

广发聚安混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2.证券从业的合法遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.报告期内本基金运作遵守信守情况的说明

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、《广发聚安混合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,在严格控制投资风险的基础上,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,无损害基金份额持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法律法规及基金合同的约定。

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,并通过及时的监控与及时的分析和评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制定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决策制度,投资组合在授权范围内可自主决策,超过投资组合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,公平交易原则,金融工程与风险管理部风险控制岗通过交易系统对投资交易全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督稽核,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,如因应对大额赎回等特殊情况进行反向交易的,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同日反向交易的情况,与本公司管理的被动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收盘价格的5%。这些交易不存在任何利益输送的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

宏观经济稳中趋升有所预期,通胀预期有所升温,货币政策保持稳健中性,资金利率下降,但基建等稳增长的实际稳增长效果,叠加近期降准等宽松不能确定性因素的支持,市场对于经济下滑的预期进一步趋化,资产价格方面,长期利率在下降下,整体维持震荡;中期债收益率显著下降,获得不错的收益,权益资产继续下行,行业分化进一步分化,本基金以中短期的AA类固本为主,基于经济下行的判断,精选了7-10年期的金融债,适度提高了组合久期,权益仓位略有下调。

4.5 报告期内基金的投资表现

本报告期内,广发聚安混合A类净值增长率为11.5%,广发聚安混合C类净值增长率为0.6%,同期业绩比较基准收益率为0.32%。

5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

Table with columns: 序号, 代码, 名称, 数量, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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股票投资组合

5.2.2 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

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债券投资明细

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五名债券投资明细

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十名贵金属投资明细

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五名权证投资明细

5.7 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.8 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9 投资组合报告附注

5.11 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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。

5.12 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。

5.13 其他各项资产构成

5.14 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.16 报告期末前十名权证中存在流通受限情况的说明

5.17 开放式基金份额变动

5.18 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.19 影响投资者决策的其他重要信息

5.20 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

5.21 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.22 影响投资者决策的其他重要信息

5.23 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

5.24 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.25 影响投资者决策的其他重要信息

5.26 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

5.27 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.28 影响投资者决策的其他重要信息

5.29 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

5.30 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.31 影响投资者决策的其他重要信息

5.32 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

5.33 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.34 影响投资者决策的其他重要信息

5.35 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

5.36 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.37 影响投资者决策的其他重要信息

5.38 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

5.39 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.40 影响投资者决策的其他重要信息

5.41 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

5.42 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.43 影响投资者决策的其他重要信息

5.44 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

5.45 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.46 影响投资者决策的其他重要信息

5.47 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

5.48 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.49 影响投资者决策的其他重要信息

5.50 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

5.51 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.52 影响投资者决策的其他重要信息

5.53 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

5.54 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.55 影响投资者决策的其他重要信息

5.56 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

5.57 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.58 影响投资者决策的其他重要信息

5.59 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

5.60 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.61 影响投资者决策的其他重要信息

5.62 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

5.63 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.64 影响投资者决策的其他重要信息

5.65 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

5.66 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.67 影响投资者决策的其他重要信息

5.68 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

5.69 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.70 影响投资者决策的其他重要信息

5.71 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

5.72 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.73 影响投资者决策的其他重要信息

5.74 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

5.75 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.76 影响投资者决策的其他重要信息

5.77 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

5.78 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.79 影响投资者决策的其他重要信息

5.80 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

5.81 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.82 影响投资者决策的其他重要信息

5.83 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

5.84 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.85 影响投资者决策的其他重要信息

5.86 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

5.87 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.88 影响投资者决策的其他重要信息

5.89 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

5.90 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.91 影响投资者决策的其他重要信息

5.92 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

5.93 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.94 影响投资者决策的其他重要信息

5.95 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

5.96 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.97 影响投资者决策的其他重要信息

5.98 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

5.99 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.100 影响投资者决策的其他重要信息

5.101 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

5.102 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.103 影响投资者决策的其他重要信息

5.104 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

5.105 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.106 影响投资者决策的其他重要信息

5.107 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

5.108 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.109 影响投资者决策的其他重要信息

5.110 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

5.111 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.112 影响投资者决策的其他重要信息

5.113 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

5.114 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.115 影响投资者决策的其他重要信息

5.116 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

5.117 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.118 影响投资者决策的其他重要信息

5.119 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

5.120 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.121 影响投资者决策的其他重要信息

5.122 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

5.123 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.124 影响投资者决策的其他重要信息

5.125 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

5.126 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.127 影响投资者决策的其他重要信息

5.128 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

5.129 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.130 影响投资者决策的其他重要信息

5.131 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

5.132 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.133 影响投资者决策的其他重要信息

5.134 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

5.135 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.136 影响投资者决策的其他重要信息

5.137 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

5.138 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.139 影响投资者决策的其他重要信息

5.140 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

5.141 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.142 影响投资者决策的其他重要信息

5.143 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

5.144 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.145 影响投资者决策的其他重要信息

5.146 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

5.147 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.148 影响投资者决策的其他重要信息

5.149 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

5.150 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.151 影响投资者决策的其他重要信息

5.152 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

5.153 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.154 影响投资者决策的其他重要信息

5.155 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

5.156 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.157 影响投资者决策的其他重要信息

5.158 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

5.159 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.160 影响投资者决策的其他重要信息

5.161 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

5.162 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.163 影响投资者决策的其他重要信息

5.164 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

5.165 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.166 影响投资者决策的其他重要信息

5.167 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

5.168 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.169 影响投资者决策的其他重要信息

5.170 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

5.171 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.172 影响投资者决策的其他重要信息

5.173 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

5.174 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.175 影响投资者决策的其他重要信息

5.176 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

5.177 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.178 影响投资者决策的其他重要信息

5.179 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

5.180 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.181 影响投资者决策的其他重要信息

5.182 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

5.183 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.184 影响投资者决策的其他重要信息

5.185 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

5.186 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.187 影响投资者决策的其他重要信息

5.188 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

5.189 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.190 影响投资者决策的其他重要信息

5.191 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

5.192 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.193 影响投资者决策的其他重要信息

5.194 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

5.195 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.196 影响投资者决策的其他重要信息

5.197 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

5.198 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.199 影响投资者决策的其他重要信息

5.200 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

5.201 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.202 影响投资者决策的其他重要信息

5.203 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

5.204 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.205 影响投资者决策的其他重要信息

5.206 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

5.207 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.208 影响投资者决策的其他重要信息

5.209 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

5.210 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.211 影响投资者决策的其他重要信息

5.212 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

5.213 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.214 影响投资者决策的其他重要信息

5.215 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

5.216 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

5.217 影响