

信息披露

Disclosure

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一九年四月二十二日
§ 1 提要提示
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责任。

基金托管人:中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年4月18日核对了本基金中的财务数据、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请仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期中费用资料未经审计。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

名称	基金类型	基金代码	基金简称	运作周期	期限
混合基金	广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金	000097	广发逆向策略	-	139天
定期开放	定期开放混合型基金	000097	定期开放	-	139天
混合基金	定期开放混合型基金	2019010141	定期开放	-	139天
混合基金	定期开放混合型基金	54,009,963.04	定期开放	-	139天

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标		报告期(2019年1月1日至2019年3月31日)	
1.本期利润	44,383.97	2.本期利润	10,003,10.06
3.本期利润/同期基本每股收益	0.0308	4.期末可供分配利润	96,006,047.00
5.期末可供分配利润	1,046	6.期末可供分配利润/期末基金资产净值	1.046

注: (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，计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

(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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	35.3%	1.5%	16.0%	0.7%	10.3%	0.6%

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

广发逆向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

(2014年9月4日至2019年3月31日)

广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名	性别	任本基金的基金经理	担任日期	说明
基金经理	男	广发逆向策略	2014-04-04	基金经理
基金经理	男	广发逆向策略	-	基金经理
基金经理	男	广发逆向策略	-	基金经理
基金经理	男	广发逆向策略	-	基金经理

注: (1) “任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业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 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益。本基金报告期内运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 平等交易制度的执行情况

本公司通过建立科学、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作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。超过权限的投资需要经严格的审批程序。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。金融工程与风险管理部风控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、研究交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本公司报告期内，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）进行同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如因应对大额赎回等特殊情形需要进行反向交易的，则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本公司组合主动型开放式基金。本报告期内，本公司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，但成交量较少的单边交易量不超过该证券当成

数的0.1%。

4.4 报告期内基金的经营业绩

截至报告期末，本基金的资产净值为人民币96,006,047.00元，份额净值为人民币1.046元，本报告期基金份额净值增长率为25.34%，同期业绩比较基准收益率为26.34%。

4.5 投资组合报告

4.5.1 投资组合报告

4.5.2 投资组合报告

4.5.3 投资组合报告

4.5.4 投资组合报告

4.5.5 投资组合报告

4.5.6 投资组合报告

4.5.7 投资组合报告

4.5.8 投资组合报告

4.5.9 投资组合报告

4.5.10 投资组合报告

4.5.11 投资组合报告

4.5.12 投资组合报告

4.5.13 投资组合报告

4.5.14 投资组合报告

4.5.15 投资组合报告

4.5.16 投资组合报告

4.5.17 投资组合报告

4.5.18 投资组合报告

4.5.19 投资组合报告

4.5.20 投资组合报告

4.5.21 投资组合报告

4.5.22 投资组合报告

4.5.23 投资组合报告

4.5.24 投资组合报告

4.5.25 投资组合报告

4.5.26 投资组合报告

4.5.27 投资组合报告

4.5.28 投资组合报告

4.5.29 投资组合报告

4.5.30 投资组合报告

4.5.31 投资组合报告

4.5.32 投资组合报告

4.5.33 投资组合报告

4.5.34 投资组合报告

4.5.35 投资组合报告

4.5.36 投资组合报告

4.5.37 投资组合报告

4.5.38 投资组合报告

4.5.39 投资组合报告

4.5.40 投资组合报告

4.5.41 投资组合报告

4.5.42 投资组合报告

4.5.43 投资组合报告

4.5.44 投资组合报告

4.5.45 投资组合报告

4.5.46 投资组合报告

4.5.47 投资组合报告

4.5.48 投资组合报告

4.5.49 投资组合报告

4.5.50 投资组合报告

4.5.51 投资组合报告

4.5.52 投资组合报告

4.5.53 投资组合报告

4.5.54 投资组合报告

4.5.55 投资组合报告

4.5.56 投资组合报告

4.5.57 投资组合报告

4.5.58 投资组合报告

4.5.59 投资组合报告

4.5.60 投资组合报告

4.5.61 投资组合报告

4.5.62 投资组合报告

4.5.63 投资组合报告

4.5.64 投资组合报告

4.5.65 投资组合报告

4.5.66 投资组合报告

4.5.67 投资组合报告

4.5.68 投资组合报告

4.5.69 投资组合报告

4.5.70 投资组合报告

4.5.71 投资组合报告

4.5.72 投资组合报告

4.5.73 投资组合报告

4.5.74 投资组合报告

4.5.75 投资组合报告

4.5.76 投资组合报告

4.5.77 投资组合报告

4.5.78 投资组合报告

4.5.79 投资组合报告

4.5.80 投资组合报告

4.5.81 投资组合报告