

广发睿享稳健增利混合型证券投资基金

2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年十月二十六日

§ 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 24 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发睿享稳健增利混合
基金主代码	007251
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 8 月 21 日
报告期末基金份额总额	182,912,694.75 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健增值。
投资策略	本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动

	性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。	
业绩比较基准	中证全债指数收益率×75%+中证 800 指数收益率×25%	
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	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发睿享稳健增利混合 A	广发睿享稳健增利混合 C
下属分级基金的交易代码	007251	011702
报告期末下属分级基金的份额总额	152,261,615.82 份	30,651,078.93 份

§ 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 (2022 年 7 月 1 日-2022 年 9 月 30 日)	
	广发睿享稳健增利混合 A	广发睿享稳健增利混合 C
1.本期已实现收益	-2,044,254.83	127,900.62
2.本期利润	-15,201,626.79	-3,445,416.03

3.加权平均基金份额本期利润	-0.1007	-0.0697
4.期末基金资产净值	144,938,191.15	29,128,094.89
5.期末基金份额净值	0.9519	0.9503

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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

1、广发睿享稳健增利混合 A:

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	-9.51%	1.24%	-2.50%	0.23%	-7.01%	1.01%
过去六个月	-4.63%	1.15%	-0.32%	0.30%	-4.31%	0.85%
过去一年	-14.76%	1.06%	-1.95%	0.30%	-12.81%	0.76%
过去三年	-4.91%	0.69%	12.67%	0.31%	-17.58%	0.38%
自基金合同生效起至今	-4.81%	0.68%	12.97%	0.30%	-17.78%	0.38%

2、广发睿享稳健增利混合 C:

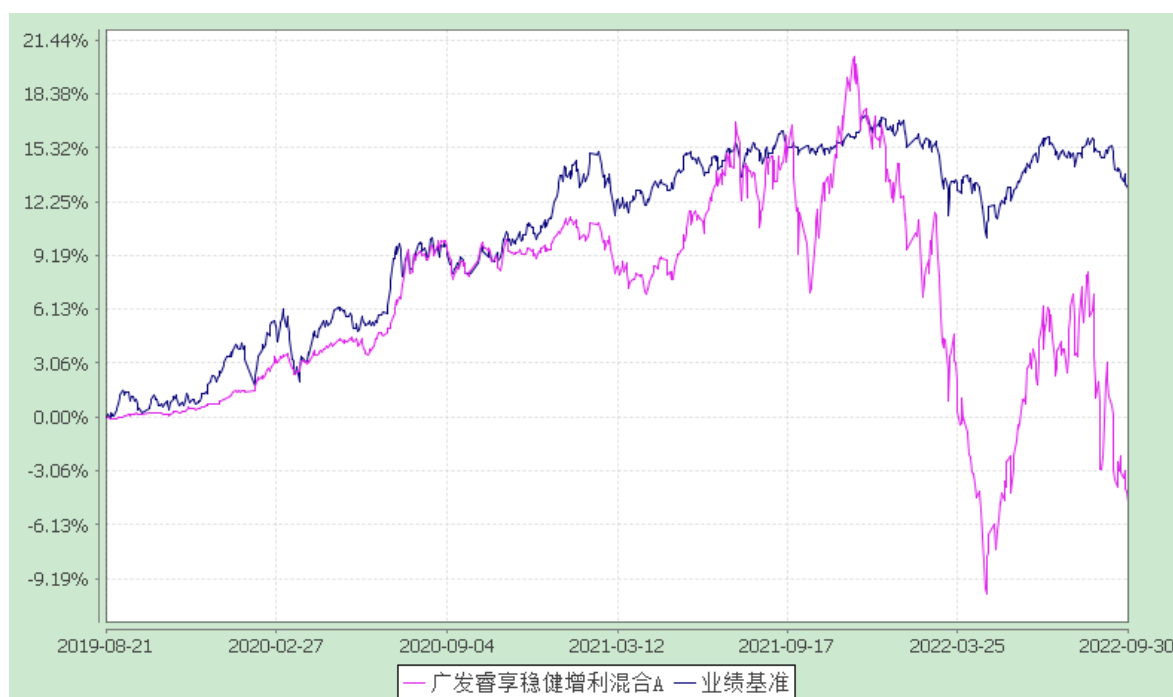
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-9.54%	1.24%	-2.50%	0.23%	-7.04%	1.01%
过去六个月	-4.68%	1.15%	-0.32%	0.30%	-4.36%	0.85%
过去一年	-14.84%	1.06%	-1.95%	0.30%	-12.89%	0.76%

自基金合同生效起至今	-13.51%	0.93%	-0.27%	0.29%	-13.24%	0.64%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

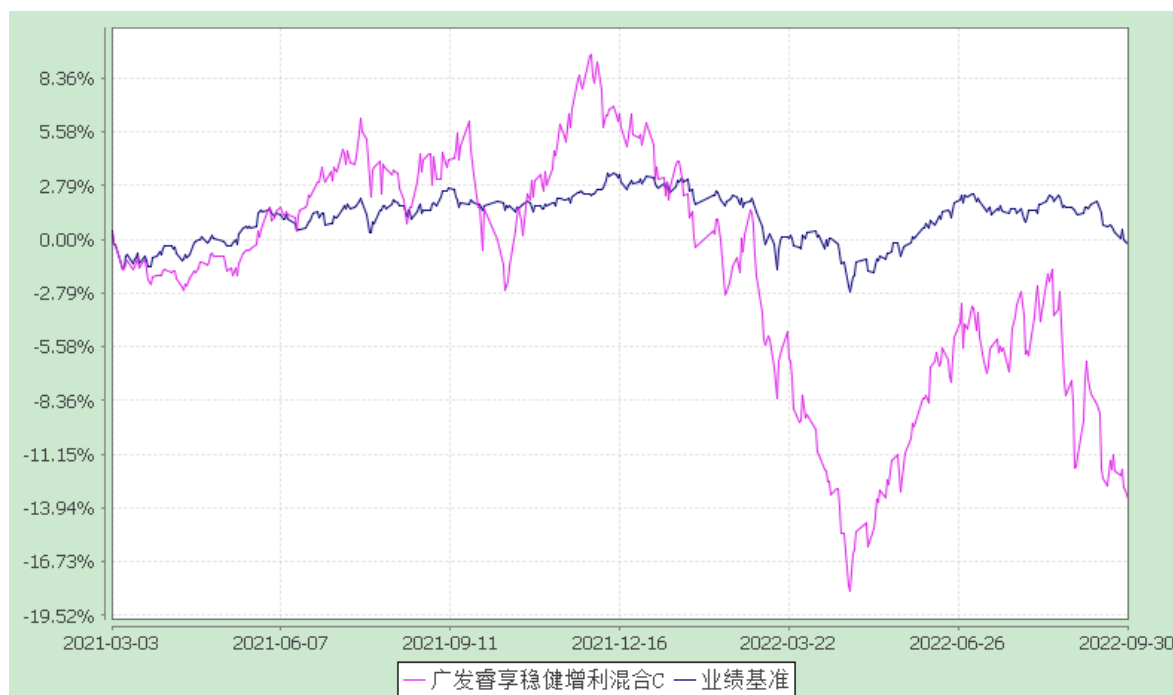
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发睿享稳健增利混合型证券投资基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2019 年 8 月 21 日至 2022 年 9 月 30 日)

1、广发睿享稳健增利混合 A:



2、广发睿享稳健增利混合 C:



§ 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		
王颂	本基金的基金经理；广发稳安灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发均衡增长混合型证券投资基金的基金经理；资产配置总监	2020-10-21	-	25 年	王颂先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任平安证券投资管理部投资经理，平安资产基金投资部总经理，广发基金管理有限公司机构投资部总经理、权益投资二部总经理、资产配置部（原另类投资部）总经理、广发聚瑞混合型证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 24 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2016 年 8 月 24 日至 2017 年 11 月 9 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 9 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日)、广发新动力混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 1 日至 2020 年 8 月 11 日)、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 3 月 1 日至 2020 年 8 月 11 日)、广发价值回报混合型证券投资基金基金经理(自 2019 年 4 月 29 日至 2021 年 7 月 16 日)。
李阳	本基金的基金经理；广发均衡增长混合型证券投资基金的基金经理	2021-03-09	-	6 年	李阳先生，工程硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国工商银行股份有限公司产品研发中心产品经理，新时代证券股份有限公司资产管理总部量化研究员、量化投资经理，泰康养老保险股份有限公司养老金投资部高级投资经理，广发基金管理有限公司资产配置部研究员。
郎振东	本基金的基金经理；广发集瑞债券型证券投资基金的基金经理；广发聚安混合型证券投资基金的基金经理；广发中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金的基金经理	2021-04-09	-	10 年	郎振东先生，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管理总部债券交易员。

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》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 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，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，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

本报告期内，本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% 的交易共有 2 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，有关投资经理按规定履行了审批程序。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在经历了二季度的反弹后，今年三季度的权益市场出现整体回调。宏观上受到海外抑制通胀的加息影响和国内地产数据的持续走弱，尽管国内仍然坚定地执行以我为主的货币政策，但一定程度上仍会影响到交易情绪。同时海外利率的上行，成长风格也在三季度明显跑输价值风格，板块上，能源板块因资源品价格上行带来的业绩释放，

有着明显的超额收益。债券市场涨幅明显，但是不同期限品种表现差异较大，利率好于信用、长端好于短端，尤其是超长端，可谓一骑绝尘。从资产性价比的角度看，进入三季度后期，权益市场的估值下跌和债券利率下行，更加凸显权益资产性价比。

三季度以来，本基金股票仓位没有太多的调整。虽然短期受市场情绪的压制，但结构上依然寻找中长期增速较为确定的行业为主线，聚焦在集中储能和化工能源等板块，降低了部分汽车零部件仓位。股票上对于看好的细分行业和个股标的，选择坚定持有。鉴于较为低迷的市场情绪和转债估值，本基金在季度末期降低了部分可转债持仓。三季度，利率机会大于信用，因此本基金减少了可转债的仓位，增加了纯债的配置，以中长端利率债为主，取得了一定的超额收益。

4.5 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-9.51%，C 类基金份额净值增长率为-9.54%，同期业绩比较基准收益率为-2.50%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	57,077,644.68	28.62
	其中：普通股	57,077,644.68	28.62
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	135,665,595.67	68.02
	其中：债券	135,665,595.67	68.02
	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	6,572,184.07	3.30
7	其他资产	122,644.93	0.06
8	合计	199,438,069.35	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	6,902,087.32	3.97
C	制造业	40,481,522.54	23.26
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	6,103,718.82	3.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,590,316.00	2.06
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	57,077,644.68	32.79

5.2.2 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。

5.3 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	300109	新开源	296,400	8,325,876.00	4.78
2	603876	鼎胜新材	96,700	5,422,936.00	3.12
3	300274	阳光电源	49,000	5,420,380.00	3.11
4	688035	德邦科技	65,098	5,068,530.28	2.91
5	600938	中国海油	256,004	4,052,543.32	2.33
6	300604	长川科技	64,400	3,672,088.00	2.11
7	301095	广立微	34,200	3,590,316.00	2.06
8	600026	中远海能	178,098	3,221,792.82	1.85
9	601975	招商南油	578,700	2,881,926.00	1.66
10	603619	中曼石油	136,800	2,849,544.00	1.64

5.4 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	63,315,000.27	36.37
	其中：政策性金融债	47,653,979.45	27.38
4	企业债券	42,419,846.47	24.37
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	29,930,748.93	17.20
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	135,665,595.67	77.94
----	----	----------------	-------

5.5 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	2028054	20 华夏银行	150,000	15,661,020.82	9.00
2	136914	G18 京 Y4	100,000	10,580,402.74	6.08
3	155917	19 风电 Y2	100,000	10,461,046.03	6.01
4	190208	19 国开 08	100,000	10,294,265.75	5.91
5	188419	21 平证 08	100,000	10,202,287.67	5.86

5.6 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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、华夏银行股份有限公司、中国进出口银行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或

其派出机构的处罚。平安证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证监会的处罚。

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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	120,435.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,209.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	122,644.93

5.11.4 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	110068	龙净转债	10,078,904.28	5.79
2	123121	帝尔转债	4,501,936.12	2.59
3	113534	鼎胜转债	4,217,721.89	2.42
4	110061	川投转债	3,042,945.05	1.75
5	128111	中矿转债	2,185,411.21	1.26
6	128134	鸿路转债	2,033,715.29	1.17
7	113047	旗滨转债	1,352,095.38	0.78
8	113626	伯特转债	1,257,063.37	0.72
9	113591	胜达转债	5,971.58	0.00
10	110080	东湖转债	4,473.94	0.00

11	113044	大秦转债	2,218.78	0.00
12	128081	海亮转债	623.04	0.00
13	128033	迪龙转债	357.55	0.00

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发睿享稳健增利 混合A	广发睿享稳健增利 混合C
报告期期初基金份额总额	145,897,481.65	54,293,980.67
报告期期间基金总申购份额	15,469,487.95	15,750,543.31
减：报告期期间基金总赎回份额	9,105,353.78	39,393,445.05
报告期期间基金拆分变动份额（份 额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	152,261,615.82	30,651,078.93

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会注册广发睿享稳健增利混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发睿享稳健增利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) 《广发睿享稳健增利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

8.2 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

8.3 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 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇二二年十月二十六日