# 广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金 2017 年第 1 季度报告

2017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: 上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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	广发汇瑞一年定开债券
基金主代码	003746
交易代码	003746
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2016年11月28日
报告期末基金份额总额	500,011,147.85 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	1、封闭期投资策略 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。
	2、开放期投资策略
	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。
小小车以方寸水	中债综合指数(总财富)收益率×90%+银行1年期
业绩比较基准 	定期存款利率(税后)×10%。
	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益
可吸收关键红	率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基
风险收益特征 	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	上海浦东发展银行股份有限公司

# §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
土女州分14州	(2017年1月1日-2017年3月31日)
1.本期已实现收益	4,585,744.39
2.本期利润	1,778,630.18
3.加权平均基金份额本期利润	0.0036
4.期末基金资产净值	500,435,096.40
5.期末基金份额净值	1.0008

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	0.35%	0.04%	-0.27%	0.06%	0.62%	-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

广发汇瑞一年定期开放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

44 F	TH 67	任本基金的基金经理期限		证券从业	\7 uu
姓名	职务	任职日期	离任日期	年限	说明
代字	本金基经广聚债基的金理发财用券金基经广集一定开债基的金理发长选基的金理发利券金基经广聚信债基的金理发利年期放券金基经广成优混	2016-11-28		12年	女士基年后公及研户月资日金3信理公2011年金月十年,并业至2011年6月,广固易员资入员门。 2011年6月,一国易员资入员,广金日差上,广固易员资入员任金日差生,广大型、大型、大型、大型、大型、大型、大型、大型、大型、大型、大型、大型、大型、大

\ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \ \		到床坐井入的井入屋
合基		利债券基金的基金经
金的		理,2016年4月26日起
基金		任固定收益部副总经
经理;		理,2016年7月26日起
广发		任广发安瑞回报混合基
聚惠		金的基金经理,2016年
混合		8月19日起任广发安祥
基金		回报混合基金的基金经
的基		理,2016年11月9日起
金经		任广发集丰债券基金的
理;广		基金经理, 2016 年 11
发安		月28日起任广发汇瑞一
泰回		年定开债券基金的基金
报混		经理, 2016年12月13
合基		日起任广发新常态混合
金的		基金的基金经理,2017
基金		年1月6日起任广发汇
经理;		平一年定期债券基金的
广发		基金经理,2017年2月
安心		8 日起任广发安泽回报
回报		纯债债券基金的基金经
温 温合		理,2017年2月13日起
基金		任广发汇富一年定期债
的基		券基金的基金经理,
金经		2017年3月31日起任广
理;广		发汇安18个月定期债券
发双		基金的基金经理。
		天 <b>亚</b> 川天亚江云。
利债		
一		
金的		
<u> </u>		
· 经理;		
广发		
安瑞		
回报		
混合		
基金		
的基		
金经		
理;广		
发安		
祥回		
报混 报混		

合基		
金的		
基金		
经理;		
广发		
集丰		
债券		
基金		
的基		
金经		
理;广		
发新		
常态		
混合		
基金		
的基		
金经		
理;广		
发汇		
平一		
年定		
期债		
券基		
金的		
基金		
经理;		
广发		
安泽		
回报		
纯债		
债券		
基金		
的基		
金经		
理;广		
发汇		
富一		
年定		
期债		
券基		
金的		
基金		
经理;		
广发		

بدر حیر				
汇安				
18 个				
月定				
期债				
券基				
金的				
基金				
经理;				
固定				
收益				
部副				
总经				
理				
本基				男,中国籍,金融学硕
金的				士, 持有中国证券投资
基金				基金业从业证书和特许
经理;				金融分析师状 (CFA),
广发				2003年7月至2006年9
增强				月先后任广发基金管理
债券				有限公司研究发展部产
基金				品设计人员、企业年金
的基				和债券研究员,2006年
金经				9月12日至2010年4
理;广				月28日任广发货币基金
发聚				的基金经理, 2008 年 3
源定				月27日起任广发增强债
期债				券基金的基金经理,
券基				2008年4月17日至2012
谢军 金的	2016-12-02	-	14 年	年2月14日先后任广发
基金				基金管理有限公司固定
经理;				收益部总经理助理、副
广发				总经理、总经理,2011
安享				年3月15日至2014年3
混合				月20日任广发聚祥保本
基金				混合基金的基金经理,
的基				2012年2月15日起任广
金经				发基金管理有限公司固
理;广				定收益部副总经理,
发安				2013年5月8日起任广
悦回				发聚源定期债券基金的
报混				基金经理, 2016年2月
合基				22 日起任广发安享混合
金的				基金的基金经理,2016
基金				年11月7日起任广发安
坐並				11月月日尼日月及女

经理: 广发 照务 业精 选混合基金的基金 经理: 2016 年 11 月 9 日起任广发服务 业精 选混 合 4	 		
服务业精 造混 合基金的基金经理,2016年1月 18 日起任广发发现混合基金的基金 11 月 18 日起任产发发现混合基金的基金 2016年11 月 28 日起任产发 28 是华理,2016年11 月 28 日本任产发 28 是华理,2016年11 月 28 日本任产发 28 是华理,2016年12 月 2 日开 10 日起任产发 28 建二十二 2017年1 月 10 日起中产发 26 建二十二 2017年1 月 10 日本 10 日	经理;		悦回报混合基金的基金
业精 选混 2016年 11 月 18 日起任广发鑫额混合 基金的基金企 2016年 11 月 18 日起任广发混合基金的基金 经理, 2016年 11 月 28 日起任广发混合基金的基金的基金的基金的基金 2017年 2016年 11 月 28 日起任广发 鑫灏 理,2016年 12 月 19 日 10 日	广发		经理; 2016 年 11 月 9
业精 选混 2016年 11 月 18 日起任广发鑫额混合 基金的基金企 2016年 11 月 18 日起任广发混合基金的基金 经理, 2016年 11 月 28 日起任广发混合基金的基金的基金的基金的基金 2017年 2016年 11 月 28 日起任广发 鑫灏 理,2016年 12 月 19 日 10 日	服务		日起任广发服务业精选
选混 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 景华纯债基全的基金经理, 2016 年 11 月 28 日起任广发 景华纯债基全的基金经理, 2016 年 12 月 2 日 任厂发汇瑞一年定开明, 2017 年 1 月 10 日起任广发安福, 10 日起任广发安福, 2017 年 2 月 17 日基金的基金经理, 2017 年 3 月 2 日 起任广发景源纯债和企会。 2017 年 3 月 2 日 起任广发景源线债基金的基金经理, 2017 年 3 月 2 日 起任广发景泽纯债基金的基金经理, 广发景华纯债基金的基金经理, 广发景华纯债基金的基金经理, 广发景华纯债基金的基金经理, 广发泽四报 统债基金的基金经理; 广发泽四报 统债基金的基金经理; 广发泽四报 统债基金的基金经理; 广发泽四报 统债基金的基金经理; 广发泽四报 统债基金的基金经理; 广发泽四报 统债基金的基金经理; 广发泽四报 统债基金			
合基金的基金金经理; 广发鑫洞洞语 日本任广发集 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 36年 11月28日起任广发 36年 11月28日起任广发 36年 11月28日起任广发 36年 11月28日应任广发 36年 11月28日应任广发 36年 12月26日 1			
金的基金 经理; 广发鑫源混合 基金的基金经理,2016年12月2日月2日年1月10日起任广发鑫源混合基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基			•
基金 经理: 广发 鑫源 混合 基金 的基 金经 理: 产力 发集 瑞债 券基 金的 基金 的基金 经理: 广发 鑫和 混合 基金 的基金 经理: 广发 鑫和 混合 基金 的基金 经理: 广发 秦和 混合 基金 的基金 经理: 广发 秦和 混合 基金 的基金 经理: 广发 秦和 混合 基金 的基金 经理: 广发 秦和 混合 基金 的基金 经理: 广发 秦和 混合 基金 的基金 经理: 广发 秦和 混合 基金 的基金 经理: 广发 秦和 混合 基金 的基金 经理: 广发 秦神 衛基 金 经 理: 大学 一发 是 一、 一、 一、 一、 一、 一、 一、 一、 一、 一、			
经理; 广发 鑫源 混合 基金的基金经理, 2016年12月2日起任广发 景华纯债基金的基金经理, 广发集 强商基金经理, 广发 鑫和 混合 基金的 基金经理; 广发 鑫和 混合 基金的 基金经理; 广发 鑫和 混合 基金的 基金 经理; 广发 秦华 传递 金的 基金 经理; 广发 发 华纯 债基金的 基金 的 基金 经理; 广发 发 华纯 债基金			
广发 鑫源 混合 基金 的基金 全经理: 广发集 请债 券基 金经理: 广发 鑫和 混合 基本 金经理: 广发 鑫和 混合 基本 金经理: 广发 秦和 混合 基本 金经型: 广发 秦和 混合 基本 金经型: 广发 秦和 是任广发是祥纯债 传基 金。 的 基全经理: 广发 秦和 是任 发子 是一 发是理。 一 发 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是 是			
鑫源 混合 基金 的基 金经 理;广 发集 瑞债 券基 金的 基金 经理;广 发秦 利混合 基金 的基 金经 理;广 发秦 和混合 基金 的基 金经 理;广 发秦 和混合 基金 的基 金经 理;广 发秦 和混合 基金 的基 金经 理;广 发帝 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和 和			
混合 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安泽回报纯债和广发安泽回报纯债和广发安泽回报纯债和广发赛富混合基金的基金经理,2017年3月2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;广发 鑫和混合基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基金的基			
基金的基金经理, 企经理;广发集			
的基金经理;广发集			
金经理;广发集瑞债 发生	基金		券基金的基金经理,
理;广发集 瑞债 券基 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日起任广发景源纯债基金经理,2017年3月2日起任广发景祥纯债基金的基金经理;广发 鑫和 混金金的基金经理;广发发 5年 发 1	的基		2017年1月10日起任广
发集 瑞债	金经		发安泽回报纯债和广发
发集 瑞债	理;广		鑫富混合基金的基金经
券基金的基金经理: 广发鑫利混合基金的基金经理: 广发景华纯债基金的基金经理: 广发资源回报 纯债基金的基金经理: 广发交流。	发集		理,2017年2月17日起
券基金的基金经理: 广发鑫利混合基金的基金经理: 广发景华纯债基金的基金经理: 广发资源回报 纯债基金的基金经理: 广发交流。	瑞债		任广发景源纯债的基金
金的基金 经理: 广发 鑫利 混合基金 的基金 理: 广发景 华纯 债基 金的 基金 经理; 广发 安泽 回报 纯债 基金 的基金 经理; 广发 安泽 回报 纯债			
基金经理; 广发鑫 高合基基 经理; 广发操性 债基 金鱼 经产 定泽 回报 使 基金 的 基 经 严; 广发 军 四报 绝 金 的 基 经 严; 广			
经理:       广发         鑫和合基基       整基         金里:       广发华纯         债金基       经理:         广发泽       回域         基基       的金         理:       广         安国报       位         金       理:			
广发 鑫和 混基金 的基 金经 理; 广 发 等回 校 基 全 经 户 安 回 校 传 基 金 经 是 受 了 安 回 校 传 基 金 的 基 会 的 的 基 。 的 是 。 的 是 。 的 是 。 的 是 。 的 是 。 的 是 。 的 是 。 是 。			117天77717天0
鑫利 混合 基基 的 金子 理; 广 发 华 传 基 金 经 理; 广 安 回 纯 债 基 金 经 理; 广 安 回 纯 债 基 金 经 理; 广	-		
混基的金里; 广爱 华债金基 经 广安 回			
基金的金星; 广发华基的金星; 广安阳横金基路经理; 广安阳横金基路经理; 广安阳横金基路经理; 广	/ /		
的基金 理; 广 发 华			
金经 理;广 发 华债基 金的 基理; 广安泽 回报 纯债 基金 的金基 空程; 广安泽			
理; 广 发导 华纯 债基 金 经理; 广安 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区 区			
发景 华纯 债基 金的 基金 经理; 广发 安阳 纯债 基金 的基 金经 理; 广			
华纯 债基 金的 基理; 广安 程 回报 纯债 基金 的基 金的 金经 理;广			
债基 金的 基金 经理; 广发 安泽 回报 纯债 基金 的基 金经 理; 广			
金的 基金 经理; 广发 安泽 回报 纯债 基金 的基 金经 理; 广	华纯		
基金 经理; 广发 安泽 回报 纯债 基金 的基 金经 理; 广	债基		
经理; 广发 安泽 回报 纯债 基金 的基 金经 理; 广	金的		
广发 安泽 回报 纯债 基金 的基 金经 理; 广	基金		
广发 安泽 回报 纯债 基金 的基 金经 理; 广	经理;		
安泽 回报 纯债 基金 的基 金经 理; 广			
回报 纯债 基金 的基 金经 理; 广			
纯债       基金       的基       金经       理; 广			
基金 的基 金经 理; 广			
的基 金经 理; 广			
金经 理; 广			
理;广			
	及葢		

			,
富混			
合基			
金的			
基金			
经理;			
广发			
景源			
纯债			
的基			
金经			
理;广			
发景			
债基			
金的			
基金			
经理;			
固定			
收益			
部副			
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、《广发汇瑞一年定期开放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。

组合一季度保持了适度杠杆进行套息操作,主要品种以优质信用债为主。

#### 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0.35%,同期业绩比较基准收益率为-0.27%

### 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。

# § 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	-	1
	其中: 股票	-	-
2	固定收益投资	479,303,000.00	95.72
	其中:债券	479,303,000.00	95.72
	资产支持证券	1	1
3	贵金属投资	1	1
4	金融衍生品投资	1	1
5	买入返售金融资产	5,000,000.00	1.00
	其中: 买断式回购的买入返售 金融资产	L	-
6	银行存款和结算备付金合计	6,002,707.71	1.20
7	其他各项资产	10,410,500.63	2.08
8	合计	500,716,208.34	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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,016,000.00	4.00
	其中: 政策性金融债	20,016,000.00	4.00
4	企业债券	370,172,000.00	73.97
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	40,220,000.00	8.04
7	可转债 (可交换债)	-	-
8	同业存单	48,895,000.00	9.77
9	其他	-	-
10	合计	479,303,000.00	95.78

# 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	粉皂(砂)	八分份估(三)	占基金资产
775			数量(张)	公允价值(元)	净值比例(%)
1	111615385	16 民生	500,000	48,895,000.00	9.77
		CD385	300,000	48,893,000.00	
2	122288	13 东吴债	450,000	46,368,000.00	9.27
3	122315	14 东海债	450,000	45,576,000.00	9.11
4	122231	12 上电债	450,000	45,139,500.00	9.02
5	1280102	12 中石油 07	400,000	41,172,000.00	8.23

# 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 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,或在报告编制目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	29,184.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,381,316.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,410,500.63

### 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	500,011,147.85		
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	500,011,147.85		

# § 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。

# 88 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

	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
投资 者类 别	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
	1	20170101-2017 0331	500,0 09,00 0.00	0.00	0.00	500,009,000	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汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金募集的文 件
  - (二)《广发汇瑞一年定期开放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)《广发汇瑞一年定期开放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