

广发安泽短债债券型证券投资基金
(广发安泽回报纯债债券型证券投资基金)

2018年第4季度报告

2018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：平安银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年一月十九日

§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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月17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。

本基金系原广发安泽回报纯债债券型证券投资基金转型而来。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》、《广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金合同》和《广发安泽回报纯债债券型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人于2018年9月29日起至2018年10月29日15:00止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议通过了将“广发安泽回报纯债债券型证券投资基金”变更为“广发安泽短债债券型证券投资基金”的议案，同时调整因前述变更而需要修改的部分基金合同条款。自2018年10月30日起，《广发安泽短债债券型证券投资基金基金合同》生效，《广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金合同》自该日起失效。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原广发安泽回报纯债债券型证券投资基金报告期自2018年10月1日起至2018年10月29日止，广发安泽短债债券型证券投资基金报告期自2018年10月30日至2018年12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 广发安泽短债债券型证券投资基金

基金简称	广发安泽短债
基金主代码	002864

基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 10 月 30 日	
报告期末基金份额总额	10,987,921,135.68 份	
投资目标	本基金主要投资于短期债券，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稳健回报，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-新综合全价（1 年以下）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	平安银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	广发安泽短债 A	广发安泽短债 C
下属两级基金的交易代码	002864	002865
报告期末下属两级基金的份额总额	3,892,880,575.24 份	7,095,040,560.44 份

2.2 广发安泽回报纯债债券型证券投资基金

基金简称	广发安泽回报纯债
基金主代码	002864
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 18 日

报告期末基金份额总额	2,843,997,753.76 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	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。	
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的中等风险收益品种。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	广发安泽回报纯债 A	广发安泽回报纯债 C
下属两级基金的交易代码	002864	002865
报告期末下属两级基金的份额总额	-份	-份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

3.1.1 广发安泽短债债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018年10月30日(基金合同生效日)-2018年 12月31日)	
	广发安泽短债 A	广发安泽短债 C
1.本期已实现收益	15,879,637.74	25,766,887.32
2.本期利润	22,438,868.55	34,282,634.02
3.加权平均基金份额 本期利润	0.0084	0.0079
4.期末基金资产净值	4,106,930,400.54	7,486,125,610.89
5.期末基金份额净值	1.0550	1.0551

注：（1）本基金转型日为2018年10月30日，至披露时点不满一季度。

（2）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。

（3）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。

3.1.2 广发安泽回报纯债债券型证券投资基金

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2018年10月1日-2018年10月29日)	
	广发安泽回报纯债 A	广发安泽回报纯债 C
1.本期已实现收益	7,463,728.07	2,731,089.25
2.本期利润	8,389,196.88	2,861,444.91

3.加权平均基金份额 本期利润	0.0046	0.0039
4.期末基金资产净值	1,838,724,642.59	1,137,024,542.80
5.期末基金份额净值	1.0462	1.0465

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 广发安泽短债债券型证券投资基金

（报告期：2018年10月30日-2018年12月31日）

3.2.1.1 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

1. 广发安泽短债 A:

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	0.84%	0.02%	0.51%	0.01%	0.33%	0.01%

2. 广发安泽短债 C:

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	0.82%	0.02%	0.51%	0.01%	0.31%	0.01%

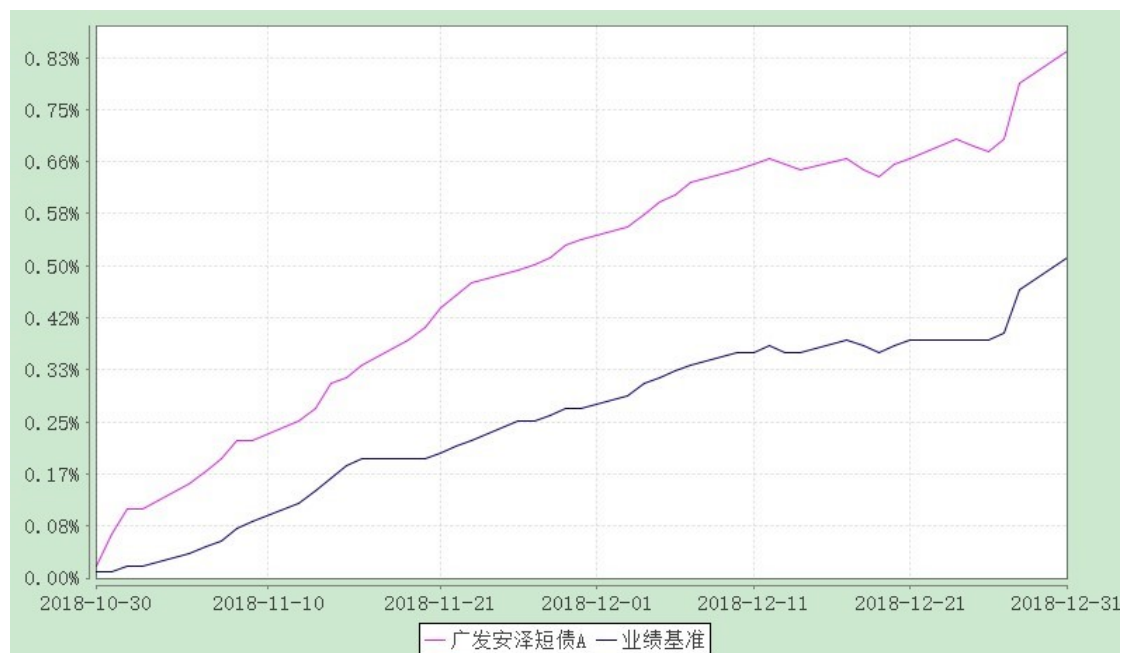
3.2.1.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发安泽短债债券型证券投资基金

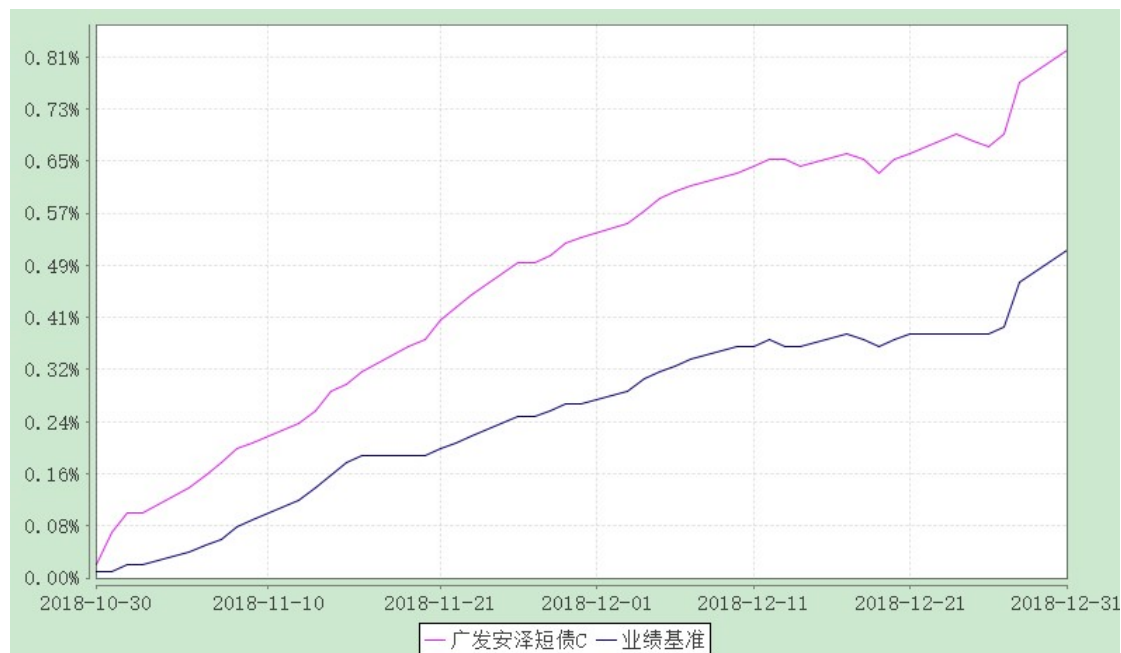
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018年10月30日至2018年12月31日)

1、广发安泽短债 A



2、广发安泽短债 C



注：（1）本基金转型日期为2018年10月30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。

3.2.2 广发安泽回报纯债债券型证券投资基金

(报告期: 2018年10月1日-2018年10月29日)

3.2.2.1 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

1. 广发安泽回报纯债 A:

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	0.39%	0.03%	0.76%	0.03%	-0.37%	0.00%

2. 广发安泽回报纯债 C:

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	0.38%	0.02%	0.76%	0.03%	-0.38%	-0.01%

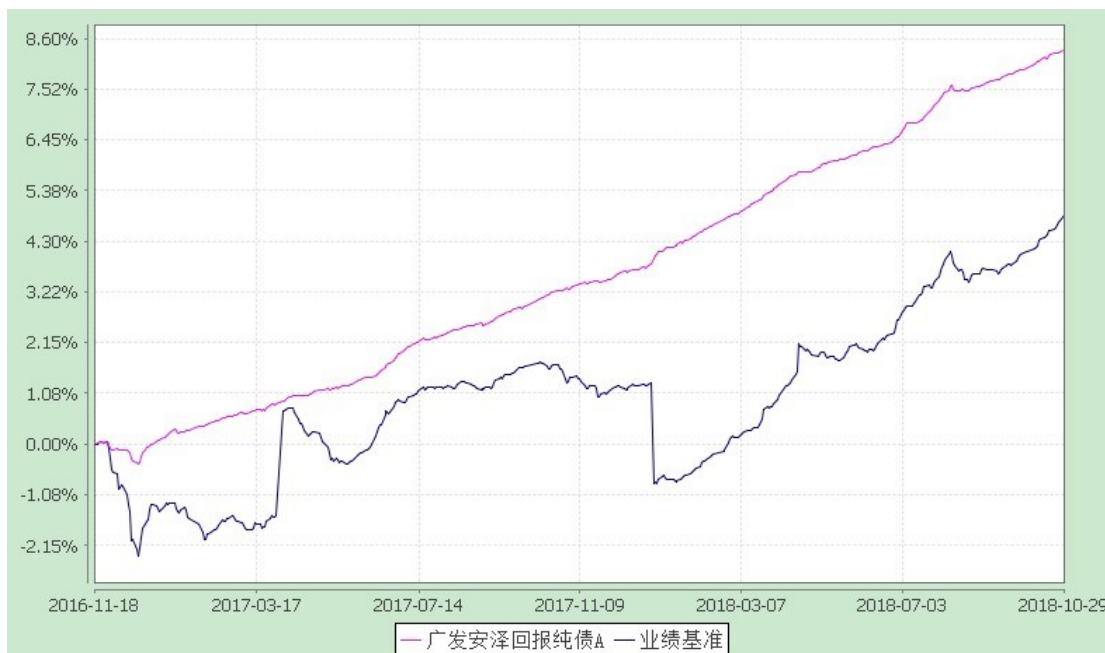
3.2.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发安泽回报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

(2016年11月18日至2018年10月29日)

1、广发安泽回报纯债 A



2、广发安泽回报纯债 C



§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	说明
----	----	-------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
代宇	本基金的基金经理；广发聚利债券基金的基金经理；广发聚财信用债券基金的基金经理；广发集利一年定期开放债券基金的基金经理；广发成长优选混合基金的基金经理；广发安泰回报基金的基金经理	2017-02-08	-	14年	代宇女士，金融学硕士，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、投资经理、固定收益部副总经理、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理（自2013年6月5日至2015年7月23日）、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年12月13日至2018年1月11日）、广发安心回报混合型证券投资基金基金经理（自2015年5月14日至2018年1月12日）、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年4月15日至2018年3月14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11月28日至2018年6月12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2月8日至2018年10月30日）、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理（自2017年8月4日至2018年11月30日）。现任广发基金管理有限公司债券投资部副总经理、广发聚利债券型证券投资基金基金经理（自2011年8月5日起任职）、广发聚财信用债券型证券投资基金

	<p>理； 广发双债添利债券基金的基金经理； 广发安瑞回报混合基金的基金经理； 广发安祥回报混合基金的基金经理； 广发集丰债券基金的基金经理； 广发汇瑞3个月定期开放债券基金的基金经理； 广发汇平</p>			<p>基金经理（自2012年3月13日起任职）、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2013年8月21日起任职）、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年2月17日起任职）、广发安泰回报混合型证券投资基金（自2015年5月14日起任职）、广发双债添利债券型证券投资基金基金经理（自2015年5月27日起任职）、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年7月26日起任职）、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年8月19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9日起任职）、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2017年1月6日起任职）、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2017年2月13日起任职）、广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2017年3月31日起任职）、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2017年6月27日起任职）、广发上证10年期国债交易型开放式指</p>
--	--	--	--	--

	<p>一年定期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； 广发汇安18个月定期债券基金的基金经理； 广发汇祥一年定期债券基金的基金经理； 广发上证10年期国债ETF基金的基金经理；</p>				<p>数证券投资基金基金经理（自2018年3月26日起任职）、广发汇瑞3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2018年6月13日起任职）、广发汇誉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自2018年6月20日起任职）、广发安泽短债债券型证券投资基金基金经理（自2018年10月30日起任职）。</p>
--	--	--	--	--	---

	广发汇誉3个月定期开放债券基金的基金经理；债券投资部副总经理				
刘志辉	本基金的基金经理；广发集源债券基金的基金经理；广发汇吉定开债券基金的基金经理；广发聚惠混合基金的基金经理；广发集瑞债券基金	2017-07-12	-	7年	刘志辉先生，金融学硕士，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、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理（自2017年7月12日至2018年10月30日）、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理（自2016年11月17日至2018年12月20日）。现任广发集源债券型证券投资基金基金经理（自2017年2月6日起任职）、广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自2018年1月29日起任职）、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年3月13日起任职）、广发集瑞债券型证券投资基金基金经理（自2018年10月18日起任职）、广发景华纯债债券型证券投资

	的基金经理； 广发景华纯债基金的基金经理； 广发景祥纯债基金的基金经理； 广发景源纯债基金的基金经理； 广发景明中短债基金的基金经理				基金基金经理（自2018年10月18日起任职）、广发景源纯债债券型证券投资基金基金经理（自2018年10月18日起任职）、广发景祥纯债债券型证券投资基金基金经理（自2018年10月18日起任职）、广发安泽短债债券型证券投资基金基金经理（自2018年10月30日起任职）、广发景明中短债债券型证券投资基金基金经理（自2018年11月29日起任职）。
谢军	本基金的基金经理； 广发增强债券基金的基金经理； 广发聚源	2017-01-10	-	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

	<p>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； 广发景华纯债基金的基金经理； 广发汇瑞</p>			<p>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金经理（自2016年11月18日至2018年11月9日）。现任广发基金管理有限公司债券投资部总经理、广发增强债券型证券投资基金基金经理（自2008年3月27日起任职）、广发聚源定期开放债券型证券投资基金基金经理（自2013年5月8日起任职）、广发安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年2月22日起任职）、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年11月7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</p>
--	---	--	--	--

	<p>3个月定期开放债券基金的基金经理；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；广发理财年年红债券基金的基金经理；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；</p>			<p>2016年11月9日起任职）、广发集瑞债券型证券投资基金基金经理（自2016年11月18日起任职）、广发景华纯债债券型证券投资基金基金经理（自2016年11月28日起任职）、广发景源纯债债券型证券投资基金基金经理（自2017年2月17日起任职）、广发景祥纯债债券型证券投资基金基金经理（自2017年3月2日起任职）、广发理财年年红债券型证券投资基金基金经理（自2017年7月5日起任职）、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年10月31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2017年10月31日起任职）、广发聚安混合型证券投资基金基金经理（自2017年10月31日起任职）、广发聚宝混合型证券投资基金基金经理（自2017年10月31日起任职）、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日起任职）、广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年1月16日起任职）、广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理（自2018年3月</p>
--	---	--	--	---

	<p>广发聚盛混合基金的基金经理； 广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理； 广发稳安保本基金的基金经理； 广发鑫和混合基金的基金经理； 广发汇吉定开债基金的基金经理； 广发汇元纯债定开发起式基</p>				<p>2 日起任职）、广发汇元纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2018 年 3 月 30 日起任职）、广发汇瑞 3 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理（自 2018 年 6 月 13 日起任职）、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2018 年 8 月 28 日起任职）、广发汇兴 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2018 年 10 月 29 日起任职）、广发安泽短债债券型证券投资基金基金经理（自 2018 年 10 月 30 日起任职）、广发景智纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2018 年 11 月 7 日起任职）、广发景润纯债债券型证券投资基金基金经理（自 2018 年 11 月 22 日起任职）、广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自 2018 年 12 月 13 日起任职）。</p>
--	--	--	--	--	--

	金的基金 经理； 广发集富 纯债基金 的基金经 理； 广发汇兴 3个月定 期开放债 券基金的 基金经 理； 广发景智 纯债基金 的基金经 理； 广发景润 纯债基金 的基金经 理； 广发汇立 定期开放 债券基金 的基金经 理； 债券				
--	--	--	--	--	--

	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、《广发安泽短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，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业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

四季度市场对经济下行的预期渐渐达成共识，同时美国经济呈现见顶回落态势，带动美债收益率下行、美股下跌、原油价格下降。通胀担忧在本季度证伪。在基本面的带动下，本季度中长端收益率明显下行，而央行的货币政策没有进一步宽松，短端收益率处于震荡，期限利差有所压缩。伴随利率的下行，部分信用债的信用利差也在压缩。本季度组合转型为短债基金，组合保持了稳健的操作，较好的平稳了收益与波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,转型前的广发安泽回报纯债 A 类净值增长率为 0.39%,广发安泽回报纯债 C 类净值增长率为 0.38%,同期业绩比较基准收益率为 0.76%;转型后的广发安泽短债 A 类净值增长率为 0.84%,广发安泽短债 C 类净值增长率为 0.82%,同期业绩比较基准收益率为 0.51%

§5 投资组合报告

5.1 广发安泽短债债券型证券投资基金

(报告期：2018年10月30日-2018年12月31日)

5.1.1 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	11,531,376,410.63	97.90
	其中：债券	10,731,567,070.00	91.11
	资产支持证券	799,809,340.63	6.79

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	1,013,480.38	0.01
7	其他各项资产	245,850,675.04	2.09
8	合计	11,778,240,566.05	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 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。

5.1.3 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。

5.1.4 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	706,662,070.00	6.10
	其中：政策性金融债	706,662,070.00	6.10
4	企业债券	19,216,000.00	0.17
5	企业短期融资券	8,072,894,000.00	69.64
6	中期票据	1,739,440,000.00	15.00
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	193,355,000.00	1.67
9	其他	-	-
10	合计	10,731,567,070.00	92.57

5.1.5 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	180410	18 农发 10	2,900,000	289,739,000.00	2.50
2	041800410	18 陕延油 CP001	2,000,000	200,260,000.00	1.73
3	041800421	18 陕煤化 CP003	2,000,000	200,220,000.00	1.73
4	011802200	18 中铝集 SCP015	2,000,000	200,120,000.00	1.73
5	041800444	18 平安租赁 CP003	1,600,000	159,936,000.00	1.38

5.1.6 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	149885	18 借 05A1	1,200,000	120,000,000.00	1.04
1	156432	东借 02A1	1,200,000	120,000,000.00	1.04
2	139112	集顺优 04	819,000	81,900,000.00	0.71
3	139302	链融 01A1	800,000	80,000,000.00	0.69
4	139091	链融 3A1	660,000	66,100,030.68	0.57
5	149086	借呗 49A1	550,000	55,776,534.60	0.48
6	149768	璀璨 3A	550,000	55,032,775.35	0.47
7	139200	集顺优 05	550,000	55,000,000.00	0.47
8	139308	尚隼 04A	450,000	45,000,000.00	0.39
9	139261	万科 29A1	400,000	40,000,000.00	0.35
9	149867	18 花 16A1	400,000	40,000,000.00	0.35
10	156390	璀璨 6A	210,000	21,000,000.00	0.18

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,801.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	114,415,554.76
5	应收申购款	131,425,318.78
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	245,850,675.04

5.1.11.2 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。

5.1.11.3 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。

5.2 广发安泽回报纯债债券型证券投资基金

(报告期：2018年10月1日-2018年10月29日)

5.2.1 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	3,596,947,723.98	91.45
	其中：债券	3,224,738,570.00	81.99
	资产支持证券	372,209,153.98	9.46
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	231,115,422.43	5.88
7	其他各项资产	104,962,044.79	2.67
8	合计	3,933,025,191.20	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 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。

5.2.3 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。

5.2.4 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	155,442,570.00	5.22
	其中：政策性金融债	155,442,570.00	5.22
4	企业债券	19,522,000.00	0.66

5	企业短期融资券	1,934,002,000.00	64.99
6	中期票据	583,922,000.00	19.62
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	531,850,000.00	17.87
9	其他	-	-
10	合计	3,224,738,570.00	108.37

5.2.5 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	011801827	18鲁钢铁SCP015	1,000,000	100,140,000.00	3.37
2	041800380	18云铜CP001	1,000,000	100,020,000.00	3.36
2	041800329	18晋煤CP003	1,000,000	100,020,000.00	3.36
3	111817189	18光大银行CD189	1,000,000	97,490,000.00	3.28
4	111818283	18华夏银行CD283	1,000,000	96,540,000.00	3.24
4	111815481	18民生银行CD481	1,000,000	96,540,000.00	3.24
5	111812175	18北京银行CD175	1,000,000	96,530,000.00	3.24

5.2.6 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	149805	借呗54A1	1,000,000	100,000,000.00	3.36
2	139112	集顺优04	819,000	81,900,000.00	2.75
3	149768	璀璨3A	550,000	55,032,775.35	1.85
4	139200	集顺优05	550,000	55,000,000.00	1.85
5	146674	花呗	400,000	40,000,000.00	1.34

		45A1			
6	149086	借呗 49A1	200,000	20,276,378.63	0.68
7	149969	璀璨 4A	200,000	20,000,000.00	0.67

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 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。

5.2.10 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,167.76
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	28,668,942.50
5	应收申购款	76,274,934.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	104,962,044.79

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 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

6.1 广发安泽短债债券型证券投资基金

单位：份

项目	广发安泽短债A	广发安泽短债C
基金合同生效日基金份额总额	1,757,461,774.32	1,086,535,979.44
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,675,885,000.78	8,270,869,718.74
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	540,466,199.86	2,262,365,137.74
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	3,892,880,575.24	7,095,040,560.44

6.2 广发安泽回报纯债债券型证券投资基金

单位：份

项目	广发安泽回报纯债A	广发安泽回报纯债C
本报告期期初基金份额总额	2,855,562,731.80	514,533,578.83
报告期基金总申购份额	375,820,788.94	672,870,096.47
减：报告期基金总赎回份额	1,473,921,746.42	100,867,695.86
报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	-	-

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 广发安泽短债债券型证券投资基金

7.1.1 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。

7.2 广发安泽回报纯债债券型证券投资基金

7.2.1 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 广发安泽回报纯债债券型证券投资基金

8.1.1 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	20181001-20181009	853,848,163.66	0.00	853,848,163.66	0.00	0.00%

产品特有风险

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。

8.1.2 影响投资者决策的其他重要信息

2018年9月29日起至2018年10月29日15:00止，广发安泽回报纯债债券型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2018年10月30日的计票会议上通过了《关于广发安泽回报纯债债券型证券投资基金

变更注册相关事项的议案》，即将“广发安泽回报纯债债券型证券投资基金”变更为“广发安泽短债债券型证券投资基金”，同时调整因前述变更而需要修改的部分基金合同条款。详情可见本基金管理人于2018年11月1日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （一）中国证监会准予广发安泽回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- （二）中国证监会准予广发安泽回报灵活配置混合型证券投资基金变更注册的文件
- （三）中国证监会准予广发安泽回报纯债债券型证券投资基金变更注册的文件
- （四）《广发安泽短债债券型证券投资基金基金合同》
- （五）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （六）《广发安泽短债债券型证券投资基金托管协议》
- （七）法律意见书

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

二〇一九年一月十九日