广发沪深300指数增强型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

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:二〇一九年一月十九日

§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2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发沪深300指数增强	
基金主代码	006020	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年6月29日	
报告期末基金份额总额	126,047,500.84份	
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。	
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化,在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下,力争获得超越标的指数的投资收益。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现,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	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	006020	006021
报告期末下属分级基金的份额总额	93,283,228.26份	32,764,272.58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10月1日-2018年12月31日)	
	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C
1.本期已实现收益	-4,714,966.18	-1,814,330.31
2.本期利润	-11,206,127.71	-4,071,016.09
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1238	-0.1250
4.期末基金资产净值	81,551,487.77	28,595,783.86
5.期末基金份额净值	0.8742	0.8728

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、广发沪深300指数增强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	-12.68%	1.60%	-11.83%	1.56%	-0.85%	0.04%

2、广发沪深300指数增强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	-12.75%	1.60%	-11.83%	1.56%	-0.92%	0.04%

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

广发沪深300指数增强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的历史走势对比图
(2018年6月29日至2018年12月31日)

注:(1)本基金合同生效日期为2018年6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		
赵杰	本基金的基金经理	2018-06-29	-	11年	赵杰先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任申银万国证券股份有限公司证券投资部量化研究员、量化投资经理,太平资产管理有限公司量化投资部量化投资经理,广发基金管理有限公司权益投资二部量化研究员。现任广发沪深300指数增强型发起式证券投资基金基金经理(自2018年6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、《广发沪深300指数增强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,超过授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。

本投资组合为指数增强型基金。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

四季度,受美股市场下跌、经济预期增速放缓等因素的影响,A股市场呈现下跌走势。在较为悲观的市场氛围中,政府出台了一系列利好资本市场的政策,对市场形成了呵护。

在本报告期内,本基金仓位保持稳定,利用量化多因子模型进行股票组合的构建。模型在多个长期有效的选股因子上进行均衡配置,以获取稳健持续的超额收益。同时为控制跟踪误差,模型严格控制在行业、市值等风险因子上的暴露。

展望后市,市场的估值已处于历史相对低位,中长期来看估值的均值回归将有利于市场表现。值得观察的是企业盈利的走势,在宏观经济整体放缓的大背景下,上市公司的盈利情况受到广泛关注。后续不管盈利出现向上或向下的超预期情形,都会对市场走势造成较大的影响。另一个需关注的是市场投资者的变化情况,海外资金及国内中长期资金的入市节奏和力度也会对市场走势和结构有一定的影响。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类份额净值增长率为-12.68%,C类份额净值增长率为-12.75%,同期业绩基准收益率为-11.83%。

§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	103,031,826.26	91.63
	其中:股票	103,031,826.26	91.63
2	固定收益投资	40,000.00	0.04
	其中:债券	40,000.00	0.04
	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	8,788,120.27	7.82
7	其他各项资产	582,107.23	0.52
8	合计	112,442,053.76	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	3,322,378.00	3.02
C	制造业	40,869,598.66	37.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,236,437.00	2.94
E	建筑业	3,730,300.00	3.39
F	批发和零售业	1,708,220.00	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	2,917,266.00	2.65
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,232,718.00	2.93
J	金融业	36,141,971.60	32.81
K	房地产业	5,207,200.00	4.73
L	租赁和商务服务业	859,752.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	371,280.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	307,970.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,126,735.00	1.02
S	综合	-	-
	合计	103,031,826.26	93.54

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	86,500	4,852,650.00	4.41
2	600036	招商银行	127,401	3,210,506.20	2.91
3	601288	农业银行	857,800	3,088,080.00	2.80
4	600030	中信证券	168,900	2,704,089.00	2.45
5	601398	工商银行	505,100	2,671,979.00	2.43
6	600276	恒瑞医药	46,000	2,426,500.00	2.20
7	601229	上海银行	207,440	2,321,253.60	2.11
8	601166	兴业银行	154,200	2,303,748.00	2.09
9	000651	格力电器	64,500	2,302,005.00	2.09
10	600519	贵州茅台	3,700	2,183,037.00	1.98

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	40,000.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	40,000.00	0.04

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	110049	海尔转债	400	40,000.00	0.04

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兴业银行(代码:601166)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兴业银行如下事由罚款5870万元人民币:(一)重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告;(二)非真实转让信贷资产;(三)无授信额度或超授信额度办理同业业务;(四)内控管理严重违反审慎经营规则,多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规;(五)同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保;(六)债券卖出回购业务违规出表;(七)个人理财资金违规投资;(八)提供日期倒签的材料;(九)部分非现场监管统计数据与事实不符;(十)个别董事未经任职资格核准即履职;(十一)变相批量转让个人贷款;(十二)向四证不全的房地产项目提供融资。

招商银行(代码:600036)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以下事由罚款6570万元,没收违法所得3.024万元,罚没合计6573.024万元人民币:(一)内控管理严重违反审慎经营规则;(二)违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款;(三)同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保;(四)销售同业非保本理财产品时违规承诺保本;(五)违规将票据贴现资金直接转回出票人账户;(六)为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保;(七)未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目;(八)高管人员在获得任职资格核准前履职;(九)未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务;(十)未严格审查贸易背景真实性开立信用证;(十一)违规签订保本合同销售同业非保本理财产品;(十二)非真实转让信贷资产;(十三)违规向典当行发放贷款;(十四)违规向关系人发放信用贷款。

本基金为指数型基金,上述股票系标的指数成份股,投资决策程序符合公司投资制度的规定。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	87,136.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,670.30
5	应收申购款	493,300.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	582,107.23

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	600030	中信证券	2,704,089.00	2.45	重大事项停牌

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C
本报告期期初基金份额总额	86,940,690.34	34,627,009.04
本报告期基金总申购份额	15,234,291.41	19,963,410.00
减:本报告期基金总赎回份额	8,891,753.49	21,826,146.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	93,283,228.26	32,764,272.58

§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	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,800.08	-
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	10,000,800.08	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	7.93	-

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	10,000,800.08	7.93%	10,000,800.08	7.93%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.08	7.93%	10,000,800.08	7.93%	三年

§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沪深300指数增强型发起式证券投资基金募集的文件

(二)《广发沪深300指数增强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)《广发沪深300指数增强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)《广发沪深300指数增强型发起式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
二〇一九年一月十九日

广发汇康定期开放债券型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

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:二〇一九年一月十九日

§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2019年1月17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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发汇康定期开放债券
基金主代码	005745
交易代码	005745
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018年4月16日
报告期末基金份额总额	2,010,156,676.67份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求获得超越业绩比较基准的投资回报,实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	封闭期内,本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。 开放期内,为了保证组合具有较高的流动性,本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下,投资于具有较高流动性的投资品种,通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合指数(总财富)收益率×95%+银行1年期定期存款利率(税后)×5%
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,属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。
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10月1日-2018年12月31日)
1.本期已实现收益	20,265,029.20
2.本期利润	26,324,136.49
3.加权平均基金份额本期利润	0.0131
4.期末基金资产净值	2,062,479,542.44
5.期末基金份额净值	1.0260

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

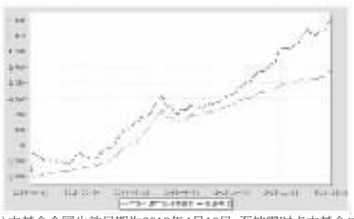
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.28%	0.03%	2.67%	0.05%	-1.39%	-0.02%

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

广发汇康定期开放债券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

(2018年4月16日至2018年12月31日)



注:(1)本基金合同生效日期为2018年4月16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		
王子柯	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;广发一年定期开放债券基金的基金经理;广发聚丰纯债基金的基金经理;广发集富纯债基金的基金经理;广发安泰回报基金的基金经理;广发双债添利债券基金的基金经理;广发安裕回报混合基金的基金经理;广发安邦回报混合基金的基金经理;广发集丰债券基金的基金经理;广发汇通定期开放债券发起式基金的基金经理;广发汇隆一年定期债券基金的基金经理;广发汇盈一年定期债券基金的基金经理;广发汇利一年定期债券基金的基金经理;广发汇泽十月定期债券基金的基金经理;广发汇达10年期国债ETF基金的基金经理;广发汇慧3个月定期开放债券基金的基金经理;债券投资部副总经理	2017-01-06	-	14年	王子柯先生,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研究员,投资经理,固定收益部副总经理、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23日至2018年1月6日)、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日至2018年11月1日)、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日至2018年11月9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2016年11月28日至2018年10月30日)、广发安泰回报纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年2月8日至2018年10月30日)、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理(自2017年8月4日至2018年11月30日)。现任广发基金管理有限公司债券投资部副总经理、广发聚利债券型证券投资基金基金经理(自2011年8月5日起任职)、广发聚财纯债券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日起任职)、广发可转债债券型发起式证券投资基金基金经理(自2018年11月2日起任职)、广发中债1-3年国开行债券指数证券投资基金基金经理(自2018年11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、《广发汇康定期开放债券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,超过授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

四季度,债市收益率先下后震荡,整体明显下行:其中10~12月上旬,市场走势非常强势,定向降准、地方债的供给放缓以及经济金融数据下行加快等是主要原因,基本面的下行预期下市场看多情绪也较为一致;12月中旬在宽信用预期与积极财政超预期等担忧,叠加前期大幅上涨且并没有像样的回调从而积累了大量的止盈盘情况下,利率出现短期明显调整。最后几个交易日,市场情绪重新回暖,收益率重归下行。宏观数据来看,四季度经济下行压力继续显现。外贸方面,10月超预期增长后11月快速回落,全球外需筑顶回落、一枝独秀的美国也出现回落迹象、PMI等领先指标下行等压力都会慢慢传导至外贸数据,后续走势并不乐观。消费方面,国内消费数据持续走弱,双十一依旧没能拉起社零增速,主要原因一方面是汽车消费较差,另一方面同样受到油价波动干扰,整体看消费仍然符合顺周期的特征。投资方面,基建投资在专项债的发力拉动下低位回升,制造业投资是少有的亮点,继续冲高,房地产投资下行速度较慢,土地购置和抢开工的逻辑仍在支撑。生产数据方面,工业增加值增速跌破6%平台后不断下探,此前市场热议的生产需求背离以生产向需求靠拢结束。另外,金融数据方面,社融总量依旧低迷,数据结构有待改善。从边际上看虽然非标融资调整压力有所放缓,但贷款中仍然维持居民为主、票据充眼、企业中长期融资保持低位的结构,金融数据的质量仍有待改善。同时,物价数据方面,10月初油价见年内高点以来连续调整,跌幅超过40%,对于短期CPI、PPI以及通胀预期有较大的缓释作用。截至12月31日,中债综合净价指数上涨1.68%。分品种看,中债国债总净价指数上涨2.93%;截至12月28日,中证金融债净价指数上涨1.96%;中证企业债净价指数上涨1.09%。组合本季度,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。展望下季度,经济下行压力仍在,货币政策宽松态势维持,债市总体仍在偏强格局中,但是空间大小有一定不确定性,且波动也会较大。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。

本基金本报告期未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

本基金本报告期末未持有股票。

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	1,017,531,000.00	49.34
	其中:政策性金融债	1,017,531,000.00	49.34
4	企业债券	50,255,000.00	2.44
5	企业短期融资券	682,907,000.00	33.11
6	中期票据	271,925,000.00	13.18
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,022,618,000.00	98.07

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	170411	17农发11	3,000,000	304,410,000.00	14.76
2	180402	18农发02	1,800,000	185,670,000.00	9.00
3	170209	17国开09	1,600,000	162,480,000.00	7.88
4	180409	18农发09	1,400,000	143,038,000.00	6.94
5	011809945	18雅西江SCP001	1,000,000	100,620,000.00	4.88

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	35,210.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	35,462,821.20
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,498,031.94

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	2,010,039,200.02
本报告期基金总申购份额	117,476.65
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,010,156,676.67

§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	10,000,200.02
本报告期买入/申购总份额	117,476.65
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	10,117,676.67
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.50

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	红利再投	2018-11-28	117,476.65	120,002.40	-
合计			117,476.65	120,002.40	

§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	10,117,676.67	0.50%	10,000,200.02	0.50%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,117,676.67	0.50%	10,000,200.02	0.50%	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	20181001-20181231	2,000,039,000.00	0.00	0.00