

广发鑫源灵活资产配置混合型证券投资基金更新的招募说明书摘要

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。

9.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

0 本基金本报告期末未进行股指期货交易。

9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金股指期货投资以套期保值为主要目的,在构建股票投资组合的同时,通过股指期货对冲市场下行风险,降低系统风险损失,提高组合收益。本基金股指期货持仓符合规定的投资策略和投资目标。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

0 本基金本报告期末未进行国债期货交易。

11. 投资组合报告附注

(1)报告期内, 招商银行(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违规批贷转让以个人为借款主体的不良贷款、销售同业非保本理财产品时违选承诺保本, 违规将票据贴现资金直接转回出票人账户等行为给予罚款人民币6570万元的行政处罚。

除上述证券外, 本基金投资的前十名证券为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、处罚的情况。

(2) 报告期末本基金持有的前十名股票中超出证监会合同规定的备选股票库:

(其他证券构成)

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	13,857.86
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,564,028.84
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	预摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,577,886.70

(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。

第十一部分 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2018年6月30日。

1. 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	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2017.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

2 自基金合同生效以来本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的比较

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.60%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.42%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	9.76%	0.35%	6.30%	0.20%	3.46%	0.15%
2017.4.1-2018.6.30	-1.92%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.10%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	7.01%	0.35%	2.51%	0.26%	4.50%	0.09%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较基准之差④	①-③	②-④
2016.11.02-2016.12.31	-0.30%	0.09%	-2.02%	0.28%	1.72%	-0.19%
2017.1.1-2017.3.31	5.82%	0.19%	6.30%	0.20%	-0.48%	-0.01%
2017.4.1-2018.6.30	-1.90%	0.39%	-0.82%	0.35%	-1.08%	0.04%
自基金合同生效以来至2018.6.30	3.50%	0.26%	2.51%	0.26%	0.99%	0.00%

广发鑫源混合 C:

阶段	净值增长率①	净值增长率与业绩比较基准之差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率与业绩比较
----	--------	-----------------	------------	----------------