

## 广发核心精选混合型证券投资基金

## 2018年半年度报告摘要

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:二〇一八年八月二十四日

## 重要提示

1.1 重要提示  
基金管理人及基金托管人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。  
本半年度报告未经会计师事务所审计,会计师事务所出具了标准无保留意见。  
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6月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。  
本半年度报告摘要摘自半年度报告全文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。  
本报告中文资料为最终版本。  
本报告自2018年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	广发核心精选混合
基金代码	270009
交易代码	270008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年07月16日
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
报告期末基金份额总额	367,512,078.429
基金份额持有人数量	9,200

## 2.2 基金产品说明

投资目标	通过主动管理,精选优质资产,合理配置股票、债券、货币资产,信用“核心+卫星”策略配置,投资于具有较高投资价值的资产,在有效控制风险的前提下,进入中长期投资,稳健地获取资产增值,在控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用“核心+卫星”的投资策略,在沪深300指数成分股及具备高成长性的个股或行业板块,通过自上而下和自下而上的策略,精选“核心+卫星”资产,构建投资组合。其中,“核心”资产主要投资于沪深300指数成分股,“卫星”资产主要投资于具有较高成长性的个股或行业板块。
业绩比较基准	80%×沪深300指数+20%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益和风险高于货币型基金,但低于股票型基金,属于证券投资基金中预期收益和风险较高的品种。

## 2.3 基金管理人及基金托管人

名称	基金管理人	基金托管人
名称	广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
法定代表人	孙树明	姜宁
联系电话	020-83939666	(010) 66105798
电子邮箱	gffund@广发.com	custody@icbc.com
客户服务电话	95168,020-83939669	95588
传真	020-83989158	(010) 66105799

## 2.4 信息披露方式

信息披露网站:www.gffund.com.cn  
基金半年度报告备查地点:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标和基金净值表现

项目	金额单位:人民币元
1.1 期间数据指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期净收益	-114,503,206.61
本期利润	-136,616,293.46
加权平均基金份额本期利润	-0.5171
期末基金份额净值	-16.644%
1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末基金份额总额	1,648,000
期末基金资产净值	990,527,659.15
期末基金份额净值	2.71

注:①上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可能会低于所列指标。

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期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

## 3.2 基金净值表现

## 3.2.1 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	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-②
过去一个月	-4.55%	1.91%	-6.04%	1.69%
过去三个月	-2.08%	1.47%	-7.85%	0.51%
过去六个月	-16.44%	1.43%	-9.76%	0.61%
过去一年	-18.40%	1.29%	-2.77%	0.07%
过去三年	-18.90%	1.77%	-15.09%	1.19%
自基金合同生效以来	217.21%	1.63%	27.62%	1.32%

注:①业绩比较基准:沪深300指数×90%+上证国债指数×10%。

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。

## 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发核心精选混合型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2008年7月16日至2018年6月30日)



注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值人民币2.71元,基金份额总额367,512,078.42份。

## 6.2 利润分配

会计主体:广发核心精选混合型证券投资基金  
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	附注	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-176,438,716.07	202,343,627.74
1.利息收入		511,056.02	796,798.98
2.投资收益		511,056.02	796,798.98
其中:公允价值变动收益		-	-
3.其他业务收入		-	-
4.公允价值变动收益		-	-
5.其他业务收入		-	-
6.其他业务收入		-	-
7.其他业务收入		-	-
8.其他业务收入		-	-
9.其他业务收入		-	-
10.其他业务收入		-	-
11.其他业务收入		-	-
12.其他业务收入		-	-
13.其他业务收入		-	-
14.其他业务收入		-	-
15.其他业务收入		-	-
16.其他业务收入		-	-
17.其他业务收入		-	-
18.其他业务收入		-	-
19.其他业务收入		-	-
20.其他业务收入		-	-
21.其他业务收入		-	-
22.其他业务收入		-	-
23.其他业务收入		-	-
24.其他业务收入		-	-
25.其他业务收入		-	-
26.其他业务收入		-	-
27.其他业务收入		-	-
28.其他业务收入		-	-
29.其他业务收入		-	-
30.其他业务收入		-	-
31.其他业务收入		-	-
32.其他业务收入		-	-
33.其他业务收入		-	-
34.其他业务收入		-	-
35.其他业务收入		-	-
36.其他业务收入		-	-
37.其他业务收入		-	-
38.其他业务收入		-	-
39.其他业务收入		-	-
40.其他业务收入		-	-
41.其他业务收入		-	-
42.其他业务收入		-	-
43.其他业务收入		-	-
44.其他业务收入		-	-
45.其他业务收入		-	-
46.其他业务收入		-	-
47.其他业务收入		-	-
48.其他业务收入		-	-
49.其他业务收入		-	-
50.其他业务收入		-	-
51.其他业务收入		-	-
52.其他业务收入		-	-
53.其他业务收入		-	-
54.其他业务收入		-	-
55.其他业务收入		-	-
56.其他业务收入		-	-
57.其他业务收入		-	-
58.其他业务收入		-	-
59.其他业务收入		-	-
60.其他业务收入		-	-
61.其他业务收入		-	-
62.其他业务收入		-	-
63.其他业务收入		-	-
64.其他业务收入		-	-
65.其他业务收入		-	-
66.其他业务收入		-	-
67.其他业务收入		-	-
68.其他业务收入		-	-
69.其他业务收入		-	-
70.其他业务收入		-	-
71.其他业务收入		-	-
72.其他业务收入		-	-
73.其他业务收入		-	-
74.其他业务收入		-	-
75.其他业务收入		-	-
76.其他业务收入		-	-
77.其他业务收入		-	-
78.其他业务收入		-	-
79.其他业务收入		-	-
80.其他业务收入		-	-
81.其他业务收入		-	-
82.其他业务收入		-	-
83.其他业务收入		-	-
84.其他业务收入		-	-
85.其他业务收入		-	-
86.其他业务收入		-	-
87.其他业务收入		-	-
88.其他业务收入		-	-
89.其他业务收入		-	-
90.其他业务收入		-	-
91.其他业务收入		-	-
92.其他业务收入		-	-
93.其他业务收入		-	-
94.其他业务收入		-	-
95.其他业务收入		-	-
96.其他业务收入		-	-
97.其他业务收入		-	-
98.其他业务收入		-	-
99.其他业务收入		-	-
100.其他业务收入		-	-

注:本基金在报告期内未进行利润分配。

## 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:广发核心精选混合型证券投资基金  
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

项目	附注	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、所有者权益(基金净值)		462,130,969.80	1,532,603,818.53
1.期初所有者权益(基金净值)		-	-
2.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)		-136,616,293.46	-136,616,293.46
3.本期基金份额发行产生的基金净值变动数(净额)		-104,618,881.38	-346,409,856.93
4.本期基金份额赎回产生的基金净值变动数(净额)		66,317,706.29	130,515,367.73
5.其他		-169,866,586.67	-371,946,332.81
6.其他		-	-
7.其他		-	-
8.其他		-	-
9.其他		-	-
10.其他		-	-
11.其他		-	-
12.其他		-	-
13.其他		-	-
14.其他		-	-
15.其他		-	-
16.其他		-	-
17.其他		-	-
18.其他		-	-
19.其他		-	-
20.其他		-	-
21.其他		-	-
22.其他		-	-
23.其他		-	-
24.其他		-	-
25.其他		-	-
26.其他		-	-
27.其他		-	-
28.其他		-	-
29.其他		-	-
30.其他		-	-
31.其他		-	-
32.其他		-	-
33.其他		-	-
34.其他		-	-
35.其他		-	-
36.其他		-	-
37.其他		-	-
38.其他		-	-
39.其他		-	-
40.其他		-	-
41.其他		-	-
42.其他		-	-
43.其他		-	-
44.其他		-	-
45.其他		-	-
46.其他		-	-
47.其他		-	-
48.其他		-	-
49.其他		-	-
50.其他		-	-
51.其他		-	-
52.其他		-	-
53.其他		-	-
54.其他		-	-
55.其他		-	-
56.其他		-	-
57.其他		-	-
58.其他		-	-
59.其他		-	-
60.其他		-	-
61.其他		-	-
62.其他		-	-
63.其他		-	-
64.其他		-	-
65.其他		-	-
66.其他		-	-
67.其他		-	-
68.其他		-	-
69.其他		-	-
70.其他		-	-
71.其他		-	-
72.其他		-	-
73.其他		-	-
74.其他		-	-
75.其他		-	-
76.其他		-	-
77.其他		-	-
78.其他		-	-
79.其他		-	-
80.其他		-	-
81.其他		-	-
82.其他		-	-
83.其他		-	-
84.其他		-	-
85.其他		-	-
86.其他		-	-
87.其他		-	-
88.其他		-	-
89.其他		-	-
90.其他		-	-
91.其他		-	-
92.其他		-	-
93.其他		-	-
94.其他		-	-
95.其他		-	-
96.其他		-	-
97.其他		-	-
98.其他		-	-
99.其他		-	-
100.其他		-	-

注:1.“任职日期”和“离任日期”指公司公布聘任或解聘日期。  
2.证券从从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 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况

4.2.1 管理人报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套法规、《广发核心精选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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资管理符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况  
公司通过建立科学、严格的投资决策体系,加强交易环节的内部控制,并通过实时监控系统对持仓的分析评估,保证公平交易制度的实现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明  
本公司报告期内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。如果出现较大金额双向特殊交易则需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备监管部门。

4.3.3 管理人报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套法规、《广发核心精选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,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金份额持有人利益的行为。基金的投资管理符合有关法律法规及基金合同的规定。

## 4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内环境相对比较温和,去杠杆和贸易使得宏观经济下行压力有所缓解,市场预期较为悲观。总体来看,消费相关行业相对抗跌,周期行业走势趋弱。报告期内,本基金净值表现较差。下跌基金仓位,本基金仓位有所调整,主要由于重仓持有的两只股票出现重大损失,股价大幅下跌,给基金净值造成重大损失。二是在较高的仓位下,重仓持有金融地产板块,承担了较大幅度的下跌。二季度持仓逐渐调整到以医药和食品饮料为代表的消费类个股上,净值表现在市场上下跌的环境下比较抗跌。

## 4.4.2 报告期内基金的投资组合

4.4.2.1 基金资产组合

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末,本基金资产组合如下:

报告期末