广发睿毅领先混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发睿毅领先混合
基金主代码	005233
交易代码	005233
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月14日
报告期末基金份额总额	160,653,072.09份
投资目标	在保持资产流动性的基础上,本基金主要通过充分挖掘符合中国经济转型升级发展方向的行业中领先企业的投资机会,并结合资本市场的运行状况对大类资产配置进行优化,力争超越本基金业绩比较基准,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	5,965,318.15
2.本期利润	-2,865,858.90
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0175
4.期末基金资产净值	177,150,517.24
5.期末基金份额净值	1.1027

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。

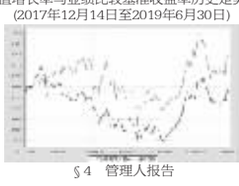
3.2 基金净值表现

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	-1.67%	1.54%	-0.75%	1.14%	-0.92%	0.40%

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

广发睿毅领先混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年12月14日至2019年6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		
林英睿	本基金的基金经理;广发多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发聚富开放式证券投资基金的基金经理	2017-12-14	-	8年	林英睿先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任瑞银证券研究员,中欧基金管理有限公司基金经理助理兼研究员、基金经理,广发基金管理有限公司权益投资一部研究员。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,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(完全复制指数组合及量化组合除外)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,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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度市场短暂冲高后较快回撤,各风格指数出现了较大差异,以上证50为代表的大蓝筹白马保持强势仍有一定的涨幅,而中证1000为代表的中小市值公司则出现了接近10%的季度下跌。战术层面,在观察到较为稳定的经济数据以及较为宽松的货币环境后,我们认为目前保持高仓位的胜率和收益率空间比较合适,因此对仓位进行了较大幅度的提升;战略层面,我们认为未来两三年权益市场会有较大的回报空间,在积极储备未来能够大概率高速增长同时目前估值水平较低的标的。

广发睿毅领先中长期的投资目标和策略为:1.希望通过努力,在中长期能够持续稳定地为持有人创造绝对回报。因此在分析行业、公司以及具体交易决策时,大致的思维逻辑是:1)是不是正的预期回报,对应的风险大致如何;2)在多长的时间框架内能够实现这个回报,相对各类资产收益率来看是否划算;3)这个决策是否有可复制性;2.要想战胜市场,即战胜大部分的市场参与者,意味着要敢于与市场主流有偏离。因此不轻易追热点,不盲目怕冷门;3.影响市场的因子是纷繁复杂的,其数量和影响权重是不断变化的。我们会努力去抓主要矛盾,但也明确地知道,理解市场特别是预测市场,在很多时候靠勤奋和禀赋是远远不够的。因此对市场变化保持持续的关注度,我们认为应对的分值不应该低于预测太多,尊重和敬畏市场;重点投资A股市场中周期企稳向好的行业以及有可持续性成长行业里的优质公司,紧密跟踪和把握市场变化趋势,适度动态调整,试图构建一个稳健向上的净值曲线。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为-1.67%,同期业绩比较基准收益率为-0.75%。

§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	165,998,691.21	92.88
	其中:股票	165,998,691.21	92.88
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	12,417,493.91	6.95
7	其他资产	299,502.11	0.17
8	合计	178,715,687.23	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,894,971.71	1.63
C	制造业	41,310,394.41	23.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,954,360.51	2.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,208,028.74	5.20
G	交通运输、仓储和邮政业	54,113,003.55	30.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,087,925.76	2.87
J	金融业	36,269,740.18	20.47
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,587,521.40	2.59
M	科学研究和技术服务业	1,063,195.35	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,519,548.60	4.24
S	综合	-	-
	合计	165,998,691.21	93.70

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

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	601021	春秋航空	221,900	9,985,500.00	5.64
2	603885	吉祥航空	731,827	9,586,933.70	5.41
3	601111	中国国航	970,300	9,285,771.00	5.24
4	603708	家家悦	403,507	9,208,029.74	5.20
5	600029	南方航空	1,179,366	9,104,705.52	5.14
6	600115	东方航空	1,412,800	8,858,256.00	5.00
7	601688	华泰证券	377,332	8,422,050.24	4.75
8	600030	中信证券	323,500	7,702,535.00	4.35
9	600977	中国电影	478,700	7,496,442.00	4.23
10	002049	紫光国微	166,100	7,326,671.00	4.14

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-645,600.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					73,080.00

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的期货合约,并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判,以及对股指期货合约的估值定价,与股票现货资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作,由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时,将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征,对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险,以改善投资组合的风险收益特性。

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报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

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 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	184,970.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,775.65
5	应收申购款	108,756.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	299,502.11

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	170,246,409.32
本报告期基金总申购份额	20,563,688.38
减:本报告期基金总赎回份额	30,156,925.61
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	160,653,072.09

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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	20190401-20190630	50,717,650.25	0.00	0.00	50,717,650.25	31.57%
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睿毅领先混合型证券投资基金募集的文件

2.《广发睿毅领先混合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.《广发睿毅领先混合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:投资者可在营业时间免费查阅,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

二〇一九年七月十八日

广发天天红发起式货币市场基金

2019年第二季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年七月十八日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月16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2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发天天红
基金主代码	000389
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年10月22日
报告期末基金份额总额	25,327,003,800.72份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
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	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	广发天天红货币A / 广发天天红货币B
下属分级基金的交易代码	000389 / 002183
报告期末下属分级基金的份额总额	3,396,962,196.75份 / 21,930,041,603.97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(2019年4月1日-2019年6月30日)	
	广发天天红货币A	广发天天红货币B
1.本期已实现收益	23,318,774.15	191,783,395.34
2.本期利润	23,318,774.15	191,783,395.34
3.期末基金资产净值	3,396,962,196.75	21,930,041,603.97

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,由于货币市场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、广发天天红货币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	0.6166%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.5281%	0.0004%

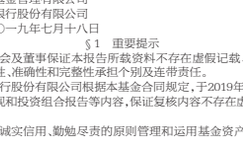
2、广发天天红货币B:

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	0.6770%	0.0004%	0.0885%	0.0000%	0.5885%	0.0004%

注:本基金收益分配按日结转份额。

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

广发天天红发起式货币市场基金
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10月22日至2019年6月30日)



1、广发天天红货币A

2、广发天天红货币B

§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		
温秀娟	本基金的基金经理;广发理财7天债券型证券投资基金的基金经理;广发天天红发起式货币市场基金的基金经理;广发钱袋子货币市场基金的基金经理;广发活期宝货币市场基金的基金经理;广发聚泰混合型证券投资基金的基金经理;广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发安盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2017-10-31	-	19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。
任爽	本基金的基金经理;广发理财7天债券型证券投资基金的基金经理;广发天天利货币市场基金的基金经理;广发钱袋子货币市场基金的基金经理;广发活期宝货币市场基金的基金经理;广发聚泰混合型证券投资基金的基金经理;广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发安盈灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2013-10-22	-	11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)、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日至2018年11月9日)、广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自2012年12月12日至2019年1月8日)、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日至2019年3月26日)。

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,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(完全复制指数组合及量化组合除外)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,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,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的5%的交易共4次,均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

二季度,货币市场在多因素推动下逐月宽松:4月降准预期落空,市场确认货币政策转入观察期,短期内流动性宽松不会进一步加码,引发债券市场一轮快速调整;5月中美谈判波澜再起,央行盘前通过完善三档两优的框架对县域农商行定向降准,加上资金利率一度非常宽松,市场开始预期逆周期政策重新加码。但随后2019年第一季度货币政策执行报告定调确认,人民币汇率急贬至敏感关口,市场再度回归货币政策观察期,难以大幅宽松的一致预期。月底,部分银行的风险事件引发市场动荡,为切断风险扩散,央行一方面加量投放,另一方面通过多种结构性手段直接对接中小银行和非银。从6月的资金利率来看,结构性问题有所改善但幅度有限,流动性更多派到在高信用机构市场,造成这些机构之间的回购利率异常走低,R007和DR007全月基本都处于OMO之下,对季末月份来说非常罕见。

报告期内,货币市场收益率在六月跌到了历史较低位置,在当前市场环境下,本基金作为流动性管理工具,对资产的选择更为审慎,做好流动性管理,防范风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类基金份额净值收益率为0.6166%,B类基金份额净值收益率为0.6770%,同期业绩比较基准收益率为0.0885%。

§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	19,865,401,741.91	72.15
	其中:债券	19,865,401,741.91	72.15
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,051,346,844.71	18.35
	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	2,417,325,958.21	8.78
4	其他资产	198,590,911.37	0.72
5	合计	27,532,665,456.20	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	3.77
	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	2,175,657,345.56	8.59
	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

本报告期内本债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	72
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	74
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	28

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

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	42.96	8.59
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	24.16	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	15.05	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	1.44	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	24.32	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		107.92	8.59

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	578,866,409.78	2.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	901,607,555.82	3.56
	其中:政策性金融债	901,607,555.82	3.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	950,310,384.38	3.75
6	中期票据	150,646,314.79	0.59
7	同业存单	17,283,971,077.14	68.24
8	其他	-	-
9	合计	19,865,401,741.91	78.44
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	111916167	19上海银行CD167	20,000,000.00	1,996,727,797.74	7.88
2	111909153	19浦发银行CD153	20,000,000.00	1,990,706,278.40	7.86
3	111909014	19浦发银行CD014	13,000,000.00	1,278,209,336.88	5.05
4	111921214	19渤海银行CD214	8,000,000.00	798,364,332.05	3.15
5	111915224	19民生银行CD224	8,000,000.00	795,245,539.41	3.14
6	111908077	19中信银行CD077	7,000,000.00	697,831,085.88	2.76
7	111916120	19上海银行CD120	7,000,000.00	697,530,915.29	2.75
8	111918211	19华夏银行CD211	7,000,000.00	684,623,145.21	2.70
9	111921216	19渤海银行CD216	6,000,000.00	598,699,523.30	2.36
10	111921176	19渤海银行CD176	4,500,000.00	447,930,864.17	1.77

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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0631%
报告期内偏离度的最低值	-0.0018%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0233%

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。

5.9.2本基金投资的前十名证券的发行主体中,上海银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、渤海银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、中信银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会(含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会)或其派出机构的处罚;上海浦东发展银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他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	54,877,875.06
4	应收申购款	143,713,036.31
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	198,590,911.37

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发天天红货币A	广发天天红货币B
本报告期期初基金份额总额	4,261,657,895.71	27,300,637,422.02
本报告期基金总申购份额	1,548,457,815.68	23,122,050,446.44
本报告期基金总赎回份额	2,413,153,514.64	28,492,646,264.49
报告期期末基金份额总额	3,396,962,196.75	21,930,041,603.97

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2019-04-01	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
2	申购	2019-04-02	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
3	申购	2019-04-03	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
4	申购	2019-04-04	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
5	申购	2019-04-08	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
6	申购	2019-04-09	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
7	申购	2019-04-10	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
8	红利再投	2019-04-30	4,398,111.86	4,398,111.86	0.00%
9	申购	2019-05-08	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
10	申购	2019-05-09	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
11	申购	2019-05-15	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
12	申购	2019-05-24	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
13	红利再投	2019-05-31	4,046,065.08	4,046,065.08	0.00%
14	申购	2019-06-05	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
15	申购	2019-06-06	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
16	申购	2019-06-11	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
17	申购	2019-06-12	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
18	申购	2019-06-13	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
19	申购	2019-06-14	10,000,000.00	10,000,000.00	0.00%
20	赎回	2019-06-21	-10,000,000.00	-10,000,000.00	0.00%
21	红利再投	2019-06-30	3,909,149.92	3,909,149.92	0.00%
合计			172,353,326.86	172,353,326.86	

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固