

广发集瑞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

重要提示
基金管理人的董事会及董事对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法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现,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。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金产品概况 (Fund Product Overview). Rows include 基金简称 (Fund Short Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 2018年7月1日至2018年9月30日 (2018-07-01 to 2018-09-30), and 广发集瑞债券C (GFJRBC). Rows include 1.本期已实现收益 (Current Realized Income), etc.

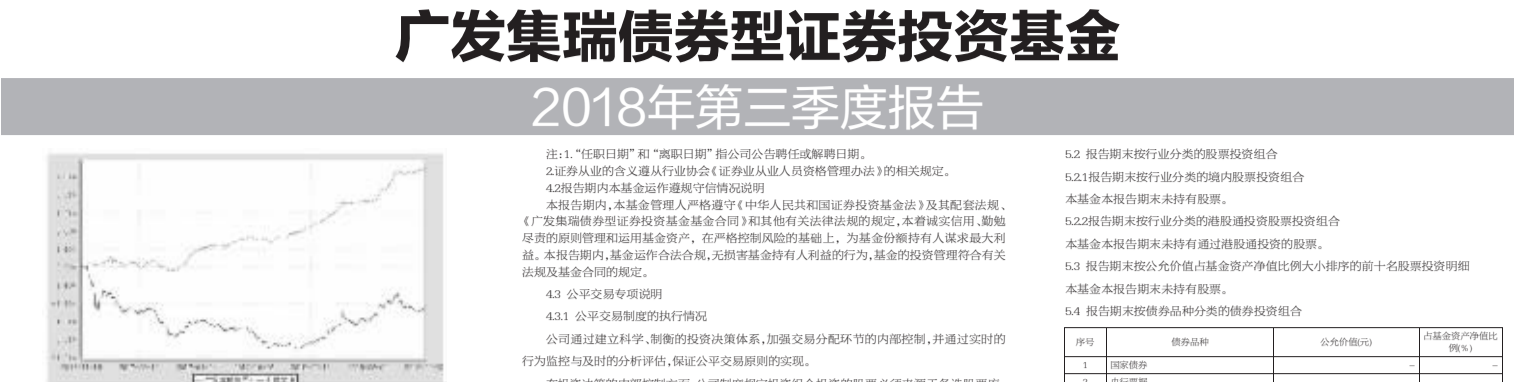
注:1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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
1.广发集瑞债券C:

Table showing performance metrics for GFJRBC. Columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Asset Value Growth Rate), 业绩比较基准收益率 (Benchmark Return), etc.

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发集瑞债券C证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2016年11月18日至2018年9月30日)

Table with 2 columns: 1. 广发集瑞债券C: (Performance comparison for GFJRBC).



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 解任日期
王宇利 基金经理 2018-07-26 11-16

4.2 报告期内本基金的投资策略和运作分析
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、《广发集瑞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长期利益。

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与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

4.4 报告期内本基金的投资组合报告
4.4.1 报告期末按资产类别的股票投资组合
报告期末本基金未持有股票。

4.4.2 报告期末按行业分类的债券投资组合
报告期末本基金未持有债券。

4.4.3 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
报告期末本基金未持有股票。

4.4.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
报告期末本基金未持有债券。

4.4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
报告期末本基金未持有资产支持证券。

4.4.6 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贵金属投资明细
报告期末本基金未持有贵金属。

4.4.7 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明细
报告期末本基金未持有权证。

4.4.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
报告期末本基金未进行股指期货交易。

4.4.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
报告期末本基金未进行国债期货交易。

4.5 投资组合报告附注
4.5.1 本基金投资的前十名证券的发行主体不存在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。

4.5.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于报告期内被出具非标审计结果或定期报告被出具非标意见的上市公司、金融企业的情形。

4.5.3 本基金投资的前十名债券中,不存在投资于同一发行人发行的同一品种债券且其占本基金资产净值比例超过10%的情形。

4.5.4 本基金投资的前十名资产支持证券中,不存在投资于同一原始权益人发行的同一资产支持证券且其占本基金资产净值比例超过10%的情形。

4.5.5 本基金投资的前十名权证中,不存在投资于同一发行人的权证。

4.5.6 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.7 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.8 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.9 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.10 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.11 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.12 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.13 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.14 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.15 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.16 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.17 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.18 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.19 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.20 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.21 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.22 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.23 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.24 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.25 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.26 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.27 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.28 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

4.5.29 本基金持有的所有以公允价值计量的金融资产,其公允价值按照《企业会计准则》确定的估值技术确定,且其估值技术使用的输入值均为可观察输入值。

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in Yuan). Rows include 1. 转出投资 (Outflow Investment), etc.

5.1.1.4 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。

5.1.1.5 报告期末前十名股票中存在受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受流通受限的情况。

5.1.3 其他各项资产
5.1.3.1 报告期末本基金持有的应收股利情况
5.1.3.2 报告期末本基金持有的应收利息情况

5.1.3.3 报告期末本基金持有的其他应收款情况
5.1.3.4 报告期末本基金持有的其他流动资产情况

5.1.3.5 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.6 报告期末本基金持有的其他无形资产情况

5.1.3.7 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.8 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.9 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.10 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.11 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.12 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.13 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.14 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.15 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.16 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.17 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.18 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.19 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.20 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.21 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.22 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.23 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.24 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.25 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.26 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.27 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.28 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.29 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.30 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.31 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.32 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.33 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.34 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.35 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.36 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.37 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.38 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.39 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.40 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.41 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.42 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.43 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.44 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.45 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

广发集泰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

重要提示
基金管理人的董事会及董事对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法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现,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。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金产品概况 (Fund Product Overview). Rows include 基金简称 (Fund Short Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 2018年7月1日至2018年9月30日 (2018-07-01 to 2018-09-30), and 广发集泰债券C (GFJTC). Rows include 1.本期已实现收益 (Current Realized Income), etc.

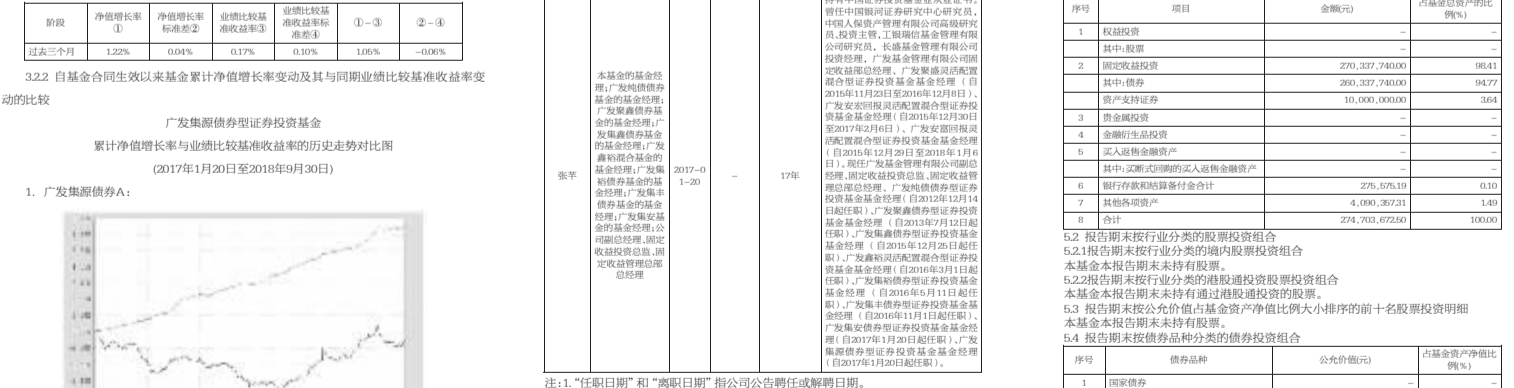
注:1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
(2) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 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
1.广发集泰债券C:

Table showing performance metrics for GFJTC. Columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Asset Value Growth Rate), 业绩比较基准收益率 (Benchmark Return), etc.

3.2.2 自基金合同生效以来本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
广发集泰债券C证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2016年11月18日至2018年9月30日)

Table with 2 columns: 1. 广发集泰债券C: (Performance comparison for GFJTC).



4.1 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 解任日期
王宇利 基金经理 2018-07-26 11-16

4.2 报告期内本基金的投资策略和运作分析
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、《广发集泰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长期利益。

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与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

4.4 报告期内本基金的投资组合报告
4.4.1 报告期末按资产类别的股票投资组合
报告期末本基金未持有股票。

4.4.2 报告期末按行业分类的债券投资组合
报告期末本基金未持有债券。

4.4.3 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
报告期末本基金未持有股票。

4.4.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细
报告期末本基金未持有债券。

4.4.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细
报告期末本基金未持有资产支持证券。

4.4.6 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贵金属投资明细
报告期末本基金未持有贵金属。

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in Yuan). Rows include 1. 转出投资 (Outflow Investment), etc.

5.1.1.4 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。

5.1.1.5 报告期末前十名股票中存在受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受流通受限的情况。

5.1.3 其他各项资产
5.1.3.1 报告期末本基金持有的应收股利情况
5.1.3.2 报告期末本基金持有的应收利息情况

5.1.3.3 报告期末本基金持有的其他应收款情况
5.1.3.4 报告期末本基金持有的其他流动资产情况

5.1.3.5 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.6 报告期末本基金持有的其他无形资产情况

5.1.3.7 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.8 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.9 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.10 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.11 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.12 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.13 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.14 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.15 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.16 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.17 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.18 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.19 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.20 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.21 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.22 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.23 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.24 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.25 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.26 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.27 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

广发集源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

重要提示
基金管理人的董事会及董事对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法律责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定,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预示其未来表现,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。

Table with 2 columns: 基金名称 (Fund Name) and 基金产品概况 (Fund Product Overview). Rows include 基金简称 (Fund Short Name), 基金代码 (Fund Code), 基金运作方式 (Fund Operation Mode), etc.

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

Table with 3 columns: 主要财务指标 (Key Financial Indicators), 2018年7月1日至2018年9月30日 (2018-07-01 to 2018-09-30), and 广发集源债券C (GFJYC). Rows include 1.本期已实现收益 (Current Realized Income), etc.

注:1) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或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。

3.2 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
1.广发集源债券C:

Table showing performance metrics for GFJYC. Columns: 阶段 (Period), 净值增长率 (Net Asset Value Growth Rate), 业绩比较基准收益率 (Benchmark Return), etc.

Table with 3 columns: 序号 (Serial Number), 名称 (Name), 金额(元) (Amount in Yuan). Rows include 1. 转出投资 (Outflow Investment), etc.

5.1.1.4 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。

5.1.1.5 报告期末前十名股票中存在受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受流通受限的情况。

5.1.3 其他各项资产
5.1.3.1 报告期末本基金持有的应收股利情况
5.1.3.2 报告期末本基金持有的应收利息情况

5.1.3.3 报告期末本基金持有的其他应收款情况
5.1.3.4 报告期末本基金持有的其他流动资产情况

5.1.3.5 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.6 报告期末本基金持有的其他无形资产情况

5.1.3.7 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.8 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.9 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.10 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.11 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.12 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.13 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.14 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.15 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.16 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.17 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.18 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.19 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.20 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.21 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.22 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.23 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.24 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.25 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.26 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

5.1.3.27 报告期末本基金持有的其他非流动资产情况

广发集源债券型证券投资基金

2018年第三季度