

广发集安债券型证券投资基金

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:交通银行股份有限公司

重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金募集机构、基金销售机构、基金服务机构、基金募集机构、基金销售机构、基金服务机构、基金募集机构...

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,也不保证基金最低收益。

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

2.1 基金基本情况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金类型, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金合同生效日...

2.2 基金产品说明

Table with columns: 投资目标, 投资策略, 业绩比较基准, 风险收益特征. 描述基金的投资目标、策略、基准及风险收益特征。

2.3 基金管理人及基金托管人

Table with columns: 基金管理人, 基金托管人. 列出基金管理人和托管人的名称、地址、电话、网址等信息。

2.4 信息披露方式

Table with columns: 基金信息披露网站, 基金半年度报告备置地点. 提供基金信息披露网站和报告备置地点。

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

Table with columns: 报告期, 基金管理人, 基金托管人. 展示基金的主要会计数据和财务指标。

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可能低于所列数字。

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

Table with columns: 阶段, 基金份额净值增长率, 业绩比较基准收益率. 比较基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率。

3.2.2 基金净值表现

业绩比较基准:中债总全价指数收益率
3.2.2.1 基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发集安债券型证券投资基金
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

广发集安债券A
广发集安债券B
广发集安债券C

注:本基金建仓期为基金合同生效6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经营情况

基金管理人经中国证监会核准,于2003年8月5日成立,注册资本为2.688亿元人民币。

4.2 基金管理人及基金经营情况

截至2018年6月30日,本基金管理人管理一百七十五只开放式基金,管理资产规模为3600亿元。

4.3 基金管理人及基金经营情况

本报告期内,本基金管理人严格按照基金合同约定的投资范围、投资策略、投资限制等开展投资运作。

4.4 基金管理人及基金经营情况

本报告期内,本基金管理人严格执行基金合同约定的估值程序,确保基金资产估值的准确性。

4.5 基金管理人及基金经营情况

本报告期内,本基金管理人严格执行基金合同约定的信息披露制度,及时、准确、完整地披露基金信息。

4.6 基金管理人及基金经营情况

本报告期内,本基金管理人严格执行基金合同约定的风险管理政策,有效控制基金投资风险。

4.7 基金管理人及基金经营情况

本报告期内,本基金管理人严格执行基金合同约定的合规管理政策,确保基金运作符合法律法规要求。

本报告期内,本基金管理人严格执行基金合同约定的投资者服务政策,提升投资者满意度。

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 说明. 列出基金管理人、托管人、销售机构、服务机构、募集机构的主要成员及其任职情况。

注:1.“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期;2.从事证券业务的含义遵照行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵守信用的说明

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、《广发集安债券型证券投资基金合同》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。

4.3 管理人报告期内公平交易情况的专项说明

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。

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

公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数构成的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。

4.4 管理人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
报告期内,股市市场整体仍维持较为宽松的态势,央行数次降准操作,不再跟随美联储上调政策利率等均以印证货币政策转向宽松;宏观经济下行,生产数据呈弱复苏态势,但需求端数据表现较弱。

4.4.2 报告期内基金业绩表现的说明

本报告期内,广发集安A类净值增长率为0.06%,广发集安C类净值增长率为-0.63%,同期业绩比较基准收益率为2.99%。

4.5 管理人对外宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

投资展望:展望下半年,基本面因素在外部贸易摩擦、内部信用风险的放大背景下悲观预期短期难以证伪,这一过程中低评级主体信用风险的暴露需要高度关注,货币政策边际宽松对冲,整体来看利好利率债和高等级信用债,信用利差继续维持分化。

4.6 管理人对外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,负责制定旗下基金估值品种的估值原则和估值程序,并选取适当的估值方法。

4.7 基金管理人对外报告期内基金估值程序等事项的说明
基金估值委员会由基金管理人、基金托管人、基金销售机构、基金服务机构、基金募集机构、基金销售机构、基金服务机构、基金募集机构、基金销售机构、基金服务机构、基金募集机构、基金销售机构、基金服务机构、基金募集机构...

5 报告期内本基金托管人报告

2018年上半年,基金托管人在广发集安债券型证券投资基金托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表
会计主体:广发集安债券型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

Table with columns: 资产, 负债, 所有者权益. 展示基金的资产负债表数据。

6.2 利润表

会计主体:广发集安债券型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

Table with columns: 营业收入, 营业支出, 利润总额, 净利润. 展示基金的利润表数据。

6.3 所有者权益变动表

会计主体:广发集安债券型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

Table with columns: 基金份额持有人权益, 未分配利润, 所有者权益合计. 展示基金的所有者权益变动表数据。

6.4 现金流量表

会计主体:广发集安债券型证券投资基金
报告截止日:2018年6月30日

Table with columns: 经营活动产生的现金流量, 投资活动产生的现金流量, 筹资活动产生的现金流量, 现金流量净额. 展示基金的现金流量表数据。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

6.4.7.2 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

本报告期内未持有股票。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

6.4.8.1.2 权证交易

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

6.4.8.2.2 基金托管费

6.4.8.2.3 销售服务费

6.4.8.2.4 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

6.4.8.2.5 与关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

6.4.8.2.6 与关联方进行融资融券交易

6.4.8.2.7 与关联方进行权证交易

6.4.8.2.8 与关联方进行股指期货交易

6.4.8.2.9 与关联方进行国债期货交易

6.4.8.2.10 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.11 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.12 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.13 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.14 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.15 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.16 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.17 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.18 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.19 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.20 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.21 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.22 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.23 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.24 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.25 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.26 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.27 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.28 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.29 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.30 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.31 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.32 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.33 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.34 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.35 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.36 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.37 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.38 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.39 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.40 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.41 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.42 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.43 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.44 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.45 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.46 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.47 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.48 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.49 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.50 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.51 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.52 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.53 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.54 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.55 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.56 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.57 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.58 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.59 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.60 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.61 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.62 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.63 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.64 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.65 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.66 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.67 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

6.4.7.2 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

本报告期内未持有股票。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

6.4.8.1.2 权证交易

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

6.4.8.2.2 基金托管费

6.4.8.2.3 销售服务费

6.4.8.2.4 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

6.4.8.2.5 与关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

6.4.8.2.6 与关联方进行融资融券交易

6.4.8.2.7 与关联方进行权证交易

6.4.8.2.8 与关联方进行股指期货交易

6.4.8.2.9 与关联方进行国债期货交易

6.4.8.2.10 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.11 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.12 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.13 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.14 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.15 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.16 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.17 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.18 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.19 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.20 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.21 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.22 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.23 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.24 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.25 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.26 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.27 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.28 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.29 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.30 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.31 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.32 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.33 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.34 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.35 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.36 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.37 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.38 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.39 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.40 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.41 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.42 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.43 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.44 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.45 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.46 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.47 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.48 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.49 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.50 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.51 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.52 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.53 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.54 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.55 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.56 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.57 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.58 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.59 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.60 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.61 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.62 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.63 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.64 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.65 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.66 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.8.2.67 与关联方进行其他衍生品交易

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

6.4.7.2 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

本报告期内未持有股票。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易