - | - | -      |
| 中信建投  | 4 | - | - | - | - | -      |
| 中信证券  | 4 | - | - | - | - | -      |
| 中银国际  | 2 | - | - | - | - | -      |
| 中原证券  | 2 | - | - | - | - | -      |

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违规行为；
- (2)经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3)具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，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、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5)能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6)能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

- (1)对交易单元候选券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实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2)协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易           |              | 回购交易              |              | 权证交易 |              |
|------|----------------|--------------|-------------------|--------------|------|--------------|
|      | 成交金额           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额              | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 广发证券 | 132,363,479.52 | 100.00%      | 19,494,287,000.00 | 100.00%      | -    | -            |

广发基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日