

**广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金**  
**2018 年年度报告摘要**  
**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：二〇一九年三月三十日

## §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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 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 2018 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       | 广发安悦回报混合         |
| 基金主代码      | 002120           |
| 交易代码       | 002120           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2016 年 11 月 7 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       |
| 报告期末基金份额总额 | 700,015,318.92 份 |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求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 | 30%×沪深 300 指数收益率+70%×中证全债指数收益率。   |
| 风险收益特征 | 本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。   |

### 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   | 平安银行股份有限公司    |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 邱春杨          | 李帅帅           |
|             | 联系电话 | 020-83936666 | 0755-25878287 |

|        |      |                    |                               |
|--------|------|--------------------|-------------------------------|
|        | 电子邮箱 | qcy@gffunds.com.cn | LISHUAISHUAI130@pingan.com.cn |
| 客户服务电话 |      | 95105828           | 95511-3                       |
| 传真     |      | 020-89899158       | 0755-82080387                 |

## 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 | 2018 年         | 2017 年         | 2016 年 11 月 7 日<br>(基金合同生效日)<br>至 2016 年 12 月<br>31 日 |
|---------------|----------------|----------------|---|
| 本期已实现收益       | 24,884,809.44  | 59,957,612.50  | -2,747,196.79   |
| 本期利润          | 33,682,167.29  | 59,140,873.22  | -6,335,553.72   |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0481         | 0.0845         | -0.0090   |
| 本期基金份额净值增长率   | 4.72%          | 8.48%          | -0.90%  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2018 年末        | 2017 年末        | 2016 年末   |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0343         | 0.0444         | -0.0090   |
| 期末基金资产净值      | 728,399,203.11 | 731,118,093.04 | 693,878,723.67  |
| 期末基金份额净值      | 1.041          | 1.044          | 0.991   |

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

| 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      | 1.13%    | 0.05%       | -1.70%     | 0.49%         | 2.83%  | -0.44% |
| 过去六个月      | 2.17%    | 0.06%       | -1.26%     | 0.44%         | 3.43%  | -0.38% |
| 过去一年       | 4.72%    | 0.09%       | -1.40%     | 0.40%         | 6.12%  | -0.31% |
| 自基金合同生效起至今 | 12.58%   | 0.10%       | 1.11%      | 0.31%         | 11.47% | -0.21% |

注：（1）业绩比较基准： $30\% \times$ 沪深 300 指数收益率 $+70\% \times$ 中证全债指数收益率。

（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

#### 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

广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金

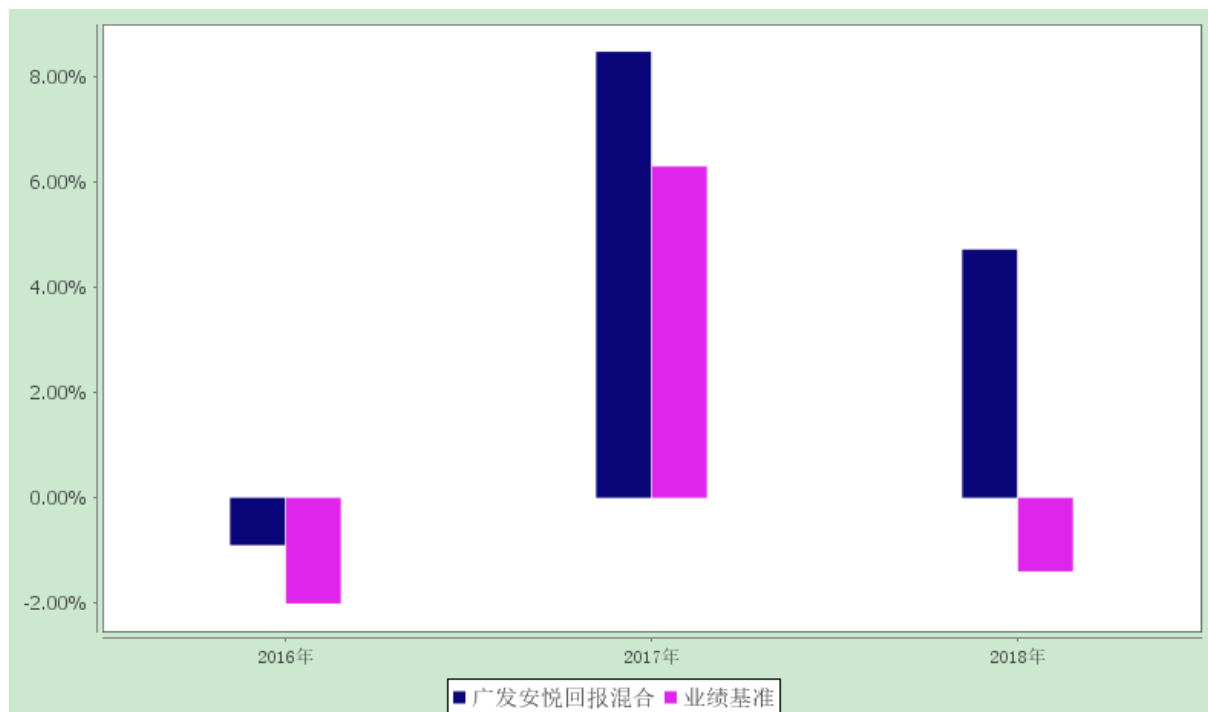
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2016 年 11 月 7 日至 2018 年 12 月 31 日)



### 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

广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金  
基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年（2016年）按实际存续期计算，未按自然年度折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

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 |
|-------|-------------|---------------|-----------|---------------|----|
| 2018年 | 0.520       | 36,400,751.26 | 43.36     | 36,400,794.62 | -  |
| 2017年 | 0.310       | 21,700,443.92 | 20.46     | 21,700,464.38 | -  |
| 合计    | 0.830       | 58,101,195.18 | 63.82     | 58,101,259.00 | -  |

## §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 31 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、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 2018 年 12 月 31 日，本基金管理人管理一百八十一只开放式基金，管理资产规模为 4684 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合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<br>(助理) 期限 |      | 证券从业<br>年限 | 说明   |
|----|---|----------------------|------|------------|--|
|    |   | 任职日期                 | 离任日期 |            |  |
| 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；广发鑫源灵活配置混合型证券投资基 | 2016-11-07           | -    | 15 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 |

|  |   |  |  |  |   |
|--|---|--|--|--|---|
|  | <p>金的基金经理；<br/>                 广发集瑞债券型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发景华纯债债券型证券投资基金的基金经理；<br/>                 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；<br/>                 广发安泽短债债券型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发景源纯债债券型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发景祥纯债债券型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发理财年年红债券型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发聚安混合型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发聚宝混合型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发稳安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；<br/>                 广发</p> |  |  |  | <p>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）。</p> |
|--|---|--|--|--|---|



|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  | 鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；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；广发汇元纯债定期开放债券型发起式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；广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；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、《广发安悦回报灵活配置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 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，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。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）；对于不同投资组合间的同时同向交易，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，未发现该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 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

本年度，国内固收市场的走势与年初市场的一致预期大相径庭。利率债方面，收益率整体下行，曲线变陡，节奏上看一、二季度连续下行，三季度转入区间调整震荡，四季度重新下行加快。信用债方面，整体上仍为牛市，最突出的特点是分化，其中中高等级和低等级信用债分化、国企和民企分化、产业债和城投债分化。权益方面，年初脉冲式诱多后，估值偏高逢景气高点，再叠加内外部风险，整体走势一路下行。组合固收部分在 2018 年初逐步将久期提高到 1 年以上，由于收益率下滑快于预期，久期整体提高到 2 年附近，并没有太积极。2017 年底，组合开始谨慎看待权益收益，仓位大幅降低到 3% 以内，并在 2018 年全年保持低仓位运作，较好的规避了权益下跌的风险。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发安悦回报混合净值增长率为 4.72%,同期业绩比较基准收益率为-1.40%

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望明年，短期内债市仍将受益于基本面下行与货币政策宽松，总体仍在偏强格局中，但是从估值上看比较贵。明年是本轮短周期继续探底和筑底的过程，大方向对债市有利，但是受制于估值，期间会有明显的波动风险和机会。债券方面需要继续注意把握好节奏，应对好内外部不确定性。权益市场大体上没有确定性大机会，阶段性下跌风险释放后可以期待部分结构性机会。因此，组合以绝对收益思路进行风险收益的匹配，中期方向，债券策略是持有中短久期高等级品种以获取票息，权益策略以消费领域稳定类、低估值板块为方向。

#### 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、估值的公司领导、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，2018 年 11 月 15 日广发安悦回报混合每 10 份基金份额分配 0.520 元。截至 2018 年 12 月 31 日，广发安悦回报混合可分配利润为 23,992,694.54 元，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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### **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**

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

### **§6 审计报告**

本报告期的基金财务会计报告经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师赵雅、李明明签字出具了安永华明（2019）审字第 60873695\_G89 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：广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产          | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|--------------------------|
| 资产：         | -                       | -                        |
| 银行存款        | 649,012.04              | 567,611.96               |
| 结算备付金       | 1,712,702.26            | 2,080,309.71             |
| 存出保证金       | 93,798.06               | 260,173.67               |
| 交易性金融资产     | 859,362,000.00          | 723,235,650.00           |
| 其中：股票投资     | -                       | 15,356,650.00            |
| 基金投资        | -                       | -                        |
| 债券投资        | 829,362,000.00          | 637,879,000.00           |
| 资产支持证券投资    | 30,000,000.00           | 70,000,000.00            |
| 贵金属投资       | -                       | -                        |
| 衍生金融资产      | -                       | -                        |
| 买入返售金融资产    | -                       | -                        |
| 应收证券清算款     | -                       | -                        |
| 应收利息        | 12,854,330.10           | 12,619,997.30            |
| 应收股利        | -                       | -                        |
| 应收申购款       | -                       | -                        |
| 递延所得税资产     | -                       | -                        |
| 其他资产        | -                       | -                        |
| <b>资产总计</b> | <b>874,671,842.46</b>   | <b>738,763,742.64</b>    |
| 负债和所有者权益    | 本期末<br>2018 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2017 年 12 月 31 日 |
| 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         | 145,200,000.00        | 6,700,000.00          |
| 应付证券清算款           | -                     | 11,659.77             |
| 应付赎回款             | -                     | 10.36                 |
| 应付管理人报酬           | 370,679.75            | 372,287.72            |
| 应付托管费             | 61,779.97             | 62,047.96             |
| 应付销售服务费           | -                     | -                     |
| 应付交易费用            | 7,068.33              | 169,558.72            |
| 应交税费              | 59,485.77             | -                     |
| 应付利息              | 211,625.53            | -2,914.95             |
| 应付利润              | -                     | -                     |
| 递延所得税负债           | -                     | -                     |
| 其他负债              | 362,000.00            | 333,000.02            |
| <b>负债合计</b>       | <b>146,272,639.35</b> | <b>7,645,649.60</b>   |
| <b>所有者权益：</b>     | <b>-</b>              | <b>-</b>              |
| 实收基金              | 700,015,318.92        | 700,015,563.64        |
| 未分配利润             | 28,383,884.19         | 31,102,529.40         |
| <b>所有者权益合计</b>    | <b>728,399,203.11</b> | <b>731,118,093.04</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>874,671,842.46</b> | <b>738,763,742.64</b> |

注：报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.041 元，基金份额总额 700,015,318.92 份。

## 7.2 利润表

会计主体：广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目  | 本期                                  | 上年度可比期间                             |
|------|-------------------------------------|-------------------------------------|
|      | 2018 年 1 月 1 日至<br>2018 年 12 月 31 日 | 2017 年 1 月 1 日至<br>2017 年 12 月 31 日 |
| 一、收入 | <b>42,103,084.82</b>                | <b>66,405,497.16</b>                |

|                            |                      |                      |
|----------------------------|----------------------|----------------------|
| 1.利息收入                     | 37,336,853.95        | 28,061,144.47        |
| 其中：存款利息收入                  | 68,751.85            | 546,819.83           |
| 债券利息收入                     | 34,755,173.99        | 25,158,581.70        |
| 资产支持证券利息收入                 | 2,407,010.91         | 782,652.06           |
| 买入返售金融资产收入                 | 105,917.20           | 1,573,090.88         |
| 其他利息收入                     | -                    | -                    |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | -4,031,419.21        | 39,160,148.34        |
| 其中：股票投资收益                  | -2,836,201.17        | 37,457,129.97        |
| 基金投资收益                     | -                    | -                    |
| 债券投资收益                     | -2,474,157.01        | -858,419.15          |
| 资产支持证券投资收益                 | 802,871.23           | -                    |
| 贵金属投资收益                    | -                    | -                    |
| 衍生工具收益                     | -                    | -                    |
| 股利收益                       | 476,067.74           | 2,561,437.52         |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 8,797,357.85         | -816,739.28          |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -                    | -                    |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 292.23               | 943.63               |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>8,420,917.53</b>  | <b>7,264,623.94</b>  |
| 1. 管理人报酬                   | 4,471,243.64         | 4,240,238.23         |
| 2. 托管费                     | 745,207.29           | 701,659.40           |
| 3. 销售服务费                   | -                    | -                    |
| 4. 交易费用                    | 569,787.36           | 1,355,061.11         |
| 5. 利息支出                    | 2,149,327.13         | 539,765.20           |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | 2,149,327.13         | 539,765.20           |
| 6. 税金及附加                   | 94,952.11            | -                    |
| 7. 其他费用                    | 390,400.00           | 427,900.00           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>33,682,167.29</b> | <b>59,140,873.22</b> |

|                          |                      |                      |
|--------------------------|----------------------|----------------------|
| 减：所得税费用                  | -                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b> | <b>33,682,167.29</b> | <b>59,140,873.22</b> |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2018 年 1 月 1 日至 2018 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<br>(基金净值)                    | 700,015,563.64                              | 31,102,529.40  | 731,118,093.04 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -   | 33,682,167.29  | 33,682,167.29  |
| 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)      | -244.72                                     | -17.88         | -262.60        |
| 其中：1.基金申购款                             | 41.70                                       | 1.66           | 43.36          |
| 2.基金赎回款                                | -286.42                                     | -19.54         | -305.96        |
| 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) | -   | -36,400,794.62 | -36,400,794.62 |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                    | 700,015,318.92                              | 28,383,884.19  | 728,399,203.11 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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<br>(基金净值)                    | 700,214,277.39 | -6,335,553.72  | 693,878,723.67 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -              | 59,140,873.22  | 59,140,873.22  |
| 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)      | -198,713.75    | -2,325.72      | -201,039.47    |
| 其中：1.基金申购款                             | 50,714.10      | -123.34        | 50,590.76      |
| 2.基金赎回款                                | -249,427.85    | -2,202.38      | -251,630.23    |
| 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) | -              | -21,700,464.38 | -21,700,464.38 |
| 五、期末所有者权益<br>(基金净值)                    | 700,015,563.64 | 31,102,529.40  | 731,118,093.04 |

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

广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2015]1926号《关于准予广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2562号《关于广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准,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》等有关规定和《广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

(“基金合同”)发起,于 2016 年 11 月 7 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,基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金募集期为 2016 年 11 月 1 日至 2016 年 11 月 1 日，本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 700,214,277.39 元，有效认购户数为 226 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 14,004.00 元，折合基金份额 14,004.00 份，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。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2019 年 3 月 28 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### **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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 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**

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票

收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称  | 与本基金的关系                    |
|--|----------------------------|
| 平安银行股份有限公司   | 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                 |
| 珠海瑞元祥和股权投资基金合伙企业（有限合伙）   | 基金管理人控股子公司的控股子公司           |
| GF International Asset Management (UK) Company Limited（广发国际资产管理（英国）有限公司） | 基金管理人全资子公司的全资子公司           |
| 广发纳正（上海）资产管理有限公司   | 基金管理人全资子公司的全资子公司           |

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 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<br>2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 上年度可比期间<br>2017年1月1日至2017年<br>12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 4,471,243.64                    | 4,240,238.23                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | -                               | -                                    |

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.6% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

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 5 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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

|                | 2018年1月1日至2018年<br>12月31日 | 2017年1月1日至2017年<br>12月31日 |
|----------------|---------------------------|---------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 745,207.29                | 701,659.40                |

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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固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固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

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                    |                       | 上年度可比期间               |                       |
|------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|
|            | 2018年1月1日至2018年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 | 2017年1月1日至2017年12月31日 | 2017年1月1日至2017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                |
| 平安银行股份有限公司 | 649,012.04            | 28,250.40             | 567,611.96            | 73,758.70             |

注：本基金的银行存款由基金托管人平安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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.9 期末（2018 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 2018 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 2018 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 2018 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 2018 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 145,200,000.00 元，于 2019 年 1 月 2 日到期。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

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 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人民币 859,362,000.00 元，无属于第一层级和第三层级的金额（2017 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为人民币 15,356,650.00 元，属于第二层级的余额为人民币 637,879,000.00 元，属于第三层级的余额为人民币 70,000,000.00 元）。

(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 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中无属于第三层级的余额；本报告期内转出第三层级的金额为人民币 70,000,000.00 元，除上述变动外，该层级金融资产无其他变动。

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

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例<br>(%) |
|----|-------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资              | -              | -                |
|    | 其中：股票             | -              | -                |
| 2  | 基金投资              | -              | -                |
| 3  | 固定收益投资            | 859,362,000.00 | 98.25            |
|    | 其中：债券             | 829,362,000.00 | 94.82            |
|    | 资产支持证券            | 30,000,000.00  | 3.43             |
| 4  | 贵金属投资             | -              | -                |
| 5  | 金融衍生品投资           | -              | -                |
| 6  | 买入返售金融资产          | -              | -                |
|    | 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       | 2,361,714.30   | 0.27             |



|   |        |                |        |
|---|--------|----------------|--------|
|   | 计      |                |        |
| 8 | 其他各项资产 | 12,948,128.16  | 1.48   |
| 9 | 合计     | 874,671,842.46 | 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 14,665,642.45 | 2.01            |
| 2  | 300347 | 泰格医药 | 13,488,731.00 | 1.84            |
| 3  | 600867 | 通化东宝 | 11,604,398.84 | 1.59            |
| 4  | 002507 | 涪陵榨菜 | 11,186,990.26 | 1.53            |
| 5  | 002262 | 恩华药业 | 10,727,009.18 | 1.47            |
| 6  | 601888 | 中国国旅 | 9,331,398.78  | 1.28            |
| 7  | 603288 | 海天味业 | 8,628,398.90  | 1.18            |
| 8  | 600763 | 通策医疗 | 8,411,721.00  | 1.15            |
| 9  | 603866 | 桃李面包 | 8,231,303.31  | 1.13            |
| 10 | 300357 | 我武生物 | 8,111,498.00  | 1.11            |
| 11 | 600298 | 安琪酵母 | 7,925,865.00  | 1.08            |
| 12 | 002821 | 凯莱英  | 6,510,510.00  | 0.89            |
| 13 | 600547 | 山东黄金 | 6,045,254.00  | 0.83            |
| 14 | 600276 | 恒瑞医药 | 5,931,129.25  | 0.81            |
| 15 | 600009 | 上海机场 | 5,810,838.94  | 0.79            |
| 16 | 300003 | 乐普医疗 | 5,754,250.00  | 0.79            |
| 17 | 600030 | 中信证券 | 5,671,057.00  | 0.78            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 18 | 600900 | 长江电力 | 5,252,644.00 | 0.72 |
| 19 | 600887 | 伊利股份 | 5,029,451.76 | 0.69 |
| 20 | 000651 | 格力电器 | 4,887,905.00 | 0.67 |

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 14,592,810.00 | 2.00            |
| 2  | 300347 | 泰格医药 | 12,697,444.34 | 1.74            |
| 3  | 002507 | 涪陵榨菜 | 11,798,729.90 | 1.61            |
| 4  | 600867 | 通化东宝 | 11,662,192.00 | 1.60            |
| 5  | 002262 | 恩华药业 | 10,851,593.60 | 1.48            |
| 6  | 603288 | 海天味业 | 9,819,956.19  | 1.34            |
| 7  | 600547 | 山东黄金 | 9,174,338.00  | 1.25            |
| 8  | 601888 | 中国国旅 | 8,862,122.30  | 1.21            |
| 9  | 300357 | 我武生物 | 8,547,901.23  | 1.17            |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 8,150,358.00  | 1.11            |
| 11 | 603866 | 桃李面包 | 8,069,209.70  | 1.10            |
| 12 | 600763 | 通策医疗 | 7,871,827.80  | 1.08            |
| 13 | 600298 | 安琪酵母 | 7,342,066.00  | 1.00            |
| 14 | 002821 | 凯莱英  | 6,807,897.00  | 0.93            |
| 15 | 600276 | 恒瑞医药 | 5,943,127.00  | 0.81            |
| 16 | 600487 | 亨通光电 | 5,645,545.21  | 0.77            |
| 17 | 300003 | 乐普医疗 | 5,631,614.00  | 0.77            |
| 18 | 600009 | 上海机场 | 5,562,414.00  | 0.76            |
| 19 | 000651 | 格力电器 | 5,326,545.40  | 0.73            |
| 20 | 600030 | 中信证券 | 5,319,440.00  | 0.73            |

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|               |                |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 203,342,754.43 |
|---------------|----------------|

|               |                |
|---------------|----------------|
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 216,557,890.91 |
|---------------|----------------|

### 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      | 40,092,000.00  | 5.50         |
|    | 其中：政策性金融债 | 40,092,000.00  | 5.50         |
| 4  | 企业债券      | 481,178,000.00 | 66.06        |
| 5  | 企业短期融资券   | 110,709,000.00 | 15.20        |
| 6  | 中期票据      | 91,067,000.00  | 12.50        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | 106,316,000.00 | 14.60        |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 829,362,000.00 | 113.86       |

### 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  | 180312    | 18 进出 12      | 400,000 | 40,092,000.00 | 5.50         |
| 2  | 101682009 | 16 中铝业 MTN002 | 300,000 | 30,495,000.00 | 4.19         |
| 3  | 143582    | 18 中化 01      | 300,000 | 30,390,000.00 | 4.17         |
| 4  | 143736    | 18 远海 02      | 300,000 | 30,357,000.00 | 4.17         |
| 5  | 122450    | 15 齐鲁债        | 300,000 | 30,294,000.00 | 4.16         |

### 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          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|---------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 149993 | 花呗 65A1 | 300,000 | 30,000,000.00 | 4.12         |

#### 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** 18 中信银行 CD293（代码：111808293）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给予罚款 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。

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。

**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 | 93,798.06 |

|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | -             |
| 3 | 应收股利    | -             |
| 4 | 应收利息    | 12,854,330.10 |
| 5 | 应收申购款   | -             |
| 6 | 其他应收款   | -             |
| 7 | 待摊费用    | -             |
| 8 | 其他      | -             |
| 9 | 合计      | 12,948,128.16 |

#### 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

| 持有人户数(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额     | 占总份<br>额比例 |
| 204      | 3,431,447.6<br>4 | 700,013,000.00 | 100.00%    | 2,318.92 | 0.00%      |

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 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 | 1,870.01  | 0.0003%  |

### 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                                 | 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<br>研究部门负责人持有本开放式基金 | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |                |
|---------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2016年11月7日)基金份额总额 | 700,214,277.39 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 700,015,563.64 |
| 本报告期基金总申购份额               | 41.70          |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 286.42         |
| 本报告期基金拆分变动份额              | -              |
| 本报告期期末基金份额总额              | 700,015,318.92 |

### §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

本基金管理人于 2018 年 2 月 6 日发布公告，自 2018 年 2 月 5 日起，聘任张芊女士担任公司副总经理；于 2018 年 9 月 28 日发布公告，自 2018 年 9 月 28 日起，聘任王凡先生担任公司副总经理；于 2018 年 11 月 3 日发布公告，自 2018 年 11 月 2 日起，聘任邱春杨先生担任公司督察长，段西军先生不再担任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

#### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、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

自 2018 年 9 月 27 日起，本基金管理人改聘安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

#### 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、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 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 |        |
| 国金证券 | 2      | 419,895,915.34 | 100.00%      | 307,070.72 | 100.00%    | -      |
| 中金公司 | 1      | -              | -            | -          | -          | -      |
| 中信建投 | 1      | -              | -            | -          | -          | 新增 1 个 |
| 银河证券 | 2      | -              | -            | -          | -          | 新增 2 个 |
| 华鑫证券 | 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           | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国金证券 | -              | -            | 5,401,300,000.00 | 100.00%      | -    | -            |
| 华鑫证券 | 231,231,107.39 | 100.00%      | -                | -            | -    | -            |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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              | 20180101-20181231       | 700,013,000.00 | 0.00 | 0.00 | 700,013,000.00 | 100.00% |
| 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。 |                |                         |                |      |      |                |         |

广发基金管理有限公司

二〇一九年三月三十日