广发汇安18个月定期开放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:平安银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年八月二十四日

1 重要提示

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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月22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。

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

基金简称	广发汇安18个月定期债券	
基金主代码	004386	
交易代码	004386	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2017年3月31日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	500,147,724.26份	
下属两级基金的基金简称	广发汇安18个月定期债券A	广发汇安18个月定期债券C
下属两级基金的交易代码	004386	004387
报告期末下属分级基金的份额总额	500,110,389.81份	37,334.45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,力求获得超越业绩比较基准的投资回报,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	封闭期内,本基金通过对国内外宏观经济动势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合研判,构建和调整组合投资组合,力求获得稳健的投资收益。开放期内,为了保证组合具有较高的流动性,本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下,投资于具有较高流动性的投资品种,通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合指数(总财富)收益率×90%+银行1年期定期存款利率(税后)×10%。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金、高于货币市场基金,属于证券投资基金中具有中等风险收益特征的品种。

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	方琦
	联系电话	020-83936666	0755-22160168
	电子邮箱	dxj@gffund.com.cn	FANGQI279@pingan.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95511-3
传真		020-89899168	0755-82080387

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com.cn
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

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(2018年1月1日至2018年6月30日)	
	广发汇安18个月定期债券A	广发汇安18个月定期债券C
本期已实现收益	10,027,466.80	67126
本期利润	17,692,133.88	1,243.00
加权平均基金份额本期利润	0.0354	0.0333
本期加权平均净值利润率	3.48%	3.28%
本期基金份额净值增长率	3.53%	3.34%
3.1.2期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)	
	广发汇安18个月定期债券A	广发汇安18个月定期债券C
期末可供分配利润	15,289,871.22	1,025.33
期末可供分配基金份额利润	0.0306	0.0275
期末基金资产净值	517,532,144.37	38,518.82
期末基金份额净值	1.0348	1.0317

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

广发汇安18个月定期债券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	0.51%	0.03%	0.57%	0.05%	-0.06%	-0.02%
过去三个月	1.71%	0.08%	1.80%	0.09%	-0.09%	-0.01%
过去六个月	3.53%	0.06%	3.56%	0.07%	-0.03%	-0.01%
过去一年	4.15%	0.05%	3.97%	0.06%	0.18%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.93%	0.05%	4.23%	0.06%	0.70%	-0.01%

广发汇安18个月定期债券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	0.48%	0.03%	0.57%	0.05%	-0.09%	-0.02%
过去三个月	1.62%	0.08%	1.80%	0.09%	-0.18%	-0.01%
过去六个月	3.34%	0.06%	3.56%	0.07%	-0.22%	-0.01%
过去一年	3.74%	0.05%	3.97%	0.06%	-0.23%	-0.01%
自基金合同生效起至今	4.41%	0.05%	4.23%	0.06%	0.18%	-0.01%

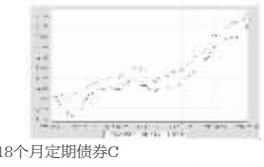
(1)业绩比较基准:中债综合指数(总财富)收益率×90%+银行1年期定期存款利率(税后)×10%。

(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。

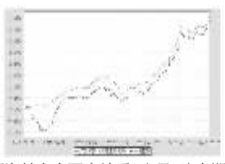
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发汇安18个月定期开放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
(2017年3月31日至2018年6月30日)

广发汇安18个月定期债券A



广发汇安18个月定期债券C



注:本基金建仓期为基金合同生效后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30个部门:宏观策略部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、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、养老金与战略业务部、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。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)及基金经理助理的简介

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		
代宇	本基金的基金经理;广发聚利债券基金的基金经理;广发聚利纯债一年定期开放债券基金的基金经理;广发聚利一年定期开放债券基金的基金经理;广发聚利一年定期开放债券基金的基金经理;广发远化选择基金的基金经理;广发鑫利纯基金的基金经理;广发纯债一年定期开放债券基金的基金经理;广发纯债一年定期开放债券基金的基金经理;广发鑫利纯基金的基金经理;广发汇瑞3个月定期开放债券基金的基金经理;广发汇安一年定期债券基金的基金经理;广发汇安18个月定期开放债券基金的基金经理;广发汇享一年定期开放债券基金的基金经理;广发汇稳一年定期开放债券基金的基金经理;广发汇稳一年定期开放债券基金的基金经理;广发汇稳