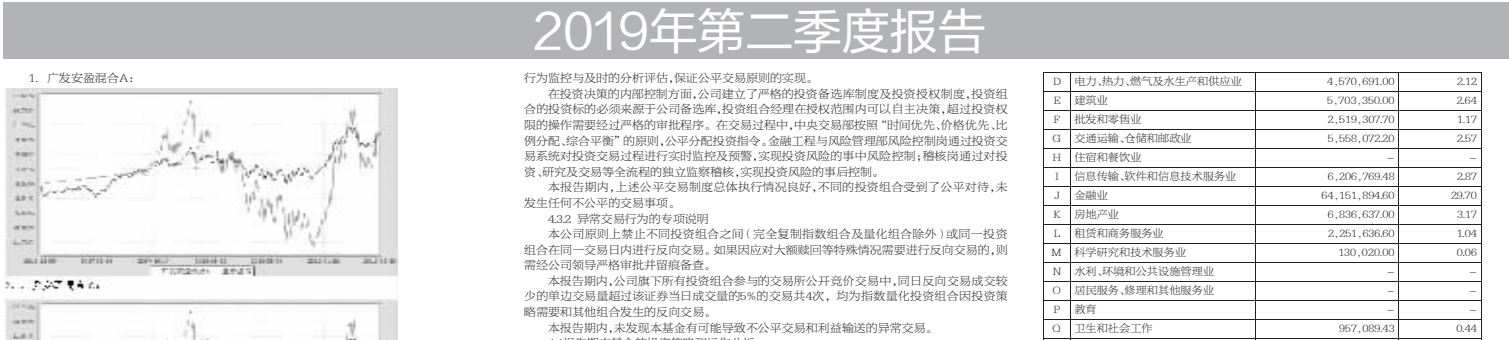
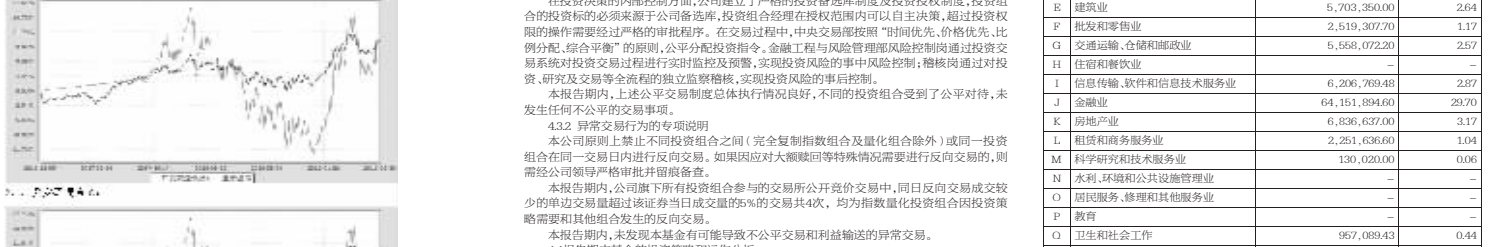


## 广发安盈灵活配置混合型证券投资基金

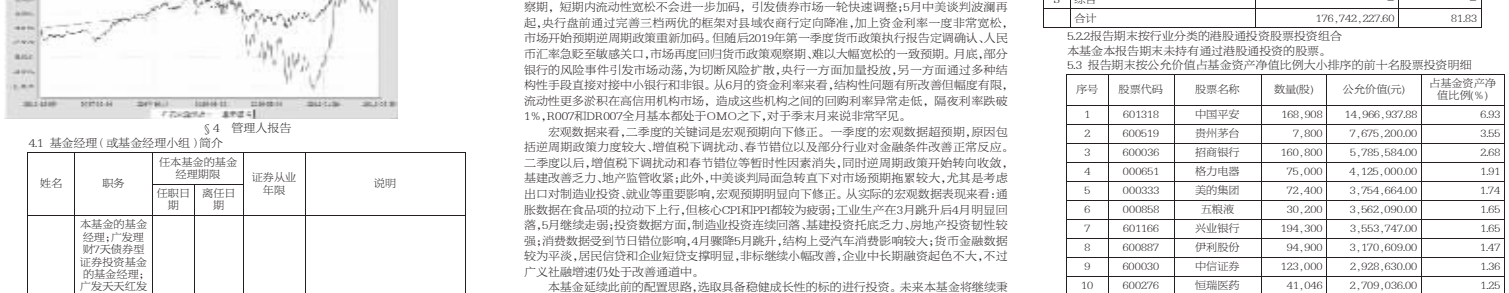
## 2019年第三季度报告



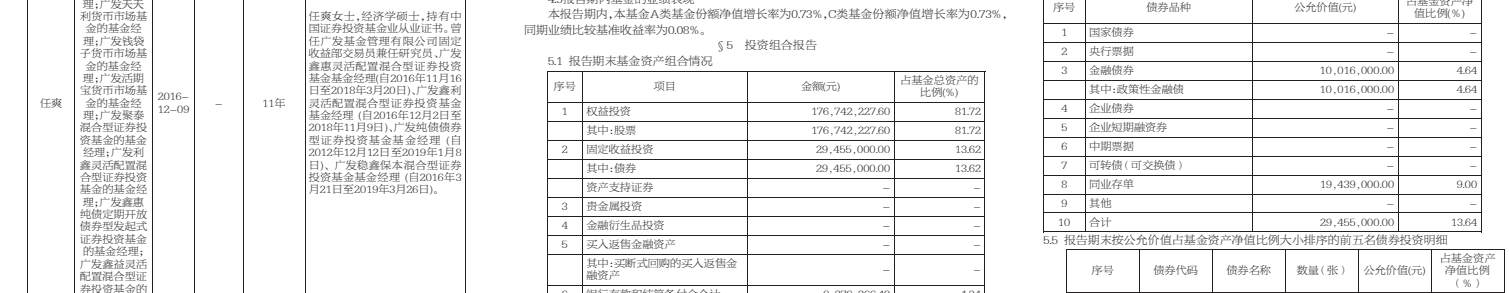
1. 广发安盈混合A:



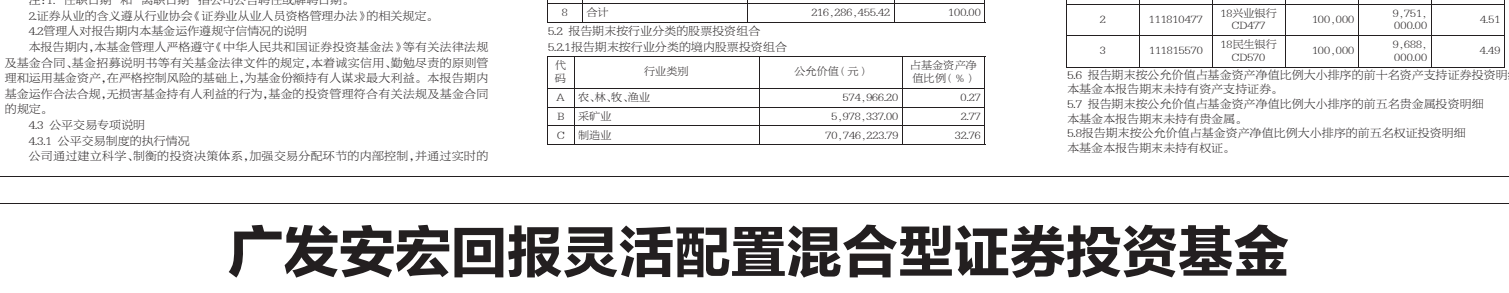
1. 广发安盈混合A:



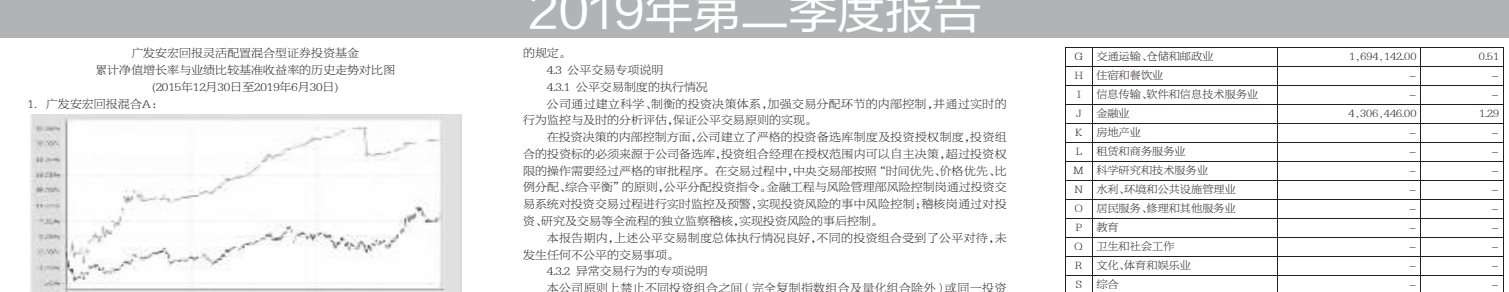
1. 广发安盈混合A:



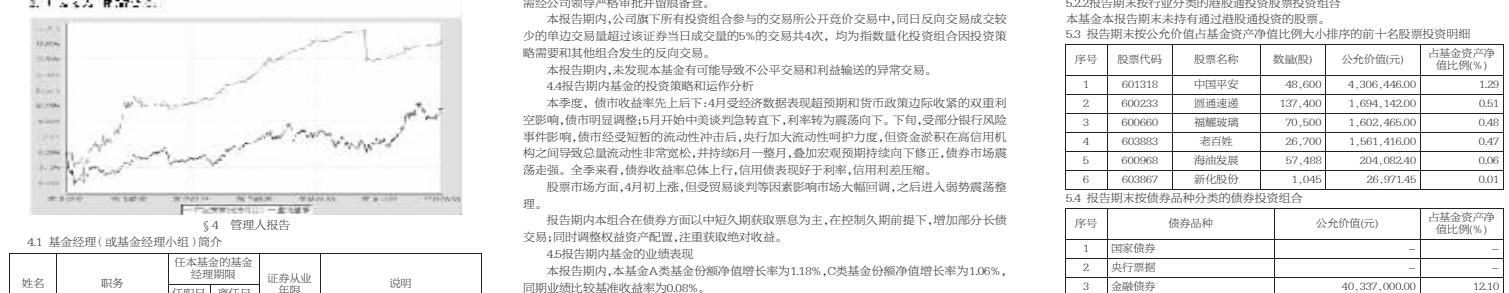
1. 广发安盈混合A:



1. 广发安盈混合A:



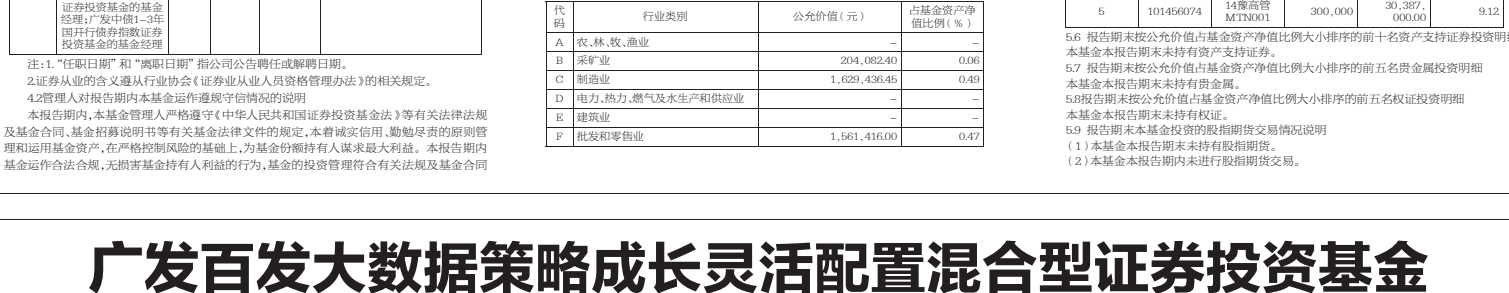
1. 广发安盈混合A:



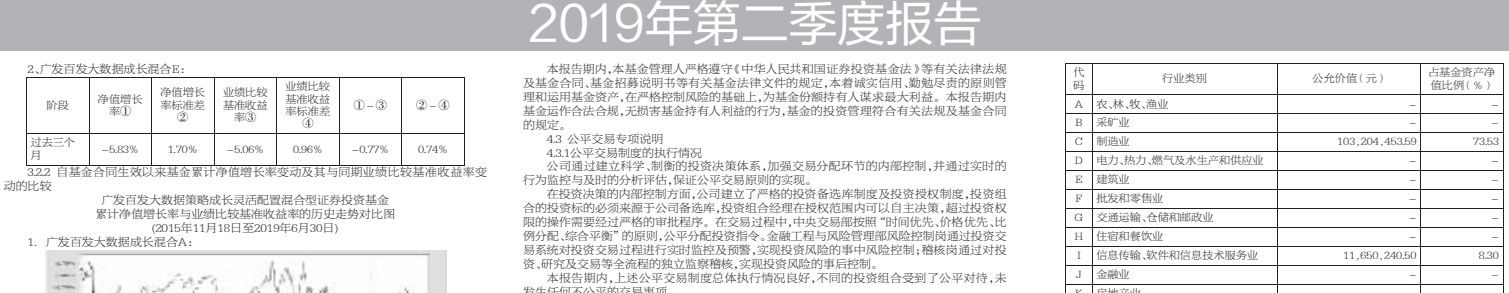
1. 广发安盈混合A:



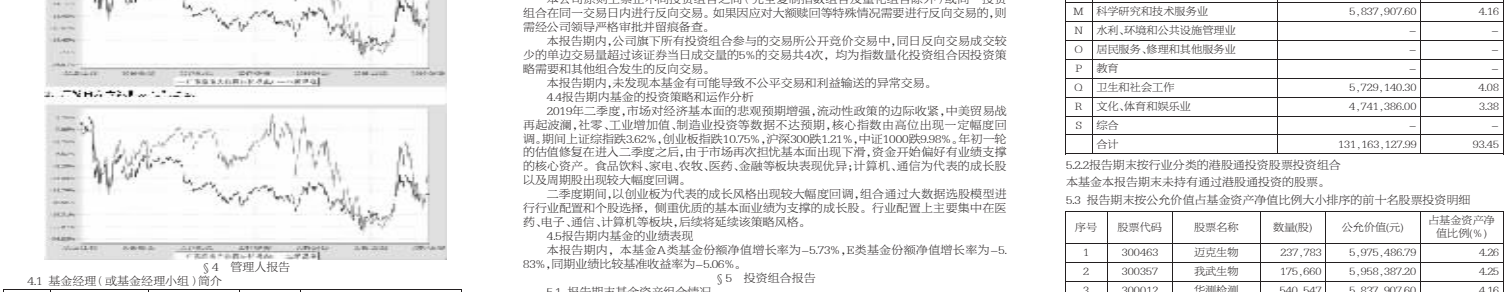
1. 广发安盈混合A:



1. 广发安盈混合A:



1. 广发安盈混合A:



1. 广发安盈混合A:



1. 广发安盈混合A:

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:二〇一九年七月十八日

§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7月16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预示其未来表现,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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	广发安盈混合
基金代码	002118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月30日
报告期末基金份额总额	196,311,943.04份

投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘增值机会,对股票、债券和现金等大类资产进行分散化配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略

本基金在宏观经分分析基础上,结合政策面、市场资金面、利率债市场变化趋势,根据经济周期不同阶段大类资产配置策略进行资产配置,对股票、债券和现金等大类资产进行分散化配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准

30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率

风险收益特征

本基金属混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中收益风险特征的投资品种。

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

下属分级基金的基础费率

广发安盈混合A 广发安盈混合C

下属分级基金的交易代码

002118 002119

报告期末下属分级基金的份额总额

196,620,947.89份 660,986.15份

§3 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	3,032,474.67
2.本期利润	1,612,386.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0094
4.期末基金资产净值	215,362,004.00
5.期末基金份额净值	1.101

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 0.73% 1.27% 0.08% 0.44% 0.65% 0.83%

2.广发安盈混合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 0.73% 1.29% 0.08% 0.44% 0.65% 0.85%

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

广发安盈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的对比图  
(2016年12月30日至2019年6月30日)

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:二〇一九年七月十八日

§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7月16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预示其未来表现,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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	广发安盈混合
基金代码	002118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月30日
报告期末基金份额总额	260,233,817.19份

投资目标

本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过对不同资产类别的合理配置,充分挖掘增值机会,对股票、债券和现金等大类资产进行分散化配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略

本基金在宏观经分分析基础上,结合政策面、市场资金面、利率债市场变化趋势,根据经济周期不同阶段大类资产配置策略进行资产配置,对股票、债券和现金等大类资产进行分散化配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准

30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率

风险收益特征

本基金属混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中收益风险特征的投资品种。

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

下属分级基金的基础费率

广发安盈混合A 广发安盈混合C

下属分级基金的交易代码

002118 002119

报告期末下属分级基金的份额总额

260,057,041.32份 176,775.87份

§3 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	3,302,186.77
2.本期利润	3,727,242.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.0143
4.期末基金资产净值	323,011,500.50
5.期末基金份额净值	1.201

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.广发安盈混合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 1.18% 0.06% 0.08% 0.44% 1.10% -0.38%

2.广发安盈混合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 1.06% 0.06% 0.08% 0.44% 0.98% -0.39%

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

广发安盈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的对比图  
(2016年12月30日至2019年6月30日)

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:二〇一九年七月十八日

§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7月16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预示其未来表现,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。

本报告自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	广发安盈混合
基金代码	002118
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年12月30日
报告期末基金份额总额	158,091,720.92份

投资目标

在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过灵活的资产配置,在股票、固定收益证券和现金等大类资产中充分挖掘增值机会,对股票、债券和现金等大类资产进行分散化配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

投资策略

本基金在宏观经分分析基础上,结合政策面、市场资金面、利率债市场变化趋势,根据经济周期不同阶段大类资产配置策略进行资产配置,对股票、债券和现金等大类资产进行分散化配置,力争实现基金资产的长期稳定增值。

业绩比较基准

30%×沪深300指数收益率+70%×中证全债指数收益率

风险收益特征

本基金属混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币型基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中收益风险特征的投资品种。

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

下属分级基金的基础费率

广发安盈混合A 广发安盈混合C

下属分级基金的交易代码

002118 002119

报告期末下属分级基金的份额总额

157,661,492.62份 19,430,228.40份

§3 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年4月1日至2019年6月30日)
1.本期已实现收益	10,378,944.52
2.本期利润	-7,689,266.69
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0547
4.期末基金资产净值	123,077,748.88
5.期末基金份额净值	0.7858

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

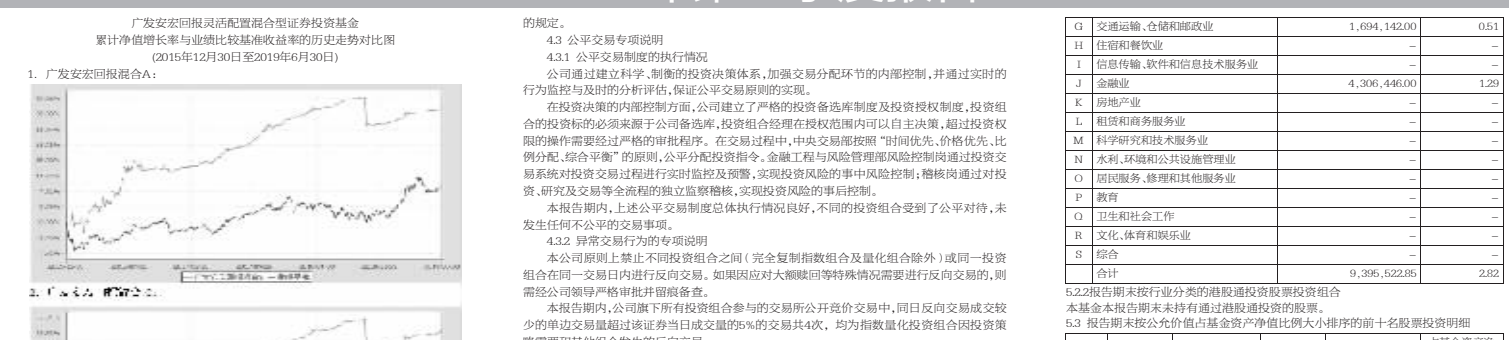
1.广发安盈混合A:

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

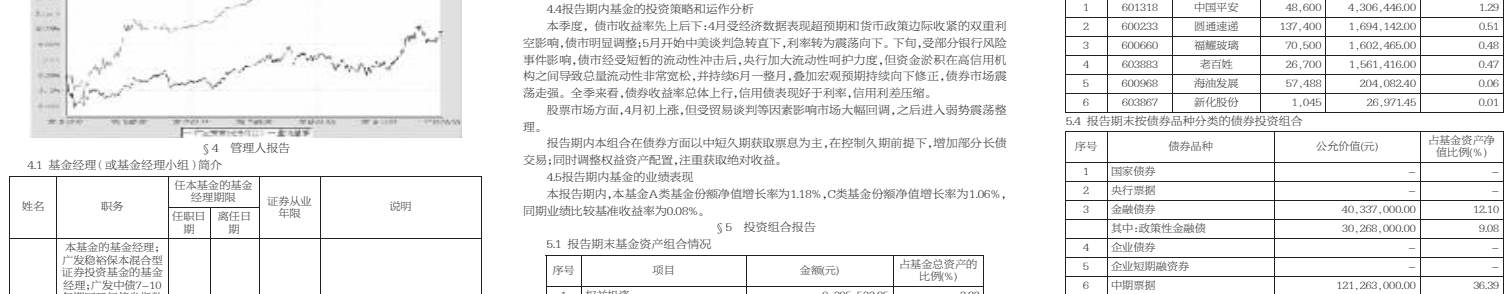
过去三个月 -6.73% 1.71% -0.06% 0.06% -0.67% 0.75%

## 广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金

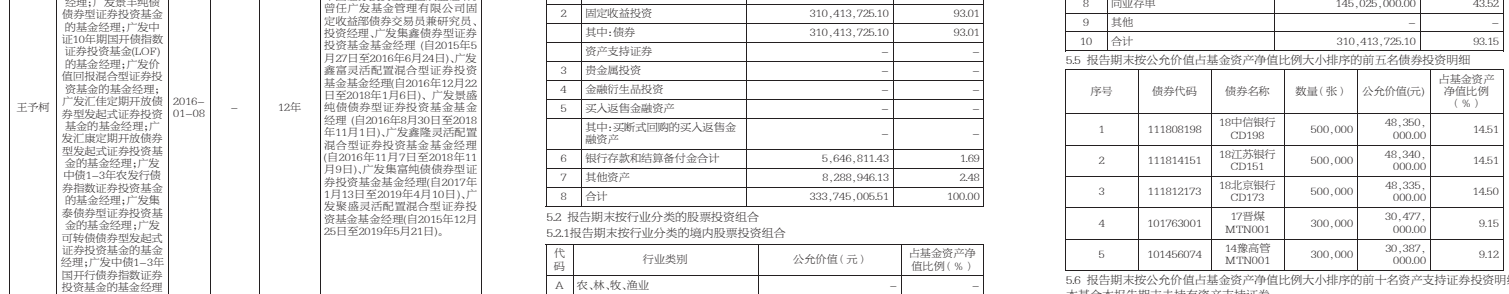
## 2019年第二季度报告



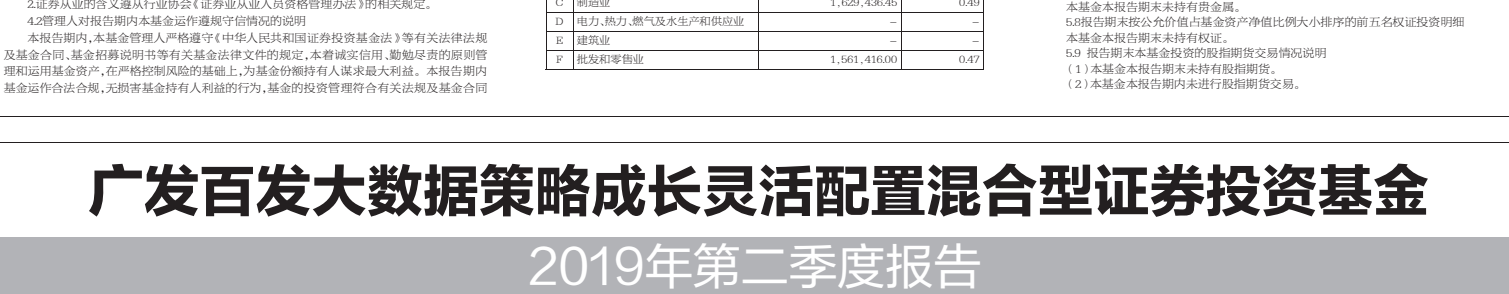
1. 广发安宏回报混合A:



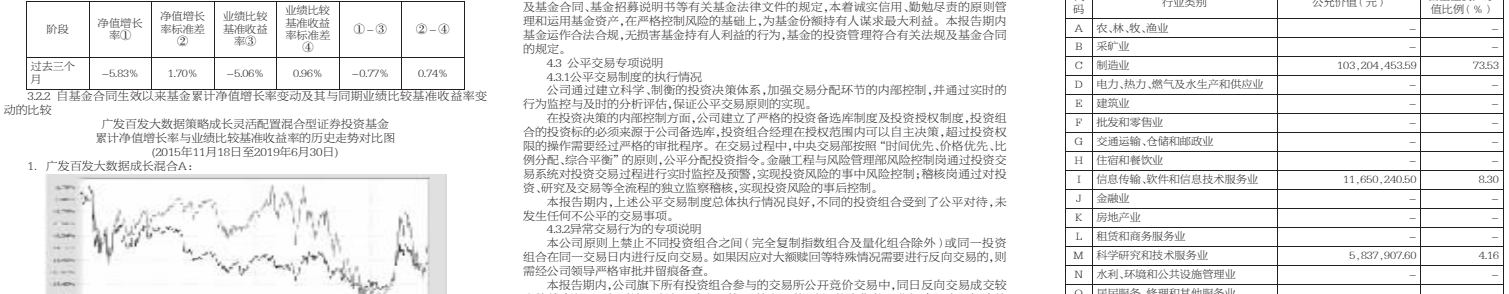
1. 广发安宏回报混合A:



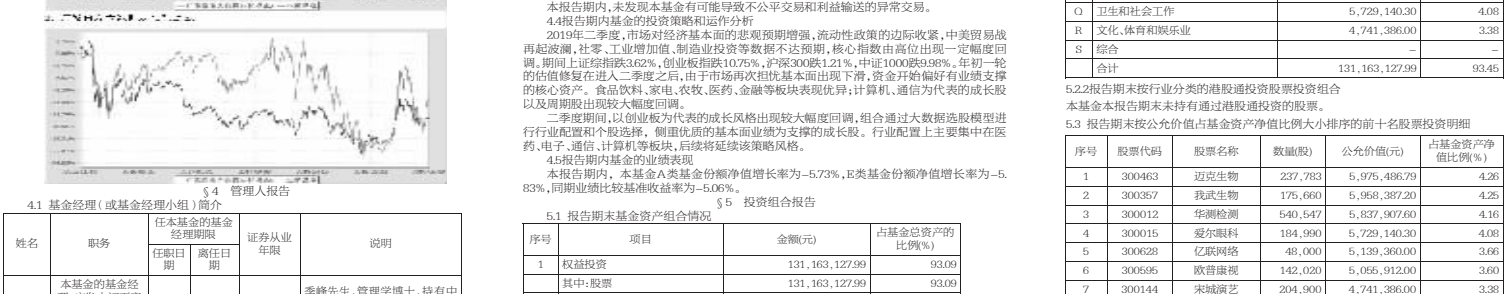
1. 广发安宏回报混合A:



1. 广发安宏回报混合A:



1. 广发安宏回报混合A:



1. 广发安宏回报混合A:



1. 广发安宏回报混合A:

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,570,691.00	2.12
E	建筑业	5,769,360.00	2.64
F	批发和零售业	2,519,307.70	1.17
G	交通运输、仓储和邮政业	5,568,072.20	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,206,769.48	2.87
J	金融业	64,151,894.60	29.70
K	房地产业	6,836,637.00	3.17
L	租赁和商务服务业	2,261,636.60	1.04
M	科学研究和技术服务业	130,020.00	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	房地产业、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	967,089.43	0.44
R	文化、体育和娱乐业	567,222.60	0.26
S	综合	-	-
合计		176,742,227.80	81.83

5.2 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有通过港股通投资股票。

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	168,908	14,966,927.88	6.93
2	600619	贵州茅台	7,800	7,675,200.00	3.55
3	600036	招商银行	160,800	5,785,584.00	2.68
4	000061	格力电器	75,000	4,125,000.00	1.91
5	000033	美的电器	72,400	3,754,064.00	1.74
6	000059	五粮液	30,200	3,562,090.00	1.65
7	601166	兴业银行	194,300	3,553,747.00	1.65
8	000087	伊利股份	94,900	3,170,459.00	1.47
9	600050	中国联通	122,000	2,926,630.00	1.36
10	000076	长城铝业	41,046	2,769,038.00	1.26

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	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,016,000.00	4.64
4	企业债券	10,016,000.00	4.64
5	企业中期票据	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转换(可交换)债	-	-
8	同业存单	19,429,000.00	9.00
9	其他	-	-
10	合计	29,465,000.00	13.64

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	180312	18国电12	100,000	10,016,000.00	4.64
2	111810477	18国电17	100,000	9,751,000.00	4.51
3	111815670	18国电16	100,000	9,688,000.00	4.49

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进行股指期货交易。

(2) 本基金本报告期末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进行国债期货交易。

(2) 本基金本报告期末未进行国债期货交易。

5.11 本基金投资的前十名证券的发行主体中,中信银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司在报告编制前一年內曾受到中国银行保险监督管理委员会(含中国银保监会)或中国证监会、中国银保监会或中国证监会派出机构监管处罚或采取自律措施的情况

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券发行主体本期未有受到监管部门立案调查,或在报告编制前一年內受到公开谴责、处罚的情况。

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 股指期货投资情况

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,中信银行股份有限公司、江苏银行股份有限公司在报告编制前一年內曾受到中国银行保险监督管理委员会(含中国银保监会)或中国证监会、中国银保监会或中国证监会派出机构监管处罚或采取自律措施的情况

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券发行主体本期未有受到监管部门立案调查,或在报告编制前一年內受到公开谴责、处罚的情况。</