

## 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

(原广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金转型)

## 2018年半年度报告摘要

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

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。

基金托管人根据本基金合同规定，于2018年8月22日核对了本基金的财务指标、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。

本半年度报告摘要摘录自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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。

### 2 基金简介

#### 2.1 基金基本情况

##### 2.1.1 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

基金名称	广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金
基金简称	广发鑫惠纯债
基金主代码	002128
交易代码	002128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年3月21日
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	1,607,074,396.05份
基金合同存续期	不定期

##### 2.1.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

基金名称	广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发鑫惠混合
基金主代码	002128
交易代码	002128
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年1月16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	1,497,212,483.27份
基金合同存续期	不定期

##### 2.2 基金产品说明

###### 2.2.1 广发鑫惠定期开放债券型发起式证券投资基金

投资目标	在严格控制风险和保证资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和货币等各类资产中充分控制和利用信用的时机，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济、微观经济运行状况、收益率曲线变化趋势的分析，对股票、债券和现金类资产的投资比例进行动态调整，力求在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	中债总全价(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金，其预期收益及风险水平低于股票型基金，高于货币基金，属于证券投资基金中具有较低风险收益特征的品种。
2.2.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金	

投资目标	在严格控制风险和保证资产流动性的基础上，本基金通过灵活的资产配置，在股票、固定收益证券和货币等各类资产中充分控制和利用信用的时机，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过对宏观经济、微观经济运行状况、收益率曲线变化趋势的分析，对股票、债券和现金类资产的投资比例进行动态调整，力求在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%×中债全价指数收益率。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币基金，低于股票型基金，属于混合型基金中具有较高风险收益特征的品种。
2.3 基金管理人和基金托管人	

###### 2.4 信息披露方式

###### 2.4.1 本基金管理人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

###### 2.4.2 登载半年度报告正文的管理人互联网网址: http://www.gffunds.com.cn

###### 2.4.3 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

#### 3 主要财务指标和基金净值表现

##### 3.1 广发鑫惠定期开放债券型发起式证券投资基金

###### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年3月21日至2018年6月30日)
本期已实现收益	18,854,327.58
本期利润	35,333,930.44
加权平均基金份额利润率	0.0234
本期平均净值增长率	2.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2018年6月30日)

注: (1) 本基金合同生效日为2018年3月21日,至披露时点不满半年。

(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将有所列数字。

(3) 本期已实现收益指基金本期利润收入、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。

(4) 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(为期末余额,不期当期发生数)。

###### 3.1.2 基金净值表现

###### 3.1.2.1 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

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	0.95%	0.04%	0.87%	0.10%	-0.29%	-0.06%
过去三个月	1.17%	0.08%	1.76%	0.15%	0.01%	-0.07%
自基金合同生效日起至今	2.37%	0.08%	2.35%	0.15%	0.02%	-0.07%

注: (1) 自2018年3月21日本基金转型起,本基金的业绩比较基准由“沪深300指数收益率×30%+中债全价指数收益率×70%”变更为“中债总全价(总值)指数收益率”。

(2) 业绩比较基准是根据基金管理人关于资产配置比例的规定构建的。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内本基金投资策略和运作分析

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,并通过实时的行情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池。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合的授权范围内可以由自主决策,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过程对实时监控及预警,实现投资风险的集中监控和防范。

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

合受到公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.4.2 异常交易行为的专项说明

公司本报告期内不存在影响公平交易的异常交易行为。

4.4.3 代理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.3.1 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,并通过实时的行情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池。公司建立了严格的投资授权制度,

投资组合的授权范围内可以由自主决策,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过程对实时监

控及预警,实现投资风险的集中监控和防范。

4.4.3.2 报告期内异常交易行为的专项说明

公司本报告期内不存在影响公平交易的异常交易行为。

4.4.3.3 代理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.3.4 报告期内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,并通过实时的行情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池。公司建立了严格的投资授权制度,

投资组合的授权范围内可以由自主决策,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过程对实时监

控及预警,实现投资风险的集中监控和防范。

4.4.3.5 报告期内异常交易行为的专项说明

公司本报告期内不存在影响公平交易的异常交易行为。

4.4.3.6 代理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.3.7 报告期内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,并通过实时的行情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池。公司建立了严格的投资授权制度,

投资组合的授权范围内可以由自主决策,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过程对实时监

控及预警,实现投资风险的集中监控和防范。

4.4.3.8 报告期内异常交易行为的专项说明