# 广发聚鑫债券型证券投资基金

## 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 | 广发聚鑫债券 | |
| 基金主代码 | 000118 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2013年6月5日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 357,173,844.73份 | |
| 投资目标 | 在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过积极主动的投资管理，追求较高的当期收益和长期回报，力争实现基金资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 本基金将密切关注股票、债券市场的运行状况与风险收益特征，通过自上而下的定性分析和定量分析，综合分析宏观经济形势、国家政策、市场流动性和估值水平等因素，判断金融市场运行趋势和不同资产类别在经济周期的不同阶段的相对投资价值，对各大类资产的风险收益特征进行评估，从而确定固定收益类资产和权益类资产的配置比例，并依据各因素的动态变化进行及时调整。 | |
| 业绩比较基准 | 中债总全价指数收益率 | |
| 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。 | |
| 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 | 广发聚鑫债券A | 广发聚鑫债券C |
| 下属分级基金的交易代码 | 000118 | 000119 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 184,430,882.58份 | 172,742,962.15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） | |
|---|---|---|
| | 广发聚鑫债券A | 广发聚鑫债券C |
| 1.本期已实现收益 | -2,874,141.92 | -2,963,206.10 |
| 2.本期利润 | -2,720,118.61 | -4,269,149.21 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0126 | -0.0233 |
| 4.期末基金资产净值 | 222,446,913.75 | 206,434,019.60 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.206 | 1.195 |

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、广发聚鑫债券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 | -0.99% | 0.57% | 0.17% | 0.10% | -1.16% | 0.47% |

2、广发聚鑫债券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 | -1.08% | 0.56% | 0.17% | 0.10% | -1.25% | 0.46% |

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

广发聚鑫债券型证券投资基金

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

(2013年6月5日至2018年9月30日)

1. 广发聚鑫债券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 | | |
| 张芊 | 本基金的基金经理；广发纯债债券基金的基金经理；广发集鑫债券基金的基金经理；广发聚裕混合基金的基金经理；广发集裕债券基金的基金经理；广发集丰债券基金的基金经理；广发集安债券基金的基金经理；广发集源债券基金的基金经理；公司副总经理、固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理 | 2013-07-12 | - | 17年 | 张芊女士，经济学和工商管理双硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中国银河证券研究中心研究员，中国人保资产管理有限公司高级研究员、投资主管，工银瑞信基金管理有限公司研究员，长盛基金管理有限公司投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部总经理、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年11月23日至2016年12月8日）、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年12月30日至2017年2月6日）、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年12月29日至2018年1月6日）。现任广发基金管理有限公司副总经理、固定收益投资总监、固定收益管理总部总经理，广发纯债债券型证券投资基金基金经理（自2012年12月14日起任职）、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理（自2013年7月12日起任职）、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理（自2015年12月25日起任职）、广发聚裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2016年3月1日起任职）、广发集裕债券型证券投资基金基金经理（自2016年5月11日起任职）、广发集丰债券型证券投资基金基金经理（自2016年11月1日起任职）、广发集安债券型证券投资基金基金经理（自2017年1月20日起任职）、广发集源债券型证券投资基金基金经理（自2017年1月20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、《广发聚鑫债券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

本季度，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，信用违约事件仍然层出不穷，尤其集中在中低资质民企，中低评级信用利差和等级利差继续小幅走阔。组合三季度，密切跟踪市场动向，灵活调整持仓券种结构、组合杠杆和久期分布。转债和股票方面主要关注市场变化择时参与，在7-8月都略有增加，随后择机进行减仓操作。展望下季度，债市将受益于基本面与货币政策宽松，但通胀预期、中美利差以及汇率压力将不利于债市表现，组合将继续跟踪经济基本面、货币政策等方面变化，增强操作的灵活性，同时注意做好持仓券种梳理，优化持仓结构。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发聚鑫债券A类净值增长率为-0.99%，广发聚鑫债券C类净值增长率为-1.08%，同期业绩比较基准收益率为0.17%

§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 | 85,579,783.93 | 16.98 |
| | 其中：股票 | 85,579,783.93 | 16.98 |
| 2 | 固定收益投资 | 409,823,965.19 | 81.32 |
| | 其中：债券 | 399,823,965.19 | 79.34 |
| | 资产支持证券 | 10,000,000.00 | 1.98 |
| 3 | 贵金属投资 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买入返售金融资产 | 2,600,000.00 | 0.52 |
| | 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 | 1,637,474.38 | 0.32 |
| 7 | 其他各项资产 | 4,318,711.37 | 0.86 |
| 8 | 合计 | 503,959,934.87 | 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 | 2,419,213.68 | 0.56 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 60,568,178.86 | 14.12 |
| 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 | 17,299,566.39 | 4.03 |
| J | 金融业 | 2,495,097.00 | 0.58 |
| 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 | 2,797,728.00 | 0.65 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 85,579,783.93 | 19.95 |

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 | 000988 | 华工科技 | 809,104 | 11,893,828.80 | 2.77 |
| 2 | 002050 | 三花智控 | 853,600 | 11,369,952.00 | 2.65 |
| 3 | 600019 | 宝钢股份 | 1,131,800 | 8,884,630.00 | 2.07 |
| 4 | 002410 | 广联达 | 302,479 | 8,100,387.62 | 1.89 |
| 5 | 600426 | 华鲁恒升 | 442,309 | 7,612,137.89 | 1.77 |
| 6 | 300750 | 宁德时代 | 80,700 | 5,891,100.00 | 1.37 |
| 7 | 603605 | 珀莱雅 | 129,179 | 5,571,490.27 | 1.30 |
| 8 | 002439 | 启明星辰 | 242,557 | 4,574,625.02 | 1.07 |
| 9 | 002230 | 科大讯飞 | 120,500 | 3,442,685.00 | 0.80 |
| 10 | 603228 | 景旺电子 | 53,626 | 2,916,181.88 | 0.68 |

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 | 22,195,890.00 | 5.18 |
| | 其中：政策性金融债 | 22,195,890.00 | 5.18 |
| 4 | 企业债券 | 104,252,657.10 | 24.31 |
| 5 | 企业短期融资券 | 20,032,000.00 | 4.67 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | 253,343,418.09 | 59.07 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 399,823,965.19 | 93.22 |

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 | 113019 | N玲珑转 | 212,040 | 21,865,564.80 | 5.10 |
| 2 | 018005 | 国开1701 | 210,000 | 21,086,100.00 | 4.92 |
| 3 | 143271 | 17南铝债 | 200,000 | 20,152,000.00 | 4.70 |
| 4 | 011801527 | 18北控迪SCP003 | 200,000 | 20,032,000.00 | 4.67 |
| 5 | 132014 | 18中化EB | 184,750 | 19,158,575.00 | 4.47 |

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

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 146674 | 花呗45A1 | 100,000 | 10,000,000.00 | 2.33 |

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 | 107,168.45 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,192,422.36 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,956,332.65 |
| 5 | 应收申购款 | 62,787.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 4,318,711.37 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113019 | 玲珑转债 | 21,865,564.80 | 5.10 |
| 2 | 128035 | 大族转债 | 18,935,132.40 | 4.42 |
| 3 | 113008 | 电气转债 | 17,197,200.00 | 4.01 |
| 4 | 110031 | 航信转债 | 16,359,358.20 | 3.81 |
| 5 | 123003 | 蓝思转债 | 16,351,761.60 | 3.81 |
| 6 | 123006 | 东财转债 | 15,540,284.97 | 3.62 |
| 7 | 110042 | 航电转债 | 14,233,600.00 | 3.32 |
| 8 | 132009 | 17中油EB | 13,389,795.00 | 3.12 |
| 9 | 128027 | 崇达转债 | 10,759,448.70 | 2.51 |
| 10 | 110040 | 生益转债 | 6,853,356.00 | 1.60 |
| 11 | 128029 | 太阳转债 | 6,033,280.86 | 1.41 |
| 12 | 123002 | 国祯转债 | 4,349,220.62 | 1.01 |
| 13 | 128024 | 宁行转债 | 3,632,309.31 | 0.85 |
| 14 | 113504 | 艾华转债 | 2,918,401.20 | 0.68 |
| 15 | 128020 | 水晶转债 | 1,839,800.00 | 0.43 |
| 16 | 132007 | 16凤凰EB | 1,327,725.00 | 0.31 |
| 17 | 110032 | 三一转债 | 1,269,300.00 | 0.30 |
| 18 | 110034 | 九州转债 | 1,053,700.00 | 0.25 |
| 19 | 128019 | 久立转2 | 1,046,774.83 | 0.24 |
| 20 | 132012 | 17巨化EB | 97,400.00 | 0.02 |

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 | 广发聚鑫债券A | 广发聚鑫债券C |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 214,284,910.18 | 117,282,501.76 |
| 本报告期基金总申购份额 | 111,863,750.66 | 125,835,451.30 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 141,717,778.26 | 70,374,990.91 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 184,430,882.58 | 172,742,962.15 |

§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 | 20180701-20180930 | 128,368,618.49 | 82,413,664.30 | 48,368,618.49 | 162,413,664.30 | 45.47% |
| 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聚鑫债券型证券投资基金募集的文件

2.《广发聚鑫债券型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.《广发聚鑫债券型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

8.《广发聚鑫债券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

# 广发行业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：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 | 广发行业领先混合 | |
| 基金主代码 | 270025 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2010年11月23日 | |
| 报告期末基金份额总额 | 2,220,052,335.00份 | |
| 投资目标 | 通过把握宏观经济周期及行业生命周期的发展趋势，发掘发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业中的领先企业进行投资，力争为投资者实现资产的长期稳健增值。 | |
| 投资策略 | 不同的行业在经济周期的不同阶段呈现出不同的运行态势。本基金将主要通过"广发领先行业评价体系"，对行业进行定性、定量分析，同时，结合国内外宏观经济环境及国家相关政策的变化，选择发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业作为本基金行业配置的重点。 | |
| 业绩比较基准 | 80%×沪深300指数＋20%×中证全债指数。 | |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。 | |
| 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 | 广发行业领先混合A | 广发行业领先混合H |
| 下属分级基金的交易代码 | 270025 | 960001 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 2,215,716,858.94份 | 4,335,476.06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） | |
|---|---|---|
| | 广发行业领先混合A | 广发行业领先混合H |
| 1.本期已实现收益 | -116,780,499.81 | -144,208.00 |
| 2.本期利润 | -390,717,262.75 | -485,606.31 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.1718 | -0.1077 |
| 4.期末基金资产净值 | 2,329,679,155.51 | 2,829,850.12 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.051 | 0.653 |

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、广发行业领先混合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 | -14.06% | 1.45% | -1.37% | 1.09% | -12.69% | 0.36% |

2、广发行业领先混合H：

| 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 | -13.97% | 1.45% | -1.37% | 1.09% | -12.60% | 0.36% |

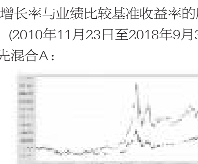
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

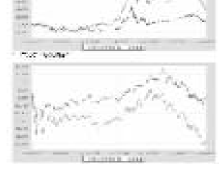
广发行业领先混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010年11月23日至2018年9月30日)

1. 广发行业领先混合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 | | |
| 邱璟旻 | 本基金的基金经理；广发新经济混合基金的基金经理；广发医疗保健股票基金的基金经理；广发聚丰混合基金的基金经理 | 2017-03-29 | 2018-08-06 | 9年 | 邱璟旻先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任申万菱信基金管理有限公司研究员，建信基金管理有限责任公司研究部研究员，广发基金管理有限公司研究发展部研究员、广发基金管理有限公司研究发展部和权益投资一部研究员、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4月20日至2018年8月6日）、广发行业领先混合型证券投资基金基金经理（自2017年3月29日至2018年8月6日）。现任广发新经济混合型发起式证券投资基金基金经理（自2017年3月1日起任职）、广发医疗保健股票型证券投资基金基金经理（自2017年8月10日起任职）、广发聚丰混合型证券投资基金基金经理（自2018年2月2日起任职）。 |
| 刘格菘 | 本基金的基金经理；广发小盘成长混合（LOF）基金的基金经理；广发创新升级混合基金的基金经理；广发鑫享混合基金的基金经理；成长投资部总经理，兼任北京权益投资部总经理 | 2017-06-19 | - | 8年 | 刘格菘先生，经济学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理，融通基金管理有限公司权益投资部总经理、基金经理，广发基金管理有限公司权益投资一部研究员、权益投资一部副总经理、北京权益投资部总经理。现任广发基金管理有限公司成长投资部总经理、广发行业领先混合型证券投资基金基金经理（自2017年6月19日起任职）、广发小盘成长混合型证券投资基金(LOF)基金经理（自2017年6月19日起任职）、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年7月5日起任职）、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年11月9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、《广发行业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

2018年3季度的宏观经济运行平稳回落，CPI稳中有升，但整体仍维持在较低位置，PPI逐季下滑，显示由于供给侧结构性改革带来的工业品价格上涨趋缓。3季度出口仍然较强，流动性方面呈现略偏宽松的局面，显示出宏观调控逆周期的属性。中美贸易摩擦预期的扰动变大。

市场层面，3季度仍然延续了二季度低迷的市场环境，而且从结构上看，市场的热点行业和板块更加稀缺、更加分散，持续性更差，成交量收窄，市场活跃度很低。本基金在3季度重点配置了科技成长类行业和公司，主要是云计算、半导体、新能源车龙头以及部分消费升级领域龙头。我们认为立足于当前，市场的风险收益比已经比较突出，上证综指、深成指等重点指数已经跌破2016年熔断低点，创业板指已经跌破2014年位置，各指数静态PE已经在历史新低位置。我们预期4季度的市场行情可能会有所表现，部分行业或有较好的结构性行情。

本基金展望4季度，仍然重点配置科技成长类行业和个股，对一些消费、医药龙头个股也会适当加以配置。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金A类的净值增长率为-14.06%，本基金H类的净值增长率为-13.97%，同期业绩比较基准收益率为-1.37%。

§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 | 1,899,106,199.96 | 80.28 |
| | 其中：股票 | 1,899,106,199.96 | 80.28 |
| 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 | - | - |
| | 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 | 464,891,386.70 | 19.65 |
| 7 | 其他各项资产 | 1,553,431.98 | 0.07 |
| 8 | 合计 | 2,365,551,018.64 | 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 | 1,434,566,728.61 | 61.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 88,782.16 | 0.00 |
| 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 | 270,018,265.58 | 11.58 |
| J | 金融业 | 289,808.46 | 0.01 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 169,534,990.26 | 7.27 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 74,515.29 | 0.00 |
| 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 | 24,533,109.60 | 1.05 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,899,106,199.96 | 81.42 |

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 | 603816 | 顾家家居 | 3,388,431 | 168,743,863.80 | 7.23 |
| 2 | 603986 | 兆易创新 | 1,699,890 | 150,831,239.70 | 6.47 |
| 3 | 300408 | 三环集团 | 7,016,834 | 145,879,978.86 | 6.25 |
| 4 | 002488 | 金固股份 | 12,988,316 | 139,884,163.32 | 6.00 |
| 5 | 300601 | 康泰生物 | 3,000,000 | 130,500,000.00 | 5.59 |
| 6 | 300454 | 深信服 | 1,499,831 | 124,515,969.62 | 5.34 |
| 7 | 002183 | 怡亚通 | 20,009,958 | 123,661,540.44 | 5.30 |
| 8 | 300124 | 汇川技术 | 4,099,891 | 113,566,980.70 | 4.87 |
| 9 | 300750 | 宁德时代 | 1,509,850 | 110,219,050.00 | 4.73 |
| 10 | 002624 | 完美世界 | 4,288,476 | 103,609,580.16 | 4.44 |

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 | 1,034,383.86 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 84,404.46 |
| 5 | 应收申购款 | 434,643.66 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 1,553,431.98 |

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 | 广发行业领先混合A | 广发行业领先混合H |
|---|---|---|
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,305,214,646.94 | 4,541,633.43 |
| 本报告期基金总申购份额 | 50,715,492.55 | 11,339.79 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 140,213,280.55 | 217,497.16 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,215,716,858.94 | 4,335,476.06 |

§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

| 项目 | 广发行业领先混合A | 广发行业领先混合H |
|---|---|---|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 19,932,890.37 | - |
| 本报告期买入/申购总份额 | - | - |
| 本报告期卖出/赎回总份额 | 4,983,222.60 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 14,949,667.77 | - |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.67 | - |

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 | -415,268.55 | -505,334.07 | - |
| 2 | 赎回 | 2018-07-20 | -415,268.55 | -497,070.23 | - |
| 3 | 赎回 | 2018-07-24 | -415,268.55 | -506,986.84 | - |
| 4 | 赎回 | 2018-07-31 | -415,268.55 | -492,938.30 | - |
| 5 | 赎回 | 2018-08-07 | -415,268.55 | -462,775.28 | - |
| 6 | 赎回 | 2018-08-14 | -415,268.55 | -491,698.72 | - |
| 7 | 赎回 | 2018-08-21 | -415,268.55 | -457,403.77 | - |
| 8 | 赎回 | 2018-08-28 | -415,268.55 | -468,973.15 | - |
| 9 | 赎回 | 2018-09-04 | -415,268.55 | -454,511.43 | - |
| 10 | 赎回 | 2018-09-11 | -415,268.55 | -434,265.01 | - |
| 11 | 赎回 | 2018-09-18 | -415,268.55 | -416,084.55 | - |
| 12 | 赎回 | 2018-09-26 | -415,268.55 | -431,785.85 | - |
| 合计 | | | -4,983,222.60 | -5,619,827.20 | |

注：赎回费28240.35元。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发行业领先混合型证券投资基金募集的文件；

2.《广发行业领先混合型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.《广发行业领先混合型证券投资基金托管协议》；

5.《广发行业领先混合型证券投资基金基金招募说明书》及更新版；

6.广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照；

7.基金托管人业务资格批件、营业执照。

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

# 广发资源优选股票型发起式证券投资基金

## 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 | 广发资源优选股票 |
| 基金主代码 | 005402 |
| 交易代码 | 005402 |
| 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 | 120,013,860.50份 |
| 投资目标 | 本基金重点关注资源行业上市公司的投资机会，通过自下而上的深度挖掘，精选个股，力争为基金份额持有人获取长期稳健的超额回报。 |
| 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。 |
| 业绩比较基准 | 中证全指能源指数收益率×10%+中证全指原材料指数收益率×80%+银行活期存款利率（税后）×10% |
| 风险收益特征 | 本基金是股票型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，属于高风险高收益特征的基金。 |
| 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 | -8,693,789.81 |
| 2.本期利润 | -4,636,387.38 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0390 |
| 4.期末基金资产净值 | 108,966,133.62 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.9079 |

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

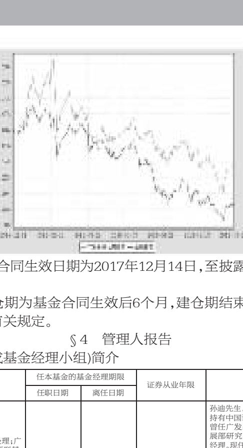
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | -4.12% | 1.32% | -4.58% | 1.20% | 0.46% | 0.12% |

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

广发资源优选股票型发起式证券投资基金

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 | | |
| 孙迪 | 本基金的基金经理；广发品牌消费股票型基金的基金经理；研究发展部总经理 | 2017-12-14 | - | 9年 | 孙迪先生，金融学和工程学双硕士，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研究发展部研究员、部门总经理助理、副总经理。现任广发基金管理有限公司研究发展部总经理、广发资源优选股票型发起式证券投资基金基金经理（自2017年12月14日起任职）、广发品牌消费股票型发起式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、《广发资源优选股票型发起式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

2018年三季度以来，权益市场仍然表现不佳，各主要指数继续出现下跌，上证综指和沪深300分别下跌0.92%和2.05%，在银行、非银等权重板块支撑下表现相对抗跌，而中小板、创业板分别大幅下跌11.22%和12.16%。行业板块表现分化巨大，在本基金投资范围内的各资源类子行业中，采掘、钢铁表现较好，取得小幅正收益，而有色跌幅超过10%。

我们认为市场的持续调整主要反映了投资者对于外部中美贸易摩擦延续和国内经济下行趋势以及长期发展的担心，尽管短期经济数据总体还算平稳，市场估值总体已经到了历史很低的水平，货币和财政政策也出现结构性放松，但市场短期仍看不到大幅反弹的机会。

在三季度，本基金基于对市场风险的警惕，基本维持了对板块内石化、黄金、农化等防御性品种的配置，并在财政政策明确转向后，适当增加了需求和业绩确定性高的水泥、钢铁等品种。展望第四季度，我们计划继续重点配置受益于高油价环境的石油石化、化工以及资产负债表健康、盈利较为稳定、现金流充沛且估值处于低位的周期行业龙头。

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-4.12%，同期业绩比较基准收益率为-4.58%。

§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 | 87,536,618.21 | 79.38 |
| | 其中：股票 | 87,536,618.21 | 79.38 |
| 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 | - | - |
| | 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 | 22,072,974.84 | 20.02 |
| 7 | 其他各项资产 | 662,712.38 | 0.60 |
| 8 | 合计 | 110,272,305.43 | 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 | 31,348,034.28 | 28.77 |
| C | 制造业 | 56,188,583.93 | 51.57 |
| 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 | - | - |
| 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 | 87,536,618.21 | 80.33 |

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 | 600028 | 中国石化 | 1,490,100 | 10,609,512.00 | 9.74 |
| 2 | 601857 | 中国石油 | 825,700 | 7,571,669.00 | 6.95 |
| 3 | 600309 | 万华化学 | 165,580 | 7,032,182.60 | 6.45 |
| 4 | 600585 | 海螺水泥 | 181,026 | 6,659,946.54 | 6.11 |
| 5 | 601088 | 中国神华 | 276,152 | 5,630,739.28 | 5.17 |
| 6 | 603799 | 华友钴业 | 101,360 | 5,401,474.40 | 4.96 |
| 7 | 600547 | 山东黄金 | 226,200 | 5,354,154.00 | 4.91 |
| 8 | 300696 | 利安隆 | 186,528 | 4,853,458.56 | 4.45 |
| 9 | 600426 | 华鲁恒升 | 281,401 | 4,842,911.21 | 4.44 |
| 10 | 000902 | 新洋丰 | 522,198 | 4,840,775.46 | 4.44 |

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 | 179,067.84 |
| 2 | 应收证券清算款 | 124,733.93 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,066.11 |
| 5 | 应收申购款 | 349,844.50 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 662,712.38 |

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 | 119,409,536.04 |
| 本报告期基金总申购份额 | 6,033,167.59 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 5,428,843.13 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 120,013,860.50 |

§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 | 19,099,071.24 |
| 本报告期买入/申购总份额 | - |
| 本报告期卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 19,099,071.24 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 15.91 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例 | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例 | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 19,099,071.24 | 15.91% | 10,000,800.08 | 8.33% | 三年 |
| 基金管理人高级管理人员 | 925,981.18 | 0.77% | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 20,025,052.42 | 16.68% | 10,000,800.08 | 8.33% | 三年 |

§9影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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 | 20180701-20180930 | 50,442,388.65 | - | - | 50,442,388.65 | 42.03% |
| 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。 | | | | | | | |

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（一）中国证监会批准广发资源优选股票型发起式证券投资基金募集的文件

（二）《广发资源优选股票型发起式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）《广发资源优选股票型发起式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）《广发资源优选股票型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新版

10.2 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

10.3 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