

# 广发理财 7 天债券型证券投资基金

## 2014 年半年度报告

### 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：二〇一四年八月二十九日

## 1 重要提示及目录

### 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 2014 年 8 月 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2014 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
<b>7 投资组合报告</b> .....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 债券回购融资情况.....	32
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	32
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细.....	34
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 投资组合报告附注.....	34
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	35
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.....	36
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	36

<b>10 重大事件揭示</b> .....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	39
10.9 其他重大事件.....	39
<b>11 备查文件目录</b> .....	40
11.1 备查文件目录.....	40
11.2 存放地点.....	40
11.3 查阅方式.....	41

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发理财 7 天债券型证券投资基金	
基金简称	广发理财 7 天债券	
基金主代码	000037	
交易代码	000037	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 6 月 20 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	371,377,211.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发理财 7 天债券 A	广发理财 7 天债券 B
下属分级基金的交易代码	000037	000038
报告期末下属分级基金的份额总额	94,028,459.11 份	277,348,752.42 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的当期收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金属于债券型证券投资基金，长期风险收益水平低于股票型基金、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 负责人	姓名	段西军	赵会军
	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
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	王志伟	姜建清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	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（2014年1月1日至2014年6月30日）	
	广发理财 7 天债券 A	广发理财 7 天债券 B
本期已实现收益	2,659,838.18	4,799,582.29
本期利润	2,659,838.18	4,799,582.29
本期净值收益率	2.4439%	2.1440%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2014年6月30日)	
	广发理财 7 天债券 A	广发理财 7 天债券 B
期末基金资产净值	94,028,459.11	277,348,752.42
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	报告期末(2014年6月30日)	
	广发理财 7 天债券 A	广发理财 7 天债券 B

累计净值收益率	4.9457%	4.6763%
---------	---------	---------

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，由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金每个运作期期末收益结转。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 1. 广发理财 7 天债券 A:

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差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	0.3833%	0.0054%	0.1125%	0.0000%	0.2708%	0.0054%
过去三个月	1.1475%	0.0032%	0.3413%	0.0000%	0.8062%	0.0032%
过去六个月	2.4439%	0.0030%	0.6788%	0.0000%	1.7651%	0.0030%
过去一年	4.6372%	0.0030%	1.3688%	0.0000%	3.2684%	0.0030%
自基金合同生效起至今	4.9457%	0.0045%	1.4100%	0.0000%	3.5357%	0.0045%

##### 2. 广发理财 7 天债券 B:

阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差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	0.4072%	0.0054%	0.1125%	0.0000%	0.2947%	0.0054%
过去三个月	1.2207%	0.0032%	0.3413%	0.0000%	0.8794%	0.0032%
过去六个月	2.1440%	0.0031%	0.6788%	0.0000%	1.4652%	0.0031%
过去一年	4.3603%	0.0030%	1.3688%	0.0000%	2.9915%	0.0030%
自基金合同生效起至今	4.6763%	0.0046%	1.4100%	0.0000%	3.2663%	0.0046%

注：本基金的业绩比较基准为：七天通知存款利率（税后）。

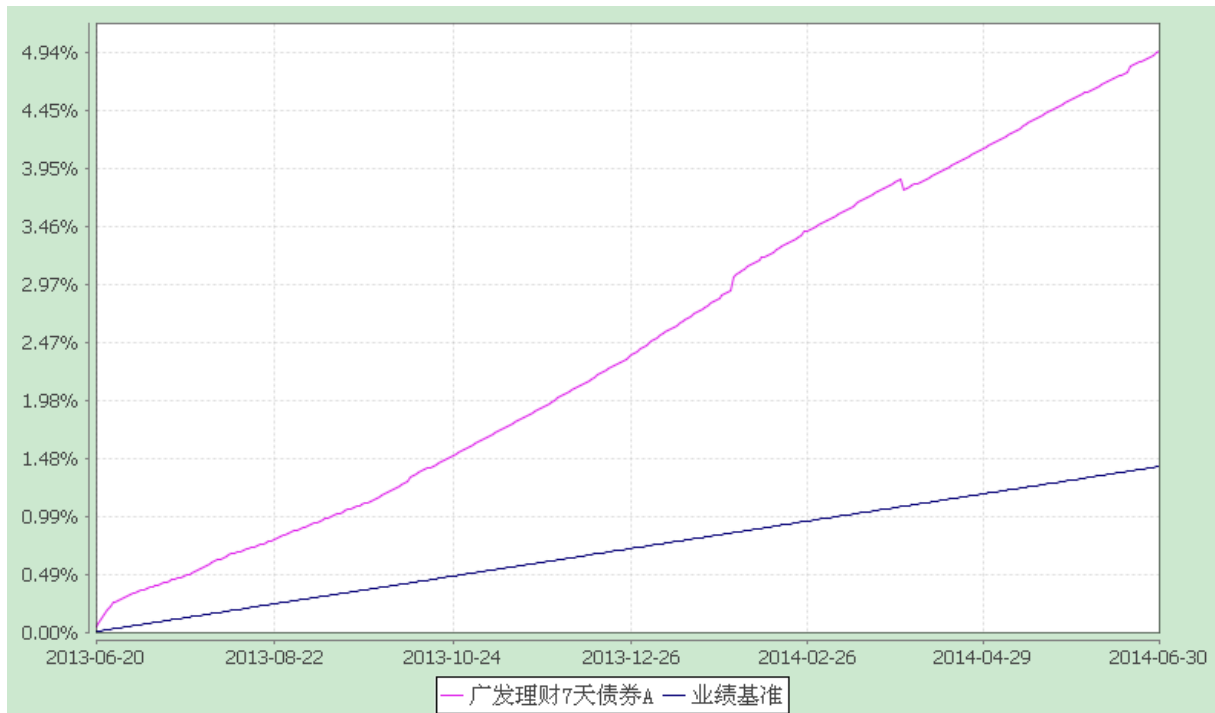
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发理财 7 天债券型证券投资基金

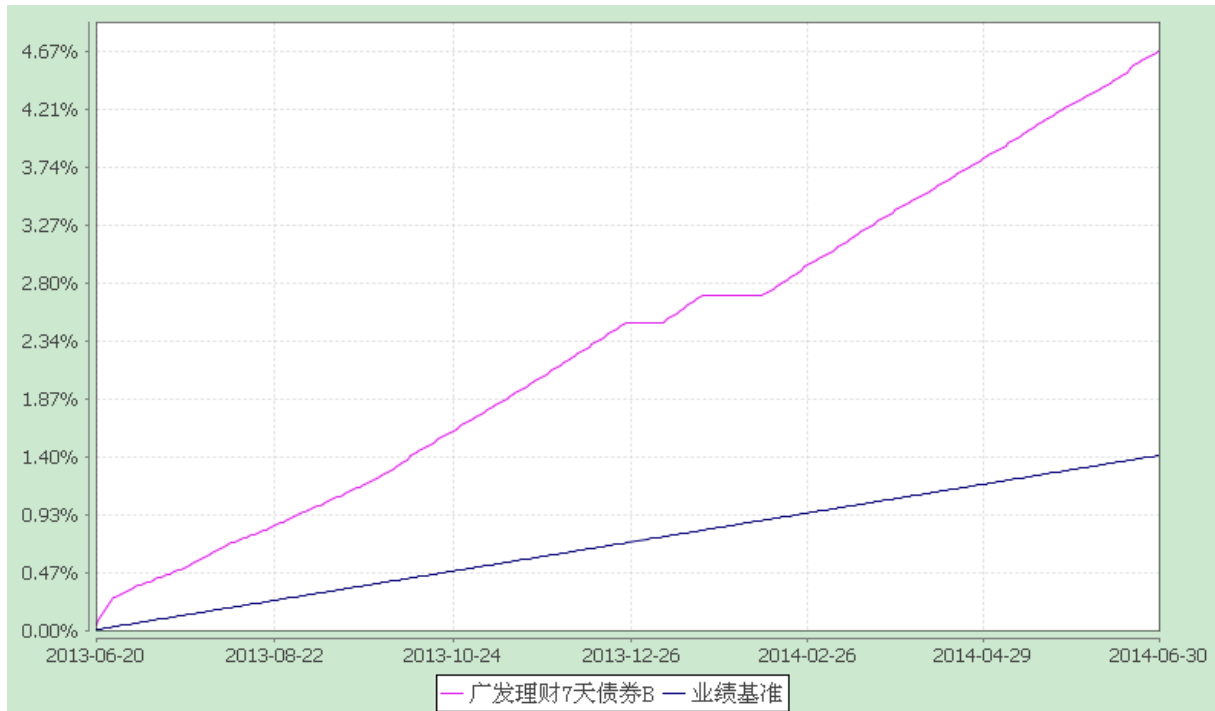
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2013 年 6 月 20 日至 2014 年 6 月 30 日)

### 广发理财 7 天债券 A



### 广发理财 7 天债券 B





## 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风险投资有限公司。公司拥有公募基金、社保基金投资管理人、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管理人（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 22 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、金融工程部、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、国际业务部、营销服务部、互联网金融部（下辖深圳理财中心、杭州理财中心）、北京办事处、北京分公司、广州分公司、上海分公司。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。

截至 2014 年 6 月 30 日，本基金管理人管理五十一只开放式基金——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、广发中债金融债指数证券投资基金、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和广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金，管理资产规模为1271.27亿元。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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
温秀娟	本基金的基金经理；广发货币基金的基金经理；广发理财30天债券基金的基金经理；广发现金宝场内货币基金的基金经理；固定收益部副总经理	2013-06-20	-	14	女，中国籍，经济学学士，持有基金业执业资格证书，2000年7月至2004年10月任职于广发证券股份有限公司江门营业部，2004年10月至2008年8月在广发证券股份有限公司固定收益部工作，2008年8月11日至今在广发基金管理有限公司固定收益部工作，2010年4月29日起任广发货币基金的基金经理，2013年1月14日起任广发理财30天债券基金的基金经理，2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理，2013年12月2日起任广发现金宝场内货币基金的基金经理，2014年3月17日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理。
任爽	本基金的基金经理；广发纯债债券基金的基金经理；广发天天红货币基金的基金经理；广	2013-06-20	-	6	女，中国籍，经济学硕士，持有基金业执业资格证书，2008年7月至2012年12月在广发基金管理有限公司固定收益部兼任交易员和研究员，2012年12月12日起任广发纯债债券基金的基金经理，2013年6月20日起任广发理财7天债券基金的基金经理，2013年10月22日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理，

	发天天利货币基金的基金经理；广发钱袋子货币市场基金的基金经理					2014 年 1 月 27 日起任广发天天利货币市场基金的基金经理，2014 年 5 月 30 日起任广发钱袋子货币市场基金的基金经理。
--	--------------------------------	--	--	--	--	--

注：1. 基金经理的“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2. 基金经理助理的“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

3. 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、《广发理财 7 天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

报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 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

年初货币市场和债券市场收益率均处于历史较高水平，具备较好的配置价值，但政策面的不明确使得机构参与者情绪上偏谨慎。随后在央行持续呵护下，市场预期趋于稳定。银行同业资金需求持续收缩，货币市场资金利率也跟随持续下行，整体资金处于中性偏松状态。我们在此阶段，加长了久期和杠杆水平，把握趋势和阶段性时点配置高收益的存款和新发短融。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

广发理财 7 天 A 净值增长率为 2.4439%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%，广发理财 7 天 B 净值增长率为 2.1440%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

针对经济下滑，政府持续采取微刺激的政策，确保经济增速不低于 7.5% 的底线。近期数据来看，经济略有企稳迹象。预计未来仍在经济下限通胀上限区间内运行。房地产量价下滑情况以及后续政策需持续关注。货币政策方面，预计央行仍继续采取定向宽松的方式维持市场稳定性。定向降准、再贷款等措施仍会延续，CD 等作为推进利率市场化的产品，其定价水平将影响以后的基础收益率曲线形状。在降低实体企业融资成本的大方向下，货币市场的资金流向和利率水平或许会出现结构性的摩擦。我们将继续在保证合理流动性的前提下，综合运用货币市场工具安排到期现金流，争取为投资者获得稳健的投资回报。

#### 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、投资管理部负责人、研究发展部负责人、金融工程部负责人、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。金融工程部负责提供有关涉及模型的技术支持。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签署服务协议,由其按合同约定提供银行间同业市场交易的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

据本基金合同第十五部分“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定,本基金基金收益分配方式为红利再投资,每日分配,按月支付。本基金报告期内累计分配收益 7,459,420.47 元。

### 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理财 7 天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,广发理财 7 天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理财 7 天债券型证券投资基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金利润分配、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,广发理财 7 天债券型证券投资基金未进行利润分配。

#### 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理财 7 天债券型证券投资基金 2014 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：广发理财7天债券型证券投资基金

报告截止日：2014年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	186,173,907.28	70,332,325.26
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	210,115,614.88	40,021,415.22
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		210,115,614.88	40,021,415.22
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	70,000,345.00	10,000,135.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	3,787,687.54	847,662.00
应收股利		-	-
应收申购款		5,633,681.21	2,576,082.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>475,711,235.91</b>	<b>123,777,619.56</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2014年6月30日</b>	<b>上年度末 2013年12月31日</b>
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		103,603,268.27	18,312,790.84
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		89,448.99	30,460.97
应付托管费		26,503.41	9,025.44

应付销售服务费		23,333.18	30,012.94
应付交易费用	6.4.7.7	18,855.74	9,466.85
应交税费		-	-
应付利息		44,571.06	1,674.98
应付利润		300,440.42	63,517.87
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,603.31	139,000.00
负债合计		104,334,024.38	18,595,949.89
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	371,377,211.53	105,181,669.67
未分配利润	6.4.7.1 0	-	-
所有者权益合计		371,377,211.53	105,181,669.67
负债和所有者权益总计		475,711,235.91	123,777,619.56

注：报告截止日2014年6月30日，广发理财7天A基金份额净值人民币1.0000元，基金份额总额94,028,459.11份；广发理财7天B基金份额净值人民币1.0000元，基金份额总额277,348,752.42份；总份额总额371,377,211.53份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发理财7天债券型证券投资基金

本报告期：2014年1月1日至2014年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2014年1月1日至2014年6月30日
<b>一、收入</b>		<b>8,862,950.03</b>
1. 利息收入		8,671,646.18
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	5,769,439.46
债券利息收入		2,034,211.61
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		867,995.11
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		191,303.85
其中：股票投资收益		-
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.1 2	191,303.85
资产支持证券投资收益		-
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)		
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6.4.7.1 3	-
<b>减: 二、费用</b>		<b>1,403,529.56</b>
1. 管理人报酬		406,425.51
2. 托管费		120,422.43
3. 销售服务费		172,047.85
4. 交易费用	6.4.7.1 4	-
5. 利息支出		486,810.97
其中: 卖出回购金融资产支出		486,810.97
6. 其他费用	6.4.7.1 5	217,822.80
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>7,459,420.47</b>
减: 所得税费用		-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		<b>7,459,420.47</b>

注: 本基金合同生效日为2013年6月20日, 上年度无可比期间。

### 6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 广发理财7天债券型证券投资基金

本报告期: 2014年1月1日至2014年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014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)	105,181,669.67	-	105,181,669.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	7,459,420.47	7,459,420.47
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)	266,195,541.86	-	266,195,541.86
其中: 1. 基金申购款	1,388,850,849.28	-	1,388,850,849.28
2. 基金赎回款	-1,122,655,307.42	-	-1,122,655,307.42
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)	-	-7,459,420.47	-7,459,420.47
五、期末所有者权益 (基金净值)	371,377,211.53	-	371,377,211.53



项目	上年度可比期间		
	2013 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2013 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）	942,755,487.21	-	942,755,487.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,662,472.78	2,662,472.78
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）	-372,564,212.09	0.00	-372,564,212.09
其中：1. 基金申购款	617,127,693.37	0.00	617,127,693.37
2. 基金赎回款	-989,691,905.46	0.00	-989,691,905.46
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）	-	-2,662,472.78	-2,662,472.78
五、期末所有者权益（基金净值）	570,191,275.12	0.00	570,191,275.12

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：王志伟，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

广发理财 7 天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]63 号文《关于核准广发理财 7 天债券型证券投资基金募集的批复》批准，由基金发起人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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发理财 7 天债券型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2013 年 6 月 20 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。

本基金募集期为自 2013 年 6 月 13 日至 2013 年 6 月 17 日止，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，募集资金总额为人民币 942,755,487.21 元，有效认购户数为 2,176 户。其中广发理财 7 天债券 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 410,476,100.00 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 3,719.51 元；广发理财 7 天债券 B 类基金（“B 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 532,264,000.00 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 11,667.70 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，本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体如下：现金、通知存款、短期融资券、一年以内（含一年）的银行定期存款、大额存单、剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的中期票据、剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的资产支持证券、中国证监会/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。

本基金实施分级，在任何一个开放日，若 A 类基金份额持有人在单个基金账户中保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额，若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。两类基金份额分设不同的基金代码，收取不同的销售服务费并分别公布每万份基金净收益和七日年化收益率。本基金业绩比较基准：七天通知存款利率（税后）。

本基金的财务报表于 2014 年 8 月 25 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于 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 2014 年 6 月 30 日的财务状况以及 2014 年上半年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

本基金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[2008]1 号文《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》、国税函[2008]870 号文《关于做好证券市场个人投资者证券交易结算资金利息所得免征个人所得税工作的通知》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) 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。
- 3) 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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2014 年 6 月 30 日
活期存款	173,907.28
定期存款	186,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	40,000,000.00
其中：存款期限 3-12 个月	146,000,000.00
其他存款	-
合计	186,173,907.28

注：根据定期存款协议的规定，上述定期存款若提前支取，利息收入仍然按照原协议利率与实际天数计算。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2014 年 6 月 30 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	210,115,614.88	210,658,000.00	542,385.12	0.1460
	合计	210,115,614.88	210,658,000.00	542,385.12	0.1460

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	70,000,345.00	-
合计	70,000,345.00	-

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应收活期存款利息	31.09
应收定期存款利息	959,922.45
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	2,751,291.34
应收买入返售证券利息	76,442.66
应收申购款利息	-
其他	-
合计	3,787,687.54

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	18,855.74
合计	18,855.74

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-

预提费用	227,603.31
合计	227,603.31

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 广发理财 7 天债券 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	105,181,669.67	105,181,669.67
本期申购	493,102,052.57	493,102,052.57
本期赎回（以“-”号填列）	-504,255,263.13	-504,255,263.13
本期末	94,028,459.11	94,028,459.11

注：本期申购含红利再投资、转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

##### 广发理财 7 天债券 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日	
	基金份额	账面金额
本期申购	895,748,796.71	895,748,796.71
本期赎回（以“-”号填列）	-618,400,044.29	-618,400,044.29
本期末	277,348,752.42	277,348,752.42

注：本期申购含红利再投资、转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 广发理财 7 天债券 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.00	-	-
本期利润	2,659,838.18	-	2,659,838.18
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-2,659,838.18	-	-2,659,838.18
本期末	-	-	-

##### 广发理财 7 天债券 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	0.00	-	-
本期利润	4,799,582.29	-	4,799,582.29
本期基金份额交易产生的	-	-	-

变动数			
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-4,799,582.29	-	-4,799,582.29
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
活期存款利息收入	8,401.98
定期存款利息收入	5,757,007.31
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	0.00
其他	4,030.17
合计	5,769,439.46

#### 6.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	51,269,670.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	50,003,426.22
减：应收利息总额	1,074,940.27
债券投资收益	191,303.85

#### 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
基金赎回费收入	-
手续费返还	-
其他	-
合计	-

注：本基金本报告期内无其他收入。

#### 6.4.7.14 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

#### 6.4.7.15 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
----	----------------------------

审计费用	19,835.79
信息披露费	148,767.52
银行汇划费	30,819.49
账户维护费	18,000.00
其他	400.00
合计	217,822.80

#### 6.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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	基金管理人股东、代销机构

#### 6.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。

##### 6.4.10.2关联方报酬

###### 6.4.10.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	406,425.51

其中：支付销售机构的客户维护费	89,481.29
-----------------	-----------

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

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2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。

#### 6.4.10.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	120,422.43

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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2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。

#### 6.4.10.2.3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		
	2014年1月1日至2014年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	合计
广发基金管理有限公司	7,959.35	7,664.47	15,623.82
中国工商银行股份有限公司	86,950.30	1,644.07	88,594.37
广发证券股份有限公司	3,228.57	-	3,228.57
合计	98,138.22	9,308.54	107,446.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2013年6月20日（基金合同生效日）至2013年6月30日		



	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B	合计
广发基金管理有限公司	2,735.64	85.24	2,820.88
中国工商银行股份有限公司	29,778.08	1,177.46	30,955.54
广发证券股份有限公司	120.68	-	120.68
合计	32,634.40	1,262.70	33,897.10

注：本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 A 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。

本基金 B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，基金年销售服务费率应自其达到 B 类条件的开放日后的下一个工作日起适用 B 类基金份额持有人的费率。

各类基金份额的基金销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{基金销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金资产中划出，经注册登记机构分别支付给各个基金销售机构。若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联交易方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 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

#### 广发理财 7 天债券 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况（A 类）。

#### 广发理财 7 天债券 B

份额单位：份

关联方名称	广发理财7天债券B本期末	广发理财7天债券B上年度末
-------	--------------	---------------

	2014年6月30日		2013年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	42,137,558.28	15.19%	-	-

#### 6.4.10.5 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 2014年1月1日至2014年6月30日		上年度可比期间 2013年6月20日（基金合同生效日）至 2013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	173,907.28	209,346.42	10,614,017.33	40,185.05

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 1、广发理财 7 天债券 A

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
2,312,080.14	357,882.87	-10,124.83	2,659,838.18	-

##### 2、广发理财 7 天债券 B

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分 配合计	备注
3,945,637.63	606,897.28	247,047.38	4,799,582.29	-

#### 6.4.12 期末（2014 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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 2014 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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2014 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限的股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2014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人民币103,603,268.27元,是以如下债券作为质押:

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 单价	数量(张)	期末估值总额
041466007	14冀水泥 CP002	2014-07-02	100.19	16,000.00	1,603,040.00
041356030	13西宁特钢 CP001	2014-07-02	100.00	100,000.00	10,000,000.00
041458046	14魏桥铝电 CP001	2014-07-02	100.00	300,000.00	30,000,000.00
041359055	13雏鹰CP001	2014-07-03	100.04	100,000.00	10,004,000.00
041464028	14连城投 CP001	2014-07-03	100.01	100,000.00	10,001,000.00
011489001	14鞍钢股 SCP001	2014-07-03	100.01	200,000.00	20,002,000.00
011415003	14中铝业 SCP003	2014-07-01	100.11	100,000.00	10,011,000.00
041466007	14冀水泥 CP002	2014-07-01	100.19	144,000.00	14,427,360.00
合计				1,060,000.00	106,048,400.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2014年6月30日止,本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款,无抵押债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念,在董事会下设立合规及风险管理委员会,负责制定风险管理的宏观政策,审议通过风险控制的总体措施等;在管理层层面设立风险控制委员会,讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施;在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责,协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

**6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2014年6月30日	上年末 2013年12月31日
A-1	140,045,127.09	40,021,415.22
A-1 以下	-	-
未评级	70,070,487.79	-
合计	210,115,614.88	40,021,415.22

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级；  
2. 以上未评级的债券为剩余期限一年以内国债、政策性金融债及央行票据。

**6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

**6.4.13.3 流动性风险**

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产均为银行间同业市场交易，未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

**6.4.13.4 市场风险**

本基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的最大的风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

**6.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

**6.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2014年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	186,173,907.28	-	-	-	186,173,907.28
交易性金融资产	210,115,614.88	-	-	-	210,115,614.88
买入返售金融资产	70,000,345.00	-	-	-	70,000,345.00
应收申购款	-	-	-	5,633,681.21	5,633,681.21
应收利息	-	-	-	3,787,687.54	3,787,687.54
资产总计	466,289,867.16	-	-	9,421,368.75	475,711,235.91
负债					
卖出回购金融资产款	103,603,268.27	-	-	-	103,603,268.27
应付管理人报酬	-	-	-	89,448.99	89,448.99
应付托管费	-	-	-	26,503.41	26,503.41
应付销售服务费	-	-	-	23,333.18	23,333.18
应付证券清算款	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	44,571.06	44,571.06
应付利润	-	-	-	300,440.42	300,440.42
其他负债	-	-	-	227,603.31	227,603.31
应付交易费用	-	-	-	18,855.74	18,855.74
负债总计	103,603,268.27	-	-	730,756.11	104,334,024.38
利率敏感度缺口	362,686,598.89	-	-	8,690,612.64	371,377,211.53
上年度末 2013年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	70,332,325.26	-	-	-	70,332,325.26
交易性金融资产	40,021,415.22	-	-	-	40,021,415.22
买入返售金融资产	10,000,135.00	-	-	-	10,000,135.00
应收申购款	543,000.00	-	-	2,033,082.08	2,576,082.08
应收利息	-	-	-	847,662.00	847,662.00
资产总计	120,896,875.48	-	-	2,880,744.08	123,777,619.56
负债					
卖出回购金融资产款	18,312,790.84	-	-	-	18,312,790.84
应付管理人报酬	-	-	-	30,460.97	30,460.97
应付托管费	-	-	-	9,025.44	9,025.44
应付销售服务费	-	-	-	30,012.94	30,012.94
其他负债	-	-	-	139,000.00	139,000.00
应付利息	-	-	-	1,674.98	1,674.98
应付利润	-	-	-	63,517.87	63,517.87
应付交易费用	-	-	-	9,466.85	9,466.85
负债总计	18,312,790.84	-	-	283,159.05	18,595,949.89
利率敏感度缺口	102,584,084.64	-	-	2,597,585.03	105,181,669.67

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2014年6月30日	上年度末 2013年12月31日
	市场利率上升25个基点	-113,611.67	-15,541.47
	市场利率下降25个基点	148,399.91	22,165.43

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2014年6月30日		上年度末 2013年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	210,115,614.88	56.58	40,021,415.22	38.05
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	210,115,614.88	56.58	40,021,415.22	38.05

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

其他价格风险是指以交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金主要投资于固定收益类金融工具，因此无重大市场价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析财务报表的其他事项。

## 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	固定收益投资	210,115,614.88	44.17

	其中：债券	210,115,614.88	44.17
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	70,000,345.00	14.71
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	186,173,907.28	39.14
4	其他各项资产	9,421,368.75	1.98
5	合计	475,711,235.91	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	10.34	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	103,603,268.27	27.90
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的40%的说明

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	112
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	30

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 127 天情况说明

本基金合同约定：“本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 127 天”，本报告期内，本基金未发生超标情况。



## 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	47.44	27.90
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	5.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	43.10	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	5.39	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	24.25	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	125.56	27.90

## 7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,007,604.90	5.39
	其中：政策性金融债	20,007,604.90	5.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	190,108,009.98	51.19
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	210,115,614.88	56.58
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

## 7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	041458046	14 魏桥铝电 CP001	300,000.00	30,001,146.36	8.08
2	071436002	14 华安证券 CP002	300,000.00	29,998,917.56	8.08
3	011470005	14 赣高速 SCP005	200,000.00	20,050,786.98	5.40
4	041466007	14 冀水泥 CP002	200,000.00	20,038,256.93	5.40
5	041456014	14 中铝业 CP002	200,000.00	20,001,726.19	5.39
6	011489001	14 鞍钢股 SCP001	200,000.00	20,001,327.20	5.39
7	011415003	14 中铝业 SCP003	100,000.00	10,010,768.71	2.70
8	130232	13 国开 32	100,000.00	10,005,802.44	2.69
9	041359055	13 雏鹰 CP001	100,000.00	10,003,727.44	2.69
10	110413	11 农发 13	100,000.00	10,001,802.46	2.69

## 7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1468%
报告期内偏离度的最低值	-0.0546%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0817%

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 投资组合报告附注

## 7.8.1 基金计价方法说明

本基金采用“摊余成本法”计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。

7.8.2 本基金本报告期内未持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券。

7.8.3 根据公开市场信息，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。

## 7.8.4 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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	3,787,687.54
4	应收申购款	5,633,681.21
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	9,421,368.75

## 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
广发理财 7 天 债券 A	1,913	49,152.36	613,041.94	0.65%	93,415,417.17	99.35%
广发理财 7 天 债券 B	5	55,469,750.48	277,348,752.42	100.00%	-	-
合计	1,918	193,627.33	277,961,794.36	74.85%	93,415,417.17	25.15%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发理财 7 天 债券 A	7,249.14	0.0077%
	广发理财 7 天	-	-

金	债券 B		
	合计	7,249.14	0.0020%

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	广发理财 7 天债券 A	0
	广发理财 7 天债券 B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发理财 7 天债券 A	0~10
	广发理财 7 天债券 B	0
	合计	0~10

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发理财 7 天债券 A	广发理财 7 天债券 B
基金合同生效日（2013 年 6 月 20 日）基金份额总额	410,479,819.51	532,275,667.70
本报告期期初基金份额总额	105,181,669.67	-
本报告期基金总申购份额	493,102,052.57	895,748,796.71
减：本报告期基金总赎回份额	504,255,263.13	618,400,044.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	94,028,459.11	277,348,752.42

## 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

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，因中国工商银行股份有限公司（以下简称“本行”）工作需要，周月秋同志不再担任本行资产托管部总经理。在新任资产托管部总经理李勇同志完成证券投资基金行业高级管理人员任职资格备案手续前，由副总经理王立波同志代为行使本行资产托管部总经理部分业务授权职责。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 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

本报告期内未发生基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

### 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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

东兴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	4	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
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	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	4	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
民族证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
齐鲁证券	3	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	3	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
厦门证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-

银河证券	3	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
招商证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券（浙江）	3	-	-	-	-	-
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。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未发生偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

### 10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日
----	------	--------	-------

			期
1	广发基金管理有限公司关于广发理财 7 天债券型证券投资基金 2014 年春节假期前暂停申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-01-27
2	广发基金管理有限公司关于增加富滇银行为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-01-30
3	广发基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-02-28
4	广发基金管理有限公司关于增加东兴证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-04-03
5	广发基金管理有限公司关于广发理财 7 天债券型证券投资基金劳动节假期前暂停申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-04-25
6	广发基金管理有限公司关于广发理财 7 天债券型证券投资基金暂停大额申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-05-14
7	广发基金管理有限公司关于广发理财 7 天债券型证券投资基金端午节假期前暂停申购业务的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-05-26
8	广发基金管理有限公司关于增加上海久富财富为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-06-06
9	广发基金管理有限公司关于增加深圳新兰德为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-06-11
10	广发基金管理有限公司关于增加天风证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》	2014-06-27

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发理财 7 天债券型证券投资基金募集的文件
2. 《广发理财 7 天债券型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. 《广发理财 7 天债券型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

### 11.2 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



### 11.3 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>。

广发基金管理有限公司

二〇一四年八月二十九日