（上接B648版）

合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.1.4.8.7.2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

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.1.4.8.8 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 2018年3月21日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	303,197.96	3,735.26

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。

6.1.4.8.9 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.1.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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证券。

6.1.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2018年6月30日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

6.1.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额162,639,556.04元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
011800272	18晋能SCP002	2018-07-02	100.40	312,000.00	31,324,800.00
101800183	18川交投MTN002	2018-07-02	101.01	500,000.00	50,505,000.00
011800299	18金隅SCP002	2018-07-02	100.44	900,000.00	90,396,000.00
合计				1,712,000.00	172,225,800.00

6.1.4.9.3.2 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。

6.1.4.10 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二层级的余额为1,563,341,000.00元，属于第三层级的余额为70,000,000.00元，无属于第一层级的金额（2017年12月31日：属于第二层级的余额为1,402,733,000.00元，属于第三层级的余额为70,000,000.00元，无属于第一层级的金额）。

（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。

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三层级的余额为人民币70,000,000.00元；该层级金融资产未产生变动。

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。

6.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体：广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2018年3月20日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018年3月20日	上年度末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	623,570.76	4,819,702.75
结算备付金	20,005.59	226,472.23
存出保证金	22,249.81	12,747.44
交易性金融资产	1,620,858,996.50	1,472,733,000.00
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	1,510,748,996.50	1,352,778,000.00
资产支持证券投资	110,110,000.00	119,955,000.00
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	29,153,153.54	25,264,437.75
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,650,677,976.20	1,503,056,360.17
负债和所有者权益	本期末 2018年3月20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	-	-
卖出回购金融资产款	132,239,733.88	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	10.05	-
应付管理人报酬	830,512.57	1,289,831.01
应付托管费	166,102.54	257,966.22
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,100.79	6,923.08
应交税费	101,984.73	-
应付利息	10,374.33	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	430,146.13	349,000.00
负债合计	133,785,965.02	1,903,720.31
所有者权益：	-	-
实收基金	1,497,212,483.27	1,497,245,005.64
未分配利润	19,679,527.91	3,907,634.22
所有者权益合计	1,516,892,011.18	1,501,152,639.86
负债和所有者权益总计	1,650,677,976.20	1,503,056,360.17

注：（1）报告截止日2018年3月20日，基金份额净值人民币1.013元，基金份额总额1,497,212,483.27份。

（2）本会计期间为2018年1月1日至2018年3月20日。

6.2.2 利润表

会计主体：广发鑫惠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3月20日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年1月1日至2018年3月20日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入	20,219,929.97	26,379,819.57
1.利息收入	13,905,004.70	25,667,912.06
其中：存款利息收入	5,766.84	9,385,449.77
债券利息收入	12,757,226.35	14,017,781.45
资产支持证券利息收入	1,142,011.51	-
买入返售金融资产收入	-	2,264,680.84
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	224,177.50	-1,227,905.34
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	216,215.76	-1,227,905.34
资产支持证券投资收益	7,961.74	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,090,624.48	1,939,799.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	123.29	13.12
减：二、费用	4,447,638.47	8,469,593.65
1. 管理人报酬	3,264,725.34	6,570,810.21
2. 托管费	652,945.07	1,314,162.02
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	2,325.00	10,125.00
5. 利息支出	385,458.67	354,541.99
其中：卖出回购金融资产支出	385,458.67	354,541.99
6. 税金及附加	39,720.19	-
7. 其他费用	102,464.20	219,954.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	15,772,291.50	17,910,225.92
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	15,772,291.50	17,910,225.92

注：本年度期间为2018年1月1日至2018年3月20日，上年度可比期间为2017年1月1日至2017年6月30日。

6.2.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发鑫惠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3月20日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年3月20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）	1,497,245,005.64	3,907,634.22	1,501,152,639.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	15,772,291.50	15,772,291.50
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）	-32,522.37	-397.81	-32,920.18
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-32,522.37	-397.81	-32,920.18
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）	1,497,212,483.27	19,679,527.91	1,516,892,011.18
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）	999,207,988.82	2,859,023.95	1,002,067,012.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,910,225.92	17,910,225.92
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）	498,019,389.01	1,992,119.45	500,011,508.46
其中：1.基金申购款	498,022,838.15	1,992,154.69	500,014,992.84
2.基金赎回款	-3,449.14	-35.24	-3,484.38
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）	1,497,227,377.83	22,761,369.32	1,519,988,747.15

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：

基金管理公司负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

广发鑫惠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]1466号《关于准予广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2487号《关于广发鑫惠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《广发鑫惠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08日向社会公开发行募集并于2016年11月16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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为2016年11月08日至2016年11月08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200,005,139.25元，有效认购户数为216户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币4,000.00元，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。上述资金业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（包括国内依法发行上市的国债、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为：30%×沪深300指数收益率+70%×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。

6.2.4.2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。

6.2.4.3 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3月20日的财务状况以及2018年1月1日至2018年3月20日的经营成果和基金净值变动情况。

6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.2.4.5.1 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。

6.2.4.5.2 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。

6.2.4.5.3 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。

6.2.4.6 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。

6.2.4.7 关联方关系

6.2.4.7.1 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。

6.2.4.7.2 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

6.2.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.2.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.8.1.1 股票交易

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股票交易。

6.2.4.8.1.2 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。

6.2.4.8.1.3 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3月20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	3,000,000.00	100.00%	-	-

6.2.4.8.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

6.2.4.8.2 关联方报酬

6.2.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年3月20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	3,264,725.34	6,570,810.21
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1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.0%÷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。

6.2.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年3月20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	652,945.07	1,314,162.02

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷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。

6.2.4.8.3 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。

6.2.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.8.4.1 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。

6.2.4.8.4.2 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

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。

6.2.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年3月20日		上年度可比期间 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	623,570.76	5,766.84	1,881,121.86	29,609.73

注：本基金的部分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。

6.2.4.8.6 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。

6.2.4.9 期末（2018年3月20日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末2018年3月20日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

6.2.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2018年3月20日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

6.2.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年3月20日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额132,239,733.88元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
101766009	17中电投MTN001	2018-03-21	100.33	392,000.00	39,329,360.00
101756034	17诚通控股MTN002	2018-03-21	99.42	1,000,000.00	99,420,000.00
合计				1,392,000.00	138,749,360.00

6.2.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年3月20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。

6.2.5 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3月20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11,657,996.50元，属于第二层级的余额为1,539,201,000.00元，属于第三层级的余额为70,000,000.00元（2017年12月31日：属于第二层级的余额为1,402,733,000.00元，属于第三层级的余额为70,000,000.00元，无属于第一层级的金额）。

（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。

于2018年3月20日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第三层级的余额为人民币70,000,000.00元；该层级金融资产未产生变动。

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 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

（报告期：2018年3月21日-2018年6月30日）

7.1.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,633,341,000.00	94.64
	其中：债券	1,546,791,000.00	89.63
	资产支持证券	86,550,000.00	5.02
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	62,720,214.08	3.63
	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	303,197.96	0.02
8	其他各项资产	29,400,146.58	1.70
9	合计	1,725,764,558.62	100.00

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.1.2.2 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。

7.1.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期内未持有股票。

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	-
卖出股票的收入（成交）总额	-

注：本基金本报告期内未持有股票。

7.1.5 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	185,862,000.00	11.90
	其中：政策性金融债	185,862,000.00	11.90
4	企业债券	301,870,000.00	19.32
5	企业短期融资券	140,596,000.00	9.00
6	中期票据	819,433,000.00	52.45
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	99,030,000.00	6.34
9	其他	-	-
10	合计	1,546,791,000.00	99.01

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	011800299	18金隅SCP002	900,000	90,396,000.00	5.79
2	101753007	17中电子MTN001	800,000	80,480,000.00	5.15
3	160210	16国开10	600,000	55,386,000.00	3.55
4	101766009	17中电投MTN001	500,000	50,970,000.00	3.26
5	1720048	17三峡银行三农债03	500,000	50,880,000.00	3.26

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	146256	借呗26A1	700,000	70,000,000.00	4.48
2	1789220	17惠益2A2	500,000	16,550,000.00	1.06

7.1.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.1.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

（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。

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

（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。

7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 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。

7.1.12.2 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。

7.1.12.3 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	9,733.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,390,413.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,400,146.58

7.1.12.4 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。

7.1.12.5 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。

7.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2018年1月1日-2018年3月20日）

7.2.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,620,858,996.50	98.19
	其中：债券	1,510,748,996.50	91.52
	资产支持证券	110,110,000.00	6.67
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	643,576.35	0.04
8	其他各项资产	29,175,403.35	1.77
9	合计	1,650,677,976.20	100.00

7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
合计	-	-

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.2.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 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

本基金本报告期内未持有股票。

7.2.4.2 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

本基金本报告期内未持有股票。

7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	-
卖出股票的收入（成交）总额	-

注：本基金本报告期内未持有股票。

7.2.5 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	151,533,000.00	9.99
	其中：政策性金融债	151,533,000.00	9.99
4	企业债券	207,539,000.00	13.68
5	企业短期融资券	160,109,000.00	10.56
6	中期票据	979,910,000.00	64.60
7	可转债	11,657,996.50	0.77
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,510,748,996.50	99.60

7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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	101766009	17中电投MTN001	1,000,000	100,330,000.00	6.61
2	101752030	17远东租赁MTN001	1,000,000	100,060,000.00	6.60
3	101756034	17诚通控股MTN002	1,000,000	99,420,000.00	6.55
4	011800299	18金隅SCP002	900,000	90,081,000.00	5.94
5	101753007	17中电子MTN001	800,000	80,240,000.00	5.29

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	146256	借呗26A1	700,000	70,000,000.00	4.61
2	1789220	17惠益2A2	500,000	40,110,000.00	2.64

7.2.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.2.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.2.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

（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。

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

（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。

7.2.12tl投资组合报告附注

7.2.12.1 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。

7.2.12.2 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。

7.2.12.3 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	22,249.81
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,153,153.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,175,403.35

7.2.12.4 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。

7.2.12.5 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 广发鑫惠纯债定期开放债券型发起式证券投资基金

（报告期：2018年3月21日-2018年6月30日）

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
207	7,280,552.64	1,507,071,705.25	100.00%	2,690.80	0.00%

8.1.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,751.98	0.0001%

8.1.3 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

8.1.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	9,861,932.94	0.65%	9,861,932.94	0.65%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	50.01	0.00%	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,861,982.95	0.65%	9,861,932.94	0.65%	三年

8.2 广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2018年1月1日-2018年3月20日）

8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |