

广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金  
(广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金)

2018 年第 1 季度报告

2018 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年四月二十日

## §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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 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。

本基金系原广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金转型而来。依据《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》等法律法规的规定和《广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金合同》的有关规定，我司于 2018 年 1 月 8 日起至 2018 年 2 月 7 日 15:00 止以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议关于广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金变更注册类型及其相关事项的议案，该次会议决议生效日为 2018 年 3 月 21 日，即从该日起，广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金变更注册为广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 2018 年 3 月 20 日止，广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金报告期自 2018 年 3 月 21 日起至 2018 年 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

基金简称	广发鑫惠定开债
基金主代码	002128
交易代码	002128
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2018年3月21日
报告期末基金份额总额	1,507,074,416.21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	中债总全价（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，属于证券投资基金中具有较低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	中国银行股份有限公司

## 2.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	广发鑫惠混合
基金主代码	002128
交易代码	002128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月16日
报告期末基金份额总额	1,497,212,483.27份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘和利用潜在的投资机会，力求实现基金资产的持续稳定增值。
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场

	资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后的收益。
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。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

### §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 (2018年3月21日-2018 年3月31日)	报告期 (2018年1月1日-2018 年3月20日)
1.本期已实现收益	1,227,819.77	9,681,667.02
2.本期利润	8,982,623.27	15,772,291.50
3.加权平均基金份额本期利润	0.0060	0.0105
4.期末基金资产净值	1,535,874,634.45	1,516,892,011.18
5.期末基金份额净值	1.019	1.013

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

(报告期：2018年3月21日-2018年3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

阶段	净值增	净值增	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

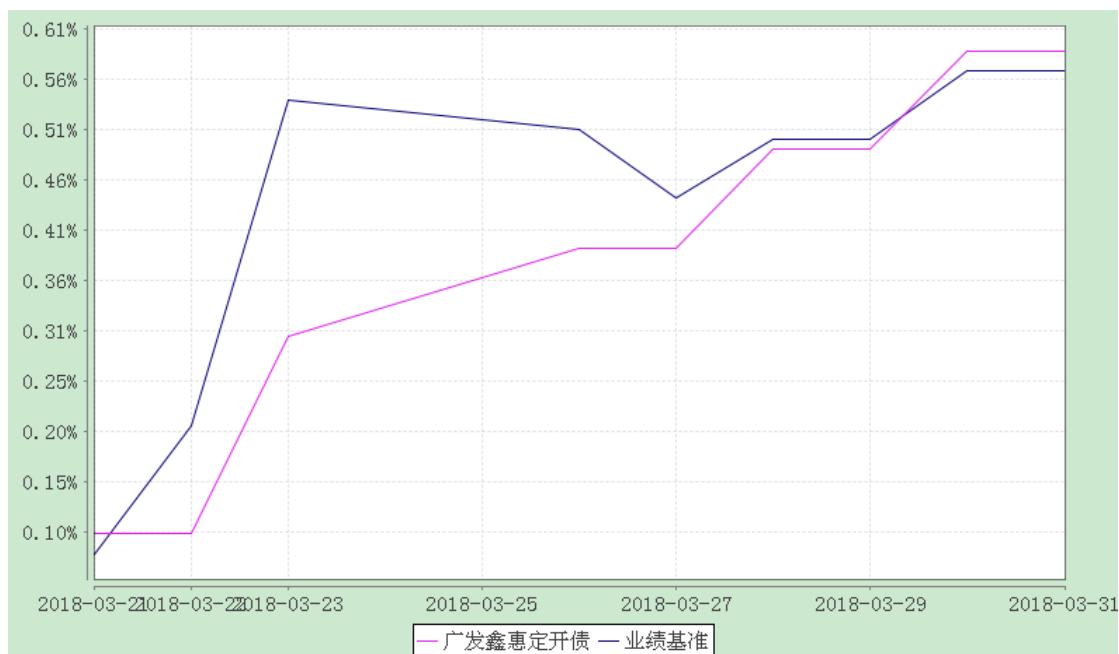
	长率①	长率标准差②	较基准收益率③	较基准收益率标准差④		
过去三个月	0.59%	0.07%	0.57%	0.12%	0.02%	-0.05%

### 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

广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年3月21日-2018年3月31日)



注：(1) 自2018年3月21日起，本基金的业绩比较基准由原“30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率”变更为“中债总全价(总值)指数收益率”。

(2) 本基金建仓期为基金合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

### 3.2.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

(报告期：2018年1月1日-2018年3月20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

阶段	净值增	净值增	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

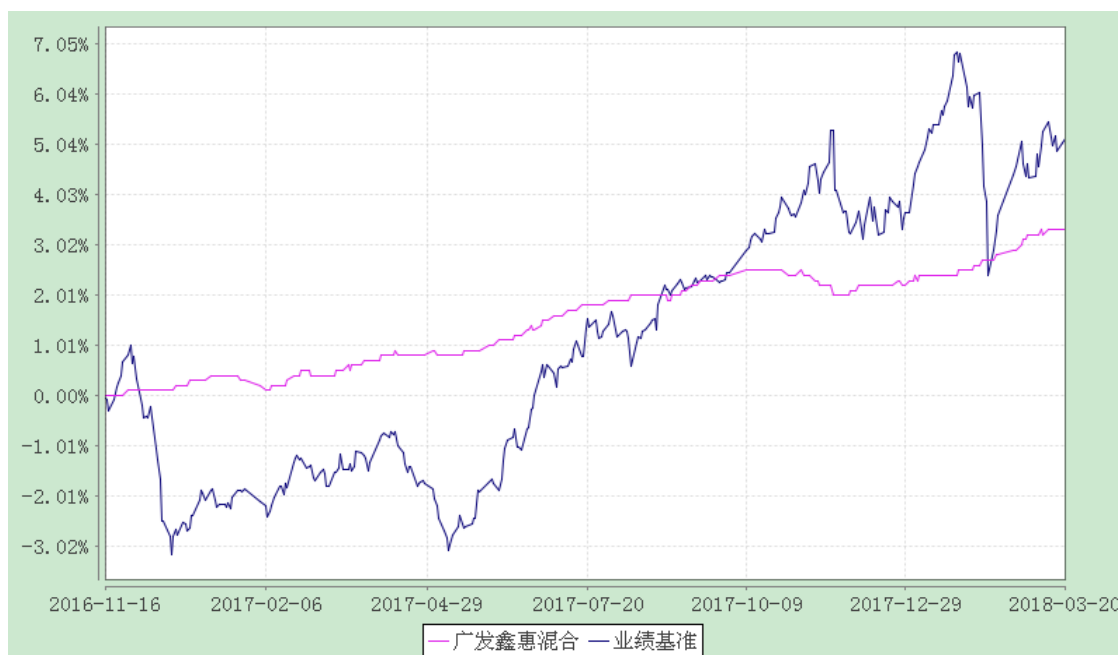
	长率①	长率标准差②	较基准收益率③	较基准收益率标准差④		
过去三个月	1.00%	0.05%	1.42%	0.35%	-0.42%	-0.30%

### 3.2.2.2 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

广发鑫惠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历史走势对比图

(2018年1月1日-2018年3月20日)



注：本基金建仓期为基金合同生效后6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## §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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任爽	本基	2016-11-16	-	10年	任爽女士，经济学硕士，

	<p>金的基金经理；广发纯债债券基金的基金经理；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</p>			<p>持有中国证券投资基金从业证书。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、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日至2018年3月20日）。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</p>
--	---	--	--	--

	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				日起任职)、广发鑫惠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21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、《广发鑫惠纯债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。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

2018 年一季度，银行间资金面整体维持宽松，超出市场预期。从各指标表现来看，R007 月度均值连续回落，目前已经回到去年一季度的水平；反映流动性分层情况的 R007-DR007 指标回落到较低位置。从央行公开市场操作（含 MLF）未到期余额数据来看，截至 3 月底约为 5.2 万亿，市场流动性状况仍然对央行操作的力度与节奏较为依赖。实体经济小幅放缓、金融监管制度逐步完善等是支持

流动性好于去年的重要原因,目前来看这两方面可能有一定持续性。但资管新规以及一系列配套规定即将落地,之后政策执行如何调整需要密切关注。报告期内本基金一直采取短久期的策略,安排较多现金在季末到期,重新配置较高收益存款、存单和回购,增厚组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,转型前的广发鑫惠混合的净值增长率为 1%,业绩比较基准收益率为 1.42%;转型后的广发鑫惠定开债的净值增长率为 0.59%,业绩比较基准收益率为 0.57%

## §5 投资组合报告

### 5.1 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

(报告期: 2018年3月21日-2018年3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	1,764,955,000.00	98.19
	其中: 债券	1,654,825,000.00	92.06
	资产支持证券	110,130,000.00	6.13
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	308,548.50	0.02
7	其他各项资产	32,309,069.19	1.80
8	合计	1,797,572,617.69	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。

### 5.1.2.2 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。

### 5.1.3 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	152,351,000.00	9.92
	其中：政策性金融债	152,351,000.00	9.92
4	企业债券	208,753,000.00	13.59
5	企业短期融资券	160,296,000.00	10.44
6	中期票据	985,170,000.00	64.14
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	148,255,000.00	9.65
8	其他	-	-
9	合计	1,654,825,000.00	107.74

### 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	101766009	17 中电投 MTN001	1,000,000	100,940,000.00	6.57
2	101752030	17 远东租赁 MTN001	1,000,000	100,570,000.00	6.55

3	101756034	17 诚通控股 MTN002	1,000,000	100,040,000.00	6.51
4	111809030	18 浦发银行 CD030	1,000,000	98,840,000.00	6.44
5	011800299	18 金隅 SCP002	900,000	90,198,000.00	5.87

### 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	146256	借呗 26A1	700,000	70,000,000.00	4.56
2	1789220	17 惠益 2A2	500,000	40,130,000.00	2.61

### 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 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.1.11.2 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。

### 5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
----	----	-------

1	存出保证金	22,249.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,286,819.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	32,309,069.19

#### 5.1.11.4 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。

#### 5.1.11.5 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。

## 5.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

(报告期: 2018年1月1日-2018年3月20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	1,620,858,996.50	98.19
	其中: 债券	1,510,748,996.50	91.52
	资产支持证券	110,110,000.00	6.67
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	643,576.35	0.04
7	其他各项资产	29,175,403.35	1.77
8	合计	1,650,677,976.20	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。

### 5.2.2.2 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。

## 5.2.3 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	151,533,000.00	9.99
	其中：政策性金融债	151,533,000.00	9.99
4	企业债券	207,539,000.00	13.68
5	企业短期融资券	160,109,000.00	10.56
6	中期票据	979,910,000.00	64.60
7	可转债（可交换债）	11,657,996.50	0.77
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,510,748,996.50	99.60

## 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	101766009	17 中电投 MTN001	1,000,000	100,330,000.00	6.61
2	101752030	17 远东租赁 MTN001	1,000,000	100,060,000.00	6.60
3	101756034	17 诚通控股 MTN002	1,000,000	99,420,000.00	6.55
4	011800299	18 金隅 SCP002	900,000	90,081,000.00	5.94
5	101753007	17 中电子 MTN001	800,000	80,240,000.00	5.29

### 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	146256	借呗 26A1	700,000	70,000,000.00	4.61
2	1789220	17 惠益 2A2	500,000	40,110,000.00	2.64

### 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 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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.2.11.2 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。

### 5.2.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	22,249.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,153,153.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,175,403.35

### 5.2.11.4 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。

### 5.2.11.5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

### 6.1 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,497,212,483.27
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	9,861,932.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-



本报告期期末基金份额总额	1,507,074,416.21
--------------	------------------

## 6.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	1,497,245,005.64
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	32,522.37
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,497,212,483.27

## §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

项目	报告期 (2018年3月21日-2018 年3月31日)	报告期 (2018年1月1日-2018 年3月20日)
报告期期初管理人持有的 的本基金份额	-	-
基金合同生效日起至报 告期期末买入/申购总份 额	9,861,932.94	0.00
基金合同生效日起至报 告期期末卖出/赎回总份 额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有 的本基金份额	9,861,932.94	0.00

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.65	0.00
---------------------------	------	------

## 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

### 7.2.1 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
-	申购	2018-03-21	9,861,932.94	10,001,000.00	-
合计			9,861,932.94	10,001,000.00	

注：申购费1000元。

### 7.2.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

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

### 8.1 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,861,932.94	0.65%	9,861,932.94	0.65%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	50.01	0.00%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,861,982.95	0.65%	9,861,932.94	0.65%	三年

## §9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

### 9.1.1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	20180321-20180331	1,497,209,772.31	0.00	0.00	1,497,209,772.31	99.35%
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>							

### 9.2广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

#### 9.2.1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	20180101-20180320	1,497,209,772.31	0.00	0.00	1,497,209,772.31	99.99%
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</p>							

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。

### 9.3影响投资者决策的其他重要信息

2018年1月8日至2018年2月7日15:00止，广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，本次会议议案《关于广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金转型有关事项的议案》在2018年2月9日的计票会议上获得通过。根据持有人大会通过的议案，广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金自2018年3月21日起转型为广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式基金。有关重要事项详情可见本基金管理人在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及本公司网站（www.gffunds.com.cn）于2018年2月13日刊登的《关于广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

## §10 备查文件目录

### 10.1备查文件目录

- （一）中国证监会注册广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金募集的文件
- （二）《广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式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）《广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式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
- （八）《广发基金管理有限公司关于广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》

## 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

二〇一八年四月二十日