广发价值回报混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发价值回报混合	
基金主代码	004852	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年11月29日	
报告期末基金份额总额	95,115,296.56份	
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过对不同资产类别的优化配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×20%＋中证全债指数收益率×80%。	
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，属于中高收益风险特征的基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发价值回报混合A	广发价值回报混合C
下属分级基金的交易代码	004852	004853
报告期末下属分级基金的份额总额	70,332,273.12份	24,783,023.44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（2018年7月1日-2018年9月30日）	
	广发价值回报混合A	广发价值回报混合C
1.本期已实现收益	678,984.24	197,085.06
2.本期利润	868,670.75	266,953.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0112	0.0101
4.期末基金资产净值	74,261,235.34	26,026,915.12
5.期末基金份额净值	1.0559	1.0502

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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、广发价值回报混合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	1.09%	0.05%	0.67%	0.27%	0.42%	-0.22%

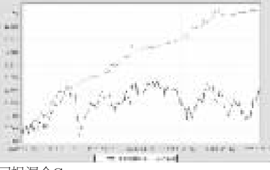
2、广发价值回报混合C：

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	0.97%	0.05%	0.67%	0.27%	0.30%	-0.22%

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

广发价值回报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
(2017年11月29日至2018年9月30日)

1. 广发价值回报混合A：



2. 广发价值回报混合C：

注：（1）本基金合同生效日期为2017年11月29日，至披露时点本基金成立未满一年。

（2）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		
王予柯	本基金的基金经理；广发聚盛混合基金的基金经理；广发安宏回报混合基金的基金经理；广发稳裕保本基金的基金经理；广发景盛纯债基金的基金经理；广发中债7-10年国开债指数基金的基金经理；广发鑫隆混合基金的基金经理；广发景丰纯债基金的基金经理；广发集富纯债基金的基金经理；广发中证10年期国开债指数基金的基金经理；广发汇佳定期开放债券发起式基金的基金经理；广发汇康定开发起债基金的基金经理；广发中债1-3年农发债指数基金的基金经理；广发集泰债券基金的基金经理	2017-11-29	-	11年	王予柯先生，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部债券交易员兼研究员、投资经理、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理（自2015年5月27日至2016年6月24日）、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年12月22日至2018年1月6日）。现任广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年12月25日起任职）、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年1月8日起任职）、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理（自2016年6月27日起任职）、广发景盛纯债债券型证券投资基金基金经理（自2016年8月30日起任职）、广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金基金经理（自2016年9月26日起任职）、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年11月7日起任职）、广发景丰纯债债券型证券投资基金基金经理（自2016年11月23日起任职）、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理（自2017年1月13日起任职）、广发中证10年期国开债指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2017年11月15日起任职）、广发价值回报混合型证券投资基金基金经理（自2017年11月29日起任职）、广发汇佳定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理（自2018年3月12日起任职）、广发中债1-3年农发行债券指数证券投资基金基金经理（自2018年4月24日起任职）、广发集泰债券型证券投资基金基金经理（自2018年7月26日）。

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发价值回报混合型证券投资基金基金合同》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。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，投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度，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

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成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。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，利率债收益率先下后上，整体维持震荡：其中7月债市收益率整体区间震荡，8月中旬在经历过前期极度宽松的资金利率后，央行开始暂停公开市场操作叠加地方债的巨量供给挤出，引发资金利率和长端利率的连续调整，9月下旬地方债供给放缓、美联储加息国内未跟随带来市场情绪好转，收益率小幅下行。信用债方面，中低评级信用利差和等级利差继续小幅走阔。三季度以来，本基金以中短久期利率品种及高等级信用债为主要配置方向，对股票资产暂时保持谨慎，等待机会。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发价值回报混合A类净值增长率为1.09%，广发价值回报混合C类净值增长率为0.97%，同期业绩比较基准收益率为0.67%

§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	34,747.97	0.03
	其中：股票	34,747.97	0.03
2	固定收益投资	94,043,456.10	91.00
	其中：债券	94,043,456.10	91.00
	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	5,800,000.00	5.61
	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	267,156.26	0.26
7	其他各项资产	3,199,930.19	3.10
8	合计	103,345,290.52	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	-	-
C	制造业	31,196.97	0.03
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	3,551.00	0.00
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	34,747.97	0.03

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	600519	贵州茅台	39	28,470.00	0.03
2	601601	中国太保	100	3,551.00	0.00
3	600309	万华化学	63	2,675.61	0.00
4	600887	伊利股份	2	51.36	0.00

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	26,242,456.10	26.17
	其中：政策性金融债	26,242,456.10	26.17
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	67,801,000.00	67.61
9	其他	-	-
10	合计	94,043,456.10	93.77

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	180402	18农发02	200,000	20,498,000.00	20.44
2	111815207	18民生银行CD207	200,000	19,440,000.00	19.38
2	111820102	18广发银行CD102	200,000	19,440,000.00	19.38
3	111809230	18浦发银行CD230	200,000	19,300,000.00	19.24
4	111807085	18招商银行CD085	100,000	9,621,000.00	9.59
5	018005	国开1701	57,210	5,744,456.10	5.73

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

5.11.118浦发银行CD230（代码：111809230）为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会针对浦发银行通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款、通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节、理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求等行为给予罚款人民币5845万元的行政处罚。

18招商银行CD085（代码：111807085）为本基金的前十大持仓证券之一。2018年5月4日，中国银行保险监督管理委员会针对招商银行违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款、销售同业非保本理财产品时违规承诺保本、违规将票据贴现资金直接转回出票人账户等行为给予罚款人民币6570万元的行政处罚。

除上述证券外，本基金投资的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。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,060.80
2	应收证券清算款	1,400,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,753,399.83
5	应收申购款	42,469.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,199,930.19

5.11.4报告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。

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	广发价值回报混合A	广发价值回报混合C
本报告期期初基金份额总额	78,876,926.85	25,777,330.08
本报告期基金总申购份额	11,983,483.93	3,256,179.32
减：本报告期基金总赎回份额	20,528,137.66	4,250,485.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	70,332,273.12	24,783,023.44

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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价值回报混合型证券投资基金募集的文件

（二）《广发价值回报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）《广发价值回报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

（八）《广发价值回报混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版

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：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日

广发全球医疗保健指数证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人：广发基金管理有限公司
基金托管人：广发银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人广发银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发全球医疗保健（QDII）
基金主代码	000369
交易代码	000369
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年12月10日
报告期末基金份额总额	182,879,526.36份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金以实现对标的指数的有效跟踪为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%，基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过5%。
业绩比较基准	人民币计价的标普全球1200医疗保健指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Citibank N.A
境外资产托管人中文名称	美国花旗银行有限公司

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	265,693.26
2.本期利润	27,578,527.23
3.加权平均基金份额本期利润	0.1877
4.期末基金资产净值	278,488,419.76
5.期末基金份额净值	1.523

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期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	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	14.94%	0.51%	15.55%	0.53%	-0.61%	-0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

广发全球医疗保健指数证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2013年12月10日至2018年9月30日）

§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		
李耀柱	本基金的基金经理；广发纳指100ETF基金的基金经理；广发纳斯达克100指数（QDII）基金的基金经理；广发沪港深新起点股票基金的基金经理；广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；广发海外多元配置（QDII）基金的基金经理；广发科技动力股票基金的基金经理；国际业务部总经理助理	2016-08-23	2018-09-20	8年	李耀柱先生，理学硕士，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中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2017年11月9日）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2018年9月20日）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2018年9月20日）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2018年9月20日）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年8月23日至2018年9月20日）。现任广发基金管理有限公司国际业务部总经理助理、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2015年12月17日起任职）、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理（自2016年8月23日起任职）、广发沪港深新起点股票型证券投资基金基金经理（自2016年11月9日起任职）、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理（自2017年3月10日起任职）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2017年9月21日任职）、广发海外多元配置证券投资基金（QDII）基金经理（自2018年2月8日起任职）、广发科技动力股票型证券投资基金基金经理（自2018年5月31日起任职）。
刘杰	本基金的基金经理；广发沪深300ETF联接基金的基金经理；广发中证500ETF基金的基金经理；广发中证500ETF联接(LOF)基金的基金经理；广发沪深300ETF基金的基金经理；广发养老指数基金的基金经理；广发中小板300ETF基金的基金经理；广发中小板300联接基金的基金经理；广发中证环保ETF联接基金的基金经理；广发军工ETF基金的基金经理；广发中证军工ETF联接基金的基金经理；广发中证环保ETF基金的基金经理；广发创业板ETF基金的基金经理；广发创业板ETF联接基金的基金经理；广发量化稳健混合基金的基金经理；广发道琼斯石油指数（QDII-LOF）基金的基金经理；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理；广发纳斯达克100指数（QDII）基金的基金经理；广发纳指100ETF基金的基金经理；广发全球农业指数（QDII）基金的基金经理；广发生物科技指数（QDII）基金的基金经理；指数投资部总经理助理	2018-08-06	-	14年	刘杰先生，工学学士，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信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理（自2014年4月1日至2016年1月17日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年1月25日至2018年4月25日）。现任广发基金管理有限公司指数投资部总经理助理、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2014年4月1日起任职）、广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)基金经理（自2014年4月1日起任职）、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2015年8月20日起任职）、广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2016年1月18日起任职）、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2016年1月25日起任职）、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（自2016年1月25日起任职）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2016年1月25日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2016年8月30日起任职）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自2016年9月26日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年1月25日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2017年4月25日起任职）、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自2017年5月25日起任职）、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理（自2017年8月4日起任职）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（自2018年4月26日起任职）、广发纳斯达克100指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自2018年8月6日起任职）。

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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、《广发全球医疗保健指数证券投资基金基金合同》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。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，投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度，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

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成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。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

3季度，纳斯达克100上涨了8.33%、纳斯达克指数上涨了7.14%、标普500上涨了7.20%、道琼斯工业指数上涨了9.01%，总体上美股市场延续了上涨的趋势。而10月份受到美债利率快速上行，彭博社中国芯片报道短暂导致科技股受挫，4季度开盘美股整体出现承压下挫。

整体上美国经济依然强劲，9月ISM 制造业PMI为 59.8，略低于预期的60.3，较上个月的 61.3 有所回落，但依然强劲；非制造业PMI为 61.6，高于预期的58，并创造2005年初以来的新高。9月ADP非农就业新增23万人，也远好于预期的18.4万人。美联储主席鲍威尔对经济前景表示乐观，并表示目前尚未观察到劳动力市场过热的迹象，劳动力市场收紧也尚未给通胀带来显著的上行压力。

虽然短期纳斯达克指数出现较大幅度调整，但其背后是经济复苏过于强劲带来的加息预期导致利率过快上涨对股市形成压制，当前美债期限利差仍有所扩大，经济基本面并没有出现衰退，因此投资者不必过于担忧，未来美股市场，尤其是以美国生物、医疗等为主的全球技术领先竞争优势明显的医疗保健领域依然值得适当关注。

报告期内，本基金紧密跟踪标的指数。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的净值增长率为14.94%，同期业绩比较基准收益率为15.55%。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	241,889,870.44	84.48
	其中：普通股	241,478,540.65	84.34
	存托凭证	411,329.79	0.14
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	12,851,987.80	4.49
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
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	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	25,202,644.93	8.80
8	其他各项资产	6,371,838.32	2.23
9	合计	286,316,341.49	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	173,015,870.16	62.13
瑞士	20,651,432.69	7.42
英国	12,568,779.14	4.51
日本	10,437,875.45	3.75
德国	7,204,137.89	2.59
法国	6,171,120.25	2.22
丹麦	4,872,677.47	1.75
澳大利亚	4,048,686.39	1.45
荷兰	2,010,676.35	0.72
比利时	536,971.22	0.19
加拿大	371,643.43	0.13
合计	241,889,870.44	86.86

注：1、国家（地区）类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2、上述美国比重包括注册地为西班牙在美国上市的ADR。

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
公用事业	-	-
能源	-	-
信息技术	-	-
日常消费品	-	-
非日常生活消费品	-	-
通信服务	-	-
原材料	-	-
工业	-	-
金融	-	-
房地产	-	-
医疗保健	241,889,870.44	86.86
合计	241,889,870.44	86.86

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	JOHNSON & JOHNSON	强生	JNJ US	纽约证券交易所	美国	18,248.00	17,344,706.92	6.23
2	PFIZER INC	辉瑞制药	PFE US	纽约证券交易所	美国	39,803.00	12,066,929.99	4.33
3	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康	UNH US	纽约证券交易所	美国	6,533.00	11,956,320.09	4.29
4	NOVARTIS AG-REG	诺华	NOVN SW	瑞士证券交易所	瑞士	17,351.00	10,311,754.27	3.70
5	MERCK & CO. INC	默克	MRK US	纽约证券交易所	美国	18,304.00	8,932,543.24	3.21
6	ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	罗氏	ROG SW	瑞士证券交易所	瑞士	4,775.00	7,993,914.52	2.87
7	ABBVIE INC	艾伯维生物制药公司	ABBV US	纽约证券交易所	美国	10,308.00	6,706,742.86	2.41
8	AMGEN INC	-	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	4,526.00	6,454,027.88	2.32
9	MEDTRONIC PLC	美敦力	MDT US	纽约证券交易所	美国	9,209.00	6,231,793.88	2.24
10	ABBOTT LABORATORIES	雅培制药	ABT US	纽约证券交易所	美国	11,924.00	6,017,543.33	2.16

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有债券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

5.9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基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例(%)
1	ISHARES GLOBAL HEALTHCARE ET	ETF	契约型开放式	BlackRock Fund Advisors	12,851,987.80	4.61

5.10 投资组合报告附注

5.10.1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。

5.10.2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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	262,257.19
4	应收利息	1,710.23
5	应收申购款	6,070,506.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	37,363.97
8	其他	-
9	合计	6,371,838.32

5.10.4 报告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。

5.10.5 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

报告期期初基金份额总额	123,359,091.39
本报告期基金总申购份额	84,696,081.04
减：本报告期基金总赎回份额	25,175,646.07
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	182,879,526.36

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2018-07-17	-319,024.37	-441,544.09	-
2	赎回	2018-07-23	-319,024.37	-442,496.37	-
3	赎回	2018-07-25	-319,024.37	-447,257.81	-
4	赎回	2018-08-01	-319,024.37	-455,828.41	-
5	赎回	2018-08-08	-319,024.37	-463,764.13	-
6	赎回	2018-08-15	-319,024.37	-459,954.98	-
7	赎回	2018-08-22	-319,024.37	-467,573.29	-
8	赎回	2018-08-30	-319,024.37	-468,843.00	-
9	赎回	2018-09-06	-319,024.37	-467,255.85	-
10	赎回	2018-09-12	-319,024.37	-466,303.57	-
11	赎回	2018-09-19	-319,024.37	-472,017.29	-
12	赎回	2018-09-27	-319,024.37	-477,731.02	-
合计			-3,828,292.44	-5,530,569.81	

注：赎回费27791.79元。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180701-20180919	34,622,800.43	-	-	34,622,800.43	18.93%
产品特有风险							
报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。							

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1.中国证监会批准广发全球医疗保健指数证券投资基金募集的文件；

2.《广发全球医疗保健指数证券投资基金基金合同》；

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》；

4.《广发全球医疗保健指数证券投资基金托管协议》；

5.法律意见书；

6.基金管理人业务资格批件、营业执照；

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

9.2 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

9.3 查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话95105828或020-83936999，或发电子邮件：services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日

广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金
2018年第3季度报告
2018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：中国银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年十月二十五日

§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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018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2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发优企精选混合
基金主代码	002624
交易代码	002624
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月4日
报告期末基金份额总额	991,288,659.64份
投资目标	本基金力图把握优质企业的投资机会，通过深度研究、精选个股，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整
业绩比较基准	中证 800 指数收益率×65%+中债全债指数收益率×35%
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，属于中高收益风险特征的基金。
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

§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(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,150,779.49
2.本期利润	-33,785,138.06
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0367
4.期末基金资产净值	1,275,416,476.17
5.期末基金份额净值	1.287

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。

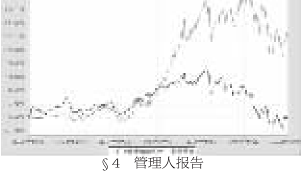
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	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	-3.60%	1.36%	-1.83%	0.85%	-1.77%	0.51%

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

广发优企精选灵活配置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历史走势对比图
(2016年8月4日至2018年9月30日)



§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		
傅友兴	本基金的基金经理；广发稳健增长混合基金的基金经理；广发鑫和基金的基金经理；价值投资部总经理	2016-08-04	-	16年	傅友兴先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任天同基金管理有限公司研究员、基金经理助理、投委会秘书，广发基金管理有限公司研究发展部研究员、基金经理助理、研究发展部副总经理、研究发展部总经理、权益投资一部副总经理、广发聚丰混合型证券投资基金的基金经理（自2013年2月5日至2016年2月23日）、广发稳安保本混合型证券投资基金的基金经理（自2016年2月4日至2017年8月4日）、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自2016年12月30日至2018年1月9日）、广发聚安混合型证券投资基金的基金经理（自2017年3月1日至2018年3月14日）。现任广发基金管理有限公司价值投资部总经理、广发稳健增长开放式证券投资基金的基金经理（自2014年12月8日起任职）、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理（自2016年8月4日起任职）、广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2018年1月29日起）。

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》及其配套法规、《广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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。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，投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度，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

本公司原则上禁止不同投资组合之间（完全按照有关指数的构成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。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，中美贸易战逐渐升级，美国对中国出口征税范围从最初的500亿美元扩到最新的2000亿美元。此外，随着社融月度增量持续负增长，高频数据显示经济增速开始下行，之前市场预期景气度上行的消费行业也出现增速下降迹象，叠加疫苗事件以及带量采购等政策的负面冲击，消费、医药行业股票大幅补跌。三季度，沪深300跌2.05；中证500跌7.99%；中小板指跌11.22%；创业板指跌12.16%。行业方面，低估值的银行、石化、保险等涨幅靠前，家电、服装、电子、医药等行业跌幅较大。

本基金在三季度主要减持农业、建筑、轻工等行业，增持了消费、交运等行业，基金的股票仓位有所下降。三季度，组合的消费、医药持仓下跌造成组合净值表现不理想。贸易战、去杠杆、经济放缓、行业政策冲击等等，综合造成今年的投资遭遇较大的困难。管理人认为，随着市场整体估值趋近底部区域，上市公司的分化将逐步展开。管理人将以审慎、严谨的态度对组合持仓保持紧密的基本面跟踪与评估，积极应对当下的困难与挑战。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金净值增长率为-3.60%，同期业绩比较基准收益率-1.83%。

§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	915,940,520.74	71.13
	其中：股票	915,940,520.74	71.13
2	固定收益投资	59,634,000.00	4.63
	其中：债券	59,634,000.00	4.63
	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	200,000,000.00	15.53
	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	96,933,170.97	7.53
7	其他各项资产	15,235,545.77	1.18
8	合计	1,287,743,237.48	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	19,409,400.00	1.52
C	制造业	767,402,700.47	60.17
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	40,548,420.27	3.18
H	住宿和餐饮业	24,300,000.00	1.91
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	64,280,000.00	5.04
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	915,940,520.74	71.82

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	300357	我武生物	1,800,000	80,730,000.00	6.33
2	002202	金风科技	5,086,000	61,082,860.00	4.79
3	002557	洽洽食品	3,281,626	56,640,864.76	4.44
4	600332	白云山	1,500,000	54,900,000.00	4.30
5	603517	绝味食品	1,300,000	54,470,000.00	4.27
6	600529	山东药玻	3,165,876	54,104,820.84	4.24
7	603866	桃李面包	900,000	52,650,000.00	4.13
8	600132	重庆啤酒	1,800,000	52,578,000.00	4.12
9	600009	上海机场	689,951	40,548,420.27	3.18
10	601601	中国太保	1,000,000	35,510,000.00	2.78

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	59,634,000.00	4.68
	其中：政策性金融债	59,634,000.00	4.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	59,634,000.00	4.68

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	160215	16国开15	600,000	59,634,000.00	4.68

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。

5.11.2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。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	437,468.68
2	应收证券清算款	10,391,484.63
3	应收股利	-
4	应收利息	1,386,763.13
5	应收申购款	3,019,829.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,235,545.77

5.11.4报告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。

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

本报告期期初基金份额总额	715,602,982.58
本报告期基金总申购份额	347,483,547.04
减：本报告期基金总赎回份额	71,797,869.98
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	991,288,659.64

§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

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	53,516,055.05
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	13,379,013.72
报告期期末管理人持有的本基金份额	40,137,041.33
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	4.05

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2018-07-16	-1,114,917.81	-1,525,346.93	-
2	赎回	2018-07-20	-1,114,917.81	-1,506,488.10	-
3	赎回	2018-07-24	-1,114,917.81	-1,483,191.88	-
4	赎回	2018-07-31	-1,114,917.81	-1,449,911.59	-
5	赎回	2018-08-07	-1,114,917.81	-1,350,070.70	-
6	赎回	2018-08-14	-1,114,917.81	-1,415,521.95	-
7	赎回	2018-08-21	-1,114,917.81	-1,350,070.70	-
8	赎回	2018-08-28	-1,114,917.81	-1,431,052.75	-
9	赎回	2018-09-04	-1,114,917.81	-1,397,772.46	-
10	赎回	2018-09-11	-1,114,917.81	-1,370,038.88	-
11	赎回	2018-09-18	-1,114,917.81	-1,336,758.58	-
12	赎回	2018-09-26	-1,114,917.81	-1,391,116.40	-
合计			-13,379,013.72	-17,007,340.92	

注：赎回费85464.02元。

§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优企精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

（二）《广发优企精选灵活配置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）《广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）《广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版

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：查阅时间为每工作日8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：http://www.gffunds.com.cn

广发基金管理有限公司
二〇一八年十月二十五日