

**广发稳安灵活配置混合型证券投资基金**  
**(原广发稳安保本混合型证券投资基金)**

**2019年第1季度报告**

**2019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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年四月二十二日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 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。

本基金系原广发稳安保本混合型证券投资基金转型而来。广发稳安保本混合型证券投资基金于 2016 年 2 月 4 日正式成立，根据《广发稳安保本混合型证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）的有关规定，自《基金合同》生效之日（即 2016 年 2 月 4 日）起至三个公历年后对应日 2019 年 2 月 11 日止，本基金保本周期到期。保本周期到期后，由于未能符合保本基金存续条件，本基金管理人经与基金托管人协商一致，根据《基金合同》的规定，广发稳安保本混合型证券投资基金转型为非保本的“广发稳安灵活配置混合型证券投资基金”。转型后，基金管理人、基金托管人及基金登记机构不变；基金代码亦保持不变；基金名称、基金投资、基金费率、分红方式等将按照由本基金管理人根据《基金合同》的约定拟定的《广发稳安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关条款执行。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原广发稳安保本混合型证券投资基金报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 2 月 14 日止，广发稳安灵活配置混合型证券投资基金报告期自 2019 年 2 月 15 日至 2019 年 3 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

### 2.1 广发稳安灵活配置混合型证券投资基金

基金简称	广发稳安混合
------	--------

基金主代码	002295
交易代码	002295
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年2月15日
报告期末基金份额总额	266,996,254.58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	50%×沪深300指数收益率+50%×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。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

## 2.2 广发稳安保本混合型证券投资基金

基金简称	广发稳安保本
基金主代码	002295
交易代码	002295
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年2月4日
报告期末基金份额总额	427,004,234.13份

投资目标	本基金运用投资组合保险策略，在严格控制投资风险、保证保本周期到期时本金安全的基础上，实现基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金的保本策略为固定比例组合保险策略（CPPI），该策略的基本原理是将基金资产按一定比例划分为安全资产和风险资产，其中安全资产遵循保本要求将投资于各类债券及银行存款，以保证投资本金的安全性，进而起到到期保本的效果；而除安全资产外的风险资产主要投资于股票、权证、股指期货等权益类工具，以提升基金投资者的收益。
业绩比较基准	3年期银行定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的低风险品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金，低于股票基金和一般混合基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金保证人	北京首创融资担保有限公司

### §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 (2019年2月15日-2019 年3月31日)	报告期 (2019年1月1日-2019 年2月14日)
1.本期已实现收益	-32,895.12	-1,718,982.53
2.本期利润	2,046,702.43	5,883,448.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0066	0.0078
4.期末基金资产净值	291,806,321.63	463,683,585.52

5.期末基金份额净值	1.093	1.086
------------	-------	-------

注：（1）本基金转型日为2019年2月15日，至披露时点不满一季度。

（2）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（3）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 广发稳安灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2019年2月15日-2019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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.64%	0.11%	6.99%	0.95%	-6.35%	-0.84%

注：（1）业绩比较基准： $50\% \times \text{沪深300指数收益率} + 50\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

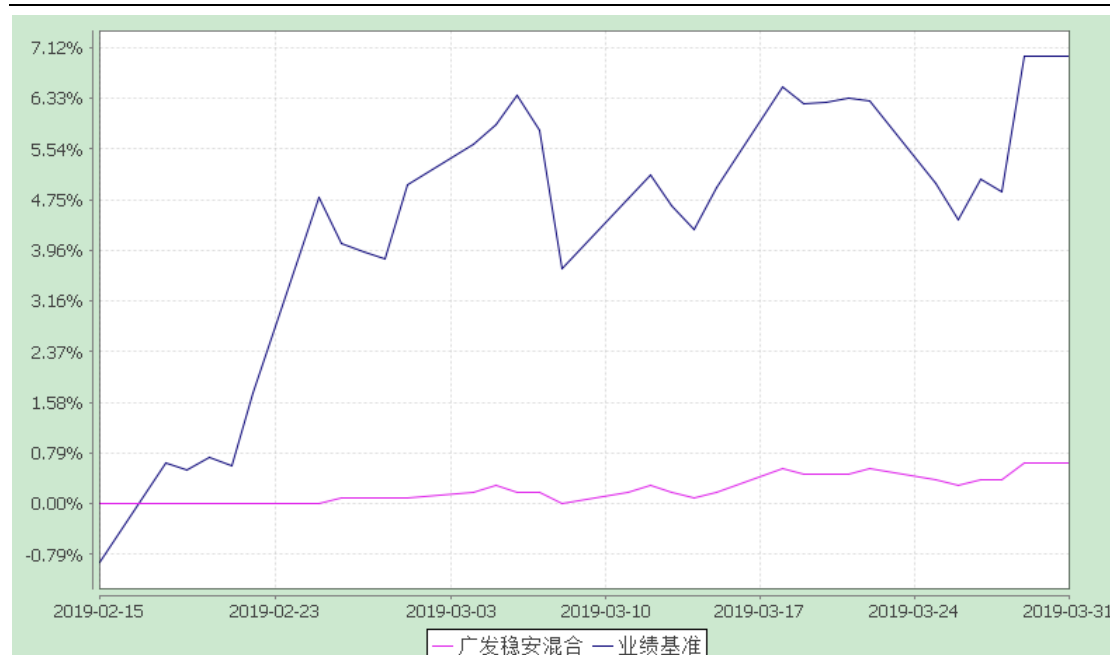
（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

#### 3.2.1.2 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

广发稳安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

(2019年2月15日-2019年3月31日)



注：(1)本基金转型日期为2019年2月15日，至披露时点本基金成立未满一年。  
 (2)本基金建仓期为基金合同生效后6个月，至披露时点本基金仍处于建仓期。

### 3.2.2 广发稳安保本混合型证券投资基金

(报告期：2019年1月1日-2019年2月14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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.65%	0.07%	0.34%	0.00%	0.31%	0.07%

#### 3.2.2.2 自基金合同生效日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

广发稳安保本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2月4日-2019年2月14日)



## §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		
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	2017-10-31	2019-04-10	16年	谢军先生，金融学硕士，CFA，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理、固定收益部总经理、广发货币市场基金基金经理（自2006年9月12日至2010年4月29日）、广发聚祥保本混合型证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

	<p>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;广发安悦回报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金的基金经理;广发集瑞债券型</p>				<p>基金基金经理(自2017年1月10日至2018年1月6日)、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2016年12月2日至2018年6月12日)、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月9日至2018年10月9日)、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年1月10日至2018年10月30日)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月18日至2018年11月9日)、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日至2019年2月14日)。</p>
--	---	--	--	--	---



	证券投资基金的基金经理; 广发景华纯债债券型证券投资基金的基金经理; 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; 广发景源纯债债券型证券投资基金的基金经理; 广发景祥纯债债券型				
--	--	--	--	--	--

	证券投资基金的基金经理；广发理财年年红债券型证券投资基金的基金经理；广发聚安混合型证券投资基金的基金经理；广发聚宝混合型证券投资基金的基金经理；广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金的基金				
--	--	--	--	--	--

	经理； 广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理； 广发鑫和灵活配置混合型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 券券 型型 证证 券券 投投 资资 基基 金金 的的 基基 金金 经经 理理；广 发景 润纯 债债 券券 型型 证证 券券 投投 资资 基基 金金 的的 基基 金金 经经 理理；广 发汇 立定 期开 放债 券券 型型 发发 起起 式式 证证 券券 投投 资资 基基 金金 的的 基基 金金 经经 理理；广 发集 裕裕 债债 券券 型型 证证 券券 投投 资资 基基 金金 的的 基基 金金				
--	---	--	--	--	--

	<p>经理； 广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理； 广发汇承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</p>				
谭昌杰	<p>本基金的基金经理； 广发理财年年红债券型证券投资基金的基金经理； 广</p>	2016-02-04	-	11年	<p>谭昌杰先生，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研究员、广发双债添利债券型证券投资基金基金经理（自2012年9月20日至2015年5月27日）、广发天天红发起式货币市场基金基金经理（自2013年10月22日至2017年10月31日）、广发钱袋子货币市场基金基金经理（自2014年1月10日</p>

	<p>发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理; 广发聚安混合型证券投资基金的基金经理; 广发聚宝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金的基金经理; 广发汇瑞3个月</p>				<p>至 2015 年 7 月 24 日)、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理 (自 2014 年 1 月 27 日至 2015 年 5 月 27 日)、广发天天利货币市场基金基金经理(自 2014 年 1 月 27 日至 2015 年 7 月 24 日)、广发季季利理财债券型证券投资基金基金经理 (自 2014 年 9 月 29 日至 2015 年 4 月 30 日)、广发聚康混合型证券投资基金基金经理 (自 2015 年 6 月 1 日至 2016 年 5 月 24 日)、广发安泽回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理 (自 2016 年 6 月 17 日至 2016 年 11 月 17 日)、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理 (自 2016 年 11 月 18 日至 2017 年 12 月 22 日)、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理 (自 2016 年 2 月 4 日至 2019 年 2 月 14 日)。</p>
--	---	--	--	--	--

	<p>定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发集瑞债券型证券投资基金的基金经理；广发景华纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发景祥纯债债券型证券投资基金的基金经理；广发景源纯债债券型</p>				
--	---	--	--	--	--

	证券投资基金的基金经理				
--	-------------	--	--	--	--

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。

3.根据本基金管理人发布的《广发基金管理有限公司广发稳安灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告》，自2019年4月10日起，谢军先生不再担任本基金基金经理。

#### 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、《广发稳安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 公平交易专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库，重点投资的股票必须来源于核心股票库，投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了



公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外）或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本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 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

本季度的宏观金融数据开始企稳，配合降税减费政策落地，同时一线及周边房地产交易逐步活跃、三四线城市消费呈现较强的韧性，导致市场对多类资产都开始转为乐观。以避险属性为主的债券资产在此背景下受到一定程度的冲击，尽管短端资金面宽松使得短端收益率维持低位，但长周期利率债的波动率有所加大，利率水平略有上移。权益资产全面上涨。本基金已经转为灵活配置型基金，后续以获取低风险的绝对回报作为投资目标。转型为灵活配置基金后，持仓结构以AAA 国企债为主，小幅增持权益资产。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金由广发稳安保本转型为广发稳安混合，在2019年1月1日至2019年2月14日，广发稳安保本的净值增长率为0.65%，同期业绩比较基准收益率为0.34%；在2019年2月15日至2019年3月31日，广发稳安混合的净值增长率为0.64%，同期业绩比较基准收益率为6.99%。

## §5 投资组合报告

### 5.1 广发稳安灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2019年2月15日-2019年3月31日）

#### 5.1.1 报告期末基金资产组合情况

广发稳安灵活配置混合型证券投资基金(原广发稳安保本混合型证券投资基金)2019年第1季度报告

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	22,490,695.80	7.62
	其中：股票	22,490,695.80	7.62
2	固定收益投资	163,528,719.50	55.39
	其中：债券	143,528,719.50	48.61
	资产支持证券	20,000,000.00	6.77
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	104,300,550.00	35.33
	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	556,119.58	0.19
7	其他各项资产	4,378,846.78	1.48
8	合计	295,254,931.66	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

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	6,090,900.80	2.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,604,000.00	1.58
F	批发和零售业	5,802,000.00	1.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,795.00	0.00
K	房地产业	3,456,000.00	1.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,534,000.00	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,490,695.80	7.71

#### 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603939	益丰药房	100,000	5,802,000.00	1.99
2	601186	中国铁建	400,000	4,604,000.00	1.58
3	300003	乐普医疗	140,000	3,710,000.00	1.27
4	001979	招商蛇口	150,000	3,456,000.00	1.18
5	300284	苏交科	200,000	2,534,000.00	0.87
6	300357	我武生物	49,935	2,380,900.80	0.82
7	002958	青农商行	500	3,795.00	0.00

#### 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	19,974,000.00	6.84
	其中：政策性金融债	19,974,000.00	6.84
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	80,054,000.00	27.43
6	中期票据	40,660,000.00	13.93
7	可转债（可交换债）	2,840,719.50	0.97
8	同业存单	-	-
8	其他	-	-
9	合计	143,528,719.50	49.19

### 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	101766012	17 大唐集 MTN005	200,000	20,610,000.00	7.06
2	101900255	19 首钢 MTN002	200,000	20,050,000.00	6.87
3	011900528	19 桂交投 SCP001	200,000	20,022,000.00	6.86
4	011900543	19 邯鄲矿业 SCP003	200,000	20,016,000.00	6.86
5	011900462	19 鲁钢铁 SCP002	200,000	20,010,000.00	6.86

### 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	99BJ08	链融 09A1	200,000	20,000,000.00	6.85

### 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	60,886.64
2	应收证券清算款	3,602,679.21
3	应收股利	-
4	应收利息	714,769.11
5	应收申购款	511.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,378,846.78

**5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132010	17 桐昆 EB	1,847,250.00	0.63

**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 广发稳安保本混合型证券投资基金

(报告期: 2019年1月1日-2019年2月14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	37,890.85	0.01
	其中: 股票	37,890.85	0.01
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
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	615,156,402.09	99.95
7	其他各项资产	278,539.64	0.05
8	合计	615,472,832.58	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

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	37,890.85	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	37,890.85	0.01

#### 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300761	立华股份	1,291	37,890.85	0.01

#### 5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券投资。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券投资。

## 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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	73,706.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	204,833.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-



9	合计	278,539.64
---	----	------------

#### 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300761	立华股份	37,890.85	0.01	新股流通受限

### §6 开放式基金份额变动

#### 6.1 广发稳安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	427,004,234.13
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	389,858.50
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	160,397,838.05
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	266,996,254.58

#### 6.2 广发稳安保本混合型证券投资基金

单位：份

本报告期期初基金份额总额	878,066,146.49
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	107,014.56
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	451,168,926.92
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	427,004,234.13

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

#### 7.1.1 广发稳安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。

#### 7.1.2 广发稳安保本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 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 影响投资者决策的其他重要信息

广发稳安保本混合型证券投资基金于2016年2月4日正式成立，根据《广发稳安保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的保本期为三年，即2016年2月4日起至2019年2月11日止，本基金保本周期到期。由于保本周期到期后未能符合保本基金存续条件，所以本基金转型为非保本的混合型证券投资基金，转型后的基金名称为“广发稳安灵活配置混合型证券投资基金”，基金投资、基金费率、分红方式等将按照《广发稳安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关条款执行。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于广发稳安保本混合型证券投资基金保本周期到期安排及转型为广发稳安灵活配置混合型证券投资基金相关业务规则的公告》和《关于广发稳安保本混合型证券投资基金修订基金合同的公告》。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- （一）《广发稳安灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- （二）《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- （三）《广发稳安灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(四) 法律意见书

(五) 基金管理人业务资格批件、营业执照

(六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

## 9.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

## 9.3 查阅方式

1. 书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司  
二〇一九年四月二十二日