

广发汇安18个月定期开放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察稽核,实现投资风险的事后控制。

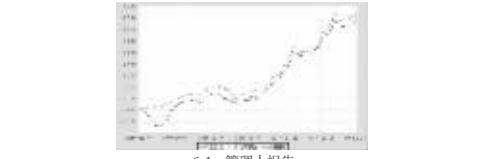


图1 基金净值增长趋势图

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日
重要提示
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。

3.1 主要财务指标
主要财务指标
报告期期末总资产
归属于母基金份额持有人权益
本报告期末基金份额净值
本报告期末基金份额持有人数量

Table with 2 columns: Item, Value. Shows financial metrics for the reporting period, including assets, equity, and share values.

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
3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图1 广发汇安18个月定期债券A

3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2017年9月31日至2018年9月30日)

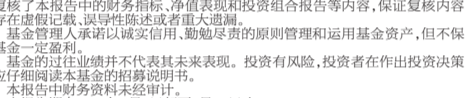


图2 广发汇安18个月定期债券C

Table with 4 columns: Name, Position, Term, and Remarks. Lists the members of the investment management team.

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
本公司报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规的规定,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。

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及及时的分析报告,保证公平交易原则的实现。

4.3.2 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。

广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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。

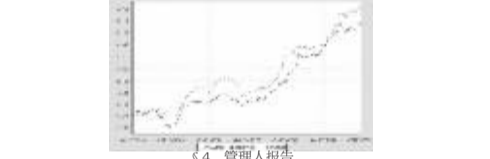


图1 基金净值增长趋势图

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日
重要提示
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。

3.1 主要财务指标
主要财务指标
报告期期末总资产
归属于母基金份额持有人权益
本报告期末基金份额净值
本报告期末基金份额持有人数量

Table with 2 columns: Item, Value. Shows financial metrics for the reporting period, including assets, equity, and share values.

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
3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

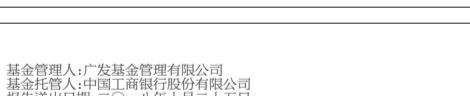


图1 广发汇富一年定期债券A

3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2017年2月13日至2018年9月30日)

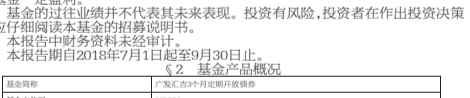


图2 广发汇富一年定期债券C

Table with 4 columns: Name, Position, Term, and Remarks. Lists the members of the investment management team.

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
本公司报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规的规定,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。

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及及时的分析报告,保证公平交易原则的实现。

4.3.2 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。

广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

通过实时的行为监控及及时的分析报告,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。

Table with 4 columns: Name, Position, Term, and Remarks. Lists the members of the investment management team.

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 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本公司报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规的规定,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。

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及及时的分析报告,保证公平交易原则的实现。

4.3.2 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:二〇一八年十月二十五日
重要提示
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。

3.1 主要财务指标
主要财务指标
报告期期末总资产
归属于母基金份额持有人权益
本报告期末基金份额净值
本报告期末基金份额持有人数量

Table with 2 columns: Item, Value. Shows financial metrics for the reporting period, including assets, equity, and share values.

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
3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



图1 广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

3.2.2 本基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2018年1月29日至2018年9月30日)

图2 广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金

Table with 4 columns: Name, Position, Term, and Remarks. Lists the members of the investment management team.

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 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本公司报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规的规定,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。

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及及时的分析报告,保证公平交易原则的实现。

4.3.2 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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2018年第三季度,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,资金利率创出新高后,央行开始暂停公开市场操作,叠加地方债的巨量供给,引发资金利率和长端利率的连续调整,9月下旬地方债供给放缓,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。

4.5 报告期内基金的业绩表现
本报告期内,广发汇吉3个月定期开放债券净值增长率为1.05%,同期业绩比较基准收益率为1.37%。

5.1 报告期末基金资产组合情况
5.1.1 报告期末按资产类别的资产组合
5.1.2 报告期末按行业分类的资产组合

Table with 4 columns: Category, Item, Value, and Percentage. Shows the asset composition of the fund as of the reporting period.

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with 4 columns: Industry, Item, Value, and Percentage. Shows the stock investment composition of the fund as of the reporting period.

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。

本基金本报告期末未持有股票。
5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
本基金本报告期末未持有通过港股投资的股票。

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

Table with 4 columns: Category, Item, Value, and Percentage. Shows the bond investment composition of the fund as of the reporting period.

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
5.5.1 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过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。

Table with 4 columns: Item, Value, and Percentage. Shows the top five bond investments of the fund as of the reporting period.

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
5.6.1 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过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。

Table with 4 columns: Item, Value, and Percentage. Shows the top ten asset-backed investment securities of the fund as of the reporting period.

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情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
(2) 本基金本报告期末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投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
(2) 本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 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过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。

5.12 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名贵金属投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.13 其他各项资产构成
(1) 本基金本报告期末未持有贵金属。

5.14 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过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。

5.15 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贵金属投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有贵金属。

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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

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情况
(1) 本基金本报告期末未持有权证。

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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.21 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情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.22 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情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.23 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情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.24 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情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.25 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情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

5.11.3 其他各项资产构成

Table with 4 columns: Item, Value, and Percentage. Shows the composition of other assets as of the reporting period.

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。

5.6 开放式基金份额变动
单位:份

Table with 4 columns: Item, Value, and Percentage. Shows the change in open-ended fund shares as of the reporting period.

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认购、赎回或买卖)本基金的情况。

5.8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

8.1.1 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过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。

Table with 4 columns: Investor, Item, Value, and Percentage. Shows the top ten securities held by investors as of the reporting period.

8.1.2 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过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。

8.1.3 其他各项资产构成
(1) 本基金本报告期末未持有贵金属。

8.1.4 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过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。

8.1.5 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贵金属投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有贵金属。

8.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.7 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权证投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有权证。

8.1.8 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.9 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情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.10 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.11 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.12 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.13 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.14 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.15 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.16 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.17 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.18 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

8.1.19 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股指期货投资情况
(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。