

广发安盈灵活配置混合型证券投资基金

2018 年半年度报告

2018 年 6 月 30 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：二〇一八年八月二十四日

1 重要提示及目录

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。本半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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 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	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
7.8 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	45
7.9 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	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
8 基金份额持有人信息	47

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.3 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	47
9 开放式基金份额变动	48
10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
10.2 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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	50
11 影响投资者决策的其他重要信息	50
12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发安盈灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	广发安盈混合	
基金主代码	002118	
交易代码	002118	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 9 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	
报告期末基金份额总额	196,202,388.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	广发安盈混合 A	广发安盈混合 C
下属两级基金的交易代码	002118	002119
报告期末下属分级基金的份额总额	195,672,830.03 份	529,558.67 份

2.2 基金产品说明

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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95566

传真	020-89899158	010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券时报、上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼、北京市西城区复兴门内大街1号

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2018年1月1日至2018年6月30日）	
	广发安盈混合 A	广发安盈混合 C
本期已实现收益	3,882,908.53	8,554.09
本期利润	-18,337,219.86	-83,963.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0937	-0.2081
本期加权平均净值利润率	-8.76%	-19.62%
本期基金份额净值增长率	-8.74%	-8.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	广发安盈混合 A	广发安盈混合 C
期末可供分配利润	-3,471,324.14	-7,607.61

期末可供分配基金份额利润	-0.0177	-0.0144
期末基金资产净值	192,201,505.89	521,951.06
期末基金份额净值	0.982	0.986
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)	
	广发安盈混合 A	广发安盈混合 C
基金份额累计净值增长率	-1.80%	-1.39%

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

广发安盈混合 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
过去一个月	-5.49%	1.07%	-1.83%	0.38%	-3.66%	0.69%
过去三个月	-7.10%	0.96%	-1.47%	0.34%	-5.63%	0.62%
过去六个月	-8.74%	1.00%	-0.82%	0.35%	-7.92%	0.65%
过去一年	-3.44%	0.79%	1.67%	0.29%	-5.11%	0.50%
自基金合同生效起至今	-1.80%	0.64%	2.57%	0.26%	-4.37%	0.38%

广发安盈混合 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
过去一个月	-5.47%	1.09%	-1.83%	0.38%	-3.64%	0.71%
过去三个月	-7.07%	0.97%	-1.47%	0.34%	-5.60%	0.63%
过去六个月	-8.36%	1.01%	-0.82%	0.35%	-7.54%	0.66%
过去一年	-2.95%	0.80%	1.67%	0.29%	-4.62%	0.51%
自基金合同生效起至今	-1.39%	0.64%	2.57%	0.26%	-3.96%	0.38%

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

（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。

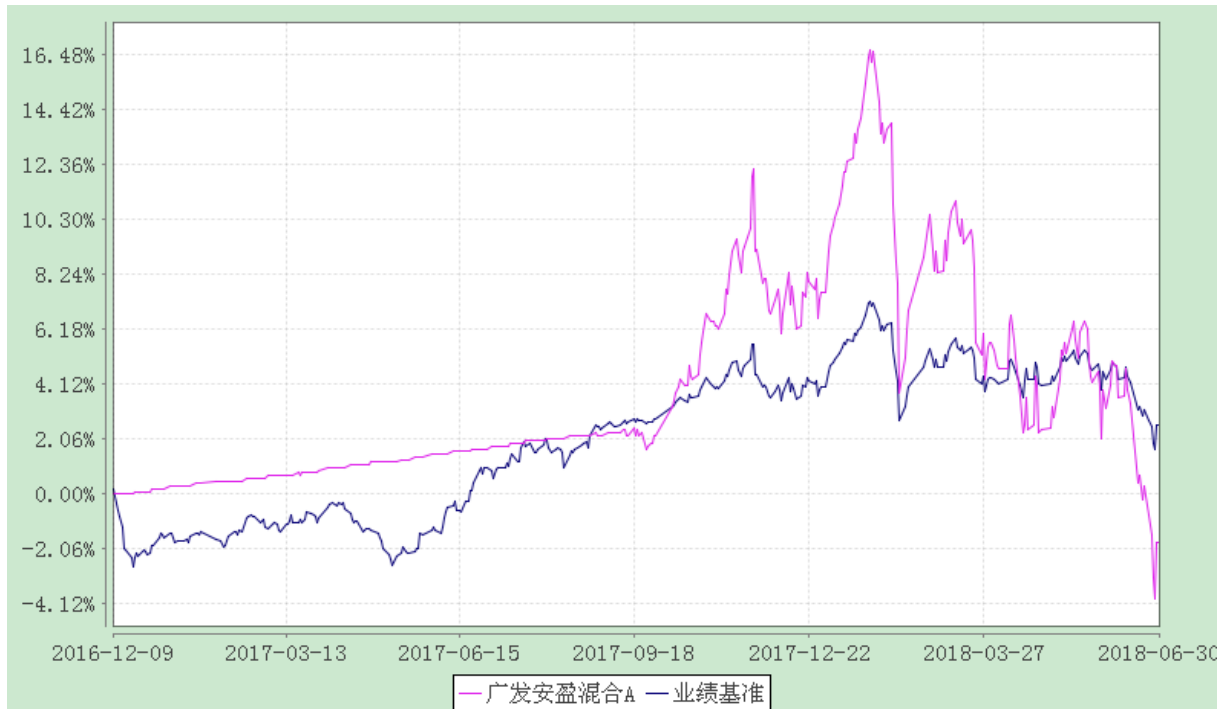
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发安盈灵活配置混合型证券投资基金

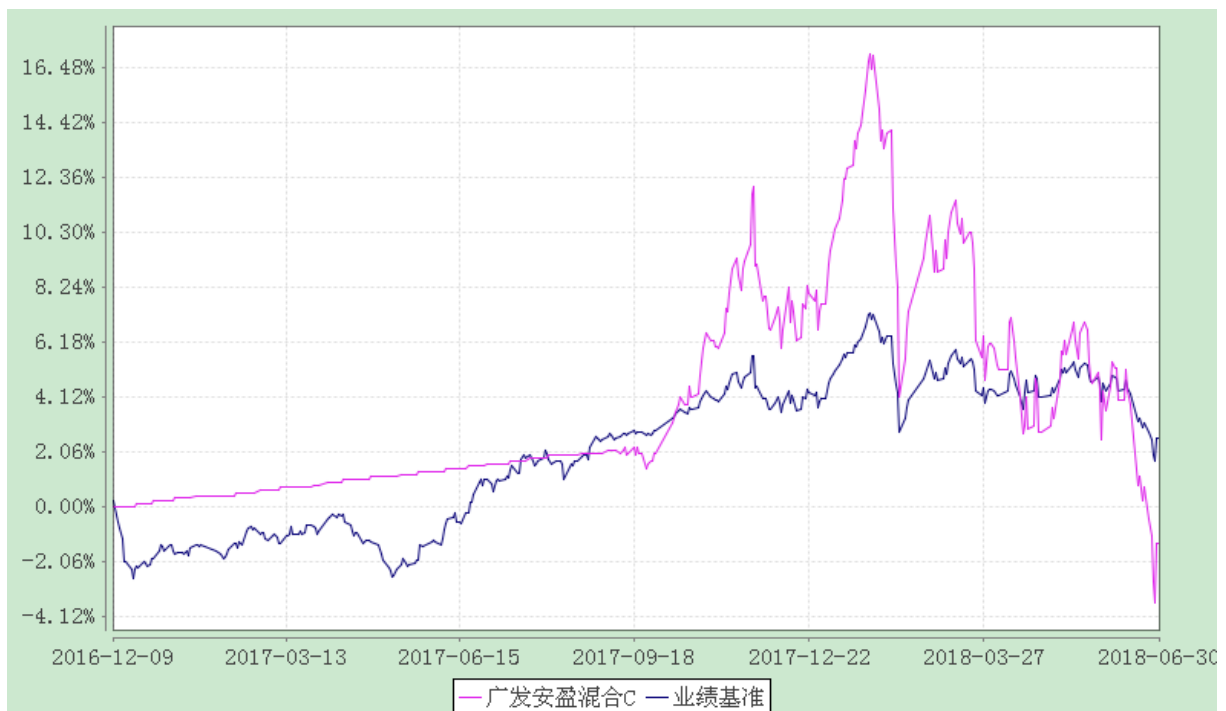
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 12 月 9 日至 2018 年 6 月 30 日)

广发安盈混合 A



广发安盈混合 C



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 30 个部门：宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、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 6 月 30 日，本基金管理人管理一百七十五只开放式基金，管理资产规模为 3600 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
任爽	本基金的基金经理；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	2016-12-09	-	10 年	任爽女士，经济学硕士，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

	<p>金经理；广发天天利货币基金的基金经理；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；广发鑫惠定开债基金的基金经理；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</p>			<p>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 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)。</p>
--	--	--	--	---

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、《广发安盈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

上半年，货币市场整体维持较宽松的态势，与去年四季度以及年初市场预期相比形成较大差异，央行操作方面，为了对冲信用环境偏紧带来的负面冲击货币政策转向结构性宽松，具体表现为一季度用多种方式呵护流动性、二季度内两次降准操作、不再跟随美联储上调政策利率、流动性相关措辞变为合理充裕等。由于央行态度是决定流动性的核心变量，预计年内流动性整体仍将维持宽松态势。需要注意的是，货币政策转向极度宽松的概率较低，杠杆需求、缴准缴税等冲击仍将干扰货币市场。报告期内本基金一直采取中短久期的策略，安排一定现金在季末到期，重新配置较高收益存款、存单和回购，增厚组合收益。权益投资方面，本基金延续此前的配置思路，选取具备持续成长性的大盘股进行配置。未来本基金将继续秉承稳健增值的理念进行资产配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发安盈混合 A 类净值增长率为-8.74%,广发安盈混合 C 类净值增长率为-8.36%,同期业绩比较基准收益率为-0.82%

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,预计宽松的货币政策将会得以延续,资金面在央行的呵护下会再下一个台阶。而信用方面,目前来看央行、银保监会已经采取了一些措施努力创造一个宽信用的环境,预计整体信用环境在宽松的货币政策下会出现边际的改善。但是此次宽信用的背景以及金融机构的处境已经和前两次发生了较大的改变,因此信用偏好的提升程度尚需观察。预计下半年仍会出现一些冲击性的事件影响资本市场预期的调整。

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、估值的副总经理、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、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,本基金本报告期内未进行利润分配,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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发安盈灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发安盈灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	2,440,139.54	4,493,082.35
结算备付金		26,024.70	-
存出保证金		5,615.99	117,200.47
交易性金融资产	6.4.7.2	190,023,591.86	205,760,209.85

其中：股票投资		160,546,591.86	186,035,227.45
基金投资		-	-
债券投资		29,477,000.00	19,724,982.40
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	263,888.18
应收利息	6.4.7.5	577,232.96	277,312.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		193,072,605.05	210,911,693.58
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,648.24	-
应付赎回款		171.21	-
应付管理人报酬		98,814.52	106,860.71
应付托管费		16,469.10	17,810.13
应付销售服务费		178.53	23.04
应付交易费用	6.4.7.7	52,265.00	18,730.80
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	177,601.50	323,000.00
负债合计		349,148.10	466,424.68
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	196,202,388.70	195,594,149.11
未分配利润	6.4.7.10	-3,478,931.75	14,851,119.79
所有者权益合计		192,723,456.95	210,445,268.90
负债和所有者权益总计		193,072,605.05	210,911,693.58

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，广发安盈混合 A 基金份额净值人民币 0.982 元，基金份额总额 195,672,830.03 份；广发安盈混合 C 基金份额净值人民币 0.986 元，基金份额总额 529,558.67 份；总份额总额 196,202,388.70 份。

6.2 利润表

会计主体：广发安盈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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-17,401,929.15	4,279,276.53
1.利息收入		490,482.61	3,783,471.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,460.25	331,126.71
债券利息收入		463,022.36	2,723,502.75
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	728,842.18
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,417,833.05	427,710.00
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,666,649.75	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,903.21	427,710.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	1,755,086.51	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-22,312,646.03	68,090.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	2,401.22	4.89
减：二、费用		1,019,254.26	1,134,786.45
1. 管理人报酬		623,122.18	767,996.33
2. 托管费		103,853.74	141,947.18
3. 销售服务费		852.18	32.14
4. 交易费用	6.4.7.18	102,437.08	3,850.00
5. 利息支出		-	11,537.11
其中：卖出回购金融资产支出		-	11,537.11
6. 税金及附加		5.28	-
7. 其他费用	6.4.7.19	188,983.80	209,423.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-18,421,183.41	3,144,490.08
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-18,421,183.41	3,144,490.08

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发安盈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 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 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（基金净值）	195,594,149.11	14,851,119.79	210,445,268.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-18,421,183.41	-18,421,183.41
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）	608,239.59	91,131.87	699,371.46
其中：1.基金申购款	1,125,208.74	131,237.27	1,256,446.01
2.基金赎回款	-516,969.15	-40,105.40	-557,074.55
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	196,202,388.70	-3,478,931.75	192,723,456.95
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 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（基金净值）	200,008,211.27	336,928.42	200,345,139.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,144,490.08	3,144,490.08
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）	68,798.30	705.39	69,503.69
其中：1.基金申购款	71,928.13	749.88	72,678.01
2.基金赎回款	-3,129.83	-44.49	-3,174.32
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	200,077,009.57	3,482,123.89	203,559,133.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发安盈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]1927 号文和机构部函[2015]2653 号《关于广发安盈灵活配置混合型证券投资基金延期募集备案的回函》的批准，由基金管理人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》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《广发安盈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 12 月 9 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2016 年 11 月 29 日至 2016 年 12 月 5 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 200,005,158.89 元，有效认购户数为 217 户。其中，广发安盈混合 A 类基金(“A 类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 200,000,108.89 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 4,000.00 元；广发安盈混合 C 类基金(“C 类基金”)扣除认购费用后的募集资金净额 1,050.00 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 0.00 元。认购资金在募集期间产生的利息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。

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》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，

包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具)、权证、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。

本基金业绩比较基准： $30\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 70\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

本基金的财务报表于 2018 年 8 月 22 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 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 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 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

本基金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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1、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、债券免征营业税或增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

2、对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，暂不缴纳企业所得税。

3、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

4、对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5、对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
活期存款	2,440,139.54
定期存款	-
其他存款	-
合计	2,440,139.54

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	173,648,418.97	160,546,591.86	-13,101,827.11	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	29,454,410.00	29,477,000.00	22,590.00
	合计	29,454,410.00	29,477,000.00	22,590.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	203,102,828.97	190,023,591.86	-13,079,237.11	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	839.54
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2.50
应收结算备付金利息	11.70
应收债券利息	576,379.22
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	577,232.96

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	51,915.00
银行间市场应付交易费用	350.00
合计	52,265.00

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	177,601.50
合计	177,601.50

6.4.7.9 实收基金

广发安盈混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期

	2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	195,535,674.42	195,535,674.42
本期申购	253,250.24	253,250.24
本期赎回（以“-”号填列）	-116,094.63	-116,094.63
本期末	195,672,830.03	195,672,830.03

广发安盈混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	58,474.69	58,474.69
本期申购	871,958.50	871,958.50
本期赎回（以“-”号填列）	-400,874.52	-400,874.52
本期末	529,558.67	529,558.67

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

广发安盈混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,377,529.80	9,469,163.09	14,846,692.89
本期利润	3,882,908.53	-22,220,128.39	-18,337,219.86
本期基金份额交易产生的变动数	4,279.87	14,922.96	19,202.83
其中：基金申购款	8,481.99	21,821.66	30,303.65
基金赎回款	-4,202.12	-6,898.70	-11,100.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,264,718.20	-12,736,042.34	-3,471,324.14

广发安盈混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,602.47	2,824.43	4,426.90
本期利润	8,554.09	-92,517.64	-83,963.55
本期基金份额交易产生的变动数	16,998.64	54,930.40	71,929.04

其中：基金申购款	33,570.13	67,363.49	100,933.62
基金赎回款	-16,571.49	-12,433.09	-29,004.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	27,155.20	-34,762.81	-7,607.61

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,588.97
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	448.61
结算备付金利息收入	422.67
其他	-
合计	27,460.25

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	38,256,987.34
减：卖出股票成本总额	35,590,337.59
买卖股票差价收入	2,666,649.75

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,211,790.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	21,609,910.00
减：应收利息总额	605,783.22
买卖债券差价收入	-3,903.21

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,755,086.51
基金投资产生的股利收益	-

合计	1,755,086.51
----	--------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1.交易性金融资产	-22,312,646.03
——股票投资	-22,362,063.63
——债券投资	49,417.60
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-22,312,646.03

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	22.08
新股手续费返还收入	-
基金转换费收入	2,379.14
配债手续费返还收入	-
基金认购利息收入	-
申购费收入	-
其他收入	-
合计	2,401.22

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	102,087.08
银行间市场交易费用	350.00
期货交易费用	-
合计	102,437.08

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	
	2018年1月1日至2018年6月30日	
审计费用		19,835.79
信息披露费		148,765.71
银行汇划费		1,782.30
账户维护费		18,000.00
其他		600.00
合计		188,983.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国银行股份有限公司	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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：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6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	37,327,847.92	54.32%	-	-

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	1,754,565.34	94.88%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	51,400,000.00	100.00%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	34,762.68	60.23%	12,603.38	24.28%

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	623,122.18	767,996.33
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(2017 年 3 月 17 日以前：1.0%)。

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 为前一日的基金资产净值

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月 30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	103,853.74	141,947.18

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(2017 年 3 月 17 日以前：0.2%)。

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 为前一日的基金资产净值

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发安盈混合 A	广发安盈混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	852.18	852.18
合计	-	852.18	852.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	广发安盈混合 A	广发安盈混合 C	合计
广发基金管理有限公司	-	32.14	32.14
合计	-	32.14	32.14

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经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划出，由注册登记机构代收，注册登记机构收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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

广发安盈混合 A

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。

广发安盈混合 C

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。

6.4.10.5 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6月30日		2017年1月1日至2017年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	2,440,139.54	26,588.97	2,698,773.75	34,238.64

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 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。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	4.83	4.83	3,410.00	16,470.30	16,470.30	-
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股流通受限	13.09	13.09	1,765.00	23,103.85	23,103.85	-
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股流通受限	9.00	9.00	5,384.00	48,456.00	48,456.00	-

注：截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002426	胜利精密	2018-06-19	重大事项停牌	3.60	2018-07-03	3.26	33,500.00	170,880.71	120,600.00	-

000723	美锦能源	2018-03-27	重大事项停牌	5.43	2018-07-31	4.89	22,500.00	141,599.00	122,175.00	-
002411	必康股份	2018-06-19	重大事项停牌	28.34	-	-	4,400.00	118,247.16	124,696.00	-
601118	海南橡胶	2018-05-24	重大事项停牌	6.62	-	-	19,600.00	128,299.92	129,752.00	-
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项停牌	4.96	2018-08-07	4.46	28,400.00	237,280.58	140,864.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项停牌	5.84	2018-07-17	5.26	34,400.00	238,865.00	200,896.00	-
002602	世纪华通	2018-06-12	重大事项停牌	32.50	-	-	7,300.00	242,514.39	237,250.00	-
002310	东方园林	2018-05-25	重大事项停牌	13.08	-	-	22,500.00	434,674.40	294,300.00	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大事项停牌	8.40	2018-07-16	7.56	37,400.00	396,030.57	314,160.00	-
600221	海航控股	2018-01-10	重大事项停牌	3.23	2018-07-20	2.91	102,600.00	340,292.00	331,398.00	-
601727	上海电气	2018-06-06	重大事项停牌	6.34	2018-08-07	5.71	53,400.00	411,553.71	338,556.00	-
300072	三聚环保	2018-06-19	重大事项停牌	23.28	2018-07-10	24.00	15,200.00	492,749.72	353,856.00	-
601390	中国中铁	2018-05-07	重大事项停牌	6.44	2018-08-20	7.25	89,200.00	789,332.81	574,448.00	-
002450	康得新	2018-06-04	重大事项停牌	17.08	-	-	35,300.00	742,208.24	602,924.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总裁负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,477,000.00	19,721,000.00
合计	29,477,000.00	19,721,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
AAA	19,464,000.00	9,751,000.00
未评级	-	-
合计	19,464,000.00	9,751,000.00

注：短期同业存单评级取自第三方评级机构的发行主体信用评级。

6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	3,982.40
未评级	-	-
合计	-	3,982.40

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、

外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型(VAR)等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,440,139.54	-	-	-	2,440,139.54
结算备付金	26,024.70	-	-	-	26,024.70
存出保证金	5,615.99	-	-	-	5,615.99
交易性金融资产	29,477,000.00	-	-	160,546,591.86	190,023,591.86
应收利息	-	-	-	577,232.96	577,232.96
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	31,948,780.23	-	-	161,123,824.82	193,072,605.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,648.24	3,648.24
应付赎回款	-	-	-	171.21	171.21
应付管理人报酬	-	-	-	98,814.52	98,814.52
应付托管费	-	-	-	16,469.10	16,469.10
应付交易费用	-	-	-	52,265.00	52,265.00
应付销售服务费	-	-	-	178.53	178.53
其他负债	-	-	-	177,601.50	177,601.50
负债总计	-	-	-	349,148.10	349,148.10
利率敏感度缺口	31,948,780.23	-	-	160,774,676.72	192,723,456.95
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	4,493,082.35	-	-	-	4,493,082.35
存出保证金	117,200.47	-	-	-	117,200.47
交易性金融资产	19,724,982.40	-	-	186,035,227.45	205,760,209.85
应收证券清算款	-	-	-	263,888.18	263,888.18
应收利息	-	-	-	277,312.73	277,312.73
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	24,335,265.22	-	-	186,576,428.36	210,911,693.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	106,860.71	106,860.71
应付托管费	-	-	-	17,810.13	17,810.13
应付交易费用	-	-	-	18,730.80	18,730.80
应付销售服务费	-	-	-	23.04	23.04
其他负债	-	-	-	323,000.00	323,000.00
负债总计	-	-	-	466,424.68	466,424.68
利率敏感度缺口	24,335,265.22	-	-	186,110,003.68	210,445,268.90

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-22,067.98	-18,229.98
	市场利率下降 25 个基点	22,105.17	18,264.98

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	160,546,591.86	83.30	186,035,227.45	88.40
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	3,982.40	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	160,546,591.86	83.30	186,039,209.85	88.40

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
		2018 年 6 月 30 日	2017 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	8,349,470.98	12,010,607.04
	业绩比较基准下降 5%	-8,349,470.98	-12,010,607.04

6.4.14 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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2018 年 6 月 30 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 156,572,686.71 元, 属于第二层级的余额为 33,450,905.15 元, 无属于第三层级的金额 (2017 年 12 月 31 日: 属于第一层级的余额为 182,373,907.11 元, 属于第二层级的余额为 23,386,302.74 元, 无属于第三层级的金额)。

(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。

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。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	160,546,591.86	83.15
	其中: 股票	160,546,591.86	83.15
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,477,000.00	15.27
	其中: 债券	29,477,000.00	15.27
	资产支持证券	-	-
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计	2,466,164.24	1.28
8	其他各项资产	582,848.95	0.30
9	合计	193,072,605.05	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	400,958.00	0.21
B	采矿业	5,392,402.00	2.80
C	制造业	63,521,402.48	32.96
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,688,517.85	2.43
E	建筑业	5,936,180.40	3.08
F	批发和零售业	3,182,826.00	1.65
G	交通运输、仓储和邮政业	5,057,794.00	2.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,566,453.04	3.41
J	金融业	52,715,893.04	27.35
K	房地产业	7,736,697.00	4.01
L	租赁和商务服务业	2,388,809.80	1.24
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	756,635.54	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	932,698.71	0.48
R	文化、体育和娱乐业	1,269,324.00	0.66
S	综合	-	-
	合计	160,546,591.86	83.30

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	------	--------------

1	601318	中国平安	177,608	10,404,276.64	5.40
2	600519	贵州茅台	7,900	5,778,534.00	3.00
3	600036	招商银行	171,400	4,531,816.00	2.35
4	000333	美的集团	71,800	3,749,396.00	1.95
5	000651	格力电器	75,200	3,545,680.00	1.84
6	601166	兴业银行	210,900	3,036,960.00	1.58
7	600887	伊利股份	101,900	2,843,010.00	1.48
8	600016	民生银行	404,300	2,830,100.00	1.47
9	601328	交通银行	443,800	2,547,412.00	1.32
10	600276	恒瑞医药	32,370	2,452,351.20	1.27
11	600030	中信证券	139,100	2,304,887.00	1.20
12	000858	五粮液	29,800	2,264,800.00	1.18
13	002415	海康威视	59,200	2,198,096.00	1.14
14	601288	农业银行	611,600	2,103,904.00	1.09
15	000002	万科 A	79,600	1,958,160.00	1.02
16	600000	浦发银行	204,100	1,951,196.00	1.01
17	600104	上汽集团	54,200	1,896,458.00	0.98
18	601398	工商银行	350,800	1,866,256.00	0.97
19	601668	DR 中国建	336,840	1,839,146.40	0.95
20	600900	长江电力	104,500	1,686,630.00	0.88
21	601601	中国太保	50,200	1,598,870.00	0.83
22	601169	北京银行	255,500	1,540,665.00	0.80
23	000725	京东方 A	431,900	1,528,926.00	0.79
24	600048	保利地产	115,400	1,407,880.00	0.73
25	600837	海通证券	143,200	1,356,104.00	0.70
26	000001	平安银行	147,700	1,342,593.00	0.70
27	002304	洋河股份	9,900	1,302,840.00	0.68
28	600019	宝钢股份	149,800	1,166,942.00	0.61
29	600028	中国石化	178,700	1,159,763.00	0.60
30	600585	海螺水泥	32,000	1,071,360.00	0.56
31	601766	中国中车	134,500	1,035,650.00	0.54
32	601888	中国国旅	15,900	1,024,119.00	0.53
33	601818	光大银行	267,400	978,684.00	0.51
34	601211	XD 国泰君	65,100	959,574.00	0.50
35	002024	苏宁易购	67,700	953,216.00	0.49
36	002027	分众传媒	98,640	943,984.80	0.49
37	600690	青岛海尔	48,700	937,962.00	0.49
38	000538	云南白药	8,300	887,768.00	0.46
39	601688	华泰证券	59,200	886,224.00	0.46
40	002230	科大讯飞	27,200	872,304.00	0.45
41	600015	XD 华夏银	110,000	819,500.00	0.43
42	600703	三安光电	42,600	818,772.00	0.42
43	601857	中国石油	105,000	809,550.00	0.42
44	001979	招商蛇口	40,800	777,240.00	0.40

45	600050	XD 中国联	157,900	776,868.00	0.40
46	600009	上海机场	13,900	771,172.00	0.40
47	300059	东方财富	58,060	765,230.80	0.40
48	600919	江苏银行	119,100	763,431.00	0.40
49	600309	万华化学	16,800	763,056.00	0.40
50	002008	大族激光	14,000	744,660.00	0.39
51	000568	泸州老窖	12,000	730,320.00	0.38
52	601939	建设银行	109,800	719,190.00	0.37
53	601006	大秦铁路	87,100	715,091.00	0.37
54	002594	比亚迪	14,900	710,432.00	0.37
55	600196	复星医药	16,300	674,657.00	0.35
56	601012	隆基股份	40,300	672,607.00	0.35
57	002142	宁波银行	41,168	670,626.72	0.35
58	002236	大华股份	29,500	665,225.00	0.35
59	601989	中国重工	159,800	645,592.00	0.33
60	601186	中国铁建	74,700	643,914.00	0.33
61	000338	潍柴动力	73,300	641,375.00	0.33
62	601009	南京银行	82,800	640,044.00	0.33
63	300003	乐普医疗	17,400	638,232.00	0.33
64	601628	中国人寿	27,900	628,308.00	0.33
65	601088	中国神华	31,100	620,134.00	0.32
66	002450	康得新	35,300	602,924.00	0.31
67	002475	立讯精密	26,600	599,564.00	0.31
68	600031	三一重工	64,600	579,462.00	0.30
69	601899	XD 紫金矿	160,400	579,044.00	0.30
70	601390	中国中铁	89,200	574,448.00	0.30
71	600741	华域汽车	24,200	574,024.00	0.30
72	002466	天齐锂业	11,550	572,764.50	0.30
73	600999	招商证券	41,000	560,880.00	0.29
74	000963	华东医药	11,500	554,875.00	0.29
75	601336	新华保险	12,700	544,576.00	0.28
76	600660	福耀玻璃	21,000	539,910.00	0.28
77	002456	欧菲科技	33,300	537,129.00	0.28
78	600029	南方航空	63,400	535,730.00	0.28
79	601933	永辉超市	70,100	535,564.00	0.28
80	600795	国电电力	201,600	528,192.00	0.27
81	601225	陕西煤业	61,600	506,352.00	0.26
82	600436	片仔癀	4,500	503,685.00	0.26
83	002460	赣锋锂业	12,900	497,682.00	0.26
84	600958	东方证券	54,500	497,585.00	0.26
85	600340	华夏幸福	19,200	494,400.00	0.26
86	002202	金风科技	38,200	482,848.00	0.25
87	300124	汇川技术	14,600	479,172.00	0.25
88	601607	上海医药	19,900	475,610.00	0.25

89	600271	航天信息	18,800	475,076.00	0.25
90	000423	东阿阿胶	8,800	473,528.00	0.25
91	002044	美年健康	20,840	470,984.00	0.24
92	600406	XD 国电南	29,700	469,260.00	0.24
93	600886	国投电力	64,500	468,915.00	0.24
94	603799	华友钴业	4,800	467,856.00	0.24
95	600352	浙江龙盛	38,800	463,660.00	0.24
96	300015	爱尔眼科	14,299	461,714.71	0.24
97	600011	华能国际	72,500	461,100.00	0.24
98	600570	恒生电子	8,700	460,665.00	0.24
99	300070	碧水源	32,700	455,511.00	0.24
100	600089	特变电工	64,600	447,678.00	0.23
101	000895	双汇发展	16,900	446,329.00	0.23
102	600115	东方航空	67,300	445,526.00	0.23
103	601155	新城控股	14,300	442,871.00	0.23
104	601985	中国核电	78,300	442,395.00	0.23
105	600066	宇通客车	22,600	433,694.00	0.23
106	601377	兴业证券	81,400	428,978.00	0.22
107	300136	信维通信	13,900	427,147.00	0.22
108	601600	中国铝业	110,100	422,784.00	0.22
109	600535	天士力	16,000	413,120.00	0.21
110	601669	XD 中国电	76,800	411,648.00	0.21
111	002736	国信证券	44,900	408,590.00	0.21
112	600111	北方稀土	35,300	401,714.00	0.21
113	000503	国新健康	12,618	401,000.04	0.21
114	601901	方正证券	59,800	400,062.00	0.21
115	000100	TCL 集团	136,800	396,720.00	0.21
116	000069	华侨城 A	54,200	391,866.00	0.20
117	601788	光大证券	34,600	379,908.00	0.20
118	000783	长江证券	69,700	378,471.00	0.20
119	600383	金地集团	36,600	372,954.00	0.19
120	600588	用友网络	15,210	372,797.10	0.19
121	600606	绿地控股	56,600	370,164.00	0.19
122	600332	白云山	9,600	365,280.00	0.19
123	600010	包钢股份	231,800	359,290.00	0.19
124	600705	中航资本	76,400	356,788.00	0.19
125	300072	三聚环保	15,200	353,856.00	0.18
126	600637	东方明珠	23,400	352,404.00	0.18
127	601919	中远海控	71,400	351,288.00	0.18
128	002241	歌尔股份	34,000	346,460.00	0.18
129	600893	航发动力	15,300	341,496.00	0.18
130	600023	浙能电力	73,200	341,112.00	0.18
131	600804	鹏博士	28,300	339,600.00	0.18
132	601727	上海电气	53,400	338,556.00	0.18

133	601111	中国国航	37,500	333,375.00	0.17
134	600221	海航控股	102,600	331,398.00	0.17
135	300024	机器人	19,000	330,600.00	0.17
136	600522	中天科技	37,300	328,613.00	0.17
137	000768	中航飞机	21,000	328,440.00	0.17
138	000166	申万宏源	74,800	326,876.00	0.17
139	600674	川投能源	36,900	321,768.00	0.17
140	300122	智飞生物	7,000	320,180.00	0.17
141	600177	雅戈尔	41,400	318,780.00	0.17
142	600085	同仁堂	9,000	317,520.00	0.16
143	600547	山东黄金	13,200	315,744.00	0.16
144	000793	华闻传媒	37,400	314,160.00	0.16
145	600068	葛洲坝	43,000	310,030.00	0.16
146	601018	宁波港	73,500	309,435.00	0.16
147	601618	中国中冶	92,600	308,358.00	0.16
148	002007	华兰生物	9,580	308,092.80	0.16
149	600100	同方股份	35,000	307,300.00	0.16
150	000625	长安汽车	34,100	306,900.00	0.16
151	601998	中信银行	49,200	305,532.00	0.16
152	600018	上港集团	51,200	305,152.00	0.16
153	002572	索菲亚	9,200	296,056.00	0.15
154	601099	太平洋	126,200	295,308.00	0.15
155	002310	东方园林	22,500	294,300.00	0.15
156	002065	东华软件	33,900	291,540.00	0.15
157	603993	洛阳钼业	46,300	291,227.00	0.15
158	000157	中联重科	70,000	287,700.00	0.15
159	601800	中国交建	25,100	285,889.00	0.15
160	600482	中国动力	16,300	284,435.00	0.15
161	601997	贵阳银行	22,800	281,808.00	0.15
162	002081	金螳螂	27,700	279,770.00	0.15
163	601555	东吴证券	40,300	275,249.00	0.14
164	000425	徐工机械	64,700	274,328.00	0.14
165	600208	新湖中宝	71,200	271,984.00	0.14
166	000792	盐湖股份	25,100	271,582.00	0.14
167	002714	牧原股份	6,100	271,206.00	0.14
168	000839	中信国安	57,300	271,029.00	0.14
169	300144	宋城演艺	11,500	270,250.00	0.14
170	600816	安信信托	37,207	269,378.68	0.14
171	002294	信立泰	7,200	267,624.00	0.14
172	600362	江西铜业	16,800	266,280.00	0.14
173	600109	国金证券	36,500	259,515.00	0.13
174	000728	国元证券	35,000	259,000.00	0.13
175	002508	老板电器	8,456	258,922.72	0.13
176	002146	荣盛发展	29,500	257,535.00	0.13

177	600297	广汇汽车	43,500	254,910.00	0.13
178	600219	南山铝业	93,900	254,469.00	0.13
179	300017	网宿科技	23,100	247,401.00	0.13
180	002673	西部证券	32,200	243,110.00	0.13
181	601198	东兴证券	18,400	239,936.00	0.12
182	002797	第一创业	35,300	238,981.00	0.12
183	601333	广深铁路	56,200	238,850.00	0.12
184	002602	世纪华通	7,300	237,250.00	0.12
185	000876	新希望	37,400	237,116.00	0.12
186	000630	铜陵有色	107,200	236,912.00	0.12
187	600170	上海建工	77,500	235,600.00	0.12
188	600153	建发股份	26,200	235,538.00	0.12
189	000961	中南建设	36,000	227,160.00	0.12
190	000060	中金岭南	46,150	224,289.00	0.12
191	601117	中国化学	33,000	222,090.00	0.12
192	000826	启迪桑德	12,580	219,898.40	0.11
193	600415	小商品城	51,000	219,810.00	0.11
194	002558	巨人网络	9,240	219,727.20	0.11
195	600489	中金黄金	31,300	213,466.00	0.11
196	002624	完美世界	6,690	207,456.90	0.11
197	600583	海油工程	39,100	205,666.00	0.11
198	600820	隧道股份	34,700	205,077.00	0.11
199	601229	上海银行	13,000	204,880.00	0.11
200	300027	华谊兄弟	33,200	204,512.00	0.11
201	601992	金隅集团	62,300	204,344.00	0.11
202	600977	中国电影	12,700	203,708.00	0.11
203	601216	君正集团	60,400	203,548.00	0.11
204	601633	长城汽车	20,500	201,310.00	0.10
205	000415	渤海金控	34,400	200,896.00	0.10
206	000709	河钢股份	68,000	200,600.00	0.10
207	002470	金正大	28,700	197,456.00	0.10
208	600369	西南证券	49,700	191,345.00	0.10
209	600118	中国卫星	9,900	189,090.00	0.10
210	002500	山西证券	27,900	188,046.00	0.10
211	600157	永泰能源	104,800	186,544.00	0.10
212	000983	西山煤电	24,400	183,244.00	0.10
213	600663	陆家嘴	11,600	183,164.00	0.10
214	600704	物产中大	33,100	173,113.00	0.09
215	601877	正泰电器	7,700	171,864.00	0.09
216	600376	首开股份	24,300	170,829.00	0.09
217	000559	万向钱潮	25,100	170,680.00	0.09
218	000627	天茂集团	24,300	170,586.00	0.09
219	000402	金融街	20,700	166,635.00	0.09
220	002352	顺丰控股	3,700	166,500.00	0.09

221	002074	国轩高科	11,810	166,048.60	0.09
222	600008	首创股份	39,000	164,580.00	0.09
223	000898	鞍钢股份	28,800	160,416.00	0.08
224	002385	大北农	38,500	159,005.00	0.08
225	000938	紫光股份	2,500	156,500.00	0.08
226	300033	同花顺	4,000	155,480.00	0.08
227	600959	江苏有线	30,200	154,020.00	0.08
228	600061	国投资本	16,500	153,120.00	0.08
229	000671	阳光城	25,500	152,235.00	0.08
230	600038	中直股份	3,800	151,962.00	0.08
231	601021	春秋航空	4,300	150,629.00	0.08
232	000008	神州高铁	28,400	140,864.00	0.07
233	300251	光线传媒	13,800	140,484.00	0.07
234	002153	石基信息	4,800	139,200.00	0.07
235	600373	中文传媒	10,600	136,210.00	0.07
236	002601	龙蟠佰利	10,500	135,765.00	0.07
237	601866	中远海发	54,500	135,705.00	0.07
238	600549	厦门钨业	8,930	135,557.40	0.07
239	601898	中煤能源	27,900	134,757.00	0.07
240	600688	上海石化	23,500	133,715.00	0.07
241	601118	海南橡胶	19,600	129,752.00	0.07
242	002411	必康股份	4,400	124,696.00	0.06
243	000723	美锦能源	22,500	122,175.00	0.06
244	002426	胜利精密	33,500	120,600.00	0.06
245	601991	大唐发电	39,200	118,776.00	0.06
246	600372	XD 中航电	9,000	117,540.00	0.06
247	002468	申通快递	6,700	114,905.00	0.06
248	601958	金钼股份	16,500	103,455.00	0.05
249	600909	华安证券	18,000	102,960.00	0.05
250	000959	首钢股份	24,300	99,873.00	0.05
251	601611	中国核建	12,500	98,750.00	0.05
252	601881	中国银河	10,800	87,804.00	0.05
253	601718	际华集团	21,100	84,822.00	0.04
254	600233	圆通速递	6,400	84,480.00	0.04
255	002608	江苏国信	12,100	83,490.00	0.04
256	600188	兖州煤业	6,400	83,456.00	0.04
257	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.04
258	603833	欧派家居	600	76,518.00	0.04
259	002555	三七互娱	5,800	70,470.00	0.04
260	601228	广州港	11,800	68,558.00	0.04
261	600926	杭州银行	6,100	67,649.00	0.04
262	601878	浙商证券	8,000	67,200.00	0.03
263	601212	白银有色	16,300	66,667.00	0.03
264	603858	步长制药	1,500	64,185.00	0.03

265	600390	五矿资本	6,600	51,150.00	0.03
266	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.03
267	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.03
268	603160	汇顶科技	700	45,423.00	0.02
269	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.01
270	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600887	伊利股份	3,115,310.00	1.48
2	601012	隆基股份	994,057.00	0.47
3	601989	中国重工	979,281.00	0.47
4	601899	紫金矿业	871,960.00	0.41
5	600919	江苏银行	797,614.00	0.38
6	002027	分众传媒	707,708.60	0.34
7	600519	贵州茅台	692,896.00	0.33
8	601318	中国平安	585,236.00	0.28
9	002460	赣锋锂业	538,429.00	0.26
10	300136	信维通信	525,046.00	0.25
11	000100	TCL 集团	474,591.00	0.23
12	603799	华友钴业	473,000.00	0.22
13	000503	国新健康	472,366.66	0.22
14	601600	中国铝业	471,116.00	0.22
15	300003	乐普医疗	462,585.00	0.22
16	600011	华能国际	451,328.90	0.21
17	002572	索菲亚	349,838.00	0.17
18	300015	爱尔眼科	348,176.00	0.17
19	002594	比亚迪	344,474.00	0.16
20	600100	同方股份	335,795.00	0.16

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 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。

7.4.2 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	000002	万科 A	2,348,647.22	1.12
2	000651	格力电器	1,471,267.00	0.70
3	601328	交通银行	1,451,197.00	0.69
4	601766	中国中车	1,446,191.00	0.69
5	000166	申万宏源	1,133,185.00	0.54
6	600332	白云山	1,003,980.00	0.48
7	600362	江西铜业	880,497.00	0.42
8	000333	美的集团	785,767.00	0.37
9	300059	东方财富	686,582.00	0.33
10	600519	贵州茅台	667,918.00	0.32
11	603259	药明康德	611,534.95	0.29
12	000063	中兴通讯	602,627.40	0.29
13	600522	中天科技	602,252.00	0.29
14	002007	华兰生物	599,639.96	0.28
15	300251	光线传媒	577,716.00	0.27
16	000858	五粮液	539,510.00	0.26
17	002415	海康威视	432,124.00	0.21
18	600703	三安光电	414,071.00	0.20
19	002456	欧菲科技	400,409.00	0.19
20	000413	东旭光电	395,822.00	0.19

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	32,463,765.63
卖出股票收入（成交）总额	38,256,987.34

7.5 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	10,013,000.00	5.20
	其中：政策性金融债	10,013,000.00	5.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	19,464,000.00	10.10
9	其他	-	-
10	合计	29,477,000.00	15.29

7.6 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	170211	17 国开 11	100,000	10,013,000.00	5.20
2	111810253	18 兴业银行 CD253	100,000	9,903,000.00	5.14
3	111713145	17 浙商银行 CD145	100,000	9,561,000.00	4.96

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.118 兴业银行 CD253（代码：111810253）、兴业银行（兴业银行：601166）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重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告、非真实转让信贷资产、无授信额度或超授信额度办理同业业务等行为给予罚款人民币 5870 万元的行政处罚。

招商银行（招商银行：600036）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招商银行违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户等行为给予罚款人民币 6570 万元的行政处罚。

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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	5,615.99
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	577,232.96
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	582,848.95

7.12.4 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。

7.12.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
广发安盈混合 A	103	1,899,736.21	195,501,466.28	99.91%	171,363.75	0.09%
广发安盈混合 C	108	4,903.32	0.00	0.00%	529,558.67	100.00%
合计	211	929,869.14	195,501,466.28	99.64%	700,922.42	0.36%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发安盈混合 A	649.35	0.0003%
	广发安盈混合 C	780.00	0.1473%
	合计	1,429.35	0.0007%

8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	广发安盈混合 A	0
	广发安盈混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	广发安盈混合 A	0
	广发安盈混合 C	0~10

	合计	0~10
--	----	------

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发安盈混合 A	广发安盈混合 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 9 日）基金份额总额	200,004,108.89	1,050.00
本报告期期初基金份额总额	195,535,674.42	58,474.69
本报告期基金总申购份额	253,250.24	871,958.50
减：本报告期基金总赎回份额	116,094.63	400,874.52
本报告期基金拆分变动份额	0.00	0.00
本报告期末基金份额总额	195,672,830.03	529,558.67

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 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和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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
广发证券	3	37,327,847.92	54.32%	34,762.68	60.23%	-
安信证券	1	31,392,319.97	45.68%	22,956.89	39.77%	-
山西证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
华创证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	新增 1 个

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。

10.7.2 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
广发证券	1,754,565.34	94.88%	-	-	-	-
安信证券	94,712.52	5.12%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于广发安盈灵活配置混合型证券投资基金修改基金合同的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2018-03-22

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20180101-20180630	97,750,733.14	-	-	97,750,733.14	49.82%
	2	20180101-20180630	97,750,733.14	-	-	97,750,733.14	49.82%
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>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发安盈灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发安盈灵活配置混合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) 《广发安盈灵活配置混合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

12.2 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

12.3 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
二〇一八年八月二十四日