

# 广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金

## 2019 年第 1 季度报告

2019 年 3 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：杭州银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年四月二十二日

## § 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。

基金托管人杭州银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 4 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 2019 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |  |
|------------|--|
| 基金简称       | 广发汇立定期开放债券   |
| 基金主代码      | 006137   |
| 交易代码       | 006137   |
| 基金运作方式     | 契约型、定期开放式  |
| 基金合同生效日    | 2018 年 12 月 13 日   |
| 报告期末基金份额总额 | 2,009,999,000.00 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，追求基金资产的长期稳健增值。                             |
| 投资策略       | 封闭期内，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。 |

|        |   |
|--------|---|
|        | 开放期内，为了保证组合具有较高的流动性，本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下，投资于具有较高流动性的投资品种，通过合理配置组合期限结构等方式，积极防范流动性风险，在满足组合流动性需求的同时，尽量减小基金净值的波动。 |
| 业绩比较基准 | 中债综合财富（总值）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  | 杭州银行股份有限公司  |

### § 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 1 月 1 日-2019 年 3 月 31 日) |
| 1.本期已实现收益      | 27,408,431.21                    |
| 2.本期利润         | 27,097,957.02                    |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0135                           |
| 4.期末基金资产净值     | 2,045,841,570.95                 |
| 5.期末基金份额净值     | 1.0178                           |

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。

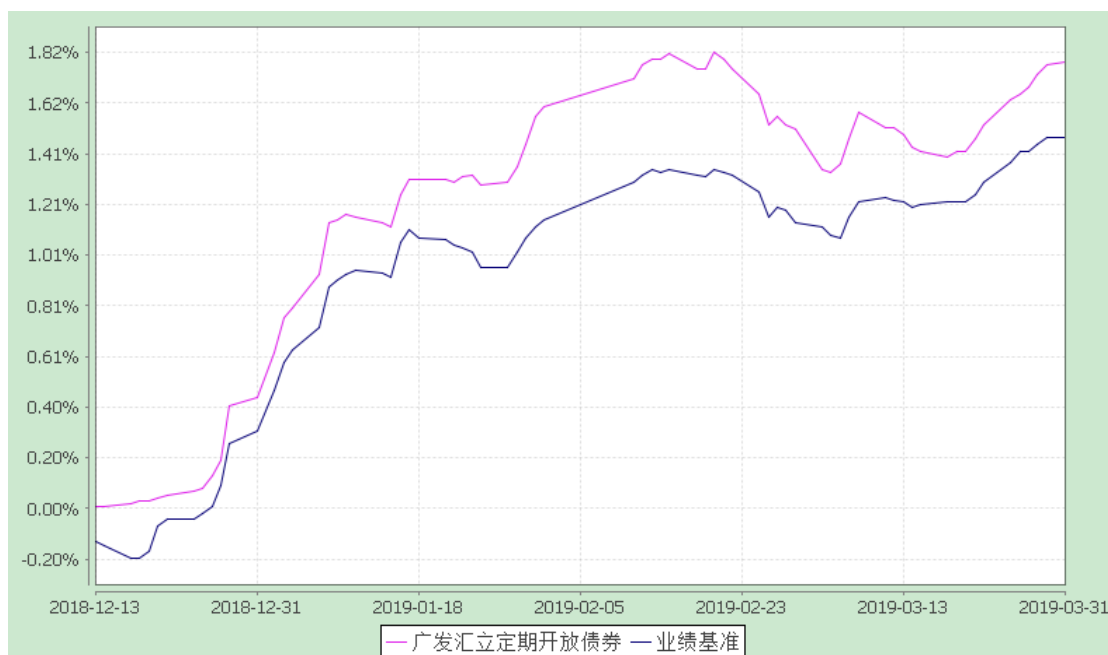
### 3.2 基金净值表现

#### 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 | 1.33%  | 0.07%     | 1.16%      | 0.05%         | 0.17% | 0.02% |

#### 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

广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金  
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2018 年 12 月 13 日至 2019 年 3 月 31 日)



注：(1) 本基金合同生效日期为 2018 年 12 月 13 日，至披露时点本基金成立未滿一年。

(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<br>理期限 |          | 证券从业<br>年限 | 说明  |
|----|---|-----------------|----------|------------|---|
|    |   | 任职日<br>期        | 离任日<br>期 |            |   |
| 谢军 | 本基金的基金经理；广发增强债券型证券投资基金的基金经理；广发聚源债券型证券投资基金(LOF)的基金经理；广发安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发集瑞债券型证券投资基金的基金经理；广发景华纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发汇瑞 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发景源纯债债券型证券投资 | 2018-12-13      | -        | 16 年       | 谢军先生，金融学硕士，CFA，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、投资经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理、固定收益部总经理、广发货币市场基金基金经理（自 2006 年 9 月 12 日至 2010 年 4 月 29 日）、广发聚祥保本混合型证券投资基金基金经理（自 2011 年 3 月 15 日至 2014 年 3 月 20 日）、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 10 日至 2018 年 1 月 6 日）、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 12 月 2 日至 2018 年 6 月 12 日）、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日）、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2017 年 1 月 10 日至 2018 年 10 月 30 日）、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基 |

|  |   |  |  |  |   |
|--|---|--|--|--|---|
|  | <p>基金的基金经理；广发景祥纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发理财年年红债券型证券投资基金的基金经理；广发聚安混合型证券投资基金的基金经理；广发聚宝混合型证券投资基金的基金经理；广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发集富纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发汇兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发景智纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发景润纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发集裕债券型证券投</p> |  |  |  | <p>金经理（自 2016 年 11 月 18 日至 2018 年 11 月 9 日）、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理（自 2017 年 10 月 31 日至 2019 年 2 月 14 日）。</p> |
|--|---|--|--|--|---|

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  | 资基金的基金<br>经理；广发鑫<br>裕灵活配置混<br>合型证券投资<br>基金的基金经<br>理；广发汇承<br>定期开放债券<br>型发起式证券<br>投资基金的基<br>金经理；债券<br>投资部总经理 |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|

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、《广发汇立定期开放债券型发起式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，投资的债券必须来自公司债券库。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

节后旺季需求到了验证阶段。草根调研需求比此前一致的稳定。大体上，当前宏观数据好坏不一，开始分化。需求有初步稳定迹象。

一季度，债券利率延续了去年四季度的下行趋势，利差继续收窄。3月初，利率开始震荡，利差开始反弹。特别是10年期金融债触及3.5%的阻力后，向下的动能衰竭。市场整体进入了震荡区间。同时，权益市场走出了大级别的反转行情。

组合操作方面，债券资产总体保持中短久期，积极挖掘具有较好骑乘效果的票息品种，高度警惕信用风险，适当套息操作。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发汇立定期开放债券净值增长率为 1.33%，同期业绩比较基准收益率为 1.16%。

### § 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 | 2,016,723,300.00 | 98.54        |



|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：债券             | 2,016,723,300.00 | 98.54  |
|   | 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      | 6,341,260.40     | 0.31   |
| 7 | 其他各项资产            | 23,587,035.54    | 1.15   |
| 8 | 合计                | 2,046,651,595.94 | 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

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      | 1,816,943,300.00 | 88.81        |
|    | 其中：政策性金融债 | 858,360,800.00   | 41.96        |
| 4  | 企业债券      | 99,640,000.00    | 4.87         |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | 100,140,000.00   | 4.89         |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |

|    |      |                  |       |
|----|------|------------------|-------|
| 8  | 同业存单 | -                | -     |
| 9  | 其他   | -                | -     |
| 10 | 合计   | 2,016,723,300.00 | 98.58 |

**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  | 180204  | 18 国开 04     | 3,800,000 | 398,050,000.00 | 19.46        |
| 2  | 180211  | 18 国开 11     | 2,000,000 | 202,820,000.00 | 9.91         |
| 3  | 170212  | 17 国开 12     | 1,600,000 | 165,936,000.00 | 8.11         |
| 4  | 1828016 | 18 民生银行 01   | 1,550,000 | 156,751,500.00 | 7.66         |
| 5  | 1828014 | 18 兴业绿色金融 01 | 1,500,000 | 152,340,000.00 | 7.45         |

**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**

5.11.117 中信银行债（代码：1728006）为本基金的前十大持仓证券之一。2018

年 12 月 7 日, 中国银行保险监督管理委员会针对中信银行如下事由罚款 2280 万元人民币:(一)理财资金违规缴纳土地款;(二)自有资金融资违规缴纳土地款;(三)为非保本理财产品提供保本承诺;(四)本行信贷资金为理财产品提供融资;(五)收益权转让业务违规提供信用担保;(六)项目投资审核严重缺位。

18 民生银行 01 (代码: 1828016) 为本基金的前十大持仓证券之一。2018 年 11 月 9 日, 中国银行保险监督管理委员会针对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则给予罚款共计人民币 200 万元的行政处罚。2018 年 12 月 7 日, 中国银行保险监督管理委员会针对民生银行如下事由罚款共计人民币 3160 万元:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)同业投资违规接受担保;(三)同业投资,理财资金违规投资房地产,用于缴交或置换土地出让金及土地储备融资;(四)本行理财产品之间风险隔离不到位;(五)个人理财资金违规投资;(六)票据代理未明示,增信未簿记和计提资本占用;(七)为非保本理财产品提供保本承诺。2018 年 12 月 8 日, 中国银行保险监督管理委员会针对民生银行贷款业务严重违反审慎经营规则给予罚款共计人民币 200 万元的行政处罚。

18 宁波银行绿色金融债(代码: 1820059) 为本基金的前十大持仓证券之一。2018 年 6 月 22 日, 因宁波银行股份有限公司存在以不正当手段违规吸收存款的行为, 被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局处罚款人民币 60 万元。2019 年 1 月 11 日, 因宁波银行股份有限公司存在将个人贷款资金违规流入房市、购买理财的行为, 被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局处罚款人民币 20 万元。2019 年 3 月 22 日, 因宁波银行股份有限公司存在违规将同业存款变为一般性存款的行为, 被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局处罚款人民币 20 万元。

18 平安银行 01(代码: 1828019) 为本基金的前十大持仓证券之一。2018 年 7 月 10 日, 因平安银行股份有限公司存在贷前调查不到位, 向环保未达标的企业提供融资; 贷后管理失职, 流动资金贷款被挪用的行为, 被中国银行保险监督管理委员会天津监管局处罚款人民币 50 万元。2018 年 8 月 1 日, 因平安银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告, 被中国人民银行处罚款人民币 140 万元。

18 兴业绿色金融 01 (代码: 1828014) 为本基金的前十大持仓证券之一。2018

年 5 月 4 日，中国银行保险监督管理委员会针对兴业银行如下事由罚款 5870 万元人民币：(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；(二)非真实转让信贷资产；(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务；(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；(六)债券卖出回购业务违规出表；(七)个人理财资金违规投资；(八)提供日期倒签的材料；(九)部分非现场监管统计数据与事实不符；(十)个别董事未经任职资格核准即履职；(十一)变相批量转让个人贷款；(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

除上述证券外,本基金投资的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。

**5.11.2** 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。

**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    | 23,587,035.54 |
| 5  | 应收申购款   | -             |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 23,587,035.54 |

**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  | 2,009,999,000.00 |
| 本报告期基金总申购份额   | -                |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | -                |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 2,009,999,000.00 |

## § 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

单位：份

|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00 |
| 本报告期买入/申购总份额             | -             |
| 本报告期卖出/赎回总份额             | -             |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 10,000,000.00 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.50          |

### 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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目          | 持有份<br>额总数    | 持有份<br>额占基<br>金总<br>份额比<br>例 | 发起份<br>额总<br>数 | 发起份<br>额占<br>基金总<br>份额<br>比例 | 发起份<br>额承<br>诺持<br>有期<br>限 |
|-------------|---------------|------------------------------|----------------|------------------------------|----------------------------|
| 基金管理人固有资金   | 10,000,000.00 | 0.50%                        | 10,000,000.00  | 0.50%                        | 三年                         |
| 基金管理人高级管理人员 | -             | -                            | -              | -                            | -                          |
| 基金经理等人员     | -             | -                            | -              | -                            | -                          |

|         |               |       |               |       |    |
|---------|---------------|-------|---------------|-------|----|
| 基金管理人股东 | -             | -     | -             | -     | -  |
| 其他      | -             | -     | -             | -     | -  |
| 合计      | 10,000,000.00 | 0.50% | 10,000,000.00 | 0.50% | 三年 |

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 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              | 20190101-20190331       | 1,999,999,000.00 | 0.00 | 0.00 | 1,999,999,000.00 | 99.50% |
| 产品特有风险  |                |                         |                  |      |      |                  |        |
| <p>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。</p> |                |                         |                  |      |      |                  |        |

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1.中国证监会注册广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件
- 2.《广发汇立定期开放债券型发起式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.《广发汇立定期开放债券型发起式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

### 10.2 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

### 10.3 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>。

广发基金管理有限公司  
二〇一九年四月二十二日