

# 广发景丰纯债债券型证券投资基金

## 2018年第三季度报告

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。金融工程与风险管理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督稽核，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形需要进行反向交易的，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运作分析  
三季度，利率债收益率先下后上，整体维持震荡；其中7月债市收益率整体区间震荡，8月中旬在经历过前期极度宽松的资金利率后，央行开始暂停公开市场操作叠加地方债的巨量供给挤出，引发资金利率和长端利率的连续调整，9月下旬地债供给放缓，美联储加息国内未跟随带来市场情绪好转，收益率小幅下行。信用债方面，中低评级信用利差和高等级利差继续小幅走阔。三季度以来，本基金以中短久期利率品种及高等级信用债为主要配置方向。

### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发景丰纯债净值增长率为1.03%，同期业绩比较基准收益率为1.37%。

### 4.6 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)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益投资	4,180,781,000.00	99.98
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	4,180,781,000.00	99.98
6	其他资产	4,180,781,000.00	99.98
7	其他负债	63,539,356.01	1.57
8	合计	8,361,562,356.01	99.98

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	医药生物	-	-
2	信息技术	-	-
3	金融	-	-
4	其他	-	-

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.4 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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

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权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

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

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

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

序号	贵金属代码	贵金属名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.9 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股指期货投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.10 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国债期货投资明细

序号	代码	名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.11 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.12 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.13 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.14 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.15 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.16 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.17 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.18 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.19 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,000	201,400,000.00	2.26
4	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71
5	10100424	恒立-00123	1,500,000	150,375,000.00	1.71

5.20 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

序号	权证代码	权证名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	175666	177626	5,000,000	462,260,000.00	5.10
2	10100424	恒立-00123	3,000,000	301,000,000.00	3.35
3	00180309	恒立-00123	2,000,		