广发睿毅领先混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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：二〇一九年四月二十二日

§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4月18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2019年1月1日起至3月31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	170,246,409.32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 (2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	14,849,706.78
2.本期利润	34,531,002.92
3.加权平均基金份额本期利润	0.1904
4.期末基金资产净值	190,906,795.92
5.期末基金份额净值	1.1214

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	20.36%	1.12%	21.82%	1.16%	-1.46%	-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2019年3月31日)

注：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；广发多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；广发聚富开放式证券投资基金的基金经理	2017-12-14	-	8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。

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

一季度市场持续上行，各类风格指数均出现较大的涨幅。去年年底市场讨论得比较多的外部贸易战的进展，以及国内宏观经济的明确下行趋势带来的悲观预期发生了显著的变化。我们战术上整体保持了中性的态势，仓位放在中低区域，结构以金融、周期以及部分成长股为主，对于市场风格以及趋势保持观望；战略层面我们认为未来两三年权益市场会有较大的回报空间，在积极储备未来能够大概率高速增长同时目前估值水平较低的标的。

广发多策略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，应尊重和敬畏市场；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20.36%，同期业绩比较基准收益率为21.82%。

§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	128,947,200.56	66.04
	其中：股票	128,947,200.56	66.04
2	固定收益投资	31,893,623.47	16.33
	其中：债券	31,893,623.47	16.33
	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	15,000,000.00	7.68
	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	17,395,867.69	8.91
7	其他各项资产	2,029,567.09	1.04
8	合计	195,266,258.81	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	1,496,979.03	0.78
B	采矿业	11,534,190.46	6.04
C	制造业	62,712,836.08	32.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,483,747.52	2.35
F	批发和零售业	12,902,000.40	6.76
G	交通运输、仓储和邮政业	19,148,520.00	10.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,875,562.94	0.98
J	金融业	5,954,879.88	3.12
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,899,326.25	3.09
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	2,939,158.00	1.54
S	综合	-	-
	合计	128,947,200.56	67.54

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	603708	家家悦	403,140	9,929,338.20	5.20
2	601021	春秋航空	221,900	9,009,140.00	4.72
3	600028	中国石化	1,070,279	6,143,401.46	3.22
4	600096	云天化	904,900	6,135,222.00	3.21
5	600587	新华医疗	397,860	6,075,322.20	3.18
6	300400	劲拓股份	260,500	5,744,025.00	3.01
7	000089	深圳机场	548,400	5,500,452.00	2.88
8	601088	中国神华	274,900	5,390,789.00	2.82
9	601369	陕鼓动力	765,655	5,114,575.40	2.68
10	601872	招商轮船	950,600	4,638,928.00	2.43

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）	31,893,623.47	16.71
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,893,623.47	16.71

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	113527	维格转债	31,640	3,576,902.00	1.87
2	113019	玲珑转债	30,730	3,471,568.10	1.82
3	113519	长久转债	25,630	3,001,016.70	1.57
4	128050	钧达转债	27,112	2,978,524.32	1.56
5	113008	电气转债	22,540	2,741,314.80	1.44

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1905	IF1905	-10.00	-11,644,200.00	-73,080.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-73,080.00
股指期货投资本期收益(元)					-2,935,980.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-73,080.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的期货合约，并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判，以及对股指期货合约的估值定价，与股票现货资产进行匹配，实现多头或空头的套期保值操作，由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时，将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，对冲系统性风险以及特殊情况下的流动性风险，以改善投资组合的风险收益特性。

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	1,503,471.15
2	应收证券清算款	128,640.02
3	应收股利	-
4	应收利息	43,074.07
5	应收申购款	354,381.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,029,567.09

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	3,471,568.10	1.82
2	113008	电气转债	2,741,314.80	1.44
3	113511	千禾转债	1,999,290.10	1.05
4	110042	航电转债	1,924,502.00	1.01
5	128043	东音转债	1,001,796.30	0.52
6	113009	广汽转债	964,775.00	0.51
7	128042	凯中转债	924,841.72	0.48

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	166,693,929.65
本报告期基金总申购份额	47,463,029.27
减：本报告期基金总赎回份额	43,910,549.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	170,246,409.32

§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	20190101-20190331	50,717,650.25	0.00	0.00	50,717,650.25	29.79%
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睿毅领先混合型证券投资基金募集的文件
2.《广发睿毅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.《广发睿毅领先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

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
二〇一九年四月二十二日

广发添利交易型货币市场基金

2019年第一季度报告

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：二〇一九年四月二十二日

§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2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发添利货币ETF	
场内简称	广发添利	
基金主代码	511950	
基金运作方式	交易型开放式	
基金合同生效日	2016年11月22日	
报告期末基金份额总额	7,080,846,285.19份	
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争为基金份额持有人创造稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。	
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对基金资产组合进行积极管理。	
业绩比较基准	人民币活期存款利率（税后）。	
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	广发添利A	广发添利B
下属分级基金的交易代码	511950	005107
报告期末下属分级基金的份额总额	10,810,298.63份	7,070,035,986.56份

注：1、广发添利交易型货币市场基金A类基金份额上市交易。

2、自2017年8月22日起，广发添利交易型货币市场基金增设B类场外份额，原场内份额转为A类份额，基金份额面值为100元，本表所列A类份额数据面值已折算为1元。

§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(2019年1月1日-2019年3月31日)	
	广发添利A	广发添利B
1.本期已实现收益	65,593.08	46,918,548.70
2.本期利润	65,593.08	46,918,548.70
3.期末基金资产净值	10,810,298.63	7,070,035,986.56

注：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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发添利A：

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.6080%	0.0007%	0.0875%	0.0000%	0.5205%	0.0007%

2、广发添利B：

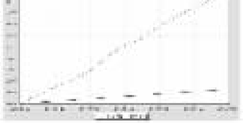
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6675%	0.0007%	0.0875%	0.0000%	0.5800%	0.0007%

注：本基金收益分配按日结转份额。

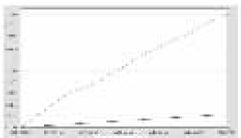
3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发添利交易型货币市场基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年11月22日至2019年3月31日)

1、广发添利A



2、广发添利B



§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		
温秀娟	本基金的基金经理；广发货币市场基金的基金经理；广发理财30天债券型证券投资基金的基金经理；广发理财7天债券型证券投资基金的基金经理；广发现金宝场内实时申赎货币市场基金的基金经理；广发活期宝货币市场基金的基金经理；广发天天红发起式货币市场基金的基金经理；现金投资部副总经理	2016-11-22	-	19年	温秀娟女士，经济学学士，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江门营业部高级客户经理、固定收益部交易员、投资经理，广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理。

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、《广发添利交易型货币市场基金基金合同》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

一季度，货币市场整体仍非常宽松，但部分时间段资金面有所波动，包括2月末资金面超预期转紧、3月中旬资金面面临时点性的收紧压力等。新增的变化是，央行在解读金融数据时提到降准空间已经没有很大，结合总理此前提到的打击票据空转套利，市场担忧央行货币政策态度边际变化。基金经理总体上维持此前对货币政策的看法：基本面仍处下行期，所以货币政策宽松格局在未来一段时间将继续维持；货币政策已经进入了观察期，短期内进一步宽松的可能性较低。一方面，二季度物价数据上行，制约货币政策空间；另一方面，中美贸易谈判中汇率稳定应该是重要考虑因素，国内基本面压力未明显加大的情况下，货币政策不宜操作过急。报告期内，组合选择在季度末等关键时点配置资产，获取相对较高的再投资收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发添利货币ETFA类净值增长率为0.6080%，广发添利货币ETFB类净值增长率为0.6675%，同期业绩比较基准收益率为0.0875%。

§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	固定收益投资	1,237,586,286.27	17.47
	其中：债券	1,237,586,286.27	17.47
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,503,825,075.73	35.35
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	3,323,895,520.24	46.93
4	其他资产	17,800,673.11	0.25
5	合计	7,083,107,555.35	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	0.50	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	56
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	59
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	19

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	45.30	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天（含）—60天	7.06	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	35.26	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天（含）—120天	1.40	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天（含）—397天（含）	10.77	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.78	-

5.4报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（元）	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	99,426,873.79	1.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	262,453,686.04	3.71
	其中：政策性金融债	262,453,686.04	3.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	875,705,726.44	12.37
8	其他	-	-
9	合计	1,237,586,286.27	17.48
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111994383	19天津银行CD039	3,000,000.00	298,074,383.19	4.21
2	111881419	18宁波银行CD132	2,000,000.00	199,657,637.98	2.82
3	111811265	18平安银行CD265	2,000,000.00	198,787,384.28	2.81
4	140358	14进出58	1,600,000.00	161,820,506.50	2.29
5	120312	12进出12	1,000,000.00	100,633,179.54	1.42
6	111921029	19渤海银行CD029	1,000,000.00	99,654,113.24	1.41
7	199902	19贴现国债02	1,000,000.00	99,426,873.79	1.40
8	111814183	18江苏银行CD183	800,000.00	79,532,207.75	1.12

5.7"影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25（含）-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.01%
报告期内偏离度的最低值	0.00%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.00%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1基金计价方法说明

本基金采用"摊余成本法"计价，即计价对象以买入成本列示，按实际利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余期限内摊销，每日计提收益。

5.9.218江苏银行CD183(代码：111814183)为本基金的前十大持仓证券之一。2019年2月3日，因江苏银行股份有限公司存在未按业务实质准确计量风险资产；理财产品之间未能实现相分离；理财投资非标资产未严格比照自营贷款管理，对授信资金未按约定用途使用监督不力的行为，被中国银行保险监督管理委员会江苏监管局处罚款人民币90万元。

18宁波银行CD132（代码：111881419）为本基金的前十大持仓证券之一。2018年6月22日，因宁波银行股份有限公司存在以不正当手段违规吸收存款的行为，被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局处罚款人民币60万元。2019年1月11日，因宁波银行股份有限公司存在将个人贷款资金违规流入房市、购买理财的行为，被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局处罚款人民币20万元。2019年3月22日，因宁波银行股份有限公司存在违规将同业存款变为一般性存款的行为，被中国银行保险监督管理委员会宁波监管局处罚款人民币20万元。

18平安银行CD265(代码：111811265）为本基金的前十大持仓证券之一。2018年7月10日，因平安银行股份有限公司存在贷前调查不到位，向环保未达标的企业提供融资；贷后管理失职，流动资金贷款被挪用的行为，被中国银行保险监督管理委员会天津监管局处罚款人民币50万元。2018年8月1日，因平安银行股份有限公司未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，被中国人民银行处罚款人民币140万元。

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。

5.9.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	415.21
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	17,800,057.90
4	应收申购款	200.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	17,800,673.11

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发添利A	广发添利B
本报告期期初基金份额总额	10,782,893.38	7,129,266,391.79
本报告期基金总申购份额	89,974.32	47,374,056.14
本报告期基金总赎回份额	62,569.07	106,604,461.37
报告期期末基金份额总额	10,810,298.63	7,070,035,986.56

§7 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	2019-01-31	256.00	25,600.00	-
2	红利再投	2019-02-28	193.00	19,300.00	-
3	红利再投	2019-03-31	181.00	18,100.00	-
合计			630.00	63,000.00	

§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

序号	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	20190101-20190331	7,018,288,062.35	48,358,613.69	0.00	7,066,646,676.04	99.80%
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

1.中国证监会核准广发添利交易型货币市场基金募集的文件
2.《广发添利交易型货币市场基金基金合同》
3.《广发添利交易型货币市场基金托管协议》
4.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
5.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.中国证监会要求的其他文件

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
二〇一九年四月二十二日

广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）

2019年第一季度报告

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：二〇一九年四月二十二日

§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2019年4月18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2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发稳健养老（FOF）
基金主代码	006298
交易代码	006298
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年12月25日
报告期末基金份额总额	556,076,755.84份
投资目标	本基金在严格控制下行风险和保持资产流动性的基础上，通过定量与定性相结合的方法精选不同资产类别中的优质基金，结合基金的风险收益特征和市场环境合理配置权重，追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金的资产配置策略包括战略型资产配置策略（SAA）和战术型资产配置策略（TAA）。战略型资产配置策略是采用定量方法和定性研究相结合的核心卫星策略来实现不同资产的配置，其中定量方法采用经典的马科维兹的均值方差模型，定性研究则是基于对国内外宏观经济周期和货币周期变化情况的深度研究，在相对稳定的长期配置中枢上动态调整权益类基金、固定收益类基金、商品基金等各类基金资产的配置比例。本基金权益类资产的长期配置比例中枢是25%。 战术配置策略的核心变量是利率（流动性）、盈利和风险偏好，当市场利率下行，企业盈利上升，风险偏好上升时，同时结合权益市场的估值水平对权益类资产进行超配，配置上限为30%；反之，则权益类资产配置比例下浮，配置下限为15%。战术配置策略包括但不限于行业轮动策略和风格轮动策略。
业绩比较基准	中证股票型基金指数收益率×25%+中证债券型基金指数收益率×70%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金，是目标风险系列基金中的稳健产品，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金和一般的混合型基金，属于中低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 (2019年1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	13,855,315.32
2.本期利润	13,784,269.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.0258
4.期末基金资产净值	570,789,072.03
5.期末基金份额净值	1.0265

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。

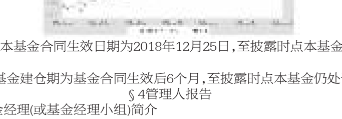
3.2 基金净值表现

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	2.59%	0.13%	8.08%	0.36%	-5.49%	-0.23%

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

广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）
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12月25日至2019年3月31日)



注：（1）本基金合同生效日期为2018年12月25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		
陆靖昶	本基金的基金经理	2018-12-25	-	10年	陆靖昶先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任浙商证券研究所金融工程研究员，平安资产管理有限责任公司投资经理。

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、《广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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，投资的基金必须来自公司基金库。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业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2019年1季度，全球风险偏好提升，A股权益市场领涨。今年开始，VIX指数从高位回落，全球风险资产大幅跑赢避险资产。美元指数小幅上涨，油价大涨，权益资产持续反弹，且新兴市场好于发达市场。固收资产在通胀预期下行叠加美联储转鸽后，十年期美债收益率较为平稳，期限利差的倒挂对股市预期略有不利，但由于存在明显的时滞，当前经济衰退的风险还未实质性产生，预期全球风险资产能持续跑赢，当前尚不会对衰退进行定价。国内固收市场受到稳健财政政策的影响，对经济下行的预期有所分歧，因此波动较去年有所增大。

本基金于2018年年底成立，目前尚在建仓期，在成立初期建仓的权益部分会较为谨慎，在固收资产上更加积极些，在基金选择上选择内外部优秀债基以及部分ETF进行配置。投资策略上，本基金仍将先以绝对收益思路构建组合，后续综合考虑组合累计净值和市场情况，按照中长期配置和TAA的需求，精选主动管理基金和被动基金，力争实现基金净值的稳健增长。

4.4.2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2.59%，同期业绩比较基准收益率为8.08%。

§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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	490,677,445.38	85.24
3	固定收益投资	39,957,976.80	6.94
	其中：债券	39,957,976.80	6.94
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	33,207,889.40	5.77
8	其他各项资产	11,768,338.64	2.04
9	合计	575,611,650.22	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

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	39,957,976.80	7.00
	其中：政策性金融债	39,957,976.80	7.00
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,957,976.80	7.00

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	018005	国开1701	399,420	39,957,976.80	7.00

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其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,473.56
2	应收证券清算款	9,006,257.38
3	应收股利	23,951.09
4	应收利息	1,493,437.34
5	应收申购款	1,232,497.46
6	其他应收款	2,721.81
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,768,338.64

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基金中基金

6.1 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基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	002864	广发安泽短债债券型证券投资基金A类	契约型开放式	37,959,221.49	40,270,938.08	7.06%	是
2	070009	嘉实超短债证券投资基金	契约型开放式	33,512,868.65	35,265,591.68	6.18%	否
3	090002	大成债券投资基金A/B	契约型开放式	24,397,129.65	25,619,425.85	4.49%	否
4	100058	富国产业债债券型证券投资基金	契约型开放式	23,539,548.02	25,540,409.60	4.47%	否
5	270044	广发双债添利债券型证券投资基金A类	契约型开放式	20,898,163.40	25,370,370.37	4.44%	是
6	380005	中银纯债债券型证券投资基金A类	契约型开放式	23,761,409.92	25,234,617.34	4.42%	否
7	001013	华夏希望债券型证券投资基金C类	契约型开放式	22,375,823.01	25,150,425.06	4.41%	否
8	000171	易方达裕丰回报债券型证券投资基金	契约型开放式	12,148,215.37	21,101,450.10	3.70%	否
9	000032	易方达信用债债券型证券投资基金A类	契约型开放式	17,024,911.84	20,276,670.00	3.55%	否
10	000024	摩根士丹利华鑫双利增强债券型证券投资基金A类	契约型开放式	17,300,173.01	20,223,902.25	3.54%	否

6.2 当期交易及持有基金产生的费用

项目	本期费用 2019年1月1日-2019年3月31日	其中：交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用
当期交易基金产生的申购费（元）	13,000.00	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	216,372.71	74,619.50
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	41,674.28	14,709.78
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	518,567.72	123,588.74
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	157,155.29	34,668.26
当期交易基金产生的交易费（元）	6,448.84	96.40

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的持仓根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务费等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.3 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内，广发双债添利债券型证券投资基金召开基金份额持有人大会，持有人大会表决结果公告并生效。

§7开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	519,533,738.41
报告期基金总申购份额	36,543,017.43
减：报告期基金总赎回份额	-
报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	556,076,755.84

§8 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

8.1 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。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会准予广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）注册募集的文件
2.《广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）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.《广发稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议》
5.法律意见书

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
二〇一九年四月二十二日