

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声明: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、完整性承担责任并个别签章。

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内容、数据指标、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、误导性陈述或重大遗漏。

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报告中的风险揭示、风险评级、投资策略、投资组合和基金合同。

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

广发多策略灵活配置混合型证券投资基金

基金代码:000763

交易方式:定期型开放式

基金合同生效日:2016年12月9日

报告期末基金份额总额:1,581,262,791.75份

投资目标:在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过大类资产的合理配置,结合市场环境灵活调整投资策略,力求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,结合政策导向、市场资金面、机构投资者动向、预期经济周期等因素对各投资资产的市场表现进行深入研究,对股票、债券、货币和商品等大类资产进行动态配置,并根据市场环境灵活调整投资策略,力求实现基金资产的长期稳健增值。

业绩比较基准:50%×沪深300指数+50%×中证债券指数

风险收益特征:本基金为混合型基金,其预期风险及预期收益水平高于货币市场基金,低于股票型基金。

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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		-98,413,694.21
2.本期利润		-50,628,926.07
3.加权平均基金份额本期利润		-0.0317
4.期末基金份额净值		1,347,093,878.01
5.期末基金份额总额		1,581,262,791.75

注:1)所列基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平以定期报告为准。

(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 本报告期基金净值增长率及其同同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

过去三个月 -3.62% 1.34% -0.26% 0.67%

-3.32% 0.67%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其同同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发多策略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(2016年12月31日至2018年9月30日)

注:1)“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2)证券业的含义从《证券业从业人员资格管理暂行办法》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,基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他配套法规、《广发多策略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,诚实信用、勤勉尽责地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取最大利益。本报告期内基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的违法行为。基金管理人符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 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,投资的债券必须来源于公司债券库。公司建立了严格的投资控制制度,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。基金经理与风险管理部定期沟通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;核稿岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察核稿,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。

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) 占基金资产的比(%)

1 权益投资 1,013,850,690.07 74.07

其中:股票 1,013,850,690.07 74.07

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

3 衍生品及套期保值准备 - -

4 买入返售金融资产 220,000,000.00 16.07

其中:买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 119,242,928.28 8.71

7 其他各项资产 16,654,727.63 1.14

8 合计 1,369,748,340.98 100.00

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

代号 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 281,124,136.73 20.86

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 68,106,896.56 5.06

E 建筑业 - -

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 62,872,089.00 4.67

J 金融、房地产 - -

K 房地产业 - -

L 租赁和商务服务业 - -

M 科学研究、技术服务业 5,203,047.20 0.39

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 1,013,850,690.07 100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期内本基金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 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002299 圣农发展 7,837,158 0.61

2 002096 百川股份 13,180,498 0.10

3 002468 万里石 7,606,057 0.06

4 002234 诚迈科技 8,010,066 0.06

5 003939 金固股份 1,670,515 0.06

6 002746 仙鹤股份 4,700,426 0.03

7 300023 三超新材 62,072,089.00 4.67

8 000603 金利科技 2,999,047 0.23

9 300398 中材科技 2,340,574 0.18

10 600268 中国石化 5,104,741 36,916,365.02 2.74

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

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 000646 金地集团 564,293 0.04

2 602393 新天燃气 110,800 0.01

3 600079 中国银行 323,300 0.02

4 000091 平安银行 369,700 0.03

5 601318 中国平安 68,400 0.00

6 002096 万科A 407,417 0.03

7 601616 兴业银行 215,800 0.02

8 300694 中科云网 76,780 0.01

9 002384 东方雨虹 278,300 0.02

10 600000 中信证券 964,000 0.07

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 项目 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 002299 圣农发展 126,215,904.08 9.61

2 002096 百川股份 126,072,020.00 9.67

3 002468 万里石 155,063,012.05 10.54

4 002234 诚迈科技 94,443,711.04 7.31

5 003939 金固股份 69,106,896.66 5.06

6 002746 仙鹤股份 65,100,900.00 4.62

7 300023 三超新材 62,072,089.00 4.67

8 000603 金利科技 46,165,647.02 3.36

9 300398 中材科技 42,012,303.00 3.12

10 600268 中国石化 36,916,365.02 2.74

5.7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.8 备查文件目录

(一)中国证监会准予广发多策略灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

(二)《广发多策略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)《广发多策略灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

(五)法律意见书

(六)基金代销机构代理协议、代销协议

(七)基金托管人业务资格文件、营业执照

(八)基金定期报告、半年报、年报

(九)临时公告及澄清公告

(十)基金销售机构的销售协议、协议

(十一)基金募集申请报告、基金募集说明书

(十二)基金验资报告、基金合同基金章程

(十三)基金托管协议

(十四)基金销售机构的销售协议、协议