

# 广发安盈灵活配置混合型证券投资基金

## 2019 年半年度报告

### 2019 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

送出日期：二〇一九年八月二十八日

## 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 2019 年 8 月 26 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>4 管理人报告</b> .....	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遵规守信情况的说明.....	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.....	13
<b>5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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真实、准确和完整发表意见.....	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	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
<b>7 投资组合报告</b> .....	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
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.....	42
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.....	44
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.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
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
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>47</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>48</b>
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
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>50</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>51</b>
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	
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	196,181,943.04 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发安盈混合 A	广发安盈混合 C
下属分级基金的交易代码	002118	002119
报告期末下属分级基金的份额总额	195,620,947.89 份	560,995.15 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	邱春杨	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	qcy@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	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	刘连舸

## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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

## 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（2019年1月1日至2019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	-613,524.96	-2,771.90
本期利润	42,771,735.64	116,196.86
加权平均基金份额本期利润	0.2186	0.2038
本期加权平均净值利润率	21.10%	19.59%
本期基金份额净值增长率	24.83%	24.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019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	7,650,064.19	22,292.84
期末可供分配基金份额利润	0.0391	0.0397
期末基金资产净值	215,362,804.94	617,637.93
期末基金份额净值	1.101	1.101

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019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	10.10%	10.11%

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	5.26%	0.98%	2.02%	0.34%	3.24%	0.64%
过去三个月	0.73%	1.27%	0.08%	0.44%	0.65%	0.83%
过去六个月	24.83%	1.28%	9.57%	0.45%	15.26%	0.83%
过去一年	12.12%	1.27%	7.21%	0.45%	4.91%	0.82%
自基金合同生效起至今	10.10%	0.93%	9.95%	0.35%	0.15%	0.58%

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	5.26%	0.98%	2.02%	0.34%	3.24%	0.64%
过去三个月	0.73%	1.29%	0.08%	0.44%	0.65%	0.85%
过去六个月	24.55%	1.29%	9.57%	0.45%	14.98%	0.84%
过去一年	11.66%	1.27%	7.21%	0.45%	4.45%	0.82%
自基金合同生效起至今	10.11%	0.94%	9.95%	0.35%	0.16%	0.59%

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 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 2019 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 32 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、养老金部、战略与创新业务部、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 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百九十只开放式基金，管理公募基金规模为 4452 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；广发理财 7 天债券型证券投资基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经	2016-12-09	-	11 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)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自

	理；广发天天利货币市场基金的基金经理；广发钱袋子货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的基金经理；广发聚泰混合型证券投资基金的基金经理；广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理；广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理				2016 年 12 月 2 日至 2018 年 11 月 9 日)、广发纯债债券型证券投资基金基金经理(自 2012 年 12 月 12 日至 2019 年 1 月 8 日)、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 日至 2019 年 3 月 26 日)。
--	---	--	--	--	--

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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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

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。

#### 4.3.2 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（完全复制指数组合及量化组合除外）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。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 4 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 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，与宏观经济走势相对应，货币市场利率先边际收敛，后逐月宽松。具体来看：

一季度，大部分时间里资金面相当宽松，但部分时间段资金面有所波动，包括 2 月末资金面超预期转紧、3 月中旬资金面面临时点性的收紧压力等。新增的变化是，央行在解读金融数据时提到降准空间已经没有很大，结合总理此前提到的打击票据空转套利，市场担忧央行货币政策态度边际变化。

随着 4 月降准预期落空，市场确认货币政策转入观察期，短期内流动性宽松不会进一步加码，引发债券市场一轮快速调整；但 5 月中美谈判波澜再起，央行盘前通过完善三档两优的框架对县域农商行定向降准，加上资金利率一度非常宽松，市场开始预期逆周期政策重新加码。但随后一季度货政报告定调确认、人民币汇率急贬至敏感关口，市场再度回归货币政策观察期、难以大幅宽松的一致预期。月底，部分银行的风险事件引发市场动荡，为切断风险扩散，央行一方面加量投放，另一方面通过多种结构性手段直接对接中小银行和非银。从 6 月的资金利率来看，结构性问题有所改善但幅度有限，流动性更多淤积在高信用机构市场，造成这些机构之间的回购利率异常走低。

上半年宏观经济预期一波三折：宏观预期年初较悲观，随后社融数据大超预期、一季度经济数据偏强表现，市场乐观预期迅速升温。但 4 月数据明显向下，5 月继续走弱，宏观预期重新向下修正。

本基金延续此前的配置思路，选取具备持续成长性的股票进行配置。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，本基金 A 类基金份额净值增长率为 24.83%，C 类基金份额净值增长率为 24.55%，同期业绩比较基准收益率为 9.57%。

#### 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，但货币市场收益已经处于近几年最低的位置，能否维持尚存疑问。未来需要进一步观察中美贸易摩擦以及国内经济下滑程度。而信用方面，信用扩张随着货币政策的宽松已经进行了将近一年的时间。在当前环境下，不同金融机构和不同资质企业主体的信用扩张能力差异很大，预计这种割裂和分化的情况仍会持续下去。在经济下滑期，信用风险的爆发预计也会持续下去。所以在此过程中，我们必须选择经过风险调整后性价比较高的资产进行配置。

#### 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应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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	9,379,266.48	6,304,475.47
结算备付金		-	-
存出保证金		1,475.75	332.81
交易性金融资产	6.4.7.2	206,197,227.60	167,012,565.39
其中：股票投资		176,742,227.60	137,567,565.39
基金投资		-	-
债券投资		29,455,000.00	29,445,000.00
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		-	40,629.42
应收利息	6.4.7.5	708,485.59	221,849.35
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		216,286,455.42	173,579,852.44
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		103,050.87	90,792.03
应付托管费		17,175.16	15,132.02
应付销售服务费		198.37	163.28
应付交易费用	6.4.7.7	9,262.78	698.85
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	176,325.37	343,000.00
负债合计		306,012.55	449,786.18
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	196,181,943.04	196,212,049.46
未分配利润	6.4.7.10	19,798,499.83	-23,081,983.20
所有者权益合计		215,980,442.87	173,130,066.26

负债和所有者权益总计		216,286,455.42	173,579,852.44
------------	--	----------------	----------------

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，广发安盈混合 A 基金份额净值人民币 1.101 元，基金份额总额 195,620,947.89 份；广发安盈混合 C 基金份额净值人民币 1.101 元，基金份额总额 560,995.15 份；总份额总额 196,181,943.04 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>43,728,180.49</b>	<b>-17,401,929.15</b>
1.利息收入		511,361.50	490,482.61
其中：存款利息收入	6.4.7.11	24,273.07	27,460.25
债券利息收入		487,088.43	463,022.36
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-288,004.67	4,417,833.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,183,488.75	2,666,649.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	18,625.90	-3,903.21
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	1,876,858.18	1,755,086.51
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	43,504,229.36	-22,312,646.03
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	594.30	2,401.22
<b>减：二、费用</b>		<b>840,247.99</b>	<b>1,019,254.26</b>
1. 管理人报酬		603,475.17	623,122.18
2. 托管费		100,579.20	103,853.74
3. 销售服务费		1,171.69	852.18
4. 交易费用	6.4.7.18	47,991.16	102,437.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.40	5.28

7. 其他费用	6.4.7.19	87,030.37	188,983.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>42,887,932.50</b>	<b>-18,421,183.41</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>42,887,932.50</b>	<b>-18,421,183.41</b>

### 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	196,212,049.46	-23,081,983.20	173,130,066.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,887,932.50	42,887,932.50
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）	-30,106.42	-7,449.47	-37,555.89
其中：1.基金申购款	258,853.65	18,886.44	277,740.09
2.基金赎回款	-288,960.07	-26,335.91	-315,295.98
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）	196,181,943.04	19,798,499.83	215,980,442.87
项目	上年度可比期间 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

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《关于准予广发安盈灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2015]2563 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 11 月 29 日向社会公开发行募集并于 2016 年 12 月 9 日正式成立。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，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。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 26 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 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

##### (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。

#### 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 2019年6月30日
活期存款	9,379,266.48
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	9,379,266.48

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	164,965,892.58	176,742,227.60	11,776,335.02	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	29,406,560.00	29,455,000.00	48,440.00
	合计	29,406,560.00	29,455,000.00	48,440.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	194,372,452.58	206,197,227.60	11,824,775.02	

##### 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 2019年6月30日

应收活期存款利息	1,835.03
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	0.70
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	706,649.86
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	708,485.59

#### 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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	9,262.78
银行间市场应付交易费用	-
合计	9,262.78

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019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	176,325.37
合计	176,325.37

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	195,684,073.16	195,684,073.16
本期申购	38,491.87	38,491.87
本期赎回（以“-”号填列）	-101,617.14	-101,617.14

本期末	195,620,947.89	195,620,947.89
-----	----------------	----------------

广发安盈混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	527,976.30	527,976.30
本期申购	220,361.78	220,361.78
本期赎回（以“-”号填列）	-187,342.93	-187,342.93
本期末	560,995.15	560,995.15

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	8,265,907.34	-31,286,469.04	-23,020,561.70
本期利润	-613,524.96	43,385,260.60	42,771,735.64
本期基金份额交易产生的变动数	-2,318.19	-6,998.70	-9,316.89
其中：基金申购款	1,572.79	692.76	2,265.55
基金赎回款	-3,890.98	-7,691.46	-11,582.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,650,064.19	12,091,792.86	19,741,857.05

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	23,404.90	-84,826.40	-61,421.50
本期利润	-2,771.90	118,968.76	116,196.86
本期基金份额交易产生的变动数	1,659.84	207.58	1,867.42
其中：基金申购款	9,328.05	7,292.84	16,620.89
基金赎回款	-7,668.21	-7,085.26	-14,753.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	22,292.84	34,349.94	56,642.78

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	24,113.70
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	9.88
结算备付金利息收入	149.49
其他	-
合计	24,273.07

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	18,012,407.70
减：卖出股票成本总额	20,195,896.45
买卖股票差价收入	-2,183,488.75

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	585,953.75
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	567,200.00
减：应收利息总额	127.85
买卖债券差价收入	18,625.90

#### 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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,876,858.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,876,858.18

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	43,504,229.36

——股票投资	43,494,229.36
——债券投资	10,000.00
——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	43,504,229.36

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	40.08
基金转换费收入	554.22
合计	594.30

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	47,991.16
银行间市场交易费用	-
合计	47,991.16

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	16,860.15
信息披露费	50,465.22
银行汇划费	1,105.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	87,030.37

#### 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。

##### 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	18,427,140.17	57.28%	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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	710,023.80	91.72%	1,754,565.34	94.88%
------------	------------	--------	--------------	--------

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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	17,075.52	62.95%	5,703.04	61.57%
关联方名称	上年度可比期间 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 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	603,475.17	623,122.18
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 0.60% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年6月30日	2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	100,579.20	103,853.74

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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取。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		
	2019年1月1日至2019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	-	1,171.69	1,171.69
合计	-	1,171.69	1,171.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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

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自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自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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	9,379,266.48	24,113.70	2,440,139.54	26,588.97

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（2019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

60123 6	红塔 证券	2019-0 6-26	2019-0 7-05	新股 流通 受限	3.46	3.46	9,789. 00	33,869 .94	33,869 .94	-
30078 8	中信 出版	2019-0 6-27	2019-0 7-05	新股 流通 受限	14.85	14.85	1,556. 00	23,106 .60	23,106 .60	-

注：截至本报告期末 2019 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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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 2019 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 2019 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经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	29,455,000.00	29,445,000.00
合计	29,455,000.00	29,445,000.00

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 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
AAA	19,439,000.00	19,422,000.00
未评级	-	-
合计	19,439,000.00	19,422,000.00

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

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债券投资。

#### 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，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 2019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	9,379,266.48	-	-	-	9,379,266.48
存出保证金	1,475.75	-	-	-	1,475.75
交易性金融资产	29,455,000.00	-	-	176,742,227.60	206,197,227.60
应收利息	-	-	-	708,485.59	708,485.59
资产总计	38,835,742.23	-	-	177,450,713.19	216,286,455.42

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	103,050.87	103,050.87
应付托管费	-	-	-	17,175.16	17,175.16
应付销售服务费	-	-	-	198.37	198.37
应付交易费用	-	-	-	9,262.78	9,262.78
其他负债	-	-	-	176,325.37	176,325.37
负债总计	-	-	-	306,012.55	306,012.55
利率敏感度缺口	38,835,742.23	-	-	177,144,700.64	215,980,442.87
<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	6,304,475.47	-	-	-	6,304,475.47
存出保证金	332.81	-	-	-	332.81
交易性金融资产	29,445,000.00	-	-	137,567,565.39	167,012,565.39
应收证券清算款	-	-	-	40,629.42	40,629.42
应收利息	-	-	-	221,849.35	221,849.35
资产总计	35,749,808.28	-	-	137,830,044.16	173,579,852.44
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	90,792.03	90,792.03
应付托管费	-	-	-	15,132.02	15,132.02
应付交易费用	-	-	-	698.85	698.85
应付销售服务费	-	-	-	163.28	163.28
其他负债	-	-	-	343,000.00	343,000.00
负债总计	-	-	-	449,786.18	449,786.18
利率敏感度缺口	35,749,808.28	-	-	137,380,257.98	173,130,066.26

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

		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-14,740.34	-49,744.85
	市场利率下降 25 个基点	14,760.80	49,918.83

#### 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

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

#### 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	176,742,227.60	81.83	137,567,565.39	79.46
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	176,742,227.60	81.83	137,567,565.39	79.46

##### 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 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日

	业绩比较基准上升 5%	9,593,438.06	7,271,462.78
	业绩比较基准下降 5%	-9,593,438.06	-7,271,462.78

#### 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

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 2019 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人民币 176,685,251.06 元，属于第二层级的余额为人民币 29,511,976.54 元，无属于第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层级的余额为人民币 135,557,795.59 元，属于第二层级的余额为人民币 31,454,769.80 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	176,742,227.60	81.72

	其中：股票	176,742,227.60	81.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	29,455,000.00	13.62
	其中：债券	29,455,000.00	13.62
	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	9,379,266.48	4.34
8	其他各项资产	709,961.34	0.33
9	合计	216,286,455.42	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	574,966.20	0.27
B	采矿业	5,978,337.00	2.77
C	制造业	70,746,223.79	32.76
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,570,691.00	2.12
E	建筑业	5,703,350.00	2.64
F	批发和零售业	2,519,307.70	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	5,558,072.20	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,206,769.48	2.87
J	金融业	64,151,894.60	29.70
K	房地产业	6,836,637.00	3.17
L	租赁和商务服务业	2,251,636.60	1.04
M	科学研究和技术服务业	130,020.00	0.06
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	957,089.43	0.44
R	文化、体育和娱乐业	557,232.60	0.26
S	综合	-	-
	合计	176,742,227.60	81.83

### 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	168,908	14,966,937.88	6.93
2	600519	贵州茅台	7,800	7,675,200.00	3.55
3	600036	招商银行	160,800	5,785,584.00	2.68
4	000651	格力电器	75,000	4,125,000.00	1.91
5	000333	美的集团	72,400	3,754,664.00	1.74
6	000858	五粮液	30,200	3,562,090.00	1.65
7	601166	兴业银行	194,300	3,553,747.00	1.65
8	600887	伊利股份	94,900	3,170,609.00	1.47
9	600030	中信证券	123,000	2,928,630.00	1.36
10	600276	恒瑞医药	41,046	2,709,036.00	1.25
11	601328	交通银行	430,400	2,634,048.00	1.22
12	600016	民生银行	387,960	2,463,546.00	1.14
13	601288	农业银行	596,200	2,146,320.00	0.99
14	600000	浦发银行	182,800	2,135,104.00	0.99
15	000002	万科 A	76,200	2,119,122.00	0.98
16	601398	工商银行	337,400	1,987,286.00	0.92
17	601668	中国建筑	327,940	1,885,655.00	0.87
18	600900	长江电力	102,900	1,841,910.00	0.85
19	000001	平安银行	133,600	1,841,008.00	0.85
20	601601	中国太保	49,287	1,799,468.37	0.83
21	600837	海通证券	125,700	1,783,683.00	0.83
22	002415	海康威视	57,600	1,588,608.00	0.74
23	600048	保利地产	112,000	1,429,120.00	0.66
24	600104	上汽集团	54,600	1,392,300.00	0.64

25	601169	北京银行	231,800	1,369,938.00	0.63
26	601888	中国国旅	15,300	1,356,345.00	0.63
27	603288	海天味业	12,700	1,333,500.00	0.62
28	600585	海螺水泥	31,300	1,298,950.00	0.60
29	601211	国泰君安	70,400	1,291,840.00	0.60
30	000725	京东方 A	370,300	1,273,832.00	0.59
31	600009	上海机场	15,000	1,256,700.00	0.58
32	601766	中国中车	152,100	1,230,489.00	0.57
33	600031	三一重工	92,300	1,207,284.00	0.56
34	601688	华泰证券	51,200	1,142,784.00	0.53
35	002304	洋河股份	9,400	1,142,664.00	0.53
36	600028	中国石化	195,500	1,069,385.00	0.50
37	600309	万华化学	24,600	1,052,634.00	0.49
38	601229	上海银行	84,740	1,004,169.00	0.46
39	600690	海尔智家	56,700	980,343.00	0.45
40	002142	宁波银行	40,368	978,520.32	0.45
41	300059	东方财富	71,252	965,464.60	0.45
42	002475	立讯精密	38,680	958,877.20	0.44
43	601818	光大银行	248,800	947,928.00	0.44
44	000568	泸州老窖	11,500	929,545.00	0.43
45	000338	潍柴动力	75,600	929,124.00	0.43
46	600019	宝钢股份	140,400	912,600.00	0.42
47	601012	隆基股份	39,210	906,143.10	0.42
48	600050	中国联通	146,200	900,592.00	0.42
49	601857	中国石油	126,200	868,256.00	0.40
50	601989	中国重工	141,400	786,184.00	0.36
51	001979	招商蛇口	37,400	781,660.00	0.36
52	600919	江苏银行	107,200	778,272.00	0.36
53	601009	南京银行	93,600	773,136.00	0.36
54	601939	建设银行	103,900	773,016.00	0.36
55	002230	科大讯飞	23,100	767,844.00	0.36
56	600999	招商证券	44,506	760,607.54	0.35
57	601006	大秦铁路	93,100	753,179.00	0.35
58	601390	中国中铁	115,500	753,060.00	0.35
59	600015	华夏银行	96,700	744,590.00	0.34
60	601628	中国人寿	25,700	727,824.00	0.34
61	002594	比亚迪	14,300	725,296.00	0.34
62	601899	紫金矿业	190,500	718,185.00	0.33
63	601336	新华保险	13,000	715,390.00	0.33
64	601186	中国铁建	71,500	711,425.00	0.33
65	000661	长春高新	2,100	709,800.00	0.33
66	000538	云南白药	8,100	675,702.00	0.31
67	002024	苏宁易购	58,700	673,876.00	0.31
68	600570	恒生电子	9,850	671,277.50	0.31

69	600352	浙江龙盛	40,500	638,685.00	0.30
70	601088	中国神华	30,700	625,666.00	0.29
71	601933	永辉超市	59,500	607,495.00	0.28
72	002027	分众传媒	114,440	605,387.60	0.28
73	300015	爱尔眼科	19,239	595,831.83	0.28
74	600958	东方证券	55,200	589,536.00	0.27
75	601225	陕西煤业	62,800	580,272.00	0.27
76	002714	牧原股份	9,780	574,966.20	0.27
77	000100	TCL 集团	171,000	569,430.00	0.26
78	601155	新城控股	14,300	569,283.00	0.26
79	000876	新希望	32,600	566,262.00	0.26
80	600436	片仔癀	4,700	541,440.00	0.25
81	600406	国电南瑞	29,000	540,560.00	0.25
82	002202	金风科技	43,226	537,299.18	0.25
83	600741	华域汽车	24,600	531,360.00	0.25
84	000166	申万宏源	104,900	525,549.00	0.24
85	600588	用友网络	19,383	521,015.04	0.24
86	601669	中国电建	97,000	513,130.00	0.24
87	002736	国信证券	38,500	506,660.00	0.23
88	601377	兴业证券	74,400	501,456.00	0.23
89	600660	福耀玻璃	21,800	495,514.00	0.23
90	600886	国投电力	62,900	488,733.00	0.23
91	600010	包钢股份	281,400	475,566.00	0.22
92	600547	山东黄金	11,300	465,221.00	0.22
93	600795	国电电力	182,500	463,550.00	0.21
94	000783	长江证券	59,300	463,133.00	0.21
95	002008	大族激光	13,300	457,254.00	0.21
96	601901	方正证券	64,100	455,751.00	0.21
97	000069	华侨城 A	64,800	450,360.00	0.21
98	601111	中国国航	46,000	440,220.00	0.20
99	603993	洛阳钼业	109,700	434,412.00	0.20
100	600111	北方稀土	33,600	431,424.00	0.20
101	600089	特变电工	59,100	428,475.00	0.20
102	600011	华能国际	68,000	423,640.00	0.20
103	601800	中国交建	37,200	421,104.00	0.19
104	600438	通威股份	29,800	418,988.00	0.19
105	600383	金地集团	35,100	418,743.00	0.19
106	600029	南方航空	54,100	417,652.00	0.19
107	000157	中联重科	69,100	415,291.00	0.19
108	601985	中国核电	73,700	409,772.00	0.19
109	002236	大华股份	28,200	409,464.00	0.19
110	600271	航天信息	17,700	407,985.00	0.19
111	002007	华兰生物	13,170	401,553.30	0.19
112	002422	科伦药业	13,400	398,382.00	0.18

113	600196	复星医药	15,700	397,210.00	0.18
114	601600	中国铝业	101,200	396,704.00	0.18
115	600606	绿地控股	58,000	396,140.00	0.18
116	300003	乐普医疗	16,900	389,038.00	0.18
117	600115	东方航空	62,000	388,740.00	0.18
118	600705	中航资本	71,600	388,072.00	0.18
119	601555	东吴证券	37,700	386,425.00	0.18
120	000895	双汇发展	15,500	385,795.00	0.18
121	600109	国金证券	38,700	376,164.00	0.17
122	002311	海大集团	12,100	373,890.00	0.17
123	002044	美年健康	29,040	361,257.60	0.17
124	300124	汇川技术	15,600	357,396.00	0.17
125	000963	华东医药	13,680	355,132.80	0.16
126	600332	白云山	8,600	352,342.00	0.16
127	600018	上港集团	51,400	350,548.00	0.16
128	600522	中天科技	37,900	347,543.00	0.16
129	600637	东方明珠	32,920	346,976.80	0.16
130	601788	光大证券	30,100	343,742.00	0.16
131	601618	中国中冶	112,000	340,480.00	0.16
132	600487	亨通光电	20,300	340,228.00	0.16
133	000768	中航飞机	21,400	337,050.00	0.16
134	000425	徐工机械	74,400	331,824.00	0.15
135	601607	上海医药	18,200	330,330.00	0.15
136	600893	航发动力	14,300	324,753.00	0.15
137	300033	同花顺	3,300	324,588.00	0.15
138	300122	智飞生物	7,400	318,940.00	0.15
139	002271	东方雨虹	13,800	312,708.00	0.14
140	600176	中国巨石	32,500	309,725.00	0.14
141	300408	三环集团	15,910	309,449.50	0.14
142	601877	正泰电器	13,400	309,406.00	0.14
143	600516	方大炭素	25,032	307,643.28	0.14
144	601727	上海电气	56,500	303,970.00	0.14
145	601919	中远海控	59,200	297,184.00	0.14
146	601998	中信银行	48,900	291,933.00	0.14
147	300136	信维通信	11,900	290,955.00	0.13
148	000423	东阿阿胶	7,300	290,686.00	0.13
149	600100	同方股份	32,000	289,600.00	0.13
150	600004	白云机场	15,800	287,560.00	0.13
151	002460	赣锋锂业	12,200	285,846.00	0.13
152	600023	浙能电力	64,500	285,090.00	0.13
153	000728	国元证券	30,700	281,519.00	0.13
154	002241	歌尔股份	31,300	278,257.00	0.13
155	600809	山西汾酒	4,000	276,200.00	0.13
156	600066	宇通客车	21,200	276,024.00	0.13

157	601018	宁波港	62,300	273,497.00	0.13
158	002673	西部证券	27,000	272,160.00	0.13
159	600489	中金黄金	26,200	269,074.00	0.12
160	600926	杭州银行	32,240	268,559.20	0.12
161	002179	中航光电	7,970	266,676.20	0.12
162	600068	葛洲坝	42,800	266,644.00	0.12
163	600170	上海建工	70,900	266,584.00	0.12
164	601997	贵阳银行	30,800	266,420.00	0.12
165	300144	宋城演艺	11,500	266,110.00	0.12
166	002081	金螳螂	25,600	263,936.00	0.12
167	002001	新和成	13,600	262,344.00	0.12
168	600482	中国动力	11,100	262,182.00	0.12
169	600362	江西铜业	16,600	261,284.00	0.12
170	600219	南山铝业	115,240	260,442.40	0.12
171	300024	机器人	17,100	260,433.00	0.12
172	002352	顺丰控股	7,600	258,096.00	0.12
173	000961	中南建设	29,800	258,068.00	0.12
174	600398	海澜之家	28,400	257,588.00	0.12
175	601881	中国银河	20,900	256,025.00	0.12
176	300017	网宿科技	23,500	253,330.00	0.12
177	601198	东兴证券	21,200	251,856.00	0.12
178	000703	恒逸石化	18,300	249,978.00	0.12
179	002146	荣盛发展	26,300	246,957.00	0.11
180	600674	川投能源	27,400	243,860.00	0.11
181	600085	同仁堂	8,400	243,600.00	0.11
182	002493	荣盛石化	20,000	241,200.00	0.11
183	600535	天士力	14,400	238,320.00	0.11
184	000630	铜陵有色	95,400	234,684.00	0.11
185	000786	北新建材	12,861	233,169.93	0.11
186	600153	建发股份	26,200	232,656.00	0.11
187	600369	西南证券	45,500	224,770.00	0.10
188	603799	华友钴业	10,296	219,407.76	0.10
189	002797	第一创业	34,100	216,194.00	0.10
190	603833	欧派家居	2,000	215,240.00	0.10
191	600346	恒力石化	17,213	209,310.08	0.10
192	002065	东华软件	29,600	206,904.00	0.10
193	600118	中国卫星	9,000	202,950.00	0.09
194	002508	老板电器	7,457	202,382.98	0.09
195	000625	长安汽车	30,300	200,889.00	0.09
196	601992	金隅集团	53,300	200,408.00	0.09
197	601021	春秋航空	4,400	198,000.00	0.09
198	000503	国新健康	11,518	197,648.88	0.09
199	600549	厦门钨业	13,720	196,333.20	0.09
200	300296	利亚德	24,900	194,967.00	0.09

201	000709	河钢股份	65,000	194,350.00	0.09
202	603160	汇顶科技	1,400	194,320.00	0.09
203	601117	中国化学	32,000	192,640.00	0.09
204	600760	中航沈飞	6,600	191,598.00	0.09
205	603986	兆易创新	2,200	190,740.00	0.09
206	002572	索菲亚	10,200	189,312.00	0.09
207	600038	中直股份	4,600	188,692.00	0.09
208	600909	华安证券	28,700	187,698.00	0.09
209	600583	海油工程	33,500	187,600.00	0.09
210	600027	华电国际	49,600	186,992.00	0.09
211	002050	三花智控	17,680	186,524.00	0.09
212	601878	浙商证券	20,000	186,000.00	0.09
213	600415	小商品城	44,200	182,104.00	0.08
214	002032	苏泊尔	2,400	181,992.00	0.08
215	600977	中国电影	11,600	181,656.00	0.08
216	600061	国投资本	12,900	180,729.00	0.08
217	600297	广汇汽车	40,300	179,738.00	0.08
218	601216	君正集团	54,400	178,976.00	0.08
219	603858	步长制药	6,880	177,297.60	0.08
220	600688	上海石化	33,700	173,892.00	0.08
221	600816	安信信托	34,207	172,745.35	0.08
222	002153	石基信息	4,700	170,093.00	0.08
223	000671	阳光城	25,800	167,184.00	0.08
224	601333	广深铁路	50,500	163,115.00	0.08
225	601238	广汽集团	14,680	160,452.40	0.07
226	002624	完美世界	6,190	159,763.90	0.07
227	601633	长城汽车	19,200	158,784.00	0.07
228	000983	西山煤电	25,800	156,348.00	0.07
229	600566	济川药业	5,100	153,561.00	0.07
230	601066	中信建投	6,900	145,452.00	0.07
231	000627	天茂集团	22,200	144,078.00	0.07
232	600188	兖州煤业	13,200	143,484.00	0.07
233	601898	中煤能源	29,600	142,080.00	0.07
234	601360	三六零	6,600	141,108.00	0.07
235	002294	信立泰	6,300	140,994.00	0.07
236	600704	物产中大	25,845	140,079.90	0.06
237	000898	鞍钢股份	36,140	136,970.60	0.06
238	002601	龙蟠佰利	9,100	134,953.00	0.06
239	603259	药明康德	1,500	130,020.00	0.06
240	600968	海油发展	35,240	125,102.00	0.06
241	601228	广州港	29,900	124,982.00	0.06
242	002468	申通快递	5,000	124,700.00	0.06
243	002602	世纪华通	11,328	123,701.76	0.06
244	600372	中航电子	8,200	121,688.00	0.06

245	601991	大唐发电	39,000	120,510.00	0.06
246	000938	紫光股份	4,340	118,265.00	0.05
247	000415	渤海租赁	27,500	107,800.00	0.05
248	600025	华能水电	26,200	106,634.00	0.05
249	600339	中油工程	24,800	104,656.00	0.05
250	002773	康弘药业	2,730	89,871.60	0.04
251	601611	中国核建	11,400	88,692.00	0.04
252	601808	中海油服	9,200	88,596.00	0.04
253	300433	蓝思科技	12,700	88,519.00	0.04
254	002120	韵达股份	2,860	88,145.20	0.04
255	000959	首钢股份	24,900	87,648.00	0.04
256	300251	光线传媒	12,700	86,360.00	0.04
257	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.04
258	000408	藏格控股	9,500	78,565.00	0.04
259	601108	财通证券	6,800	74,664.00	0.03
260	600390	五矿资本	7,700	72,611.00	0.03
261	001965	招商公路	8,600	71,638.00	0.03
262	600233	圆通速递	5,200	64,116.00	0.03
263	601838	成都银行	6,200	54,746.00	0.03
264	002925	盈趣科技	1,300	50,713.00	0.02
265	603260	合盛硅业	1,000	47,060.00	0.02
266	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
267	603156	养元饮品	980	36,338.40	0.02
268	603863	松炆资源	1,500	34,620.00	0.02
269	000553	安道麦 A	3,200	34,304.00	0.02
270	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
271	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
272	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
273	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	000661	长春高新	663,119.00	0.38
2	601318	中国平安	436,747.00	0.25
3	601766	中国中车	420,076.00	0.24
4	300142	沃森生物	410,102.00	0.24
5	603993	洛阳钼业	342,385.00	0.20

6	002311	海大集团	333,040.00	0.19
7	002422	科伦药业	324,853.74	0.19
8	600340	华夏幸福	293,460.00	0.17
9	601138	工业富联	290,484.00	0.17
10	002271	东方雨虹	278,393.00	0.16
11	600989	宝丰能源	270,838.72	0.16
12	601211	国泰君安	267,205.00	0.15
13	002179	中航光电	260,991.00	0.15
14	000703	恒逸石化	253,543.00	0.15
15	601390	中国中铁	252,852.00	0.15
16	601857	中国石油	252,740.00	0.15
17	002001	新 和 成	246,483.00	0.14
18	600027	华电国际	234,556.00	0.14
19	300296	利亚德	222,682.00	0.13
20	600760	中航沈飞	221,524.68	0.13

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	600340	华夏幸福	823,621.00	0.48
2	300142	沃森生物	464,283.00	0.27
3	601099	太平洋	429,087.00	0.25
4	600703	三安光电	421,984.00	0.24
5	600989	宝丰能源	372,646.80	0.22
6	600276	恒瑞医药	369,289.00	0.21
7	600177	雅戈尔	369,159.00	0.21
8	600016	民生银行	355,554.00	0.21
9	002456	欧菲光	341,073.00	0.20
10	600867	通化东宝	319,577.00	0.18
11	002466	天齐锂业	307,153.00	0.18
12	002415	海康威视	288,717.00	0.17
13	300070	碧水源	246,104.49	0.14
14	002450	*ST 康得	242,864.00	0.14
15	300059	东方财富	239,714.00	0.14
16	600804	鹏博士	233,418.00	0.13
17	002500	山西证券	228,200.00	0.13

18	600157	永泰能源	226,368.00	0.13
19	600928	西安银行	220,122.72	0.13
20	601138	工业富联	218,286.14	0.13

#### 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	15,876,329.30
卖出股票收入（成交）总额	18,012,407.70

#### 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	10,016,000.00	4.64
	其中：政策性金融债	10,016,000.00	4.64
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	19,439,000.00	9.00
9	其他	-	-
10	合计	29,455,000.00	13.64

#### 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	180312	18 进出 12	100,000	10,016,000.00	4.64
2	111810477	18 兴业银行 CD477	100,000	9,751,000.00	4.51

3	111815570	18 民生银行 CD570	100,000	9,688,000.00	4.49
---	-----------	---------------	---------	--------------	------

### 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

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国民生银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会（含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会）或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他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** 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。

#### 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	1,475.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	708,485.59
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	709,961.34

#### 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	96	2,037,718.21	195,501,466.28	99.94%	119,481.61	0.06%
广发安盈混合 C	126	4,452.34	0.00	0.00%	560,995.15	100.00%

合计	222	883,702.45	195,501,466.28	99.65%	680,476.76	0.35%
----	-----	------------	----------------	--------	------------	-------

### 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	640.91	0.0003%
	广发安盈混合 C	1,049.80	0.1871%
	合计	1,690.71	0.0009%

### 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、基金投资和研究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	195,684,073.16	527,976.30
本报告期基金总申购份额	38,491.87	220,361.78
减：本报告期基金总赎回份额	101,617.14	187,342.93
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	195,620,947.89	560,995.15

## 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

本基金管理人于 2019 年 6 月 4 日发布公告，自 2019 年 6 月 1 日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。

2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、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

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 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、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	
安信证券	1	13,740,719.83	42.72%	10,048.82	37.05%	-
广发证券	3	18,427,140.17	57.28%	17,075.52	62.95%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-

华西证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	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。

#### 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
安信证券	64,129.95	8.28%	-	-	-	-
广发证券	710,023.80	91.72%	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-

东莞证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

### 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	关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-21
2	关于广发安盈灵活配置混合型证券投资基金调整申购限额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-20
3	关于调整旗下基金首次申购、追加申购及定期定额投资最低数额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-01

## 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	20190101-20190630	97,750,733.14	-	-	97,750,733.14	49.83%
	2	20190101-20190630	97,750,733.14	-	-	97,750,733.14	49.83%
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。

## 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：投资者可在营业时间免费查阅，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  
二〇一九年八月二十八日