

广发纯债债券型证券投资基金

【2016】第一季度报告

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:二〇一六年四月二十二日

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2016年4月19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。

§2 基金产品概况

基金名称	广发纯债债券基金
基金代码	ZF0001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月21日
报告期末基金份额总额	5,382,797,984.63份
投资目标	在严格控制风险的基础上,通过积极主动的投资管理,追求基金资产的长期稳健增值,力争为基金份额持有人获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取组合分散化投资策略,通过分散化投资,降低单一债券品种的信用风险和利率风险,并综合运用久期管理、期限配置、品种配置、杠杆操作、个券选择等多种投资策略,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
业绩比较基准	中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票基金、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	广发纯债债券A类
下属分级基金的代码	ZF0001A
报告期末A类基金份额净值	2.512,114.984509

3.1 主要财务指标

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2016年1月1日至2016年3月31日)	广发纯债债券A类	广发纯债债券B类
1.本期已实现收益	20,407,688.00	54,537,917.76	-
2.本期利润	20,378,289.40	51,112,849.41	-
3.加权平均基金份额本期利润	0.0100	0.0084	-
4.本期基金资产净值	3,042,000,000.00	4,072,790,672.64	-
5.本期基金份额净值	1.211	1.269	-

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 报告期末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. 广发纯债债券A类:

2. 广发纯债债券C类:

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

广发纯债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的历史走势对比图
(2012年12月12日至2016年3月31日)

1. 广发纯债债券A类:

2. 广发纯债债券C类:

注:1.“任职日期”和“离任日期”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。
3.广发纯债债券型证券投资基金的投资目标:本基金采取主动管理,在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。

4. 基金管理人

5. 基金托管人

6. 基金销售机构

7. 基金注册登记机构

8. 基金投资顾问

9. 基金销售网点

10. 基金销售电话

11. 基金销售网站

12. 基金销售机构

13. 基金销售机构

14. 基金销售机构

15. 基金销售机构

16. 基金销售机构

17. 基金销售机构

18. 基金销售机构

19. 基金销售机构

20. 基金销售机构

21. 基金销售机构

22. 基金销售机构

23. 基金销售机构

24. 基金销售机构

25. 基金销售机构

26. 基金销售机构

27. 基金销售机构

28. 基金销售机构

29. 基金销售机构

30. 基金销售机构

31. 基金销售机构

32. 基金销售机构

33. 基金销售机构

34. 基金销售机构

35. 基金销售机构

36. 基金销售机构

37. 基金销售机构

38. 基金销售机构

39. 基金销售机构

40. 基金销售机构

41. 基金销售机构

42. 基金销售机构

43. 基金销售机构

44. 基金销售机构

45. 基金销售机构

46. 基金销售机构

47. 基金销售机构

48. 基金销售机构

49. 基金销售机构

50. 基金销售机构

51. 基金销售机构

52. 基金销售机构

53. 基金销售机构

54. 基金销售机构

55. 基金销售机构

56. 基金销售机构

57. 基金销售机构

58. 基金销售机构

59. 基金销售机构

60. 基金销售机构

61. 基金销售机构

62. 基金销售机构

63. 基金销售机构

64. 基金销售机构

65. 基金销售机构

66. 基金销售机构

67. 基金销售机构

68. 基金销售机构

69. 基金销售机构

70. 基金销售机构

71. 基金销售机构

72. 基金销售机构

73. 基金销售机构

74. 基金销售机构

75. 基金销售机构

76. 基金销售机构

77. 基金销售机构

78. 基金销售机构

79. 基金销售机构

80. 基金销售机构

81. 基金销售机构

82. 基金销售机构

83. 基金销售机构

84. 基金销售机构

85. 基金销售机构

86. 基金销售机构

87. 基金销售机构

88. 基金销售机构

89. 基金销售机构

90. 基金销售机构

91. 基金销售机构

92. 基金销售机构

93. 基金销售机构

94. 基金销售机构

95. 基金销售机构

96. 基金销售机构

97. 基金销售机构

98. 基金销售机构

99. 基金销售机构

100. 基金销售机构

101. 基金销售机构

102. 基金销售机构

103. 基金销售机构

104. 基金销售机构

105. 基金销售机构

106. 基金销售机构

107. 基金销售机构

108. 基金销售机构

109. 基金销售机构

110. 基金销售机构

111. 基金销售机构

112. 基金销售机构

113. 基金销售机构

114. 基金销售机构

115. 基金销售机构

116. 基金销售机构

117. 基金销售机构

118. 基金销售机构

119. 基金销售机构

120. 基金销售机构

121. 基金销售机构

122. 基金销售机构

123. 基金销售机构

124. 基金销售机构

125. 基金销售机构

126. 基金销售机构

127. 基金销售机构

128. 基金销售机构

129. 基金销售机构

130. 基金销售机构

131. 基金销售机构

132. 基金销售机构

133. 基金销售机构

134. 基金销售机构

135. 基金销售机构

136. 基金销售机构

137. 基金销售机构

138. 基金销售机构

139. 基金销售机构

140. 基金销售机构

141. 基金销售机构

142. 基金销售机构

143. 基金销售机构

144. 基金销售机构

145. 基金销售机构

146. 基金销售机构

147. 基金销售机构

148. 基金销售机构

149. 基金销售机构

150. 基金销售机构

151. 基金销售机构

152. 基金销售机构

153. 基金销售机构

154. 基金销售机构

155. 基金销售机构

156. 基金销售机构

157. 基金销售机构

158. 基金销售机构

159. 基金销售机构

160. 基金销售机构

161. 基金销售机构

162. 基金销售机构

163. 基金销售机构

164. 基金销售机构

165. 基金销售机构

166. 基金销售机构

167. 基金销售机构

168. 基金销售机构

169. 基金销售机构

170. 基金销售机构

171. 基金销售机构

172. 基金销售机构

173. 基金销售机构

174. 基金销售机构

175. 基金销售机构

176. 基金销售机构

177. 基金销售机构

178. 基金销售机构

179. 基金销售机构

180. 基金销售机构

181. 基金销售机构

182. 基金销售机构

183. 基金销售机构

184. 基金销售机构

185. 基金销售机构

186. 基金销售机构

187. 基金销售机构

188. 基金销售机构

189. 基金销售机构

190. 基金销售机构

191. 基金销售机构

192. 基金销售机构

193. 基金销售机构

194. 基金销售机构

195. 基金销售机构

196. 基金销售机构

197. 基金销售机构

198. 基金销售机构

199. 基金销售机构

200. 基金销售机构

201. 基金销售机构

202. 基金销售机构

203. 基金销售机构

204. 基金销售机构

205. 基金销售机构

206. 基金销售机构

207. 基金销售机构

208. 基金销售机构

209. 基金销售机构

210. 基金销售机构

211. 基金销售机构

212. 基金销售机构

213. 基金销售机构

214. 基金销售机构

215. 基金销售机构

216. 基金销售机构

217. 基金销售机构

218. 基金销售机构

219. 基金销售机构

220. 基金销售机构

221. 基金销售机构

222. 基金销售机构

223. 基金销售机构

224. 基金销售机构

225. 基金销售机构

226. 基金销售机构

227. 基金销售机构

228. 基金销售机构

229. 基金销售机构

230. 基金销售机构

231. 基金销售机构

232. 基金销售机构

233. 基金销售机构

234. 基金销售机构

235. 基金销售机构

236. 基金销售机构

237. 基金销售机构

238. 基金销售机构

239. 基金销售机构

240. 基金销售机构

241. 基金销售机构

242. 基金销售机构

243. 基金销售机构

244. 基金销售机构

245. 基金销售机构

246. 基金销售机构

247. 基金销售机构

248. 基金销售机构

249. 基金销售机构

250. 基金销售机构

251. 基金销售机构

252. 基金销售机构

253. 基金销售机构

254. 基金销售机构

255. 基金销售机构

256. 基金销售机构

257. 基金销售机构

258. 基金销售机构

259. 基金销售机构

260. 基金销售机构

261. 基金销售机构

262. 基金销售机构

263. 基金销售机构

264. 基金销售机构

265. 基金销售机构

266. 基金销售机构

267. 基金销售机构

268. 基金销售机构