（上接B049版）

联系电话：010-57756019
业务传真：010-57756199
客服热线：400-786-8868-5
公司网址：www.chtfund.com
（73）名称：爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
办公地址：上海市浦东新区世纪大道1600号32楼
法定代表人：钱华
联系人：王薇
联系电话：021-32229888
业务传真：021-68728703
客服热线：4001-962502
公司网址：www.ajzq.com
（74）名称：嘉实财富管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元
办公地址：上海市浦东新区世纪大道8号B座46楼06-10单元、北京市朝阳区 建国路91号金地中心A座6层
法定代表人：赵学军
联系人：景琪
电话：021-20289890
传真：021-20280110
网址：www.harvestwm.cn
客服电话：400-021-8850
（75）名称：北京创金启富投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
办公地址：北京市西城区民丰胡同31号5号楼215A
法定代表人：梁蓉
联系人：张晶晶
联系电话：010-66154828-809
业务传真：010-88067526
客服热线：010-66154828
公司网址：www.5irich.com
（76）名称：宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
注册地址：北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址：北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人：沈伟桦
联系人：程刚
联系电话：010-52855713
业务传真：010-85894285
客服热线：400-6099-200
公司网址：www.yixinfund.com
（77）名称：中经北证（北京）资产管理有限公司
公司简称：中经北证
注册地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
办公地址：北京市西城区车公庄大街4号5号楼1层
法定代表人：徐福星
联系人：陈莹莹
联系电话：13261320700
业务传真：010-88381550
客服热线：010-68998820
公司网址：www.bzfunds.com
（78）名称：一路财富(北京)信息科技有限公司
公司简称：一路财富
注册地址：北京市西城区阜公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址：北京市西城区阜成门外大街2号万通新世界广场A座22层
法定代表人：吴雪秀
联系人：刘栋栋
联系电话：010-88312877-8009
业务传真：010-88312099
客服热线：400-001-1566
公司网址：www.yilucaifu.com
（79）名称：北京恒久浩信投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人：王岩
联系人：胡明会
联系电话：010-59200855
业务传真：010-59200800
客服热线：400-819-9868
公司网址：www.tdyhfund.com
（80）名称：中信建投期货有限公司
注册地址：重庆市渝中区中山三路107号上站大楼平街11-B，名义层11-A，8-B4，9-B、C
办公地址：重庆市渝中区中山三路107号皇冠大厦11楼
法定代表人：彭文德
联系人：刘芸
联系电话：023-86769637
业务传真：023-86769629
客服热线：400-8877-780
公司网址：www.cfc108.com.cn
（81）名称：海银基金销售有限公司
注册地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼B单元
办公地址：上海市浦东新区东方路1217号16楼
法定代表人：刘惠
联系人：刘艳妮
联系电话：021-80133827
业务传真：021-80133413
客服热线：400-808-1016
公司网址：www.fundhaiyin.com
（82）名称：北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6层
法定代表人：闫振杰
联系人：翟飞飞
联系电话：010-52703350-6006
业务传真：010-62020355
客服热线：4008886661
公司网址：www.myfund.com
（83）名称：徽商期货有限责任公司
注册地址：合肥市芜湖路258号
办公地址：合肥市芜湖路258号
法定代表人：吴国华
联系人：蔡芳
联系电话：0551-62862801
业务传真：0551-62862801
客服热线：4008878707
公司网址：www.hsqh.net
（84）名称：深圳富济财富管理有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区高新技术产业园南七道惠恒集团二期418室
法定代表人：齐小贺
联系人：马力佳
电话：0755-83999907-815
传真：0411-83999926
客服电话：0755-83999907
公司网址：www.jinqianwo.cn
（85）名称：北京君德汇富投资咨询有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街18号15层办公楼一座1502室
办公地址：北京市东城区建国门内大街18号恒基中心办公楼一座2202室
法定代表人：李振
联系人：魏尧
电话：010-65181028
传真：010-65174782
客服电话：400-066-9355
公司网址：www.kingstartimes.com
（86）名称：北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址：北京市朝阳区西大望路1号1号楼1603
办公地址：北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心A座16层
法定代表人：董浩
联系人：于婷婷
电话：13811217674
客服电话：010-56409010
公司网址：www.jimufund.com
（87）名称：泰诚财富基金销售（大连）有限公司
注册地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址：辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人：林卓
联系人：薛长平
电话：0411-88891212
传真：0411-88891212
客服电话：4006411999
公司网址：www.taichengcaifu.com
（88）名称：北京微动利投资管理有限公司
注册地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址：北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
法定代表人：梁洪军
联系人：季长军
电话：13621233213
传真：010-68854009
客服电话：4008-196-665
公司网址：www.buyforyou.com.cn
（89）名称：上海陆金所资产管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人：郭坚
联系人：宁博宇
电话：021-20665952
传真：021-22066653
客服电话：4008219031
公司网址：www.lufunds.com
（90）名称：上海汇付金融服务有限公司
注册地址：上海市黄浦区中山南路100号19层
办公地址：上海市徐汇区虹梅路1801号凯科国际大厦7-9层
法定代表人：冯修敏
联系人：陈云卉
电话：021-33323999-5611
传真：021-33323837
客服电话：4000-820-2819
公司网址：https://tty.chinapnr.com
（91）名称：东莞农村商业银行股份有限公司
注册地址：东莞市东城区鸿福东路2号
办公地址：东莞市东城区鸿福东路2号
法定代表人：何沛良
联系人：何茂才
电话：0769-22866255
传真：0769-22866282
客服电话：961122
公司网站：www.drcbank.com
（92）名称：中信期货有限公司
注册地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址：深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人：张皓
联系人：洪诚
电话：0755-23953913
传真：0755-83217421
客服电话：4009908826
公司网址：www.citicsf.com
（93）名称：广州农村商业银行股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦
办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路1号信合大厦
法定代表人：王继康
联系人：黎超雄
联系电话：020-28019593
业务传真：020-28852692
客服热线：020-961111
公司网址：www.grcbank.com
（94）名称：青岛银行股份有限公司
注册地址：山东省青岛市市南区香港中路68号
法定代表人：郭少泉
联系人：滕克
联系电话：0532-85709787
传真：0532-85709799
客服电话：（青岛）96588，（全国）400-66-96588
公司网站：www.qdccb.com
（95）名称：泉州银行股份有限公司
注册地址：泉州市云鹿路3号
办公地址：泉州市云鹿路3号
法定代表人：傅子能
联系人：董培姗
联系电话：0595-22551071
业务传真：0595-22505215
客服热线：4008896312
公司网址：www.qzccbank.com
（96）名称：上海农商银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼
办公地址：上海市浦东新区银城中路8号15-20楼、22-27楼
法定代表人：胡平西
联系人：施传荣
联系电话：021-385766666
业务传真：021-50105124
客服热线：962999
公司网址：www.srcb.com
（97）名称：威海市商业银行股份有限公司
注册地址：威海市环翠区宝泉路9号
办公地址：威海市环翠区宝泉路9号
法定代表人：谭先国
联系电话：0631-5222293
业务传真：0631-5215726
客服热线：省内96636，境内40000-96636
公司网址：www.whccb.com/www.whccb.com.cn
（98）名称：广东华兴银行股份有限公司
注册地址：广东省汕头市金平区金砂路92号嘉信大厦1-2楼部分和5楼全层
办公地址：广东省广州市天河区天河路533号
法定代表人：周泽荣
联系人：王放
联系电话：020-38173635
业务传真：020-38173857
客服热线：400-830-8001
公司网址：www.ghbank.com.cn
（99）名称：国都证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层法定代表人：常喆
联系人：黄静
电话：010-84183333
传真：010-84183311-3389
客服电话：400-818-8118
公司网站：www.guodu.com
（100）名称：北京农村商业银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街九号
办公地址：北京市西城区金融大街9号金融街中心B座
法定代表人：乔瑞
联系人：王薇娜
联系电话：010-63229475
传真：010-63229763
客服电话：010-96198
公司网站：www.bjrcb.com
（101）名称：河北银行股份有限公司
注册地址：石家庄市平安北大街28号
办公地址：石家庄市平安北大街28号
法定代表人：乔志强
联系人：王栋
电话：0311-88627522
传真：0311-88627027
客服电话：400-612-9999
网址：www.hebbank.com
（102）名称：上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号
办公地址：上海市中山东一路12号
法定代表人：吉晓辉
电话：021-61618888
传真：021-63604199
联系人：高天、虞谷云
客服电话：95528
公司网站：www.spdb.com.cn
（103）名称：中信银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座
法定代表人：常振明
联系人：廉赵峰
联系电话：010-65557048
业务传真：010-65550827
客服热线：95558
公司网址：www.bank.ecitic.com
（104）名称：东兴证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层（详细地址）
办公地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层（详细地址）
法定代表人：魏庆华
联系人：汤漫川
联系电话：010-66555316
业务传真：010-66555246
客服热线：4008888993
公司网址：www.dxzq.net.cn
(105) 名称：中原证券股份有限公司
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号；
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号；
法定代表人：菅明军
联系人：程月艳；范春艳
电话：0371-69099882
传真：0371-65585899
客服电话：95377
公司网站：www.ccnew.com
(106)名称：上海利得基金销售有限公司
注册地址：上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址：上海浦东新区峨山路91弄61号10号楼12楼
法定代表人：沈继伟
联系人：张裕
联系电话：15801816961
客服热线：4000676266
公司网址：www.leadfund.com.cn
(107)名称：江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址：江苏省常州市延陵中路668号
办公地址：江苏省常州市延陵中路668号
法人代表：王国琛
联系人：续志刚
联系电话：0519-89995001
客服电话：0519-96005
传真：0519-89995001
网址：www.jnbank.cc
(108)名称：江苏吴江农村商业银行股份有限公司
注册地址：苏州市吴江区中山南路1777号
办公地址：苏州市吴江区中山南路1777号
法人代表：陆玉根
联络人：王健
联系电话：0512-63969841
客服电话：4008696068、0512-96068
传真：0512-63969962
网址：www.wjrcb.com
(109)名称：上海大智慧财富管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
办公地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路428号1号楼1102、1103单元
法定代表人：申健
联系人：印强明
电话：021-20219188
传真：021-20219923
客服电话：021-20219931
公司网址：https://8.gw.com.cn/
（110）名称：上海联泰资产管理有限公司
注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址：上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人：燕斌
联系人：凌秋艳
电话：021-52822063
传真：021-52975270
客服电话：4000-466-788
公司网址：www.66zichan.com
（111）名称：开源证券股份有限公司
注册地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址：西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人：李刚
联系人：黄芳、袁伟涛
电话：029-63387256
传真：029-81887060
客服电话：400-860-8866
公司网址：www.kysec.cn
（112）名称：珠海盈米财富管理有限公司
注册地址：珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼1201-1203室
法定代表人：肖雯
联系人：黄敏嫦
电话：020-89629019
传真：020-89629011
客服电话：020-89629066
公司网址：www.yingmi.cn
（113）名称：包商银行股份有限公司
注册地址：内蒙古包头市钢铁大街6号
办公地址：内蒙古包头市钢铁大街6号
法人代表：李镇西
联络人：刘芳
联系电话：95352
客服电话：内蒙古地区：0472-96016
北京地区：010-96016
宁波地区：0574-967210
深圳地区：0755-967210
成都地区：028-65558555
传真：0472-5189057
网址：www.bsb.com.cn
（114）名称：国盛证券有限责任公司
注册地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）
办公地址：南昌市北京西路88号（江信国际金融大厦）
法定代表人：曾小普
联系人：陈明
电话：0791-86281305
传真：0791-86282293
客服电话：4008-222-111
公司网站：www.gsstock.com
（115）名称：上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址：上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址：上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人：陈继武
联系人：李晓明
电话：021-63333319
传真：021-63332523
客服电话：4000178000
公司网址：www.lingxianfund.com
（116）名称：北京唐鼎耀华投资咨询有限公司
注册地址：北京市延庆县延庆经济开发区百泉街10号2栋236室
办公地址：北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦A303
法定代表人：王岩
联系人：胡明会
联系电话：010-59200855
业务传真：010-59200800
客服热线：400-819-9868
公司网址：www.tdyhfund.com
（117）名称：华宝证券有限责任公司
注册地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
办公地址：上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27层
法定代表人：陈林
联系人：宋歌
电话：021-50122086
传真：021-50122200
客服电话：4008209898
公司网站：www.cnhbstock.com
(118) 名称：南京证券有限责任公司
住所：江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人：张华东
联系人：徐翔
电话：025-83367888-4201
传真：022-83320066
客户服务热线：4008285888
公司网站：www.njzq.com.cn
（119）名称：北京汇成基金销售有限公司
注册地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址：北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人：王伟刚
联系人：丁向坤
电话：010-56282140
传真：010-62680827
客服电话：4006199059
公司网址：www.fundzone.cn
（120）名称：北京蛋卷基金销售有限公司
注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
办公地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元21层222507
法定代表人：钟斐斐
联系人：吴季林
电话：010-61840688
传真：010-61840699
客服电话：4000618518
公司网址：https://danjuanapp.com
（121）名称：北京广源达信投资管理有限公司
注册地址：北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址：北京市朝阳区望京宏泰东街 浦项中心B座19层
法定代表人：齐剑辉
联系人：王英俊
电话：13911468997
传真：010-82055860
客服电话：4006236060
公司网址：www.niuniufund.com
（122）名称：南京苏宁基金销售有限公司
注册地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
办公地址：南京市玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人：钱燕飞
联系人：王锋
电话：025-66996699-887226
传真：无
客服电话：4008365365-9
公司网址：www.Fund.licai.com
（123）名称：广东南海农村商业银行股份有限公司
注册地址：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北26号
办公地址：广东省佛山市南海区桂城街道南海大道北26号
法定代表人：肖寒
联系人：廖雪
联系电话：0757-86266566
业务传真：0757-86250627
客服热线：96138
公司网址：www.nanhaibank.com
（124）名称：北京肯特瑞财富投资管理有限公司
注册地址：北京市海淀区海淀东三街2号4层401-15
办公地址：北京经济开发区科创十一街18号院京东集团总部大楼A区17层
法定代表人：陈超
联系人：江卉
电话：13141319110
传真：010-89188000
客服电话：400-088-8816
公司网址：http://jr.jd.com/
（125）名称：奕丰金融服务（深圳）有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115-1116室及1307室
法定代表人：TAN YIK KUAN
联系人：叶健
电话：0755-89460607
传真：0755-21674453
客服电话：400-684-0500
公司网址：www.ifastps.com.cn
（126）名称：弘业期货股份有限公司
注册地址：南京市中华路50号
办公地址：南京市中华路50号
法定代表人：周剑秋
联系人：孙朝旺
电话：025-52278870
传真：025-52250114
客服电话：4008281288
公司网址：www.ftol.com.cn
（127）名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司
注册地址：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室
办公地址：北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层
法定代表人：钱昊旻
联系人：孙雯
电话：010-59336519
传真：010-59336586
客服电话：4008909998
公司网址：www.jnlc.com
3、其他代销机构
本基金发售期间，若新增代销机构或代销机构新增营业网点，则另行公告。
基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。
二、注册登记人
名称：广发基金管理有限公司
住所：广东省珠海市横琴新区宝中路3号4004-56室
法定代表人：孙树明
办公地址：广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31－33楼
电话：020-89188970
传真：020-89899175
联系人：李尔华
三、出具法律意见书的律师事务所
名称：北京市盈科（广州）律师事务所
住所：广州市广州大道中289号南方传媒大厦B座15-18层
负责人：牟晋军
电话：020－66857288
传真：020－66857289
经办律师：刘智、陈琛
联系人：牟晋军
四、审计基金资产的会计师事务所
名称：德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）
办公地址：上海市延安东路222号外滩中心30楼
法人代表：卢伯卿
联系人：洪锐明
电话：021－61418888
传真：021－63350003
经办注册会计师：洪锐明、江丽雅

第四部分 基金的名称

广发鑫盛18个月定期开放混合型证券投资基金

第五部分 基金类型

契约型开放式

第六部分 基金的投资目标

在深入研究、严格控制风险的基础上，通过投资定向增发（非公开发行股份）主题的股票以及固定收益类金融工具，力争获取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。

第七部分 基金的投资方向

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为股票投资占基金资产的比例为0-50%，其中通过定向增发（非公开发行）投资于上市公司的股票的成本不超过基金资产的30%；债券等固定收益类资产投资占基金资产的比例不低于50%；在封闭期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金的期货交易账户内应当保持不低于期货交易保证金一倍的现金；在开放期内，每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以做出相应调整。

第八部分 基金的投资策略

（一）大类资产配置

本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值，根据大类资产的风险收益特征进行配置，确定合适的资产配置比例，并适时进行调整。

（二）股票投资策略

在封闭期内，本基金股票投资上将优先考虑定向增发主题的股票进行投资，包括一级市场参与定向增发，以及二级市场买入涉及定增主题的股票；同时将其余资金投资于固定收益类金融工具，以及进行一些套利操作。

本基金将通过“自上而下”和“自下而上”相结合的投资思路，在综合深入研究宏观经济形势、行业生命周期以及上市公司具体涉及的定向增发项目基础上，结合定向增发项目的事件性特征与折价优势，优选能够改善、提升企业基本面与经营状况或者能提升企业估值的定向增发股票进行投资。

本基金将从实施定向增发的上市公司基本面情况（所处行业的生命周期、主营业务竞争优势、盈利水平、资本负债结构、内部管理水平等）、定向增发项目目的、定向增发项目类别、定向增发对象结构，多层面地分析备选定向增发项目所对应的公司业务环节的竞争优势和劣势，分析定向增发项目对公司未来的影响。

对于一级市场参与上市公司的定向增发项目的投资，本基金将在上述分析的基础上，进一步结合定向增发价格的折价水平、锁定时间、股票市场的整体运行状况，以及基金的流动性安排等因素进行综合考虑，积极参与成长性较高、风险较低的定向增发项目。在定向增发股票锁定期结束后，本基金将根据对股票内在投资价值和成长性的判断，结合股票市场环境的分析，选择适当的时机卖出。

（三）债券投资策略

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。

1、久期配置策略

本基金将考察市场利率的动态变化及预期变化，对GDP、CPI、国际收支等引起利率变化的相关因素进行深入的研究，分析宏观经济运行的可能情景，并在此基础上判断包括财政政策、货币政策在内的宏观经济政策取向，对市场利率水平和收益率曲线未来的变化趋势做出预测和判断，结合债券市场资金供求结构及变化趋势，确定固定收益类资产的久期配置。

2、类属配置策略

类属配置主要包括资产类别选择、各类资产的适当组合以及对资产组合的管理。本基金通过情景分析和历史预测相结合的方法，“自上而下”在债券一级市场和二级市场，银行间市场和交易所市场，银行存款、信用债、政府债券等资产类别之间进行类属配置，进而确定具有最优风险收益特征的资产组合。

3、个券选择策略

对于国债、央行票据等非信用类债券，本基金将根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种；对于信用类债券，本基金将根据发行人的公司背景、行业特性、盈利能力、偿债能力、流动性等因素，对信用债进行信用风险评估，积极发掘信用利差具有相对投资机会的个券进行投资，并采取分散化投资策略，严格控制组合整体的违约风险水平。

4、可转债投资策略

可转债兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，本基金一方面将对发债主体的信用基本面进行深入挖掘以明确该可转债的债底保护，防范信用风险，另一方面，还会进一步分析公司的盈利和成长能力以确定可转债中长期的上涨空间。本基金将借鉴信用债的基本面研究，从行业基本面、公司的行业地位、竞争优势、财务稳健性、盈利能力、治理结构等方面进行考察，精选财务稳健、信用违约风险小的可转债进行投资。

5、中小企业私募债券投资策略

本基金对中小企业私募债的投资综合考虑安全性、收益性和流动性等方面特征进行全方位的研究和比较，对个券发行主体的性质、行业、经营情况、以及债券的增信措施等进行全面分析，选择具有优势的品种进行投资，并通过久期控制和调整、适度分散投资来管理组合的风险。

6、资产支持证券投资策略

资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券（ABS）、住房抵押贷款支持证券（MBS）等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。

（四）金融衍生品投资策略

1、股指期货投资策略

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。

2、权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，投资原则以套期保值为目的，为有利于加强基金风险管理。在进行权证投资时，基金管理人将通过对权证标的证券基本面的研究，并结合权证定价模型寻求其合理估值水平，根据权证的高杠杆性、有限损失性、灵活性等特性，通过限量投资、趋势投资、优化组合、获利等投资策略进行权证投资。基金管理人将充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择、谨慎进行投资，追求较稳定的当期收益。

3、国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证基金资产安全的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。国债期货相关投资遵循法律法规及中国证监会的规定。

第九部分 业绩比较基准

沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%

第十部分 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。

第十一部分 基金投资组合报告

本基金管理人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，并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2017年6月22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。

本投资组合报告所载数据截至2017年3月31日，本报告中所列财务数据未经审计。

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	62,113,866.41	22.19
	其中：股票	62,113,866.41	22.19
2	固定收益投资	144,949,000.00	51.78
	其中：债券	144,949,000.00	51.78
	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	30,000,000.00	10.72
	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	40,921,667.31	14.62
7	其他各项资产	1,953,376.65	0.70
8	合计	279,937,910.37	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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	1,374,984.00	0.52
C	制造业	41,865,256.45	15.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,283,959.54	3.52
F	批发和零售业	2,922,370.00	1.11
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	3,287,891.00	1.25
J	金融业	-	-
K	房地产业	138.42	0.00
L	租赁和商务服务业	3,379,267.00	1.28
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	62,113,866.41	23.57

2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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	600487	亨通光电	132,000	3,400,320.00	1.29
2	002508	老板电器	68,353	3,390,308.80	1.29
3	600966	博汇纸业	657,700	3,374,001.00	1.28
4	300323	华灿光电	274,300	3,340,974.00	1.27
5	600879	航天电子	185,900	3,292,289.00	1.25
6	002555	三七互娱	158,300	3,287,891.00	1.25
7	002051	中工国际	114,938	3,256,193.54	1.24
8	000568	泸州老窖	76,900	3,244,411.00	1.23
9	300156	神雾环保	92,500	3,237,500.00	1.23
10	002179	中航光电	85,200	3,228,228.00	1.22

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）	1,379,000.00	0.52
8	同业存单	143,570,000.00	54.48
9	其他	-	-
10	合计	144,949,000.00	55.00

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	111712015	17北京银行CD015	500,000	47,890,000.00	18.17
2	111791017	17包商银行CD009	500,000	47,845,000.00	18.15
3	111791655	17杭州银行CD043	500,000	47,835,000.00	18.15
4	113011	光大转债	13,000	1,300,000.00	0.49
5	113012	骆驼转债	790	79,000.00	0.03

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。

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。

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。

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。

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。

11、投资组合报告附注

（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。

（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。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	68,679.13
2	应收证券清算款	1,013,415.59
3	应收股利	-
4	应收利息	871,281.93
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,953,376.65

（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）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。

第十二部分 基金的业绩

本基金管理人依照恪尽职守、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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2017年3月31日。

1.本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

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
2016.11.18-2016.12.31	0.24%	0.01%	-2.32%	0.31%	2.56%	-0.30%
自基金合同生效起至今	0.90%	0.14%	-1.28%	0.23%	2.18%	-0.09%

注：（1）本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×30%+中证全债指数收益率×70%

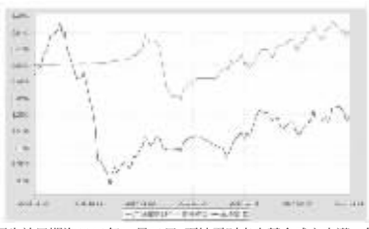
（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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

广发鑫盛18个月定期开放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

(2016年11月18日至2017年3月31日)



注：（1）本基金合同生效日期为2016年11月18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。

第十三部分 基金的费用

一、基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、证券账户开户费用和银行账户维护费；

9、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.0%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付给基