广发理财7天债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发理财7天债券	
基金主代码	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	
报告期末基金份额总额	26,560,737,994.12份	
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。	
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	
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	495,294,241.57份	26,065,443,752.55份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	广发理财7天债券A	广发理财7天债券B
1.本期已实现收益	4,591,430.51	278,647,281.04
2.本期利润	4,591,430.51	278,647,281.04
3.期末基金资产净值	495,294,241.57	26,065,443,752.55

注: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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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
过去三个月	1.0064%	0.0010%	0.3450%	0.0000%	0.6614%	0.0010%

2、广发理财7天债券B:

阶段	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
过去三个月	1.0801%	0.0010%	0.3450%	0.0000%	0.7351%	0.0010%

注:本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

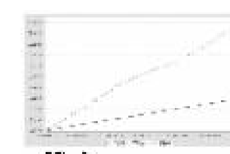
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

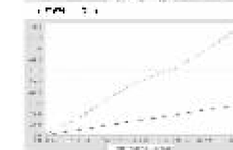
广发理财7天债券型证券投资基金

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2018年9月30日)

1、广发理财7天债券A





§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任爽	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发天天红基金的基金经理;广发天天利货币基金的基金经理;广发钱袋子基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理;广发聚泰混合基金的基金经理;广发稳鑫保本基金的基金经理;广发鑫惠定开债基金的基金经理;广发鑫益混合基金的基金经理;广发鑫利混合基金的基金经理;广发安盈混合基金的基金经理	2013-06-20	-	10年	任爽女士,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部交易员兼任研究员、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月16日至2018年3月20日)。现任广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自2012年12月12日起任职)、广发理财7天债券型证券投资基金基金经理(自2013年6月20日起任职)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2013年10月22日起任职)、广发天天利货币市场基金基金经理(自2014年1月27日起任职)、广发钱袋子货币市场基金基金经理(自2014年5月30日起任职)、广发活期宝货币市场基金基金经理(自2014年8月28日起任职)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自2015年6月8日起任职)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年3月21日起任职)、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月16日起任职)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月2日起任职)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月9日起任职)、广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2018年3月21日起任职)。
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;广发活期宝货币基金的基金经理;广发添利货币ETF基金的基金经理;广发天天红基金的基金经理;现金投资部总经理	2013-06-20	-	18年	温秀娟女士,经济学学士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理,广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理。现任广发基金管理有限公司现金投资部总经理、广发货币市场基金基金经理(自2010年4月29日起任职)、广发理财30天债券型证券投资基金基金经理(自2013年1月14日起任职)、广发理财7天债券型证券投资基金基金经理(自2013年6月20日起任职)、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理(自2013年12月2日起任职)、广发活期宝货币市场基金基金经理(2014年8月28日起任职)、广发添利交易型货币市场基金基金经理(自2016年11月22日起任职)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2017年10月31日起任职)。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发理财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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库,投资的债券必须来自公司债券库。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。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。

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,货币市场整体维持宽松态势。从量价组合上看,M2增速继续在低位震荡,回购利率R007全季都被约束在利率走廊上限之内,并且8月上旬与公开市场操作利率倒挂,市场流动性非常充裕。理解货币市场的核心在于央行,在维持流动性合理充裕的政策取向以及宽信用政策短期基本无效的背景下货币市场的宽松态势预计仍将维持。央行操作方面,为了对冲经济下行压力以及配合巨量的地方债顺利发行,央行7月和10月先后两次降准,并且暂未跟随美联储上调政策利率。在美债收益率不断创出近年来高点的情况下央行仍然动用降准这一宽松信号较强的总量手段表明,在内外均衡出现冲突时,内部稳定与增长的目标是无可置疑的首要目标。未来货币政策的焦点仍然是疏通货币到信用的传导。本基金在报告期内操作仍以流动性为最重要考虑因素。本基金在本季度采取了逐步配置的节奏,资金流运用根据整体资金供需以及收益率绝对水平进行调节。品种选择方面则在保障流动性的前提下进行择高配置,尽量在稳健基础上提高组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发理财7天债券A类净值增长率为1.0064%,广发理财7天债券B类净值增长率为1.0801%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	20,638,769,800.88	70.52
	其中:债券	20,444,528,189.29	69.85
	资产支持证券	194,241,611.59	0.66
2	买入返售金融资产	-	-
	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	8,487,599,633.47	29.00
4	其他资产	141,634,566.22	0.48
5	合计	29,268,004,000.57	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	10.64
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	2,689,187,146.20	10.12
	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20%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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	113
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	87

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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。

5.3.2 报告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	10.19	10.12
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	22.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	46.12	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	1.36	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	29.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	109.58	10.12

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	30,144,297.05	0.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,401,850,692.59	5.28
	其中:政策性金融债	1,401,850,692.59	5.28
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	19,991,015.89	0.08
6	中期票据	-	-
7	同业存单	18,992,542,183.76	71.51
8	其他	-	-
9	合计	20,444,528,189.29	76.97
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111897450	18深圳前海微众银行CD005	8,000,000.00	796,128,971.48	3.00
2	111810290	18兴业银行CD290	7,000,000.00	693,781,872.72	2.61
3	111892636	18南京银行CD032	5,000,000.00	495,902,525.69	1.87
4	111895816	18成都银行CD100	4,000,000.00	399,156,996.34	1.50
5	111895793	18汉口银行CD059	4,000,000.00	399,146,717.91	1.50
6	111809258	18浦发银行CD258	4,000,000.00	398,104,579.10	1.50
7	111883771	18常熟农村商行CD076	4,000,000.00	398,014,114.52	1.50
8	111807134	18招商银行CD134	4,000,000.00	396,543,071.10	1.49
9	111898900	18徽商银行CD085	4,000,000.00	396,514,701.96	1.49
10	111814097	18江苏银行CD097	4,000,000.00	396,455,780.55	1.49

5.7"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	5次
报告期内偏离度的最高值	0.2736%
报告期内偏离度的最低值	0.0686%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1539%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1889001	18福元1A_bc	1,500,000	68,823,746.64	0.26
2	1889027	18汇通1A	1,500,000	51,408,546.86	0.19
3	1889131	18建元11A1_bc	700,000	37,365,595.23	0.14
4	1789379	18德宝天元3A	1,500,000	20,252,138.82	0.08
5	1789253	17速利银丰2A	500,000	16,391,584.04	0.06

5.9 投资组合报告附注

5.9.1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。

5.9.218兴业银行CD290(代码:111810290)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务等行为给予罚款人民币5870万元的行政处罚。

18浦发银行CD258(代码:111809258)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会针对浦发银行通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求等行为给予罚款人民币5845万元的行政处罚。

18招商银行CD134(代码:111807134)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会针对招商银行违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户等行为给予罚款人民币6570万元的行政处罚。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	141,634,566.22
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	141,634,566.22

§6 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
本报告期期初基金份额总额	426,591,415.16	25,786,945,350.21
本报告期基金总申购份额	254,052,362.57	279,178,172.32
本报告期基金总赎回份额	185,349,536.16	679,769.98
报告期期末基金份额总额	495,294,241.57	26,065,443,752.55

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	25,747,399,848.46	277,501,363.91	0.00	26,024,901,212.37	97.98%
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。							

§9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

9.3 查阅方式

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

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

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

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

广发理财30天债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发理财30天债券	
基金主代码	270046	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年1月14日	
报告期末基金份额总额	68,268,464,646.19份	
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。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类
下属分级基金的交易代码	270046	270047
报告期末下属分级基金的份额总额	3,723,633,563.13份	64,544,831,083.06份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类
1.本期已实现收益	36,088,319.21	690,297,935.26
2.本期利润	36,088,319.21	690,297,935.26
3.期末基金资产净值	3,723,633,563.13	64,544,831,083.06

注: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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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30天债券A类:

阶段	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
过去三个月	0.9920%	0.0008%	0.3450%	0.0000%	0.6470%	0.0008%

2、广发理财30天债券B类:

阶段	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
过去三个月	1.0655%	0.0008%	0.3450%	0.0000%	0.7205%	0.0008%

注:本基金每日计算当日收益并分配,并在运作期期末集中支付。

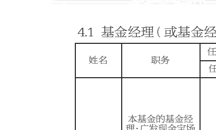
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发理财30天债券型证券投资基金

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1月14日至2018年9月30日)

1、广发理财30天债券A类



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曾雪兰	本基金的基金经理;广发现金宝场内货币基金的基金经理;广发集安基金的基金经理	2016-07-22	-	8年	曾雪兰女士,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部债券交易员、债券研究员、基金经理助理。现任广发理财30天债券型证券投资基金基金经理(自2016年7月22日起任职)、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理(自2016年7月22日起任职)、广发集安债券型证券投资基金基金经理(2017年2月6日起任职)。
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7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;广发活期宝货币基金的基金经理;广发添利货币ETF基金的基金经理;广发天天红基金的基金经理;现金投资部总经理	2013-01-14	-	18年	温秀娟女士,经济学学士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理,广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理。现任广发基金管理有限公司现金投资部总经理、广发货币市场基金基金经理(自2010年4月29日起任职)、广发理财30天债券型证券投资基金基金经理(自2013年1月14日起任职)、广发理财7天债券型证券投资基金基金经理(自2013年6月20日起任职)、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金基金经理(自2013年12月2日起任职)、广发活期宝货币市场基金基金经理(2014年8月28日起任职)、广发添利交易型货币市场基金基金经理(自2016年11月22日起任职)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2017年10月31日起任职)。

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发理财30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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库,投资的债券必须来自公司债券库。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。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。

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

报告期内,货币市场整体维持宽松态势。从量价组合上看,M2增速继续在低位震荡,回购利率R007全季都被约束在利率走廊上限之内,并且8月上旬与公开市场操作利率倒挂,市场流动性非常充裕。理解货币市场的核心在于央行,在维持流动性合理充裕的政策取向以及宽信用政策短期基本无效的背景下货币市场的宽松态势预计仍将维持。央行操作方面,在美债收益率不断创出近年来高点的情况下央行仍然动用降准这一宽松信号较强的总量手段表明,在内外均衡出现冲突时,内部稳定与增长的目标是无可置疑的首要目标。未来货币政策的焦点仍然是疏通货币到信用的传导。报告期内,组合选择在季度末、银行同业存单集中到期等时点配置资产,获取相对较高的再投资收益,提高组合收益率。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发理财30天债券A类净值增长率为0.9920%,广发理财30天债券B类净值增长率为1.0655%,同期业绩比较基准收益率为0.3450%

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	60,859,303,751.54	83.77
	其中:债券	60,859,303,751.54	83.77
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	790,072,545.11	1.09
	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	10,903,131,572.65	15.01
4	其他资产	101,866,535.02	0.14
5	合计	72,654,374,404.32	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	8.37
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	4,254,542,965.53	6.23
	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20%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。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	136
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	138
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	67

报告期内投资组合平均剩余期限超过120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150天",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3.2 报告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	2.33	6.23
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	3.13	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	30.18	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	4.78	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	65.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.28	6.23

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	697,211,800.12	1.02
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,794,469,209.79	4.09
	其中:政策性金融债	2,794,469,209.79	4.09
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,502,494,791.79	3.67
6	中期票据	50,660,464.93	0.07
7	同业存单	54,814,467,484.91	80.29
8	其他	-	-
9	合计	60,859,303,751.54	89.15
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111805212	18建设银行CD212	25,000,000.00	2,463,500,380.97	3.61
2	111884202	18成都农商银行CD014	20,000,000.00	1,970,932,541.05	2.89
3	111809276	18浦发银行CD276	20,000,000.00	1,969,916,798.79	2.89
4	111806114	18交通银行CD114	17,000,000.00	1,659,510,924.75	2.43
5	160208	16国开08	14,700,000.00	1,468,419,887.44	2.15
6	111883092	18台州银行CD044	10,000,000.00	995,778,928.02	1.46
7	111898800	18张家口银行CD022	10,000,000.00	991,289,945.44	1.45
8	111899292	18华融湘江银行CD106	10,000,000.00	990,920,266.06	1.45
9	111809193	18浦发银行CD193	10,000,000.00	990,414,688.20	1.45
10	111899468	18广州农村商业银行CD046	10,000,000.00	990,117,245.95	1.45

5.7"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	29次
报告期内偏离度的最高值	0.3921%
报告期内偏离度的最低值	0.1527%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.2523%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1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。

5.9.218浦发银行CD276(代码:111809276)、18浦发银行CD193(代码:111809193)为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日,中国银行保险监督管理委员会针对浦发银行通过资管计划投资分行协议存款,虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求等行为给予罚款人民币5845万元的行政处罚。

除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	101,866,535.02
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	101,866,535.02

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发理财30天债券A类	广发理财30天债券B类
本报告期期初基金份额总额	3,323,174,772.59	65,228,393,732.71
本报告期基金总申购份额	2,746,751,284.95	2,200,578,978.85
本报告期基金总赎回份额	2,346,292,494.41	2,884,141,628.50
报告期期末基金份额总额	3,723,633,563.13	64,544,831,083.06

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

§8 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	22,370,566,338.17	245,435,061.23	0.00	22,616,001,399.40	33.13%
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发理财30天债券型证券投资基金募集的文件

2.《广发理财30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30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

9.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

9.3 查阅方式

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

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

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

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

广发理财年年红债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发理财年年红债券
基金主代码	270043
交易代码	270043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年7月19日
报告期末基金份额总额	2,514,236,040.44份
投资目标	本基金主要投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具,力求为投资者获取稳健的收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具,具体包括企业债、公司债、国债、央行票据、地方政府债、次级债、短期融资券、高收益债券、中期票据、资产支持证券、债券回购及银行存款等。在封闭期内,本基金采用买入并持有策略,对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配,主要投资于剩余期限(或回售期限)不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。在开放期,本基金将保持资产保持现金状态。基金管理人将采取各种有效管理措施,保障基金运作安排,防范流动性风险,满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	在每个封闭期,本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的银行一年期定期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为债券型基金,属证券投资基金中的较低风险品种,风险与预期收益高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	27,881,514.77
2.本期利润	27,881,514.77
3.加权平均基金份额本期利润	0.0111
4.期末基金资产净值	2,543,533,222.74
5.期末基金份额净值	1.012

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

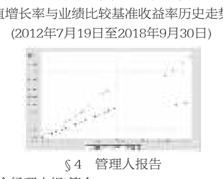
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.10%	0.04%	0.38%	0.00%	0.72%	0.04%

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

广发理财年年红债券型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年7月19日至2018年9月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理;广发聚安混合基金的基金经理;广发聚宝混合基金的基金经理;广发稳安保本基金的基金经理;广发鑫源混合基金的基金经理	2012-07-19	-	10年	谭昌杰先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部研究员、广发双债添利债券型证券投资基金基金经理(自2012年9月20日至2015年5月27日)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2013年10月22日至2017年10月31日)、广发钱袋子货币市场基金基金经理(自2014年1月10日至2015年7月24日)、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理(自2014年1月27日至2015年5月27日)、广发天天利货币市场基金基金经理(自2014年1月27日至2015年7月24日)、广发季季利理财债券型证券投资基金基金经理(自2014年9月29日至2015年4月30日)、广发聚康混合型证券投资基金基金经理(自2015年6月1日至2016年5月24日)、广发安泽回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年6月17日至2016年11月17日)、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理(自2016年11月18日至2017年12月22日)。现任广发理财年年红债券型证券投资基金基金经理(自2012年7月19日起任职)、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年1月29日起任职)、广发聚安混合型证券投资基金基金经理(自2015年3月25日起任职)、广发聚宝混合型证券投资基金基金经理(自2015年4月9日起任职)、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年2月4日起任职)、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月2日起任职)。
谢军	本基金的基金经理;广发增强债券基金的基金经理;广发聚源定期债券基金的基金经理;广发安享混合基金的基金经理;广发安悦回报混合基金的基金经理;广发服务业精选混合基金的基金经理;广发鑫源混合基金的基金经理;广发集瑞债券基金的基金经理;广发鑫利混合基金的基金经理;广发景华纯债基金的基金经理;广发汇瑞3个月定期开放债券基金的基金经理;广发安泽回报纯债基金的基金经理;广发景源纯债基金的基金经理;广发景祥纯债基金的基金经理;广发聚安混合基金的基金经理;广发聚宝混合基金的基金经理;广发聚盛混合基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理;广发稳安保本基金的基金经理;广发鑫和基金的基金经理;广发汇吉定开债基金的基金经理;广发汇元纯债定开发起式基金的基金经理;广发集富纯债基金的基金经理;债券投资部总经理	2017-07-05	-	15年	谢军先生,金融学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理、固定收益部总经理、广发货币市场基金基金经理(自2006年9月12日至2010年4月29日)、广发聚祥保本混合证券投资基金基金经理(自2011年3月15日至2014年3月20日)、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年1月10日至2018年1月6日)、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2016年12月2日至2018年6月12日)。现任广发基金管理有限公司债券投资部总经理、广发增强债券型证券投资基金基金经理(自2008年3月27日起任职)、广发聚源定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2013年5月8日起任职)、广发安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年2月22日起任职)、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月7日起任职)、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月9日起任职)、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月9日起任职)、广发集瑞债券型证券投资基金基金经理(自2016年11月18日起任职)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月18日起任职)、广发景华纯债债券型证券投资基金基金经理(自2016年11月28日起任职)、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年1月10日起任职)、广发景源纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年2月17日起任职)、广发景祥纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年3月2日起任职)、广发理财年年红债券型证券投资基金基金经理(自2017年7月5日起任职)、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发聚安混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发聚宝混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2018年1月16日起任职)、广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理(自2018年3月2日起任职)、广发汇元纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2018年3月30日起任职)、广发汇康定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2018年4月16日起任职)、广发汇瑞3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2018年6月13日起任职)、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理(自2018年8月28日起任职)。

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遵规守信情况的说明

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、《广发理财年年红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,为基金持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库,投资的债券必须来自公司债券库。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。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。

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

宏观经济的韧性走势有所弱化,部分宏观指标出现下滑。虽然货币政策持续宽松,资金利率下降,但基建等稳增长的实际措施落地不多,叠加贸易摩擦等外围不确定性因素的持续发酵,市场对于经济下滑的预期进一步强化。资产价格方面,长债利率先下后上,整体维持震荡;中短债收益率震荡下行,获得不错的绝对收益。本基金在6月快速建仓,在3季末进一步提高杠杆率,组合的静态收益率稳步提高。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发理财年年红债券净值增长率为1.10%,同期业绩比较基准收益率为0.38%

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	3,013,080,191.23	92.97
	其中:债券	3,013,080,191.23	92.97
	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	225,166,628.07	6.95
7	其他各项资产	2,772,826.05	0.09
8	合计	3,241,019,645.35	100.00

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境内股票投资组合

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通投资的股票。

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

序号	债券品种	公允价值(元)	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	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	3,013,080,191.23	118.46
9	其他	-	-
10	合计	3,013,080,191.23	118.46

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111813102	18浙商银行CD102	2,500,000	242,171,133.59	9.52
2	111821201	18渤海银行CD201	2,000,000	194,262,381.66	7.64
3	111813050	18浙商银行CD050	1,200,000	117,137,824.26	4.61
4	111814082	18江苏银行CD082	1,200,000	116,696,802.14	4.59
5	111821223	18渤海银行CD223	1,200,000	116,059,791.45	4.56

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

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

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,772,826.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,772,826.05

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	2,514,236,040.44
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	2,514,236,040.44

§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)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180930	1,000,001,501.92	-	-	1,000,001,501.92	39.77%
产品特有风险							
报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发理财年年红债券型证券投资基金募集的文件

2.《广发理财年年红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.《广发理财年年红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

9.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

9.3 查阅方式

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

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

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日