广发景华纯债债券型证券投资基金

【2017】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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§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2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发景华纯债
基金主代码	003819
交易代码	003819
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月28日
报告期末基金份额总额	196,440,092.92份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求获得超越业绩比较基准的投资回报,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。
业绩比较基准	中债总全价指数收益率。
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	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 (2017年1月1日-2017年3月31日) 上期金额	
1.本期已实现收益	17,071,704.78 -
2.本期利润	13,156,323.03 -
3.加权平均基金份额本期利润	0.0128 -
4.期末基金资产净值	202,068,290.96 -
5.期末基金份额净值	1.0287 -

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。

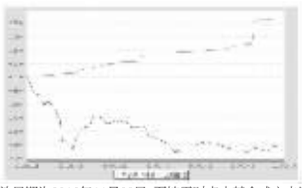
3.2 基金净值表现

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	2.38%	0.13%	-1.45%	0.10%	3.83%	0.03%

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

广发景华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历史走势对比图
(2016年11月28日至2017年3月31日)



注:(1)本基金合同生效日期为2016年11月28日,至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后6个月,至披露时点本基金仍处于建仓期。

§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		
谢军	本基金的基金经理;广发纯债债券基金的基金经理;广发聚盈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的基金经理;广发鑫盈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;广发汇瑞一年定开债券基金的基金经理;广发安泽回报纯债基金的基金经理;广发鑫富混合基金的基金经理;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;固定收益部副总经理	2016-11-28	-	14年	男,中国籍,金融学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书和特许金融分析师状(CFA),2003年7月至2006年9月先后任广发基金管理有限公司研究发展部产品设计人员、企业年金和债券研究员,2006年9月12日至2010年4月28日任广发货币基金的基金经理,2008年3月27日起任广发增强债券基金的基金经理,2008年4月17日至2012年2月14日先后任广发基金管理有限公司固定收益部总经理助理、副总经理、总经理,2011年3月15日至2014年3月20日任广发聚祥保本混合基金的基金经理,2012年2月15日起任广发基金管理有限公司固定收益部副总经理,2013年5月8日起任广发聚源定期债券基金的基金经理,2016年2月22日起任广发安享混合基金的基金经理,2016年11月7日起任广发安悦回报混合基金的基金经理;2016年11月9日起任广发服务业精选混合和广发鑫源混合基金的基金经理,2016年11月18日起任广发集瑞债券和广发鑫利混合基金的基金经理,2016年11月28日起任广发景华纯债基金的基金经理,2016年12月2日起任广发汇瑞一年定开债券基金的基金经理,2017年1月10日起任广发安泽回报纯债和广发鑫富混合基金的基金经理,2017年2月17日起任广发景源纯债的基金经理,2017年3月2日起任广发景祥纯债基金的基金经理。

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、《广发景华纯债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。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。监察稽核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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

一季度,银行间资金面整体呈现紧平衡的态势,资金成本波动中枢继续走高,与此同时银行机构与非银机构的流动性分层现象有所加剧。

全季来看整体收益率上行明显,信用利差有所走阔。但是整体上,收益率曲线过于平坦,信用利差依然位于1/4分位以下。这显示,虽然资金面维持了去年四季度较为紧张且波动较大的局面,但市场情绪依然较为乐观。

组合目前以短融、同业存单为主要配置。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为2.38%,同期业绩比较基准收益率为-1.45%

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前的主要基本面特点是:从库存周期的角度,目前乃至于上半年都依然处于相对高位,周期性企业资产负债表明显改善,通缩不是目前的主要矛盾,管理层主动释放流动性没有基本面基础。在金融层面,除大行外的银行主体在金融自由化背景下不断滚动发行存单,形成了债市的无风险收益率基础。同时,监管层也将继续延续去杠杆收紧态势。因此,债市投资还需以防御为主。

综合考虑,组合目前以较高等级城投和优质企业债为主,短久期、低杠杆。

§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	121,993,800.00	60.31
	其中:债券	101,949,800.00	50.40
	资产支持证券	20,044,000.00	9.91
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	15,360,143.04	7.59
	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	64,042,472.66	31.66
7	其他各项资产	895,790.45	0.44
8	合计	202,292,206.15	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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	1,998,800.00	0.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	9,957,000.00	4.93
	其中:政策性金融债	9,957,000.00	4.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,034,000.00	39.61
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	9,960,000.00	4.93
9	其他	-	-
10	合计	101,949,800.00	50.45

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	1789062	17金聚1A1	200,000	20,044,000.00	9.92
2	041760010	17建安投资CP001	200,000	20,024,000.00	9.91
3	011758019	17苏交通SCP003	200,000	20,012,000.00	9.90
4	011759022	17物产中大SCP004	200,000	20,002,000.00	9.90
5	011769004	17京供销SCP001	200,000	19,996,000.00	9.90

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

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	1789062	17金聚1A1	200,000	20,044,000.00	9.92

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	391,064.63
5	应收申购款	504,725.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	895,790.45

5.11.4报告期未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	3,111,528,749.00
本报告期基金总申购份额	196,439,387.77
减:本报告期基金总赎回份额	3,111,528,043.85
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	196,440,092.92

§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	期期初份额	申申购份额	赎赎回份额	持有份额	份份额占比
	1	20170101-20170319	3,111,466,796.79	0	3,111,466,796.79	0	0.00%
机构	2	20170320-20170331	0	194,646,228.71	0	194,646,228.71	99.08%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,在极端市场行情或遇其他流动性缺乏时,基金份额较大比例的集中赎回将使基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,因而对基金的正常运作和基金净值的计算造成影响,从而影响投资者的利益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准广发景华纯债债券型证券投资基金募集的文件

(二)《广发景华纯债债券型证券投资基金基金合同》

(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四)《广发景华纯债债券型证券投资基金托管协议》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)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
二〇一七年四月二十二日

广发景丰纯债债券型证券投资基金

【2017】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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年四月二十二日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发景丰纯债
基金主代码	003223
交易代码	003223
基金运作方式	-
基金合同生效日	2016年11月23日
报告期末基金份额总额	5,972,189,112.91份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求获得超越业绩比较基准的投资回报,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数(总财富)收益率×90%+银行1年期定期存款利率(税后)×10%。
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型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中具有中等风险收益特征的品种。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§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 (2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	38,820,178.20
2.本期利润	37,273,360.20
3.加权平均基金份额本期利润	0.0080
4.期末基金资产净值	6,006,815,320.08
5.期末基金份额净值	1.0058

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。

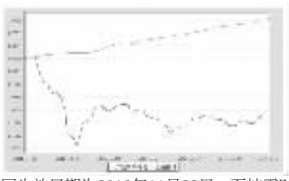
3.2 基金净值表现

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	0.81%	0.02%	-0.26%	0.06%	1.14%	-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

广发景丰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历史走势对比图
(2016年11月23日至2017年3月31日)



注:(1) 本基金合同生效日期为2016年11月23日, 至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后6个月 ,至披露时点本基金仍处于建仓期。

§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		
王予柯	本基金的基金经理;广发聚盛混合基金的基金经理;广发安泓回报混合基金的基金经理;广发稳裕保本基金的基金经理;广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理;广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理;广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理;广发沪港深新起点股票基金的基金经理;广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)基金的基金经理	2016-11-23	-	10年	男,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,2007年1月至2011年2月在广发基金管理有限公司固定收益研究部债券交易员兼研究员,2011年3月25日至2015年3月26日先后在广发基金管理有限公司机构投资部、权益投资二部及固定收益部任投资经理,2015年5月27日至2016年6月23日任广发集鑫债券基金的基金经理,2015年12月25日起任广发聚盛混合基金的基金经理,2016年1月9日起任广发安泓回报混合基金的基金经理,2016年6月27日起任广发稳裕保本基金的基金经理,2016年8月30日起任广发鑫盛纯债债券型基金的基金经理,2016年9月26日起任广发中债7-10年国开债指数基金的基金经理,2016年11月7日起任广发鑫隆混合基金的基金经理,2016年11月23日起任广发景丰纯债基金的基金经理,2016年12月22日起任广发鑫富混合基金的基金经理,2017年1月13日起任广发集富纯债基金的基金经理。

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、《广发景丰纯债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。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。监察稽核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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

经历了16年底的暴跌之后,市场整体较为悲观,但春节后货币市场不如预期中的紧张,月末因素对资金面扰动较小,等待的成本上升,同时两会上政策表态较为温和,市场预期各类监管政策新老划断的可能性较大,对市场扰动不大,同时长期看来,市场普遍又觉得经济肯定会下去,通胀不足担忧,因此现券市场在3月下旬之前都表现的较为活跃,到一季度季末,市场资金面变得非常紧张,但中长期个券基本没有调整,曲线明显变平。

本基金在本阶段配置上以短久期存单为主。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发景丰的净值增长率为0.88%,同期业绩比较基准收益率为-0.26%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

多空力量相对均衡,市场短期或将继续震荡,但中长期来看债市的各种利空因素并未消失,只是被暂时拖延。当然最终驱动因素还要看经济基本面,债券操作在当下仍然应保持谨慎,提高组合静态收益,同时适度参与交易性机会。

§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	5,970,840,400.00	99.36
	其中:债券	5,970,840,400.00	99.36
	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	5,452,294.97	0.09
7	其他各项资产	32,706,962.14	0.54
8	合计	6,008,999,657.11	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沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通投资股票。

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	306,245,400.00	5.10
	其中:政策性金融债	306,245,400.00	5.10
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	5,664,595,000.00	94.30
9	其他	-	-
10	合计	5,970,840,400.00	99.40

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	111718074	17华夏银行CD074	10,000,000	988,700,000.00	16.46
2	111710015	17兴业银行CD015	5,800,000	574,374,000.00	9.56
3	111707079	17招商银行CD079	5,000,000	494,350,000.00	8.23
3	111710108	17兴业银行CD108	5,000,000	494,350,000.00	8.23
4	111708092	17中信银行CD092	4,600,000	450,064,000.00	7.49
5	111714011	17江苏银行CD111	4,000,000	396,040,000.00	6.59

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投资。

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	32,706,962.14
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,706,962.14

5.11.4报告期未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	1,197,908,550.70
本报告期基金总申购份额	4,774,280,592.18
减:本报告期基金总赎回份额	29.97
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,972,189,112.91

§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	期期初份额	申申购份额	赎赎回份额	持有份额	份份额占比
机构	1	20170101-20170331	1,197,906,402.85	4,774,280,582.63	0.00	5,972,186,985.48	99.99%
产品特有风险							
本基金本报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情形,在极端市场行情或遇其他流动性缺乏时,基金份额较大比例的集中赎回将使基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,因而对基金的正常运作和基金净值的计算造成影响,从而影响投资者的利益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

(一)中国证监会批准广发景丰纯债债券型证券投资基金募集的文件

(二)《广发景丰纯债债券型证券投资基金基金合同》

(三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

(四)《广发景丰纯债债券型证券投资基金托管协议》

(五)法律意见书

(六)基金管理人业务资格批件、营业执照

(七)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
二〇一七年四月二十二日

广发标普全球农业指数证券投资基金

【2017】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:二〇一七年四月二十二日

§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2017年4月20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2017年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球农业指数(QDII)
基金主代码	270027
交易代码	270027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月28日
报告期末基金份额总额	63,223,495.05份
投资目标	本基金采用被动式投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,年跟踪误差不超过5%,实现对标普全球农业指数的有效跟踪。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。 本基金将不低于85%的基金资产投资于标普全球农业指数成份股、备选成份股;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为人民币计价的标普全球农业指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场指标波动风险收益特征。
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
境外资产托管人英文名称	Brown Brothers Harriman Co.
境外资产托管人中文名称	布朗兄弟哈里曼银行

§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 (2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	1,263,571.23
2.本期利润	1,075,216.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0158
4.期末基金资产净值	74,561,453.43
5.期末基金份额净值	1.179

注:1.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。

2.上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。

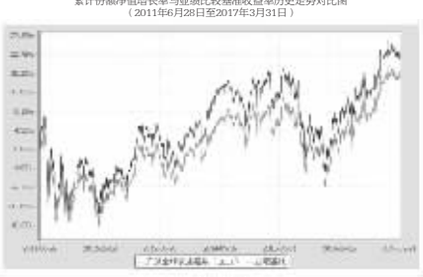
3.2 基金净值表现

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	1.29%	0.58%	0.38%	0.56%	0.91%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发标普全球农业指数证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年6月28日至2017年3月31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		
李耀柱	本基金的基金经理;广发纳指100ETF基金的基金经理;广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理;广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理;广发生物科技指数(QDII)基金的基金经理;广发沪港深新起点股票基金的基金经理;广发道琼斯石油指数(QDII-LOF)基金的基金经理	2016-08-23	-	7年	男,中国籍,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,2010年8月至2014年7月在广发基金管理有限公司中央交易部任股票交易员,2014年8月至2015年12月在国际业务部先后任QDII基金的研究员、基金经理助理,2015年12月17日起任广发纳指100ETF基金的基金经理,2016年8月23日起任广发全球农业指数(QDII)、广发纳斯达克100指数(QDII)、广发美国房地产指数(QDII)、广