广发策略优选混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

2019年6月30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:二〇一九年七月十八日

§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7月16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。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发策略优选混合
基金主代码	270006
交易代码	270006(前端) 270016(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年5月17日
报告期末基金份额总额	1,811,729,210.36份
投资目标	通过综合运用多种投资策略优选股票,分享中国经济和资本市场高速增长的成果,为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。
投资策略	本基金将主要根据宏观经济政策、资金供求、市场波动周期因素的判断,确定资产配置策略;通过综合运用主题投资、买入持有、逆向投资等多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票构建股票投资组合;通过利率预测以及收益曲线策略进行债券投资;同时严格遵守有关权证投资的比例限制。
业绩比较基准	75%*沪深300指数+25%*中证全债指数。
风险收益特征	较高风险,较高收益。
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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	63,295,039.49
2.本期利润	-40,663,791.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0223
4.期末基金资产净值	3,063,252,892.74
5.期末基金份额净值	1.6908

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。

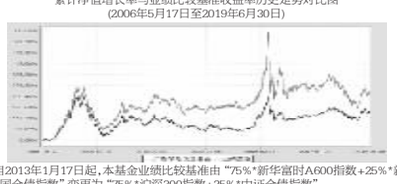
3.2 基金净值表现

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	-1.30%	1.66%	-0.75%	1.14%	-0.55%	0.52%

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

广发策略优选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
(2006年5月17日至2019年6月30日)



注:自2013年1月17日起,本基金业绩比较基准由"75%*新华富时A600指数+25%*新华巴克莱资本中国全债指数"变更为"75%*沪深300指数+25%*中证全债指数"。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
李巍	本基金的基金经理;广发制造业精选混合型证券投资基金的基金经理;广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发利鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发新兴成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发科创主题3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;策略投资部副总经理	2014-03-17	2019-05-22	14年	李巍先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发证券股份有限公司发展研究中心研究员、投资自营部研究员、投资经理,广发基金管理有限公司权益投资一部研究员、权益投资一部副总经理、权益投资一部总经理、策略投资部总经理、广发核心精选混合型证券投资基金基金经理(自2013年9月9日至2015年2月17日)、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2014年7月31日至2019年3月1日)、广发稳鑫保本混合型证券投资基金基金经理(自2016年3月21日至2019年3月26日)、广发策略优选混合型证券投资基金基金经理(自2014年3月17日至2019年5月22日)。
罗洋	本基金的基金经理	2019-05-22	-	9年	罗洋先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任国信证券股份有限公司经济研究所研究员、广发基金管理有限公司行业研究员、瑞元资本管理有限公司(广发基金子公司)投资经理、广发基金管理有限公司投资经理。
王小松	本基金的基金经理	2014-12-24	2019-05-22	12年	王小松先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任联合证券有限责任公司投资银行总部投行项目经理,华泰联合证券有限责任公司研究员,国联安基金管理有限公司研究员,广发基金管理有限公司研究发展部研究员、权益投资一部研究员、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月5日至2018年1月11日)、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年4月21日至2019年3月29日)、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年6月13日至2019年5月20日)、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年2月17日至2019年5月20日)、广发策略优选混合型证券投资基金基金经理(自2014年12月24日至2019年5月22日)、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年1月29日至2019年6月26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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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求最大利益。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 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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过授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。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察稽核,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(完全复制指数组合及量化组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因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留痕备查。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共4次,均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

2019年2季度,A股出现震荡分化。全季,上证50、沪深300、中小板综指和创业板综指涨跌幅分别为3.24%、-1.21%、-10.31%和-9.36%。

2019年2季度,中国经济基本面整体偏弱,6月PM1低于50%的荣枯线,前5月工业增加值同比增长6.0%,前5月工业企业利润同比下滑2.3%。具体看,商品房销售金额前5月同比增长6.1%,出口金额前5月同比微增0.4%,社会消费品零售总额前5月累计同比增长8.1%。

随着政府托底措施逐步发力,流动性保持回升趋势,前5月社融总量累计同比增长10.6%,M2同比增长8.5%,尽管受到包商银行事件的短期冲击,但判断影响可控,不改变总体趋势。10年期国债收益率稳定在3%以上,人民币汇率受到一定外部影响但没有破7。价格指数CPI受猪瘟影响有所抬升,PPI处于低位,5月值分别为2.70%和0.60%。

更重要的是政府减税降赋政策进一步深化,继1季度个税减免后,4月增值税率再次下调,有利于改善企业盈利和拉动消费,直接惠及民生,基金经理看好长期中国经济的结构调整。

外部环境方面,5月之后中美贸易摩擦有反复的迹象,但基金经理判断贸易摩擦将是持久战,应淡化短期波动,立足长期自身的强大。比较明确的是美国加息周期已经结束,预期年内会有数次降息,低利率环境有利于股票资产的估值提升。

A股总体估值仍处于历史偏低水平。

报告期内,本基金维持较高仓位,配置的主要方向包括金融地产、消费品、新能源和养殖,总体上配置较为均衡。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为-1.30%,同期业绩比较基准收益率为-0.75%。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,831,546,442.33	92.08
	其中:股票	2,831,546,442.33	92.08
2	固定收益投资	149,925,000.00	4.88
	其中:债券	149,925,000.00	4.88
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	91,732,859.89	2.98
7	其他资产	1,773,309.41	0.06
8	合计	3,074,977,611.63	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	263,567,662.82	8.60
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,483,070,464.01	48.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	32,776,386.99	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	3,052,300.00	0.10
H	住宿和餐饮业	30,114,126.64	0.98
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,672,872.84	2.24
J	金融业	796,906,406.32	26.02
K	房地产业	104,487,267.23	3.41
L	租赁和商务服务业	45,642,890.58	1.49
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	3,232,958.30	0.11
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,831,546,442.33	92.44

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,556,943	226,570,719.23	7.40
2	600036	招商银行	5,909,920	212,638,921.60	6.94
3	601012	隆基股份	6,584,041	152,157,187.51	4.97
4	000651	格力电器	2,703,099	148,670,445.00	4.85
5	600438	通威股份	10,330,096	145,241,149.76	4.74
6	000858	五粮液	1,229,123	144,975,057.85	4.73
7	000860	顺鑫农业	2,928,260	136,603,329.00	4.46
8	002714	牧原股份	2,286,218	134,406,756.22	4.39
9	300498	温氏股份	3,601,810	129,160,906.60	4.22
10	002142	宁波银行	3,925,193	95,146,678.32	3.11

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	149,925,000.00	4.89
	其中:政策性金融债	149,925,000.00	4.89
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	149,925,000.00	4.89

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	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	190206	19国开06	1,500,000	149,925,000.00	4.89

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体中,招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会(含原中国银行业监督管理委员会、中国保险监督管理委员会)或其派出机构的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外,本基金投资的其他前十名证券的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、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	945,137.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	776,966.59
5	应收申购款	51,215.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,773,309.41

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	1,844,614,430.18
本报告期基金总申购份额	17,328,933.90
减:本报告期基金总赎回份额	50,214,153.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,811,729,210.36

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1. 中国证监会批准广发策略优选混合型证券投资基金募集的文件
2.《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》
3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
4.《广发策略优选混合型证券投资基金托管协议》
5. 法律意见书
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅:投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件;
2.网站查阅:基金管理人网址http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一九年七月十八日

广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金

2019年第二季度报告

2019年6月30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:二〇一九年七月十八日

§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7月16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。

本报告期自2019年4月1日起至6月30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	契约型开放式
基金合同生效日	2017年6月9日
报告期末基金份额总额	197,027,833.01份
投资目标	在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,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	本基金在宏观经济分析基础上,结合政策面、市场资金面,积极把握市场发展趋势,根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况,对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整。
业绩比较基准	65%×中证800指数收益率+35%×中证全债指数收益率。
风险收益特征	本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中高收益风险特征的基金。
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

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	12,577,612.88
2.本期利润	17,183,698.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0816
4.期末基金资产净值	226,385,453.19
5.期末基金份额净值	1.149

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。

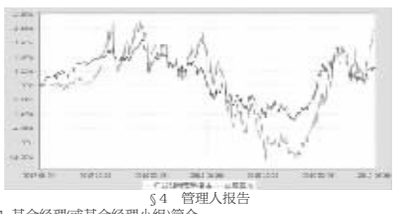
3.2 基金净值表现

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	8.09%	1.85%	-2.12%	1.01%	10.21%	0.84%

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历史走势对比图
(2017年6月9日至2019年6月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
张东一	本基金的基金经理;广发聚优灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发中小盘精选混合型证券投资基金的基金经理;广发中证500交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)的基金经理;广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金及起式联接基金的基金经理;广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金的基金经理;广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金及起式联接基金的基金经理;广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发创业板交易型开放式指数证券投资基金及起式联接基金的基金经理;广发标普全球农业指数证券投资基金的基金经理;广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理;广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)的基金经理;广发美国房地产指数证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理;广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理;广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理;广发恒生中国企业精明指数型发起式证券投资基金(QDII)的基金经理;指数投资部总经理助理	2017-10-24	-	11年	张东一女士,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司研究发展部研究员、投资经理、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年1月13日至2018年6月25日)、广发聚泰混合型证券投资基金基金经理(自2018年3月20日至2019年5月21日)。
刘杰	本基金的基金经理;公司常务副总经理、投资总监	2017-06-09	-	22年	刘杰先生,工学学士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司信息技术部系统开发专员、数量投资部研究员、广发沪深300指数证券投资基金基金经理(自2014年4月1日至2016年1月17日)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年1月25日至2018年4月25日)、广发量化稳健混合型证券投资基金基金经理(自2017年8月4日至2018年11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

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定,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求最大利益。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 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,公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度,投资组合的投资标的必须来源于公司备选库,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过授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。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察稽核,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(完全复制指数组合及量化组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因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留痕备查。

本报告期内,公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共4次,均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

我国正处于旧产能出清、新产能快速发展的经济转型期,企业的成长方式及经济结构的格局也会随之发生变化。随着中国经济的发展,居民人均可支配收入也相应提升,而消费升级也将成为大势所趋,把握住消费升级趋势的企业将有能力打破原有行业天花板,迎来更高速的发展。本组合的策略依然坚持选择长期有竞争力的个股进行长期持有。

本季度,管理人没有对持仓进行大幅度调整,仅对个别的个股进行了调整。降低了若干估值偏高的电子设备、家电板块个股的配置,增加配置了若干性价比突出的医药个股、以及销售数据超预期的白酒个股。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的份额净值增长率为8.09%,同期业绩比较基准收益率为-2.12%。

§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)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	189,084,352.44	82.67
	其中:股票	189,084,352.44	82.67
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	39,105,465.22	17.10
7	其他资产	545,402.68	0.24
8	合计	228,735,220.34	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

代码	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	10,650.00	0.00
C	制造业	155,964,764.64	68.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	15,768,480.00	6.97
G	交通运输、仓储和邮政业	7,028,670.20	3.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,552,980.00	3.34
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	2,758,807.60	1.22
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	189,084,352.44	83.52

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末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	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	191,500	22,587,425.00	9.98
2	600519	贵州茅台	22,309	21,952,056.00	9.70
3	000568	泸州老窖	251,694	20,344,426.02	8.99
4	000661	长春高新	52,446	17,726,748.00	7.83
5	000860	顺鑫农业	362,868	16,927,792.20	7.48
6	600004	白云机场	866,400	15,768,480.00	6.97
7	603369	今世缘	398,000	11,100,220.00	4.90
8	000651	格力电器	193,300	10,631,500.00	4.70
9	300760	迈瑞医疗	62,100	10,134,720.00	4.48
10	600809	山西汾酒	130,102	8,983,543.10	3.97

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	142,213.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,957.02
5	应收申购款	398,232.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	545,402.68

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	232,157,809.40
本报告期基金总申购份额	8,727,764.17
减:本报告期基金总赎回份额	43,857,740.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	197,027,833.01

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	7,252,529.83
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	7,252,529.83
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.68

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会注册广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2.《广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
4.《广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
5.法律意见书

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅:投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件;
2.网站查阅:基金管理人网址http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一九年七月十八日

广发创业板交易型开放式指数证券投资基金

2019年第二季度报告

2019年6月30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:二〇一九年七月十八日

§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7月16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。

本报告期自2019年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发创业板ETF
场内简称	创业ETF
基金主代码	159952
交易代码	159952
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017年4月25日
报告期末基金份额总额	1,944,484,929.00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,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。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80%。
业绩比较基准	本基金的标的指数为创业板指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2019年4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	33,434,649.26
2.本期利润	-145,223,708.07
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0816
4.期末基金资产净值	1,710,854,960.15
5.期末基金份额净值	0.8798

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