

**广发纯债债券型证券投资基金**  
**2017 年年度报告摘要**  
**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：二〇一八年三月二十七日

## §1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	广发纯债债券	
基金主代码	270048	
交易代码	270048	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 12 月 12 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	
报告期末基金份额总额	1,237,410,065.66 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发纯债债券 A 类	广发纯债债券 C 类
下属分级基金的交易代码	270048	270049
报告期末下属分级基金的份额总额	947,928,021.51 份	289,482,044.15 份

### 2.2 基金产品说明

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	本基金通过综合分析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，并结合各种固定收益类资产在特定经济形势下的估值水平、预期收益和预期风险特征，在符合本基金相关投资比例规定的前提下，决定组合的久期水平、期限结构和类属配置，并在此基础之上实施积极的债券投资组合管理，以获取较高的投资收益。
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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588
传真		020-89899158	010-66105798

### 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指 标	2017 年		2016 年		2015 年	
	广发纯债债 券 A 类	广发纯债债 券 C 类	广发纯债债 券 A 类	广发纯债债 券 C 类	广发纯债债券 A 类	广发纯债债 券 C 类
本期已 实现收 益	22,786,782. 18	7,511,288.2 7	103,418,335.6 5	114,956,924. 70	53,195,428.68	76,046,588.8 4
本期利 润	17,554,337. 47	6,758,680.4 8	12,388,853.90	25,954,070.7 6	141,209,667.42	174,922,201. 68
加权平 均基金 份额本	0.0168	0.0145	0.0057	0.0115	0.1730	0.1436

期利润						
本期加 权平均 净值利 润率	1.43%	1.24%	0.47%	0.96%	14.75%	12.11%
本期基 金份额 净值增 长率	1.79%	1.54%	0.88%	0.54%	15.33%	15.26%
<b>3.1.2 期末</b>	<b>2017 年末</b>		<b>2016 年末</b>		<b>2015 年末</b>	
<b>数据和指 标</b>	广发纯债债券 A 类	广发纯债债券 C 类	广发纯债债券 A 类	广发纯债债券 C 类	广发纯债债券 A 类	广发纯债债券 C 类
期末可 供分配 基金份 额利润	0.0151	0.0129	0.0108	0.0071	0.0208	0.0187
期末基 金资产 净值	1,115,232,7 86.55	339,717,339 .20	1,842,136,64 6.73	907,336,665. 67	2,352,244,510. 04	4,311,170,07 9.78
期末基 金份额 净值	1.176	1.174	1.176	1.171	1.219	1.216

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）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 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:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.26%	0.05%	-1.42%	0.09%	1.16%	-0.04%
过去六个月	0.76%	0.05%	-1.84%	0.07%	2.60%	-0.02%
过去一年	1.79%	0.06%	-4.26%	0.09%	6.05%	-0.03%
过去三年	18.43%	0.13%	-1.75%	0.11%	20.18%	0.02%
过去五年	32.42%	0.16%	0.01%	0.12%	32.41%	0.04%
自基金合同生效起至今	32.55%	0.16%	0.12%	0.12%	32.43%	0.04%

##### 2. 广发纯债债券 C 类:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-0.26%	0.05%	-1.42%	0.09%	1.16%	-0.04%
过去六个月	0.68%	0.05%	-1.84%	0.07%	2.52%	-0.02%
过去一年	1.54%	0.06%	-4.26%	0.09%	5.80%	-0.03%
过去三年	17.67%	0.12%	-1.75%	0.11%	19.42%	0.01%
过去五年	31.21%	0.16%	0.01%	0.12%	31.20%	0.04%
自基金合同生效起至今	31.33%	0.16%	0.12%	0.12%	31.21%	0.04%

注：业绩比较基准：中债总全价指数收益率。

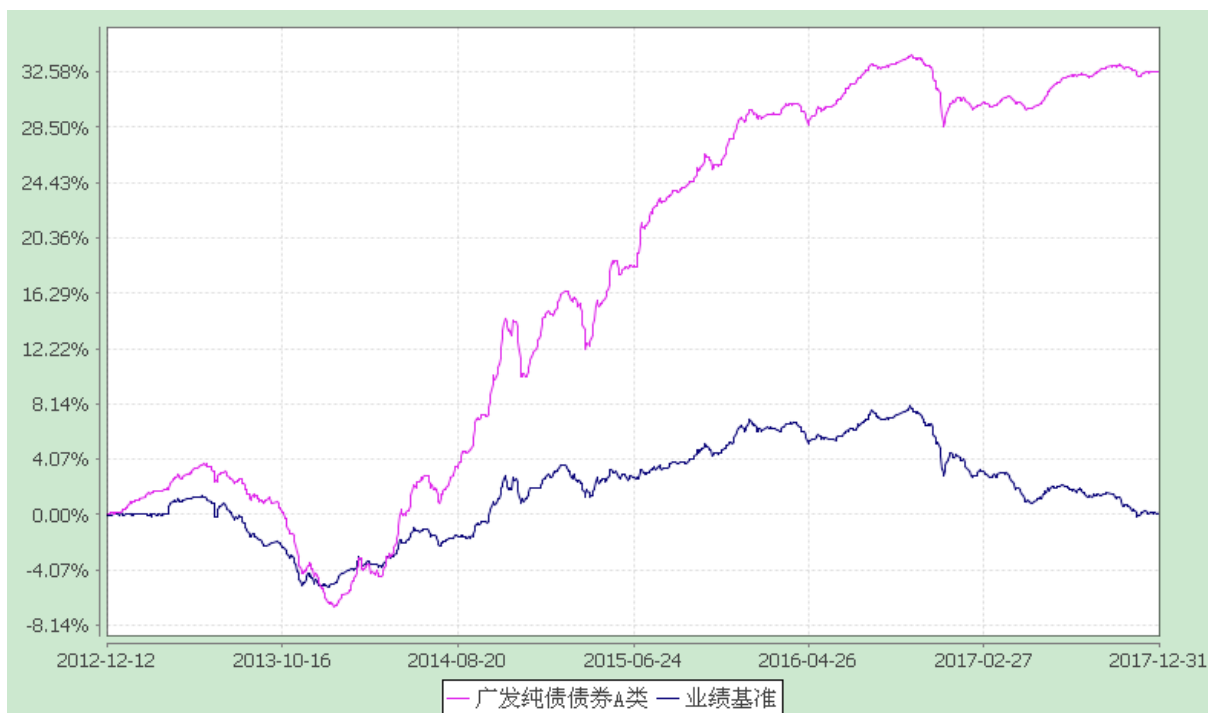
#### 3.2.2 基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发纯债债券型证券投资基金

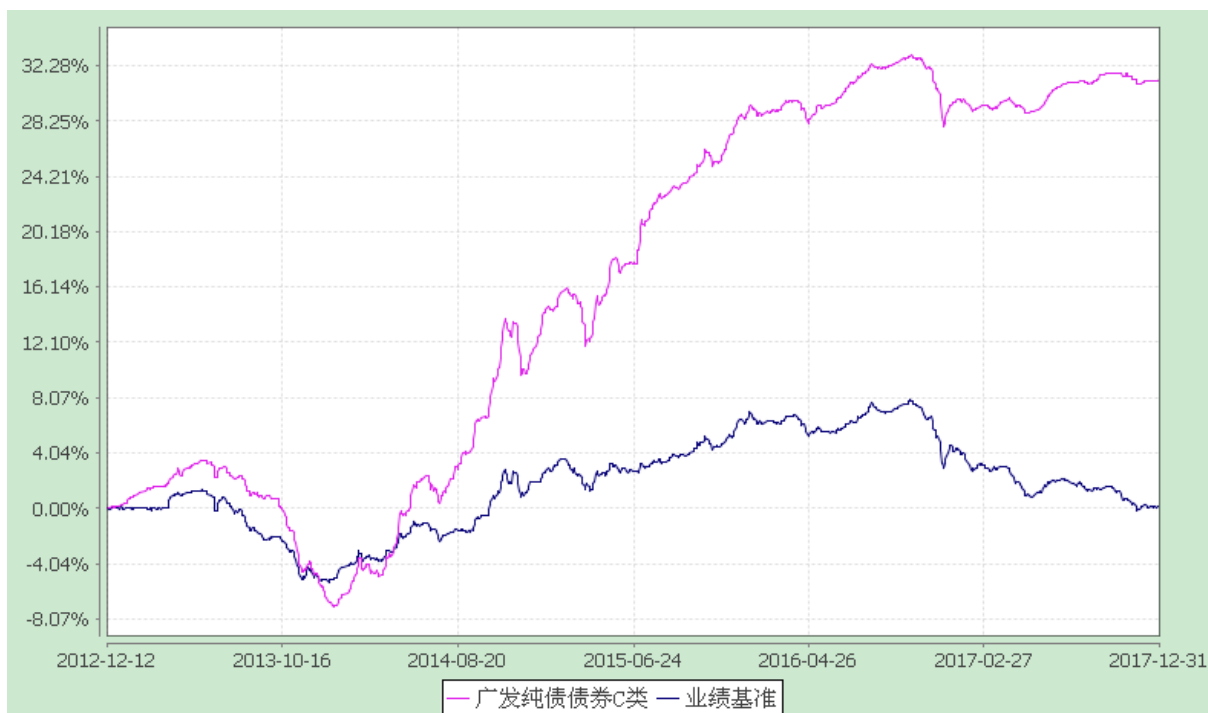
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012 年 12 月 12 日至 2017 年 12 月 31 日)

##### 1、广发纯债债券 A 类



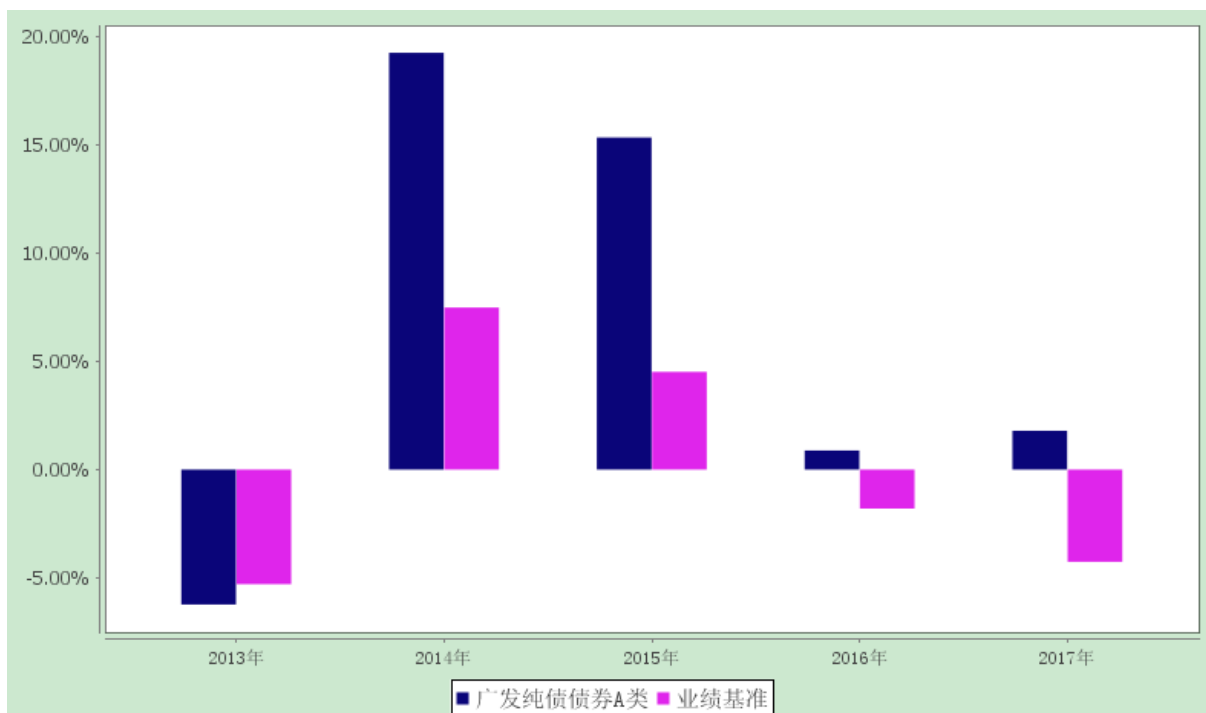
## 2、广发纯债债券 C 类



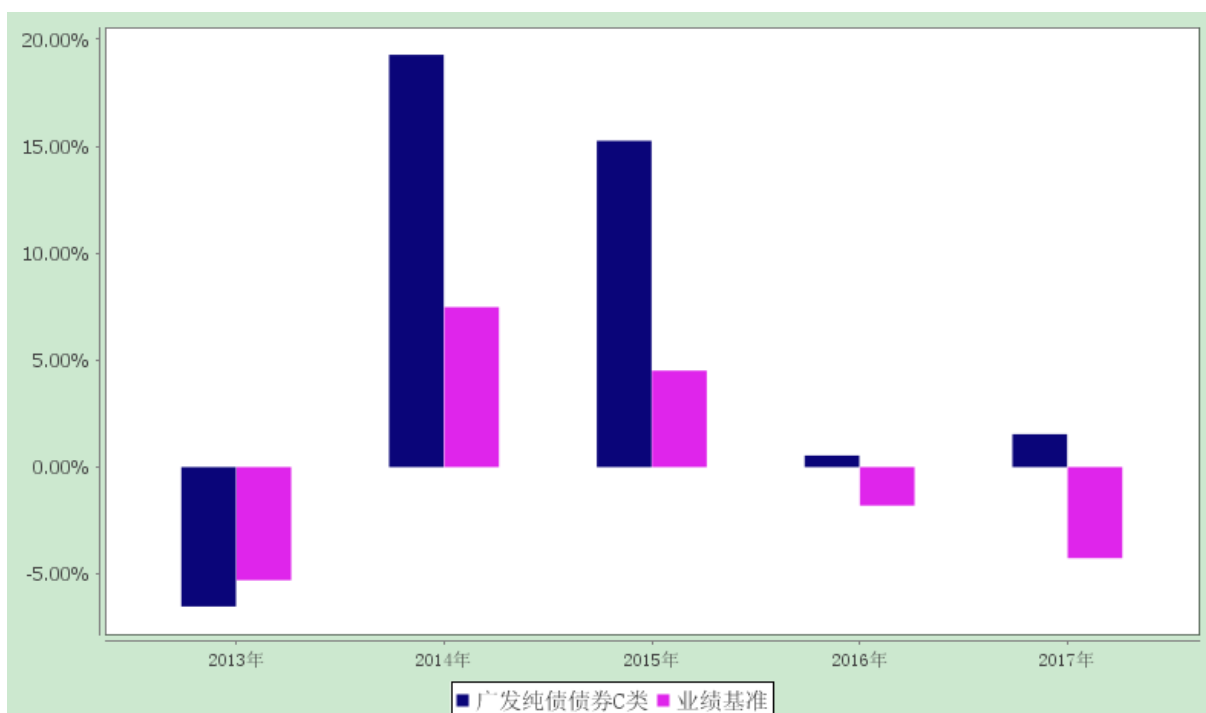
### 3.2.3 基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发纯债债券型证券投资基金  
净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

#### 1、广发纯债债券 A 类



## 2、广发纯债债券 C 类



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

#### 1、广发纯债债券 A 类:

单位：人民币元

年度	每10份基金	现金形式发放总	再投资形式发放总	年度利润分配合	备注



	份额分红数	额	额	计	
2017 年	0.210	13,824,532.11	9,843,766.89	23,668,299.00	-
2016 年	0.540	85,138,154.85	35,565,658.17	120,703,813.02	-
2015 年	0.500	30,854,543.14	9,971,851.29	40,826,394.43	-
合计	1.250	129,817,230.10	55,381,276.35	185,198,506.45	-

2、广发纯债债券 C 类：

单位：人民币元

年度	每10份基金 份额分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合 计	备注
2017 年	0.150	2,584,497.47	3,152,005.08	5,736,502.55	-
2016 年	0.520	72,721,401.24	70,514,773.83	143,236,175.07	-
2015 年	0.500	55,570,664.28	34,776,295.91	90,346,960.19	-
合计	1.170	130,876,562.99	108,443,074.82	239,319,637.81	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 29 个部门：权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人管理 161 只开放式基金，管理资产规模为 2799 亿元。

同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资和养老基金投资组合。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张芊	本基金的基金经理；广发聚鑫债券基金的基金经理；广发集鑫债券基金的基金经理；广发鑫裕混合基金的基金经理；广发集裕债券基金的基金经理；广发集丰债券基金的基金经理；广发集安基金的基金经理；广发集源债券基金的基金经理；公司副总经理、固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理	2012-12-14	-	17 年	张芊女士，经济学和工商管理双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国银河证券研究中心研究员，中国人保资产管理有限公司高级研究员、投资主管，工银瑞信基金管理有限公司研究员，长盛基金管理有限公司投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部总经理、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 11 月 23 日至 2016 年 12 月 8 日）、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 30 日至 2017 年 2 月 6 日）、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 29 日至 2018 年 1 月 6 日）。现任广发基金管理有限公司副总经理、固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理、广发纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2012 年 12 月 14 日起任职）、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理（自 2013 年 7 月 12 日起任职）、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 25 日起任职）、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 3 月 1 日起任职）、广发集裕债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 5 月 11 日起任职）、广发集丰债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 1 日起任职）、广发集安债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 20 日起

					任职)、广发集源债券型证券投资基金基金经理(自 2017 年 1 月 20 日起任职)。
任爽	本基金的基金经理; 广发理财 7 天债券基金的基金经理; 广发天天红基金的基金经理; 广发天天利货币基金的基金经理; 广发钱袋子基金的基金经理; 广发活期宝货币基金的基金经理; 广发聚泰混合基金的基金经理; 广发稳鑫保本基金的基金经理; 广发鑫惠混合基金的基金经理; 广发鑫益混合基金的基金经理; 广发鑫利混合基金的基金经理; 广发安盈混合基金的基金经理	2012-12-12	-	10 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。现任广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2012 年 12 月 12 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)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自 2013 年 10 月 22 日起任职)、广发天天利货币市场基金基金经理(自 2014 年 1 月 27 日起任职)、广发钱袋子货币市场基金基金经理(自 2014 年 5 月 30 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)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 8 日起任职)、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 日起任职)、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 11 月 16 日起任职)、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 日起任职)、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 日起任职)、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 12 月 9 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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易（指数型基金除外）；对于不同投资组合的同时同向交易，公司可以启用公平交易模块，确保交易的公平。

公司金融工程与风险管理部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则；对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息，对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释；公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3 日内和 5 日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，发现异常情况再做进一步的调查和核实。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

#### 4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017 年中国 GDP 结束多年下滑趋势，温和反弹至 6.9%，其中净出口的边际贡献最为显著。央行货币政策总体保持稳健中性，强化金融监管，期间跟随美联储加息上调公开市场指导利率，但维持存贷款基准利率不变。

2017 年国内债券市场在基本面温和复苏、监管趋严以及海外加息的背景下大幅走熊，收益率曲线呈熊平走势，期限利差显著压缩，但信用利差仍然维持在历史相对低位。

组合债券投资方面，全年总体维持谨慎态度，以短久期票息策略为主，积极精选个券，提升组合静态收益率水平。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发纯债债券 A 类净值增长率为 1.79%,广发纯债债券 C 类净值增长率为 1.54%,同期业绩比较基准收益率为-4.26%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年，我们认为经济名义增速有望保持平稳，经济发展诉求由高速增长向高质量发展转变。政策方面，“有效控制宏观杠杆率”将成为监管政策的主旋律。国内债券市场经过 2016-2017 年的大幅调整，从资产比价的角度看，已具备一定的配置价值。策略上，我们认为今年债券投资机会值得期待，但短期内仍需进一步观察政策动向及基本面信号，保持组合仓位的灵活性以应对市场变化。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，2017 年 1 月 18 日广发纯债债券 A 类每 10 份基金份额分配 0.06 元；2017 年 7 月 18 日广发纯债债券 A 类每 10 份基金份额分配 0.06 元，2017 年 07 月 18 日广发纯债债券 C 类每 10 份基金份额分配 0.06 元；2017 年 10 月 20 日广发纯债债券 A 类每 10 份基金份额分配 0.09 元，2017 年 10 月 20 日广发纯债债券 C 类每 10 份基金份额分配 0.09 元。广发纯债 A 类本报告期末可供分配利润 14,266,932.24 元，广发纯债 C 类本报告期末可供分配利润 3,737,168.12 元，本基金已于 2018 年 1 月 16 日完成 2017 年 4 季度的利润分配，上述利润分配符合合同规定。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对广发纯债债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，广发纯债债券型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发纯债债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发纯债债券型证券投资基金 2017 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### §6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师 洪锐明 江丽雅签字出具了德师报(审)字(18)第 P01499 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发纯债债券型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	310,706.31	174,341,461.24
结算备付金	5,467,797.72	12,815,904.01
存出保证金	4,111.91	21,788.94
交易性金融资产	1,619,281,526.50	2,711,146,249.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,399,281,526.50	2,710,127,249.00
资产支持证券投资	220,000,000.00	1,019,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	79,677,439.51	378,281,567.42
应收证券清算款	3,000,000.00	-
应收利息	31,872,301.91	57,981,409.35
应收股利	-	-
应收申购款	904,838.75	5,595,643.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>1,740,518,722.61</b>	<b>3,340,184,023.86</b>
	本期末	上年度末
<b>负债和所有者权益</b>	<b>2017 年 12 月 31 日</b>	<b>2016 年 12 月 31 日</b>
负债：	-	-

短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	276,112,000.00	573,100,000.00
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	6,780,210.92	12,792,326.81
应付管理人报酬	899,292.96	1,966,775.04
应付托管费	256,940.85	561,935.72
应付销售服务费	118,231.58	394,007.97
应付交易费用	9,212.57	27,362.15
应交税费	-	-
应付利息	942,595.81	1,515,231.35
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	450,112.17	353,072.42
<b>负债合计</b>	<b>285,568,596.86</b>	<b>590,710,711.46</b>
<b>所有者权益：</b>	<b>-</b>	<b>-</b>
实收基金	1,237,410,065.66	2,340,957,571.81
未分配利润	217,540,060.09	408,515,740.59
<b>所有者权益合计</b>	<b>1,454,950,125.75</b>	<b>2,749,473,312.40</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>1,740,518,722.61</b>	<b>3,340,184,023.86</b>

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，广发纯债债券 A 基金份额净值人民币 1.176 元，基金份额总额 947,928,021.51 份；广发纯债债券 C 基金份额净值人民币 1.174 元，基金份额总额 289,482,044.15 份；总份额总额 1,237,410,065.66 份。

## 7.2 利润表

会计主体：广发纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------



	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>	<b>59,595,679.01</b>	<b>127,939,253.69</b>
1.利息收入	99,777,431.40	255,697,653.72
其中：存款利息收入	5,014,932.83	762,383.67
债券利息收入	81,463,915.20	250,577,354.31
资产支持证券利息收入	4,851,538.93	137,696.47
买入返售金融资产收入	8,447,044.44	4,220,219.27
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-34,575,897.90	47,413,649.17
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-34,770,926.66	47,413,649.17
资产支持证券投资收益	195,028.76	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-5,985,052.50	-180,032,335.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	379,198.01	4,860,286.49
<b>减：二、费用</b>	<b>35,282,661.06</b>	<b>89,596,329.03</b>
1. 管理人报酬	12,554,194.19	37,583,003.83
2. 托管费	3,586,912.66	10,738,001.14
3. 销售服务费	2,215,633.15	10,989,079.84
4. 交易费用	27,177.33	65,075.44
5. 利息支出	16,434,363.26	29,745,202.74
其中：卖出回购金融资产支出	16,434,363.26	29,745,202.74
6. 其他费用	464,380.47	475,966.04

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	24,313,017.95	38,342,924.66
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	24,313,017.95	38,342,924.66

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发纯债债券型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,340,957,571.81	408,515,740.59	2,749,473,312.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,313,017.95	24,313,017.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,103,547,506.15	-185,883,896.90	-1,289,431,403.05
其中：1.基金申购款	779,343,702.12	140,992,476.41	920,336,178.53
2.基金赎回款	-1,882,891,208.27	-326,876,373.31	-2,209,767,581.58
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-29,404,801.55	-29,404,801.55
五、期末所有者权益（基金净值）	1,237,410,065.66	217,540,060.09	1,454,950,125.75
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,472,911,715.54	1,190,502,874.28	6,663,414,589.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	38,342,924.66	38,342,924.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-3,131,954,143.73	-556,390,070.26	-3,688,344,213.99
其中：1.基金申购款	5,968,042,455.03	1,238,968,089.03	7,207,010,544.06
2.基金赎回款	-9,099,996,598.76	-1,795,358,159.29	-10,895,354,758.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-263,939,988.09	-263,939,988.09
五、期末所有者权益（基金净值）	2,340,957,571.81	408,515,740.59	2,749,473,312.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

广发纯债债券型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2012]1370 号文《关于同意广发纯债债券型证券投资基金设立的批复》的批准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关法规和《广发纯债债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于 2012 年 12 月 12 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为自 2012 年 11 月 12 日至 2012 年 12 月 7 日，本基金为契约型开放式基金，存

续期限不定，根据认购费用收取方式不同将基金份额分为不同类别。本基金募集资金总额为 2,814,482,244.90 元，有效认购户数为 17,386 户。其中广发纯债债券 A 类基金(“A 类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 371,304,723.27 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 58,634.00 元；广发纯债债券 C 类基金(“C 类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 2,443,177,521.63 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 475,322.48 元，认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。上述资金经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为本基金的投资范围为具有良好流动性的固定收益类金融工具，包括国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债券、集合债券、分离交易可转债的纯债部分、私募债券（包括但不限于定向债务融资工具、非公开发行公司债、中小企业私募债）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本基金不直接从二级市场买入股票、权证和可转债等，也不参与一级市场新股申购、新股增发和可转债申购。业绩比较基准为中债总全价指数收益率。

本基金的财务报表于 2018 年 3 月 23 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

#### **7.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### **7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖债券免征营业税或增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入、债券的利息收入及其他收入，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

#### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构
深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东

GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注：本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 7.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	342,129,809.45	100.00%	1,225,598,625.26	100.00%

###### 7.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	13,984,006,000.00	100.00%	45,046,440,000.00	100.00%

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	12,554,194.19	37,583,003.83
其中：支付销售机构的客户维护费	1,580,707.71	7,801,281.97

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.70% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,586,912.66	10,738,001.14

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发纯债债券 A 类	广发纯债债券 C 类	合计
中国工商银行股份有限公司	-	362,142.03	362,142.03
广发证券股份有限公司	-	24,217.83	24,217.83
广发基金管理有限公司	-	322,865.09	322,865.09
合计	-	709,224.95	709,224.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发纯债债券A类	广发纯债债券C类	合计
中国工商银行股份有限公司	-	1,254,905.47	1,254,905.47
广发证券股份有限公司	-	233,398.37	233,398.37
广发基金管理有限公司	-	1,899,229.15	1,899,229.15
合计	-	3,387,532.99	3,387,532.99

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日



等，支付日期顺延。

### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日						
银行间市场 交易的各关 联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行 股份有限公司	-	31,711,994. 26	-	-	2,131,300,000. 00	391,253.6 6

### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

##### 广发纯债债券 A 类

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 广发纯债债券 C 类

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有 限公司	310,706.31	109,459.42	4,341,461.24	356,291.41

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2017年1月1日至2017年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股 份有限公司， 中国工商银 行股份有限 公司	018005	国开 1701	一级市场 分销	100,000.00	10,000,000.00
中国工商银 行股份有限 公司，广发证 券股份有限 公司	1780144	17 铁道 13	一级市场 分销	1,300,000.00	129,870,000.00
上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股 份有限公司、 中国工商银 行股份有限 公司	150223	15 国开 23	一级市场 分销	1,000,000.00	100,000,000.00
广发证券股	160205	16 国开 05	一级市场	300,000.00	30,000,000.00

份有限公司、 中国工商银行 股份有限 公司			分销		
广发证券股 份有限公司、 中国工商银 行股份有限 公司	160205	16 国开 05	一级市场 分销	400,000.00	40,000,000.00
中国工商银 行股份有限 公司	160416	16 农发 16	一级市场 分销	1,000,000.00	100,000,000.00
广发证券股 份有限公司、 中国工商银 行股份有限 公司	160208	16 国开 08	一级市场 分销	500,000.00	50,000,000.00
广发证券股 份有限公司、 中国工商银 行股份有限 公司	160416	16 农发 16	一级市场 分销	300,000.00	30,000,000.00
广发证券股 份有限公司、 中国工商银 行股份有限 公司	160303	16 进出 03	一级市场 分销	200,000.00	20,000,000.00

#### 7.4.9 期末（2017 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 276,112,000.00 元，于 2017 年 1 月 2 日、1 月 3 日、1 月 5 日、1 月 16 日、1 月 26 日、1 月 31 日、2 月 1 日、2 月 9 日、2 月 14 日、2 月 22 日、2 月 28 日、3 月 1 日、3 月 7 日、3 月 8 日、3 月 9 日、3 月 15 日、3 月 29 日、5 月 8 日、5 月 22 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### 1、公允价值

##### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

##### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### (i) 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见附注 7.4.4.5。

###### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 1,399,281,526.50 元，属于第三层级的余额为 220,000,000.00 元，无属于第一层级的金额（2016 年 12 月 31 日：属于第二层级的余额为 2,711,146,249.00 元，无属于第一层级和第三层级的金额）。

###### (iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

于 2017 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层级的余额为人民币 220,000,000.00 元；本报告期内新增购入属于第三层级的金额为人民币 270,000,000.00 元，处置属于第三层级的金额为人民币 50,000,000.00 元，除上述变动外，该层级金融资产无其他变动；本基金本期末持有的该层级金融工具为交易所挂牌转让的资产支持证券，金额为人民币 220,000,000.00 元，估值技术为现金流量折现法，重大不可观察输入值为折现率，与公允价值负相关。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,619,281,526.50	93.03
	其中：债券	1,399,281,526.50	80.39
	资产支持证券	220,000,000.00	12.64
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	79,677,439.51	4.58
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,778,504.03	0.33
8	其他各项资产	35,781,252.57	2.06
9	合计	1,740,518,722.61	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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。

#### 8.2.2 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。

### 8.3 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。

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	134,830,000.00	9.27
	其中：政策性金融债	134,830,000.00	9.27
4	企业债券	663,180,026.50	45.58
5	企业短期融资券	434,732,500.00	29.88
6	中期票据	166,539,000.00	11.45
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,399,281,526.50	96.17

#### 8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	124234	13 鹏铁 01	1,000,000	79,630,000.00	5.47
2	124805	14 穗铁 02	700,000	64,092,000.00	4.41
3	170408	17 农发 08	600,000	59,820,000.00	4.11

4	124970	14 杭地铁	650,000	59,416,500.00	4.08
5	143307	17 福投 02	600,000	59,280,000.00	4.07

### 8.7 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

金额单位：人民币元

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	119423	17 勒泰 A1	500,000	50,000,000.00	3.44
1	146156	花呗 28A1	500,000	50,000,000.00	3.44
1	119424	17 勒泰 A2	500,000	50,000,000.00	3.44
2	116592	万科 7A1	300,000	30,000,000.00	2.06
2	146674	花呗 45A1	300,000	30,000,000.00	2.06
3	146377	17 远东 2B	100,000	10,000,000.00	0.69

### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

**8.12.1** 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**8.12.2** 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,111.91
2	应收证券清算款	3,000,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	31,872,301.91
5	应收申购款	904,838.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,781,252.57

**8.12.4 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。

**8.12.5 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。

**§9 基金份额持有人信息**

**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例



广发纯债债券 A 类	61,765	15,347.33	596,213,235.64	62.90%	351,714,785.87	37.10%
广发纯债债券 C 类	45,375	6,379.77	13,502,405.29	4.66%	275,979,638.86	95.34%
合计	107,140	11,549.47	609,715,640.93	49.27%	627,694,424.73	50.73%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	广发纯债债券 A 类	741,164.48	0.0782%
	广发纯债债券 C 类	4,282.58	0.0015%
	合计	745,447.06	0.0602%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	广发纯债债券 A 类	50~100
	广发纯债债券 C 类	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发纯债债券 A 类	50~100
	广发纯债债券 C 类	0
	合计	50~100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发纯债债券 A 类	广发纯债债券 C 类
基金合同生效日（2012 年 12 月 12 日）基金份额总额	371,363,357.27	2,443,652,844.11
本报告期期初基金份额总额	1,566,390,054.39	774,567,517.42
本报告期基金总申购份额	578,231,273.60	201,112,428.52
减：本报告期基金总赎回份额	1,196,693,306.48	686,197,901.79
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	947,928,021.51	289,482,044.15

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市人民法院一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

除上述事项外，本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	8	-	-	-	-	新增 2 个
中天证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

中原证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
上海华信证券	1	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	6	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	4	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	新增 1 个
方正证券	7	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	减少 1 个
信达证券	3	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	5	-	-	-	-	新增 1 个
中投证券	1	-	-	-	-	减少 2 个
民生证券	3	-	-	-	-	-
西藏东方财富 证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
川财证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	3	-	-	-	-	减少 1 个
中银国际	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-

北京高华	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
广发证券	342,129,809. 45	100.00%	13,984,00 6,000.00	100.00%	-	-

广发基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日