

广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

为监控及及时的分析评估,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,投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合合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,中央交易室按照“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。金融工程与风险管理部风险控制岗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;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监督稽核,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金降低了必需消费行业的配置,增加了估值性价比更高的白酒行业及保险行业的配置,增加了成长性行业的医药行业和生物制药的配置。制造业PMI自2018年12月以来连续3个月低于临界点,2019年3月回升至临界点以上,这与PMI增速前降后升性、规模以上工业企

业利润增速基本见底一致。MSCI提高A股权重,资金面对当前A股的支撑较为显著,中长期资金的人场依旧不必过于担忧。科创板细则正式落地,有望在投资端和股东经营管理层面都对现有上市公司产生有效共振,在估值提升方面或有力促进作用。4月份进入季报期,二季度开始市场开始更多关注基本面,中央交易室按照“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。金融工程与风险管理部风险控制岗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;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程

的独立监督稽核,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

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:二〇一九年四月二十二日

§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法律责任。

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2019年4月18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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发创新驱动混合
基金主代码	004119
交易代码	004119
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2017年04月26日
报告期末基金份额总额	252,107,069.60份
投资目标	在控制风险的前提下,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。
投资策略	本基金在有效控制风险的基础上,结合宏观经济、证券市场状况、影响证券市场发展的趋势,根据经济周期阶段及各类资产市场表现变化状况,对股票、债券、货币市场工具及现金类资产的投资比例进行动态调整。
业绩比较基准	60%×中国沪深300指数收益率+40%×中证全指信息技术指数收益率
风险收益特征	本基金属于中高风险基金,其预期收益及风险水平高于证券市场基金中债券型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益特征的基金。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年1月1日至2019年3月31日)
1.本期已实现收益	8,636,898.61
2.本期利润	50,628,123.51
3.加权平均基金份额本期利润	0.2041
4.期末基金资产净值	268,897,579.67
5.期末基金份额净值	1.063

注:1.(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。

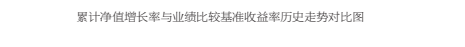
(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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	30.82%	1.00%	10.91%	1.00%	10.62%	0.00%

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



广发创新驱动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走势对比图
(2017年4月26日至2019年3月31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
报告送出日期:二〇一九年四月二十二日

§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法律责任。

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2019年4月18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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发创业板ETF
基金主代码	159962
交易代码	159962
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年04月26日
报告期末基金份额总额	1,476,344,129.69份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,按照标的指数的构成成份股的结构及权重构建股票投资组合,并可根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的90%。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与收益高于混合型基金,跟踪偏离度与跟踪误差与货币型基金、债券基金、货币市场基金等固定收益类基金的风险收益特征不同,具有较高风险,以及相应的跟踪误差和投资市场风险收益特征。
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

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年1月1日至2019年3月31日)
1.本期已实现收益	81,769,021.69
2.本期利润	406,265,031.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.2769
4.期末基金资产净值	1,630,480,096.76
5.期末基金份额净值	1.1077

注:1.(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	35.50%	1.09%	35.42%	1.00%	0.12%	-0.01%

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



广发创业板交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图
(2017年4月26日至2019年3月31日)

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十二日

§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法律责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月18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1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发电子信息传媒股票
基金主代码	006310
交易代码	006310
基金运作方式	契约式
基金合同生效日	2017年12月11日
报告期末基金份额总额	58,587,792.67份
投资目标	本基金主要投资于电子信息传媒(TMT)产业上市公司股票,通过个股精选,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。
投资策略	本基金在有效控制风险的前提下,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。
业绩比较基准	中证全指信息技术指数收益率×90%+中证全指信息技术行业指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属于股票基金,其预期收益及风险水平高于证券市场基金中债券型基金,低于股票型基金,属于中高风险收益特征的基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标

主要财务指标	报告期 (2019年1月1日至2019年3月31日)
1.本期已实现收益	982,676.96
2.本期利润	12,326,669.28
3.加权平均基金份额本期利润	0.211
4.期末基金资产净值	62,276,669.28
5.期末基金份额净值	0.9927

注:1.(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	34.71%	1.84%	38.00%	1.91%	-1.43%	-0.07%

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



广发电子信息传媒产业精选股票发起式证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率走势对比图
(2017年12月11日至2019年3月31日)

广发创业板交易型开放式指数证券投资基金

2019年第一季度报告

为监控及及时的分析评估,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,投资的债券必须来自公司债券库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合合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,中央交易室按照“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。金融工程与风险管理部风险控制岗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;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监督稽核,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金降低了必需消费行业的配置,增加了估值性价比更高的白酒行业及保险行业的配置,增加了成长性行业的医药行业和生物制药的配置。制造业PMI自2018年12月以来连续3个月低于临界点,2019年3月回升至临界点以上,这与PMI增速前降后升性、规模以上工业企

业利润增速基本见底一致。MSCI提高A股权重,资金面对当前A股的支撑较为显著,中长期资金的人场依旧不必过于担忧。科创板细则正式落地,有望在投资端和股东经营管理层面都对现有上市公司产生有效共振,在估值提升方面或有力促进作用。4月份进入季报期,二季度开始市场开始更多关注基本面,中央交易室按照“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。金融工程与风险管理部风险控制岗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;稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程

的独立监督稽核,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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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。如果出现应对大额赎回等特殊情

况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并报备备查。

本投资组合为完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的组合。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况;与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,本基金基于基本面分析,呈现出股票型基本特征,本基金主要采用完全复制法跟踪标的业绩表现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上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组合除外)或同一投资组合在同一交易日内