广发轮动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	广发轮动配置混合
基金主代码	000117
交易代码	000117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月28日
报告期末基金份额总额	518,932,878.46份
投资目标	根据经济周期中不同阶段的特征,通过大类资产配置及行业轮动策略,投资相应的受益资产,应对通货膨胀、通货紧缩、经济衰退和萧条等宏观经济波动的冲击,为投资者创造长期稳定的投资回报。
投资策略	在经济上升周期增加股票配置,重点配置受益于经济和通货膨胀的行业及个股;在经济下降周期减少股票配置,阶段重点配置相对稳定类和抗通缩的行业及个股。根据经济和通胀的各阶段变化情况,把握经济周期与行业板块轮动之间规律,通过各行业之间的轮动,进行行业轮动以降低风险,同时精选个股,实现基金资产长期稳定的增值。
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型基金、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

§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	-57,321,594.13
2.本期利润	-57,327,814.23
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1100
4.期末基金资产净值	699,372,493.31
5.期末基金份额净值	1.348

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

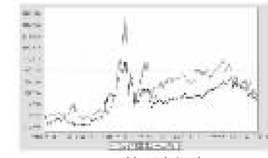
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.54%	1.73%	-1.37%	1.09%	-6.17%	0.64%

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

广发轮动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

(2013年5月28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		
吴兴武	本基金的基金经理;广发核心精选混合基金的基金经理;广发多元新兴股票基金的基金经理	2015-02-12	-	9年	吴兴武先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司研究员,广发基金管理有限公司研究发展部、权益投资一部研究员。现任广发轮动配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年2月12日起任职)、广发核心精选混合型证券投资基金基金经理(自2015年2月17日起任职)、广发多元新兴股票型证券投资基金基金经理(自2017年4月25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、《广发轮动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

三季度市场受贸易战影响,科技板块出现较大幅度的估值下移。金融等板块由于前期跌幅较深,本季度走势较强。

目前市场估值已经到了一个比较低的位置,相当一部分资产具备不错的长期吸引力。但是由于对中国长期前景不确定性的担心,以及短期经济走弱的事实,使得投资者的信心非常匮乏。

报告期内,本基金的净值表现介于蓝筹板块和中小创的走势之间,持仓结构变化不大,对仓位做了适当的降低,为后面抄底低估资产做出仓位准备。

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-7.54%,同期业绩比较基准收益率-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	573,191,761.50	81.19
	其中:股票	573,191,761.50	81.19
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	132,384,713.27	18.75
7	其他各项资产	453,621.74	0.06
8	合计	706,030,096.51	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	478,527,668.03	68.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	108,232.20	0.02
F	批发和零售业	19,238,752.96	2.75
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	9,840,330.00	1.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,818,227.68	1.83
J	金融业	408,141.21	0.06
K	房地产业	1,208,810.00	0.17
L	租赁和商务服务业	22,756,839.22	3.25
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	28,284,760.20	4.04
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	573,191,761.50	81.96

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	300596	利安隆	2,738,461	71,254,755.22	10.19
2	300357	我武生物	821,110	36,826,783.50	5.27
3	000661	长春高新	149,430	35,414,910.00	5.06
4	000860	顺鑫农业	745,300	33,985,680.00	4.86
5	002202	金风科技	2,534,449	30,438,732.49	4.35
6	603517	绝味食品	699,200	28,868,080.00	4.13
7	600763	通策医疗	526,620	28,284,760.20	4.04
8	600436	片仔癀	276,049	27,952,721.74	4.00
9	600519	贵州茅台	31,300	22,849,000.00	3.27
10	601888	中国国旅	334,561	22,756,839.22	3.25

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	341,239.36
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	24,219.42
5	应收申购款	88,162.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	453,621.74

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603517	绝味食品	8,119,200.00	1.16	限售股

§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	522,554,471.81
本报告期基金总申购份额	12,760,003.17
减:本报告期基金总赎回份额	16,381,596.52
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	518,932,878.46

§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	17,563,817.33
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	4,390,954.32
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,172,863.01
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.54

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	-365,912.86	-550,493.94	-
2	赎回	2018-07-20	-365,912.86	-539,571.45	-
3	赎回	2018-07-24	-365,912.86	-531,925.70	-
4	赎回	2018-07-31	-365,912.86	-527,556.69	-
5	赎回	2018-08-07	-365,912.86	-484,594.87	-
6	赎回	2018-08-14	-365,912.86	-505,711.70	-
7	赎回	2018-08-21	-365,912.86	-477,313.20	-
8	赎回	2018-08-28	-365,912.86	-514,449.70	-
9	赎回	2018-09-04	-365,912.86	-498,065.95	-
10	赎回	2018-09-11	-365,912.86	-476,220.95	-
11	赎回	2018-09-18	-365,912.86	-455,104.12	-
12	赎回	2018-09-26	-365,912.86	-480,589.96	-
合计			-4,390,954.32	-6,041,598.23	

注:赎回费30359.77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轮动配置混合型证券投资基金募集的文件

2.《广发轮动配置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.《广发轮动配置混合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.《广发轮动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

广发趋势优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:中国农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。

基金托管人中国农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	广发趋势优选灵活配置混合
基金主代码	000215
交易代码	000215
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年9月11日
报告期末基金份额总额	110,472,818.69份
投资目标	主要通过大类资产配置调整,辅以股票优选,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在投资中追求基金资产的长期稳定增长。在此目标下,本基金在宏观基本面分析的基础上,根据市场趋势的变化进行股票和债券资产的配置,同时,本基金通过实施"行业优选积极轮换"并精选股票的策略,实现"资本增值"目标。
业绩比较基准	沪深300指数×50%+中证全债指数×50%
风险收益特征	本基金为混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益低于股票型基金,高于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	中国农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	4,110,554.48
2.本期利润	1,756,368.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0161
4.期末基金资产净值	177,222,098.11
5.期末基金份额净值	1.604

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

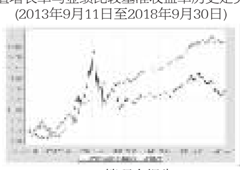
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.05%	0.35%	-0.35%	0.67%	1.40%	-0.32%

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

广发趋势优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

(2013年9月11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		
谭昌杰	本基金的基金经理;广发理财年年红债券基金的基金经理;广发聚安混合基金的基金经理;广发聚宝混合基金的基金经理;广发稳安保本基金的基金经理;广发鑫源混合基金的基金经理	2015-01-29	-	10年	谭昌杰先生,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研究员、广发双债添利债券型证券投资基金基金经理(自2012年9月20日至2015年5月27日)、广发天天红发起式货币市场基金基金经理(自2013年10月22日至2017年10月31日)、广发钱袋子货币市场基金基金经理(自2014年1月10日至2015年7月24日)、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理(自2014年1月27日至2015年5月27日)、广发天天利货币市场基金基金经理(自2014年1月27日至2015年7月24日)、广发季季利理财债券型证券投资基金基金经理(自2014年9月29日至2015年4月30日)、广发聚康混合型证券投资基金基金经理(自2015年6月1日至2016年5月24日)、广发安泽回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年6月17日至2016年11月17日)、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理(自2016年11月18日至2017年12月22日)。现任广发理财年年红债券型证券投资基金基金经理(自2012年7月19日起任职)、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年1月29日起任职)、广发聚安混合型证券投资基金基金经理(自2015年3月25日起任职)、广发聚宝混合型证券投资基金基金经理(自2015年4月9日起任职)、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年2月4日起任职)、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月2日起任职)。
谢军	本基金的基金经理;广发增强债券基金的基金经理;广发聚源定期债券基金的基金经理;广发安享混合基金的基金经理;广发安悦回报混合基金的基金经理;广发服务业精选混合基金的基金经理;广发鑫源混合基金的基金经理;广发集瑞债券基金的基金经理;广发鑫利混合基金的基金经理;广发景华纯债基金的基金经理;广发汇瑞3个月定期开放债券基金的基金经理;广发安泽回报纯债基金的基金经理;广发景源纯债基金的基金经理;广发景祥纯债基金的基金经理;广发理财年年红债券基金的基金经理;广发聚安混合基金的基金经理;广发聚宝混合基金的基金经理;广发聚盛混合基金的基金经理;广发稳安保本基金的基金经理;广发鑫和混合基金的基金经理;广发汇吉定开债基金的基金经理;广发汇元纯债定开发起式基金的基金经理;广发集富纯债基金的基金经理;债券投资部总经理	2017-10-31	-	15年	谢军先生,金融学硕士,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研究员、投资经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理、固定收益部总经理、广发货币市场基金基金经理(自2006年9月12日至2010年4月29日)、广发聚祥保本混合证券投资基金基金经理(自2011年3月15日至2014年3月20日)、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年1月10日至2018年1月6日)、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2016年12月2日至2018年6月12日)。现任广发基金管理有限公司债券投资部总经理、广发增强债券型证券投资基金基金经理(自2008年3月27日起任职)、广发聚源定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2013年5月8日起任职)、广发安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年2月22日起任职)、广发安悦回报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)、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月9日起任职)、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月9日起任职)、广发集瑞债券型证券投资基金基金经理(自2016年11月18日起任职)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月18日起任职)、广发景华纯债债券型证券投资基金基金经理(自2016年11月28日起任职)、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年1月10日起任职)、广发景源纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年2月17日起任职)、广发景祥纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年3月2日起任职)、广发理财年年红债券型证券投资基金基金经理(自2017年7月5日起任职)、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发聚安混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发聚宝混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日起任职)、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31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16日起任职)、广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理(自2018年3月2日起任职)、广发汇元纯债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30日起任职)、广发汇康定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2018年4月16日起任职)、广发汇瑞3个月定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2018年6月13日起任职)、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理(自2018年8月28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、《广发趋势优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

宏观经济的韧性走势有所弱化,部分宏观指标出现下滑。虽然货币政策持续宽松,资金利率下降,但基建等稳增长的实际措施落地不多,叠加贸易摩擦等外围不确定性因素的持续发酵,市场对于经济下滑的预期进一步强化。资产价格方面,长债利率先下后上,整体维持震荡;中短债收益率震荡下行,获得不错的绝对收益。权益资产继续震荡下行,行业表现进一步分化。本基金以中短期的AAA国企为主,基于经济下行的判断,增配了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 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发趋势优选灵活配置混合净值增长率为1.05%,同期业绩比较基准收益率为-0.35%

§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	29,182,549.58	15.95
	其中:股票	29,182,549.58	15.95
2	固定收益投资	150,408,904.11	82.20
	其中:债券	137,945,000.00	75.39
	资产支持证券	12,463,904.11	6.81
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	1,026,089.36	0.56
7	其他各项资产	2,360,808.43	1.29
8	合计	182,978,351.48	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	3,962,000.00	2.24
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,739,549.58	10.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	2,001,000.00	1.13
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	5,480,000.00	3.09
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	29,182,549.58	16.47

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	601318	中国平安	80,000	5,480,000.00	3.09
2	600031	三一重工	600,000	5,328,000.00	3.01
3	000672	上峰水泥	600,000	5,220,000.00	2.95
4	600867	通化东宝	250,000	4,535,000.00	2.56
5	300094	国联水产	700,000	3,962,000.00	2.24
6	300357	我武生物	50,000	2,242,500.00	1.27
7	601117	中国化学	300,000	2,001,000.00	1.13
8	601138	工业富联	32,809	414,049.58	0.23

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	47,830,000.00	26.99
	其中:政策性金融债	47,830,000.00	26.99
4	企业债券	49,803,000.00	28.10
5	企业短期融资券	10,115,000.00	5.71
6	中期票据	30,197,000.00	17.04
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	137,945,000.00	77.84

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	150218	15国开18	200,000	19,292,000.00	10.89
2	160210	16国开10	200,000	18,514,000.00	10.45
3	101553003	15五矿股MTN001	100,000	10,144,000.00	5.72
4	041800075	18鞍钢集CP001	100,000	10,115,000.00	5.71
5	101766007	17大唐集MTN002	100,000	10,090,000.00	5.69

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(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	139071	万科23A1	100,000	9,998,904.11	5.64
2	1789177	17金诚2A2	100,000	2,465,000.00	1.39

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	33,496.32
2	应收证券清算款	300,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,621,461.18
5	应收申购款	405,850.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,360,808.43

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	108,409,041.83
本报告期基金总申购份额	11,970,194.00
减:本报告期基金总赎回份额	9,906,417.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	110,472,818.69

§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	72,503,136.24	-	-	72,503,136.24	65.63%
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趋势优选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件;

2.《广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》;

3.《广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》;

4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》;

5.《广发广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版;

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。

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

广发转型升级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	广发转型升级混合
基金主代码	002713
交易代码	002713
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年11月27日
报告期末基金份额总额	72,112,532.53份
投资目标	本基金的投资目标在于把握中国经济转型升级过程中所蕴含的投资机会,在严格控制投资风险的基础上,力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采取积极的大类资产配置策略,通过宏观策略研究,综合考虑宏观经济、国家财政政策、货币政策、产业政策、以及市场流动性等方面因素,对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪,决定大类资产配置比例。
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	-6,090,453.28
2.本期利润	-6,906,467.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0922
4.期末基金资产净值	53,902,153.07
5.期末基金份额净值	0.7475

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	-10.05%	1.32%	-1.83%	0.85%	-8.22%	0.47%

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

广发转型升级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

(2017年11月27日至2018年9月30日)

注:(1)本基金合同生效日期为2017年11月27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		
唐晓斌	本基金的基金经理;广发多因子混合基金的基金经理	2017-11-27	-	10年	唐晓斌先生,工学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任华泰联合证券有限责任公司研究员,广发基金管理有限公司研究发展部行业研究员、研究小组组长、研究发展部总助、权益投资二部投资经理、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2014年12月24日至2018年1月9日)。现任广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年11月27日起任职)、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2018年6月25日起任职)。
易阳方	本基金的基金经理;广发创新驱动混合基金的基金经理;广发聚惠混合基金的基金经理;公司副总经理、投资总监	2017-11-27	-	21年	易阳方先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司投资自营部副经理,广发基金管理有限公司投资管理部总经理、总经理助理、广发聚富开放式证券投资基金基金经理(自2003年12月3日至2007年3月29日)、广发制造业精选混合型证券投资基金基金经理(自2011年9月20日至2013年2月5日)、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年1月22日至2017年11月9日)、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年7月25日至2017年7月28日)、广发聚丰混合型证券投资基金基金经理(自2005年12月23日至2018年2月2日)、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2014年3月21日至2018年6月6日)、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月6日至2018年8月2日)。现任广发基金管理有限公司副总经理兼任投资总监、广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年6月9日起任职)、广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年11月27日起任职)、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2018年3月13日起任职)。
王文灿	本基金的基金经理	2017-12-29	-	5年	王文灿先生,应用经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,曾任兴业证券研究所分析师,融通基金管理有限公司行业研究员,广发基金管理有限公司北京权益投资部研究员。现任广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年12月29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、《广发转型升级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

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。房地产后周期带动部分可选消费品增速回落甚至走负,周期品价格弹性变差,部分科技成长类行业如半导体等受制于中美贸易摩擦的阶段性情绪干扰,因此3季度市场呈现出轮跌、补跌的形势。

本基金在三季度重点配置了科技成长类行业和个股,主要在云计算、通信、半导体、部分机械和电子行业的利基行业龙头。

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-10.05%,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	45,395,171.60	82.37
	其中:股票	45,395,171.60	82.37
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	9,589,725.86	17.40
7	其他各项资产	128,053.13	0.23
8	合计	55,112,950.59	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	32,705,629.28	60.68
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	1,969,500.00	3.65
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	5,999,385.32	11.13
J	金融业	2,773,017.00	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	1,947,640.00	3.61
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	45,395,171.60	84.22

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	601318	中国平安	40,482	2,773,017.00	5.14
2	600271	航天信息	90,100	2,507,483.00	4.65
3	300470	日机密封	97,200	2,446,524.00	4.54
4	002410	广联达	90,000	2,410,200.00	4.47
5	002179	中航光电	51,800	2,279,200.00	4.23
6	600511	国药股份	75,000	1,969,500.00	3.65
7	002859	洁美科技	56,253	1,955,354.28	3.63
8	300012	华测检测	333,500	1,947,640.00	3.61
9	000651	格力电器	47,900	1,925,580.00	3.57
10	000063	中兴通讯	102,500	1,875,750.00	3.48

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	125,976.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,076.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,053.13

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	102,162,637.49
本报告期基金总申购份额	216,411.61
减:本报告期基金总赎回份额	30,266,516.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	72,112,532.53

§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	20180709-20180930	14,999,300.00	-	-	14,999,300.00	20.80%
	2	20180701-20180930	29,999,600.00	-	-	29,999,600.00	41.60%
	3	20180709-20180930	14,999,300.00	-	-	14,999,300.00	20.80%
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)中国证监会注册广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)《广发转型升级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)《广发转型升级灵活配置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)《广发转型升级灵活配置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