# 广发百发大数据策略精选灵活配置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 | 广发百发大数据精选混合 | |
| 基金主代码 | 001741 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2015年9月14日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 66,115,190.33份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过大类资产的灵活配置,精选股票进行投资,力求实现基金资产的持续稳定增值。 | |
| 投资策略 | 本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,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,以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 | 50%×中证800指数收益率＋50%×中证全债指数收益率。 | |
| 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 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 广发百发大数据精选混合A | 广发百发大数据精选混合E |
| 下属分级基金的交易代码 | 001741 | 001742 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 17,655,745.37份 | 48,459,444.96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) | |
|---|---|---|
| | 广发百发大数据精选混合A | 广发百发大数据精选混合E |
| 1.本期已实现收益 | 150,638.99 | 419,784.97 |
| 2.本期利润 | -1,082,518.87 | -3,033,976.82 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0613 | -0.0621 |
| 4.期末基金资产净值 | 16,640,254.88 | 45,641,196.04 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.942 | 0.942 |

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、广发百发大数据精选混合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 | -6.18% | 1.36% | -1.09% | 0.65% | -5.09% | 0.71% |

2、广发百发大数据精选混合E:

| 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 | -6.08% | 1.35% | -1.09% | 0.65% | -4.99% | 0.70% |

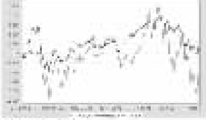
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发百发大数据策略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的历史走势对比图

(2015年9月14日至2018年9月30日)

1. 广发百发大数据精选混合A:



§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 | | |
| 季峰 | 本基金的基金经理;广发百发100指数基金的基金经理;广发百发大数据成长混合基金的基金经理;广发百发大数据价值混合基金的基金经理;广发东财大数据精选基金的基金经理;量化投资部副总经理 | 2015-09-14 | - | 9年 | 季峰先生,管理学博士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾在深圳证券交易所从事博士后研究，曾任广发基金管理有限公司数量投资部研究员、数据策略投资部副总经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2014年10月21日至2016年5月26日）、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2015年2月13日至2016年5月26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2015年3月25日至2016年5月26日）。现任广发基金管理有限公司量化投资部副总经理、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金基金经理（自2014年11月24日起任职）、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年9月14日起任职）、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年11月18日起任职）、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年6月16日起任职）、广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年12月11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、《广发百发大数据策略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

回顾三季度,市场整体持续震荡下行。虽然,电子、军工等行业一度快速修复,但区间内整体行情仍然维持周期、金融相对领先,成长板块持续承压的格局。市场悲观情绪主要来源于宏观环境——从最新的9月PMI数据来看,PMI主要分项全面下滑,反映经济尚处于下行区间。此外,海外风险事件的持续发酵也给市场增加了不确定性,美联储加息、鹰派言论叠加油价的上行,使得美债收益率向上突破3.2%,压制股票市场的估值,推助避险情绪在全球范围蔓延。

面对存在下行压力的国内经济环境及美联储加息和美债收益率持续上行所带来的汇率风险，国内对冲政策持续稳步推进——央行通过定向降准与货币工具持续释放边际宽松信号,维持市场流动性稳定。此外,减税、降费等积极财政政策仍有空间。经历了近三个季度的调整,市场风险偏好已经在低位徘徊，尚等待外部风险缓释与内生经济的积极信号提振后市。

三季度期间,组合保持整体仓位水平稳定,坚持布局业绩稳定龙头的策略,虽然阶段承压但中长期区间内会凸显其配置价值。四季度,产品运作重点将在于规避潜在的系统性风险,在保持风格稳定的基础上,适当把握市场企稳修复的机会带来的波段收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发百发大数据精选混合基金A类净值增长率为-6.18%,E类净值增长率为-6.08%,同期业绩比较基准收益率为-1.09%。

§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 | 44,084,785.08 | 67.01 |
| | 其中:股票 | 44,084,785.08 | 67.01 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 3,100,000.00 | 4.71 |
| | 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 | 18,415,781.81 | 27.99 |
| 7 | 其他各项资产 | 188,650.44 | 0.29 |
| 8 | 合计 | 65,789,217.33 | 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 | 39,320,847.40 | 63.13 |
| 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 | 111.68 | 0.00 |
| J | 金融业 | 1,614,500.00 | 2.59 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,149,326.00 | 5.06 |
| 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 | 44,084,785.08 | 70.78 |

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 | 002304 | 洋河股份 | 31,500 | 4,032,000.00 | 6.47 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 5,100 | 3,723,000.00 | 5.98 |
| 3 | 603288 | 海天味业 | 43,600 | 3,453,120.00 | 5.54 |
| 4 | 601888 | 中国国旅 | 46,300 | 3,149,326.00 | 5.06 |
| 5 | 600887 | 伊利股份 | 114,900 | 2,950,632.00 | 4.74 |
| 6 | 600559 | 老白干酒 | 150,080 | 2,737,459.20 | 4.40 |
| 7 | 000568 | 泸州老窖 | 55,640 | 2,643,456.40 | 4.24 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 36,748 | 2,497,026.60 | 4.01 |
| 9 | 000651 | 格力电器 | 51,800 | 2,082,360.00 | 3.34 |
| 10 | 603369 | 今世缘 | 98,400 | 1,968,000.00 | 3.16 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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 | 18,568.96 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 3,091.50 |
| 5 | 应收申购款 | 166,989.98 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 188,650.44 |

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 | 广发百发大数据精选混合A | 广发百发大数据精选混合E |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 17,820,929.66 | 50,106,519.06 |
| 本报告期基金总申购份额 | 497,426.71 | 1,019,798.59 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 662,611.00 | 2,666,872.69 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 17,655,745.37 | 48,459,444.96 |

§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百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

（二）《广发百发大数据策略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）《广发百发大数据策略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）《广发百发大数据策略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

# 广发科技动力股票型证券投资基金

## 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 | 广发科技动力股票 |
| 基金主代码 | 005777 |
| 交易代码 | 005777 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2018年5月31日 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,134,682,397.36份 |
| 投资目标 | 本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票,在深入研究的基础上,重点投资以科研技术为核心驱动力的行业及个股,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金为一只股票型基金，其股票投资比例占基金资产的比例为80%–95%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内,本基金将根据对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析,合理地进行股票、债券和现金类资产的配置。 |
| 业绩比较基准 | 中证800指数收益率×60%＋人民币计价的恒生综合指数收益率×20%+中证全债指数收益率×20%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |
| 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 |

§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 | -53,626,036.52 |
| 2.本期利润 | -162,738,855.79 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0721 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,976,392,624.23 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9258 |

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

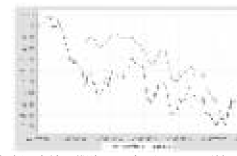
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -7.30% | 0.57% | -2.23% | 0.96% | -5.07% | -0.39% |

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

广发科技动力股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年5月31日至2018年9月30日)



注:（1）本基金合同生效日期为2018年5月31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,至披露时点本基金仍处于建仓期。

§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;国际业务部总经理助理 | 2018-05-31 | - | 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日起任职）、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）。 |

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、《广发科技动力股票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。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

7月,港股市场继续呈现弱势震荡行情全月跌1.29%,恒生国企指数跌0.44%。具体来看,7月份市场相较于6月份的剧烈波动,已经有所改善,指数呈现宽幅震荡的走势,境内外走势各异。一方面,外围欧美市场向好,而另一方面,A股市场表现持续惨淡,因此港股中途有一定幅度的反弹,但是由于A股传导的负面情绪,港股相对走弱。同时,本月影响市场的事件性因素交错,中美贸易战阴霾继续压制市场的投资情绪,市场担忧美国继续加码对中国2000亿美元商品加征关税，而内地疫苗造假也引发了医药板块调整的一个黑天鹅事件，此外部分美国科技龙头股如Facebook由于业绩和管理层指引不及预期导致股价下跌,传导效应导致港股科技板块明显下跌,而在利好方面,7月20日央行发布了资管新规细则,大方向不变但节奏适度放缓,同时国常会释放出货币宽松政策保经济增长的积极信号,市场反应积极,随后港股和A股同步上涨,其中直接受益的周期类、基建板块迎来一波上涨行情。

8月港股继续呈现弱势震荡行情,恒生指数收报27888.55,全月跌2.43%,恒生国企股指数跌1.35%，而A股方面则继续显著下跌，上证综指跌5.25%，沪深300指数跌5.21%,创业板指数跌8.07%。本月市场情绪继续受到压制,一方面人民币汇率继续贬值,月中离岸人民币兑美元汇率一度触及6.9580,人民币资产受汇率影响表现低迷;另一方面,7月份内地消费数据大幅低于市场预期，表明在持续的去杠杆进程以及内忧外患影响下,内地经济情况不容乐观;此外,起源于土耳其货币危机的新兴市场调整风险在月中又开始发酵,新兴市场再次面临利空洗礼,市场风险偏好受到多重因素打击,港股跟随A股走弱,中旬的下跌尤其显著。从板块层面来看,本月主要板块轮番表现不佳,权重蓝筹板块的金融地产表现弱势,教育板块的集体大跌拖累了消费者服务板块走势,进入业绩期科技重磅股腾讯和舜宇光学由于业绩不及预期而显著下跌,拖累科技板块表现。下旬市场开始反弹,人民币走势企稳,人民币汇率重启逆周期因子有助于稳定市场预期。

9月港股继续呈现弱势震荡行情,恒生指数全月下跌-0.36%,恒生国企股指数上涨1.31%,而A股方面则小幅反弹,上证综指全月上涨3.53%,沪深300指数全月上涨3.13%,创业板指数下跌-1.66%。本月初,受到多个新兴市场股市汇市暴跌影响,同时担忧人民币汇率走弱,投资者风险偏好下降,香港市场继续下探并创出年内新低。下旬市场开始反弹,受中美贸易谈判重启消息和权重股腾讯控股的回购影响,港股有所走高。临近月底,在内地货币政策宽松传闻的带动下,两地金融股全线上涨,港股也跟随A股走强,收复了月初跌幅。从板块层面看,本月恒生能源板块涨幅居前,9月油价快速上行并突破70美元关口,提振了板块投资情绪。此外恒生电讯指数在电信和联通合并传言刺激下走强。而受显著低于预期的收入数据影响，澳门博彩板块回调较多,带累消费者服务板块走势不佳,全月累计下跌-5.64%。

操作上,市场总体在三季度呈现宽幅震荡的格局，在经历六月的市场大幅下跌后,指数已经经历了较大的调整,我们认为A股和港股的配置慢慢进入价值区间,建仓进程陆续展开。经历了疫苗事件后的医药股有一定的配置机会,中长期我们认为中国的生物药将要进入一个快速的增长阶段,我们慢慢增加医药股票的配置比例。同时由于外围对中国的贸易摩擦增加,国内增加科技投入的趋势不变,我们在建仓上选择了云计算、半导体设备、高端制造等板块的配置比例,我们认为中长期信息科技的投入将会持续,中国的信息科技企业将会崛起,这方面的配置将持续的增加。废行业持续景气,我们认为该行业会在中长期获得持续稳定的增长,重点配置危废行业。

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-7.30%，同期业绩比较基准收益率为-2.23%。

§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 | 1,397,616,927.29 | 69.09 |
| | 其中:股票 | 1,397,616,927.29 | 69.09 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 300,000,000.00 | 14.83 |
| | 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 | 232,101,058.70 | 11.47 |
| 7 | 其他各项资产 | 93,038,962.73 | 4.60 |
| 8 | 合计 | 2,022,756,948.72 | 100.00 |

注:权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为359,685,086.83元，占基金资产净值比例18.20%。

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 | 729,421,676.57 | 36.91 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 7,914,622.00 | 0.40 |
| 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 | 194,948,158.47 | 9.86 |
| J | 金融业 | 101,590,408.54 | 5.14 |
| 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 | 4,056,974.88 | 0.21 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,037,931,840.46 | 52.52 |

5.2.2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(%) |
|---|---|---|
| 信息技术 | 167,661,792.42 | 8.48 |
| 工业 | 82,546,585.42 | 4.18 |
| 医疗保健 | 43,316,260.32 | 2.19 |
| 金融 | 39,035,461.95 | 1.98 |
| 非日常生活消费品 | 27,124,986.72 | 1.37 |
| 合计 | 359,685,086.83 | 18.20 |

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 | 600690 | 青岛海尔 | 7,849,735 | 129,677,622.20 | 6.56 |
| 2 | 000546 | 金圆股份 | 11,032,253 | 115,948,979.03 | 5.87 |
| 3 | 00700 | 腾讯控股 | 367,300 | 104,460,061.23 | 5.29 |
| 4 | 002410 | 广联达 | 3,705,433 | 99,231,495.74 | 5.02 |
| 5 | 300122 | 智飞生物 | 1,357,100 | 66,443,616.00 | 3.36 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 706,660 | 44,872,910.00 | 2.27 |
| 7 | 002371 | 北方华创 | 886,324 | 41,710,407.44 | 2.11 |
| 8 | 600031 | 三一重工 | 4,668,948 | 41,460,258.24 | 2.10 |
| 9 | 000001 | 平安银行 | 3,693,975 | 40,818,423.75 | 2.07 |
| 10 | 01766 | 中国中车 | 6,425,000 | 40,423,803.06 | 2.05 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

| 代码 | 名称 | 持仓量 | 合约市值(元) | 公允价值变动(元) | 风险说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| IC1810 | IC1810 | -21.00 | -20,172,600.00 | -772,153.84 | - |
| IF1810 | IF1810 | -48.00 | -49,527,360.00 | -2,108,386.52 | - |
| 公允价值变动总额合计(元) | | | | | -2,880,540.36 |
| 股指期货投资本期收益(元) | | | | | 1,506,892.69 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | | | | | -2,880,540.36 |

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 | 12,449,533.24 |
| 2 | 应收证券清算款 | 80,670,096.29 |
| 3 | 应收股利 | 51,469.34 |
| 4 | 应收利息 | -184,657.35 |
| 5 | 应收申购款 | 52,521.21 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 93,038,962.73 |

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 | 2,565,864,148.50 |
| 本报告期基金总申购份额 | 24,654,969.52 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 455,836,720.66 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,134,682,397.36 |

§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）中国证监会批准广发科技动力股票型证券投资基金募集的文件

（二）《广发科技动力股票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）《广发科技动力股票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）《广发科技动力股票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

# 广发睿毅领先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:兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业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 | 广发睿毅领先混合 |
| 基金主代码 | 005233 |
| 交易代码 | 005233 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017年12月14日 |
| 报告期末基金份额总额 | 167,606,781.53份 |
| 投资目标 | 在保持资产流动性的基础上，本基金主要通过充分挖掘符合中国经济转型升级发展方向的行业中领先企业的投资机会，并结合资本市场的运行状况对大类资产配置进行优化,力争超越本基金业绩比较基准,实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,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,以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 | 75%×沪深300指数收益率+25%×中证全债指数收益率。 |
| 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 | 兴业银行股份有限公司 |

§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 | -5,521,267.71 |
| 2.本期利润 | -1,007,575.93 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0081 |
| 4.期末基金资产净值 | 166,180,417.08 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9915 |

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 | -0.98% | 1.32% | -1.20% | 1.02% | 0.22% | 0.30% |

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

广发睿毅领先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

(2017年12月14日至2018年9月30日)

注:（1）本基金合同生效日期为2017年12月14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 | | |
| 林英睿 | 本基金的基金经理;广发多策略混合基金的基金经理 | 2017-12-14 | - | 7年 | 林英睿先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任瑞银证券研究员,中欧基金管理有限公司基金经理助理兼研究员、基金经理,广发基金管理有限公司权益投资一部研究员。现任广发多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年12月16日起任职）、广发睿毅领先混合型证券投资基金基金经理（自2017年12月14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 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、《广发睿毅领先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

今年3季度市场分化明显加大，以上证50为代表的大盘股上涨5.11%,以中证1000为代表的中小公司下跌11.08%,跟去年类似的情况在一定程度上说明了权益市场流动性的紧张以及各行业市占率的大体变化。我们将继续保持分散的方式，沿着基本面景气的角度去寻找标的。

广发睿毅领先中长期的投资目标和策略为:1.希望通过努力,在中长期能够持续稳定地为持有人创造绝对回报。因此在分析行业分析公司以及具体交易决策时,大致的思维逻辑是:1）是不是正的预期回报,对应的风险大致如何;2）在多长的时间框架内能够实现这个回报,相对各类资产收益率来看是否划算;3）这个决策是否有可复制性;2.要想战胜市场，即战胜大部分的市场参与者，意味着要敢于与市场主流有偏离。因此不轻易追热点,不盲目怕冷门;3.影响市场的因子是纷繁复杂的,其数量和影响权重是不断变化的。我们会努力去抓主要矛盾,但也明确地知道,理解市场特别是预测市场,在很多时候靠勤奋和禀赋是远远不够的。因此对市场变化保持持续的关注度,我们认为应对的分值不应该低于预测太多,尊重和敬畏市场;重点投资A股市场中周期企稳向好行业以及有可持续性成长行业里的优质公司，紧密跟踪和把握市场变化趋势,适度动态调整,试图构建一个稳健向上的净值曲线。

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-0.98%,同期业绩比较基准收益率-1.20%。

§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 | 123,526,718.66 | 70.15 |
| | 其中:股票 | 123,526,718.66 | 70.15 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中:债券 | - | - |
| | 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 | 34,000,000.00 | 19.31 |
| | 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 | 12,989,066.00 | 7.38 |
| 7 | 其他各项资产 | 5,570,929.40 | 3.16 |
| 8 | 合计 | 176,086,714.06 | 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 | 43,641,476.21 | 26.26 |
| B | 采矿业 | 5,040,960.00 | 3.03 |
| C | 制造业 | 35,518,390.45 | 21.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 9,438,801.00 | 5.68 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 2,989,764.00 | 1.80 |
| 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 | 19,321,022.00 | 11.63 |
| J | 金融业 | - | - |
| 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 | 3,051,774.00 | 1.84 |
| 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 | 4,524,531.00 | 2.72 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 123,526,718.66 | 74.33 |

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 | 002299 | 圣农发展 | 725,182 | 11,863,977.52 | 7.14 |
| 2 | 002696 | 百洋股份 | 1,045,649 | 9,369,015.04 | 5.64 |
| 3 | 002234 | 民和股份 | 684,600 | 8,413,734.00 | 5.06 |
| 4 | 603393 | 新天然气 | 205,300 | 8,370,081.00 | 5.04 |
| 5 | 002458 | 益生股份 | 546,697 | 8,173,120.15 | 4.92 |
| 6 | 300523 | 辰安科技 | 99,800 | 6,508,956.00 | 3.92 |
| 7 | 600803 | 新奥股份 | 367,771 | 5,538,631.26 | 3.33 |
| 8 | 600028 | 中国石化 | 708,000 | 5,040,960.00 | 3.03 |
| 9 | 002746 | 仙坛股份 | 354,650 | 4,911,902.50 | 2.96 |
| 10 | 300601 | 康泰生物 | 75,100 | 3,266,850.00 | 1.97 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

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根据公开市场信息,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 | 253,845.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,306,849.61 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | -21,971.99 |
| 5 | 应收申购款 | 32,206.73 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,570,929.40 |

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 | 116,069,310.29 |
| 本报告期基金总申购份额 | 74,158,115.74 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 22,620,644.50 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 167,606,781.53 |

§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 | 20180912-20180930 | - | 50,717,650.25 | 0.00 | 50,717,650.25 | 30.26% |
| 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

（一）中国证监会批准广发睿毅领先混合型证券投资基金募集的文件

（二）《广发睿毅领先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）《广发睿毅领先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）《广发睿毅领先混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版

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。

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日