广发大盘成长混合型证券投资基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
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:二〇一八年一月二十日

§ 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 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发大盘成长混合
基金主代码	270007
交易代码	270007(前端) 270017(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年 6 月 13 日
报告期末基金份额总额	2,383,697,751.08 份
投资目标	依托中国快速发展的宏观经济和高速成长的资本市场,通过投资于成长性较好的大市值公司股票,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。 本基金通过"自下而上"为主的股票分析流程,以成长性分析为重点,对大市值公司的基本面进行科学、全面的考察,挖掘投资机会,构建股票投资组合;通过利率预测、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析进行债券投资;同时严格遵守有关权证投资的比例限制。
业绩比较基准	75%*沪深 300 指数 +25%*上证国债指数
风险收益特征	较高风险,较高收益
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(2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	17,399,597.75
2.本期利润	220,756,228.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0900
4.期末基金资产净值	2,857,257,051.69
5.期末基金份额净值	1.1987

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。

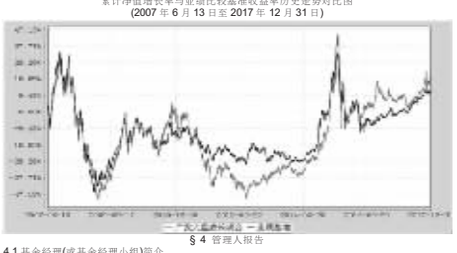
3.2 基金净值表现

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	8.03%	0.92%	3.82%	0.60%	4.21%	0.32%

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

广发大盘成长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
(2007 年 6 月 13 日至 2017 年 12 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		
李琛	本基金的基金经理;广发消费品精选混合基金的基金经理	2007-06-13	-	18年	李琛女士,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交易部交易员、广发基金管理有限公司筹建人员、投资管理部中央交易室主管、广发大盘成长混合型证券投资基金基金经理(自 2007 年 6 月 13 日至 2010 年 12 月 30 日)、广发稳健增长开放式证券投资基金基金经理(自 2010 年 12 月 31 日至 2016 年 3 月 28 日)、广发聚祥保本混合证券投资基金基金经理(自 2012 年 10 月 23 日至 2014 年 3 月 21 日)。现任广发大盘成长混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 2 月 23 日起任职)、广发消费品精选混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 2 月 23 日起任职)。
程琨	本基金的基金经理;广发逆向策略混合基金的基金经理	2013-02-05	-	12年	程琨先生,金融学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任第一上海证券有限公司研究员,广发基金管理有限公司国际业务部研究员、研究发展部研究员、基金经理助理,广发消费品精选混合型证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 8 日至 2016 年 2 月 22 日)。现任广发大盘成长混合型证券投资基金基金经理(自 2013 年 2 月 5 日起任职)、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2014 年 9 月 4 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、《广发大盘成长混合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。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。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的 5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度经济仍然保持回升的趋势,全球主要经济体 PMI 仍然维持在荣枯线之上,美联储如约加息,美国政府的减税政策也通过了,而国内十九大的成功闭幕,也标志着中国未来优质增长的大幕缓缓开启,唯一的问题是全球的资金成本都出现了上行。从市场来看,股票表现仍然延续之前的特点,上涨集中在所谓的"漂亮 50"中,白酒类股票基本都创新高,但与之前不同的是,市场开始担忧明年的经济增速以及通胀状况。从海外来看,香港和美国市场也连续创出新高,石油价格突破 60 美元大关,铜价也上升到 7200 美元以上,从价格信号来看,表明全球经济复苏的动力仍然较强,但是较高的资产价格以及逐步上行的资金成本可能会对市场构成一定的冲击。四季度,提高了股票仓位,增加了涨幅较少的优质价值股,从表现来看,四季度组合涨幅超越比较基准。

4.5 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 8.03%,同期业绩比较基准收益率为 3.82%。

§ 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	2,609,353,633.34	90.86
	其中:股票	2,609,353,633.34	90.86
2	固定收益投资	1,092,554.67	0.04
	其中:债券	1,092,554.67	0.04
	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	252,093,833.93	8.78
7	其他各项资产	9,165,016.27	0.32
8	合计	2,871,705,038.21	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	501,608,576.65	17.56
C	制造业	1,159,509,800.06	40.58
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	173,935,771.03	6.09
E	建筑业	214,709,842.75	7.51
F	批发和零售业	40,400,000.00	1.41
G	交通运输、仓储和邮政业	60,340,371.22	2.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	0.00
J	金融业	425,782,521.88	14.90
K	房地产业	33,000,314.00	1.15
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.00
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,609,353,633.34	91.32

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	601899	紫金矿业	50,399,720	231,334,714.80	8.10
2	600031	三一重工	24,600,223	223,124,022.61	7.81
3	601012	隆基股份	4,450,014	162,158,510.16	5.68
4	601117	中国化学	20,495,113	138,342,012.75	4.84
5	000001	平安银行	10,385,560	138,127,948.00	4.83
6	600489	中金黄金	12,911,105	127,690,828.45	4.47
7	600011	华能国际	20,292,824	125,206,724.08	4.38
8	601318	中国平安	1,685,600	117,958,288.00	4.13
9	600547	山东黄金	3,742,580	116,693,644.40	4.08
10	600703	三安光电	4,161,829	105,668,838.31	3.70

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)	1,092,554.67	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,092,554.67	0.04

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	113015	隆基转债	5,650	669,016.50	0.02
2	128015	久其转债	4,441	423,538.17	0.01

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,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	502,665.45
2	应收证券清算款	8,266,221.13
3	应收股利	-
4	应收利息	49,621.66
5	应收申购款	346,508.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,165,016.27

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	128015	久其转债	423,538.17	0.01

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	2,547,822,383.92
本报告期基金总申购份额	10,885,037.30
减:本报告期基金总赎回份额	175,009,670.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,383,697,751.08

§ 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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发大盘成长混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发大盘成长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.《广发大盘成长混合型证券投资基金托管协议》;

5.《广发大盘成长混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照;

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

8.2 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

8.3 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
二〇一八年一月二十日

广发天天红发起式货币市场基金

2017年第四季度报告

2017年 12 月 31 日
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:二〇一八年一月二十日

§ 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 2018 年 1 月 18 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 10 月 1 日起至 12 月 31 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,发起式
基金合同生效日	2013年 10 月 22 日
报告期末基金份额总额	6,487,890,681.68 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	4,887,870,223.21 份	1,600,020,458.47 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(2017 年 10 月 1 日 - 2017 年 12 月 31 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	44,601,074.59	20,347,345.42
2.本期利润	44,601,074.59	20,347,345.42
3.期末基金资产净值	4,887,870,223.21	1,600,020,458.47

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	1.0053%	0.0012%	0.0882%	0.0000%	0.9171%	0.0012%

2.广发天天红货币 B:

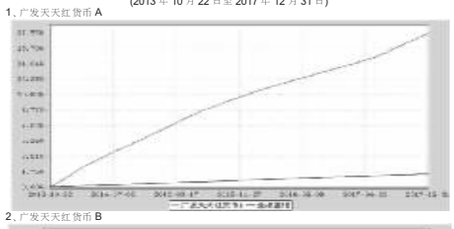
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0666%	0.0012%	0.0882%	0.0000%	0.9784%	0.0012%

注:本基金收益分配按日结转份额。

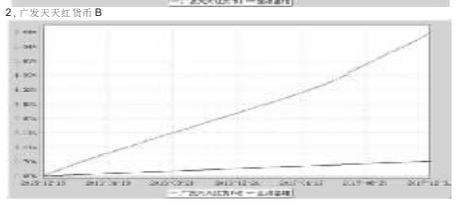
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 2017 年 12 月 31 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		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发理财年年红债券基金的基金经理;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	2013-10-22	2017-10-31	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 26 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 30 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 23 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 26 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 23 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 21 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)。
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;广发理财 7 天债券基金的基金经理;广发现金宝纯内货币基金的基金经理;广发活期宝货币基金的基金经理;广发添利宝货币 ETF 基金的基金经理;现金投资部总经理	2017-10-31	-	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)、广发现金宝纯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(自 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 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、《广发天天红发起式货币市场基金基金合同》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。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,银行间市场资金面有所分化:年内到期的资金利率还是周而复始的循环,具体表现在每月月中开始季节性收紧,每月下旬或月底重新回归利率走廊。而跨年的中长期资金利率如 3MNCD 收益率一直震荡走高,至年底创下年内新高。从央行的操作来看,基本还是延续前期削峰填谷的精细化操作模式,根据市场流动性状况灵活调整回笼或投放方向。本基金遵循年初以来资金利率变化规律,将现金流安排在季度末/年末,滚动配置。报告期内,组合积极管理现金流,在年底收益率较高的时点配置资产,获取较高的再投资收益,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,广发天天红 A 类净值增长率为 1.0604%,广发天天红 B 类净值增长率为 1.1214%,同期业绩比较基准收益率为 0.0894%

§ 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	2,348,202,580.78	33.98
	其中:债券	2,348,202,580.78	33.98
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,047,170,710.75	15.15
	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	3,369,166,695.56	48.75
4	其他资产	146,394,122.05	2.12
5	合计	6,910,934,109.14	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	4.36
	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	1,756,218,485.66	10.66
	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

本报告期内本货币市场基金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	49
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	97
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	25

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	14.98	6.17
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60 天	4.61	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90 天	63.94	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120 天	10.79	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397 天(含)	9.94	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.26	6.17

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	79,507,364.90	1.23
2	央行票据	-	-
3	金融债券	249,767,278.47	3.85
	其中:政策性金融债	249,767,278.47	3.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	109,922,055.52	1.69
6	中期票据	30,060,543.24	0.46
7	同业存单	1,878,945,338.65	28.96
8	其他	-	-
9	合计	2,348,202,580.78	36.19
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	111709506	17浦发银行 CD506	5,000,000.00	494,135,208.35	7.62
2	111711518	17平安银行 CD518	4,000,000.00	390,492,275.71	6.02
3	111709480	17浦发银行 CD480	3,000,000.00	297,068,989.07	4.58
4	111710648	17兴业银行 CD648	3,000,000.00	296,617,382.97	4.57
5	111710635	17兴业银行 CD635	2,000,000.00	197,996,597.90	3.05
6	111709493	17浦发银行 CD493	2,000,000.00	197,744,969.31	3.05
7	170204	17国开 04	1,100,000.00	109,836,417.21	1.69
8	130304	13进出 04	600,000.00	59,956,693.46	0.92
9	150406	15农发 06	500,000.00	50,008,078.40	0.77
10	011769031	17崇得新 SCP001	500,000.00	49,831,927.40	0.77

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	0.1722%
报告期内偏离度的最低值	0.0239%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1106%

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。

5.9.3 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	17,359,400.15
4	应收申购款	129,034,721.90
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	146,394,122.05

§ 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	3,986,990,339.78	3,635,313,879.48
本报告期基金总申购份额	20,375,609,706.95	1,474,124,444.91
本报告期基金总赎回份额	19,474,729,823.52	3,509,417,865.92
报告期期末基金份额总额	4,887,870,223.21	1,600,020,458.47

§ 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
-	申购	2017-10-16	28,000,000.00	28,000,000.00	-
-	分红转投	2017-10-31	2,405,163.70	2,405,163.70	-
-	申购	2017-11-02	82,000,000.00	82,000,000.00	-
-	赎回	2017-11-13	-20,000,000.00	-20,000,000.00	-
-	分红转投	2017-11-30	2,446,194.77	2,446,194.77	-
-	申购	2017-12-28	20,000,000.00	20,000,000.00	-
-	分红转投	2017-12-31	3,176,756.33	3,176,756.33	-
合计			118,028,114.80	118,028,114.80	

§ 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
基金管理人固有资金	782,685,524.96	12.06%	10,000,800.00	0.15%	三年
基金管理人高级管理人员	4.40	0.00%	-	-	-
基金经理等人员	10,427,148.17	0.16%	-	-	-
基金管理人股东	35,278.03	0.00%	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	793,147,955.56	12.22%	10,000,800.00	0.15%	三年

§ 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天天红发起式货币市场基金募集的文件;

2.《广发天天红发起式货币市场