广发沪深300指数增强型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

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	广发沪深300指数增强
基金主代码	006020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年6月29日
报告期末基金份额总额	161,791,338.41份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化方法及基本面分析进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金在指数化投资的基础上通过数量化方法进行投资组合优化,在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下,力争获得超越标的指数的投资收益。本基金力争使日均跟踪偏离度绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过8.0%。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用指数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	中国银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	广发沪深300指数增强A / 广发沪深300指数增强C
下属分级基金的交易代码	006020 / 006021
报告期末下属分级基金的份额总额	83,653,162.58份 / 78,138,175.83份

§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)	
	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C
1.本期已实现收益	4,596,153.53	2,344,405.04
2.本期利润	1,027,294.38	2,747,668.85
3.加权平均基金份额本期利润	0.0139	0.0658
4.期末基金资产净值	94,099,589.73	87,614,469.97
5.期末基金份额净值	1.1249	1.1213

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

1.广发沪深300指数增强A:

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	1.66%	1.48%	-1.14%	1.45%	2.80%	0.03%

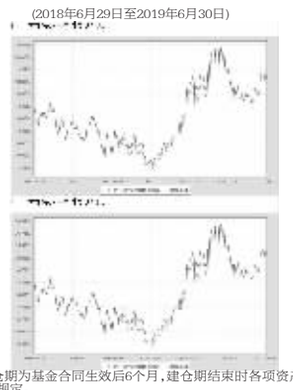
2.广发沪深300指数增强C:

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	1.59%	1.48%	-1.14%	1.45%	2.73%	0.03%

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

广发沪深300指数增强型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的历史走势对比图

(2018年6月29日至2019年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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
赵杰	本基金的基金经理;广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金的基金经理;广发量化多因子灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018-06-29	-	11年	赵杰先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任申银万国证券股份有限公司证券投资部量化研究员、量化投资经理,太平资产管理有限公司量化投资部量化投资经理,广发基金管理有限公司量化投资部二部量化研究员、量化投资部量化研究员。

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

本报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为1.66%,C类基金份额净值增长率为1.59%,同期业绩比较基准收益率为-1.14%。

§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	171,223,647.54	93.10
	其中:股票	171,223,647.54	93.10
2	固定收益投资	6,060,600.00	3.30
	其中:债券	6,060,600.00	3.30
	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	5,450,229.19	2.96
7	其他资产	1,180,805.68	0.64
8	合计	183,915,282.41	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	8,425,671.85	4.64
C	制造业	69,806,620.63	38.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,479,367.00	2.47
E	建筑业	5,277,961.00	2.90
F	批发和零售业	6,835,904.40	3.76
G	交通运输、仓储和邮政业	3,464,944.00	1.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,491,340.76	1.92
J	金融业	60,328,720.30	33.20
K	房地产业	7,602,863.00	4.18
L	租赁和商务服务业	1,487,148.00	0.82
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	171,223,647.54	94.23

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	140,000	12,405,400.00	6.83
2	600519	贵州茅台	5,700	5,608,800.00	3.09
3	600036	招商银行	144,732	5,207,457.36	2.87
4	601288	农业银行	1,174,800	4,229,280.00	2.33
5	600030	中信证券	164,900	3,926,269.00	2.16
6	000333	美的集团	73,200	3,796,152.00	2.09
7	601166	兴业银行	207,400	3,793,346.00	2.09
8	000858	五粮液	31,100	3,668,245.00	2.02
9	601328	交通银行	599,300	3,667,716.00	2.02
10	000001	平安银行	264,500	3,644,810.00	2.01

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	6,060,600.00	3.34
	其中:政策性金融债	6,060,600.00	3.34
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	6,060,600.00	3.34

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	108602	国开1704	60,000	6,060,600.00	3.34

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1909	IF1909	1.00	1,137,540.00	-3,720.00	买入股指期货多头合约是为了更有效地进行流动性管理。
公允价值变动总额合计(元)					-3,720.00
股指期货投资本期收益(元)					16,019.42
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-3,720.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,旨在配合基金日常投资管理需要,以更有效地跟踪标的指数和进行流动性管理,实现投资目标。

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、中国农业银行股份有限公司、交通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;交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行的处罚。

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	157,123.81
2	应收证券清算款	206,218.00
3	应收股利	-
4	应收利息	48,773.66
5	应收申购款	768,690.21
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,180,805.68

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

项目	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C
本报告期期初基金份额总额	73,119,679.71	30,938,451.03
本报告期基金总申购份额	35,499,113.45	72,629,195.77
减:本报告期基金总赎回份额	24,965,630.58	25,429,470.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	83,653,162.58	78,138,175.83

§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

项目	广发沪深300指数增强A	广发沪深300指数增强C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,800.08	-
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	10,000,800.08	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	6.18	-

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.08	6.18%	10,000,800.08	6.18%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,800.08	6.18%	10,000,800.08	6.18%	三年

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会注册广发沪深300指数增强型发起式证券投资基金募集的文件

2.《广发沪深300指数增强型发起式证券投资基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发沪深300指数增强型发起式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

9.2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

9.3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

广发汇康定期开放债券型发起式证券投资基金

2019年第二季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
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。

基金托管人兴业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	广发汇康定期开放债券
基金主代码	005745
交易代码	005745
基金运作方式	契约型、定期开放式
基金合同生效日	2018年4月16日
报告期末基金份额总额	1,018,374,677.99份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力求获得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	封闭期内,本基金通过对国内外宏观经济态势、利率走势、收益率曲线变化趋势和信用风险变化等因素进行综合分析,构建和调整固定收益证券投资组合,力求获得稳健的投资收益。 开放期内,为了保证组合具有较高的流动性,本基金将在遵守有关投资限制与投资比例的前提下,投资于具有较高流动性的投资品种,通过合理配置组合期限结构等方式,积极防范流动性风险,在满足组合流动性需求的同时,尽量减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率。
风险收益特征	本基金为债券型基金,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中具有中低风险收益特征的品种。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§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	25,688,585.45
2.本期利润	7,356,437.03
3.加权平均基金份额本期利润	0.0050
4.期末基金资产净值	1,033,462,486.57
5.期末基金份额净值	1.0148

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。

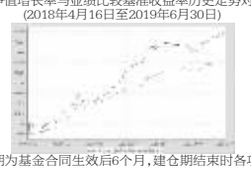
3.2 基金净值表现

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	0.63%	0.03%	0.65%	0.06%	-0.02%	-0.03%

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

广发汇康定期开放债券型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历史走势对比图
(2018年4月16日至2019年6月30日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§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
谢军	本基金的基金经理;广发增强债券型证券投资基金的基金经理;广发聚源债券型证券投资基金(LOF)的基金经理;广发安享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发聚利债券型证券投资基金的基金经理;广发华纯债券型证券投资基金的基金经理;广发景祥纯债债券型证券投资基金的基金经理;广发聚宝混合型证券投资基金的基金经理;广发聚鑫混合型证券投资基金的基金经理;广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发裕势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发集益纯债债券型证券投资基金的基金经理;广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发汇承定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发集裕债券型证券投资基金的基金经理;广发汇添3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇添6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;债券投资部总经理	2019-05-21	-	16年	谢军先生,金融学硕士,CFA,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固定收益部研究员、投资经理、固定收益部副总经理、广发聚利债券型证券投资基金基金经理(自2016年8月12日至2018年11月6日)、广发华纯债券型证券投资基金基金经理(自2016年1月10日至2018年11月6日)、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2016年12月2日至2018年6月12日)、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月9日至2018年10月9日)、广发安泽回报纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年1月10日至2018年10月29日)、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月18日至2018年11月9日)、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理(自2017年10月31日至2019年2月14日)、广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2018年3月23日至2019年4月10日)、广发汇元纯债定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理(自2018年3月30日至2019年4月10日)、广发稳安保本混合型证券投资基金基金经理(自2018年10月30日至2019年4月10日)、广发安泽短债债券型证券投资基金基金经理(自2018年10月30日至2019年4月10日)。
洪志	本基金的基金经理;广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发汇利3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发集裕债券型证券投资基金的基金经理;广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发汇立定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇吉3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇禄6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发聚鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发集益纯债债券型证券投资基金的基金经理	2019-05-21	-	6年	洪志先生,管理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后任广发基金管理有限公司固定收益管理总部债券交易兼研究员、投资经理。
王子柯	本基金的基金经理;广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发稳裕保本混合型证券投资基金的基金经理;广发中债7-10年期国开行债券指数证券投资基金的基金经理;广发景丰纯债债券型证券投资基金的基金经理;广发景辉纯债债券型证券投资基金的基金经理;广发景祥纯债债券型证券投资基金的基金经理;广发聚安混合型证券投资基金的基金经理;广发聚宝混合型证券投资基金的基金经理;广发聚鑫混合型证券投资基金的基金经理;广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发盛世灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发裕势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发鑫和灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发集益纯债债券型证券投资基金的基金经理;广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发汇添3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇添6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发中债1-3年农发行债券指数证券投资基金的基金经理;广发集泰债券型证券投资基金的基金经理;广发可转债债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发中债1-3年国开行债券指数证券投资基金的基金经理	2018-04-16	-	12年	王子柯先生,经济学硕士,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固定收益部债券交易员兼研究员、投资经理、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理(自2015年5月27日至2016年6月24日)、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年12月22日至2018年1月6日)、广发景盛纯债债券型证券投资基金基金经理(自2016年8月30日至2018年11月1日)、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年11月7日至2018年11月9日)、广发集富纯债债券型证券投资基金基金经理(自2017年1月13日至2019年4月10日)、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年12月25日至2019年5月21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年第二季度,债券收益率先上后下,利率品和信用品表现分化,前者首尾几乎相当,后者震荡上行。4月受经济数据表现超预期和货币政策边际收紧的双重利空影响,债市明显调整,5月开始中美谈判急转直下,利率转为震荡向下。下旬,受部分银行风险事件影响,债市经受短暂的流动性冲击后,央行加大流动性呵护力度,但资金淤积在高信用机构之间导致总量流动性非常宽松,并持续6月一整月,叠加宏观预期持续向下修正,债券市场延续5月走势而走强。

宏观数据方面,关键词从一季度的宏观超预期转入二季度的宏观预期向下修正:逆周期政策开始转向收敛,基建改善乏力、地产监管收紧;此外,中美贸易谈判的进度乏力对市场预期拖累较大。仅有房地产投资韧性较强以及广义社融增速仍处于改善通道。

截至6月28日,中债综合净价指数下跌0.32%。分品种看,中债国债总净价指数下跌1.05%,中证金融债净价指数下跌0.11%,中证企业债净价指数下跌0.10%。

我们在本季度密切跟踪市场动向,灵活调整持仓券种结构、组合杠杆和久期分布。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类基金份额净值增长率为0.52%,C类基金份额净值增长率为0.41%,同期业绩比较基准收益率为0.62%。

§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	-	-
	其中:股票	-	-
2	固定收益投资	1,213,365,000.00	97.78
	其中:债券	1,213,365,000.00	97.78
	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	644,202.59	0.05
7	其他资产	26,886,906.48	2.17
8	合计	1,240,896,109.07	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

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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	91,136,000.00	8.82
	其中:政策性金融债	91,136,000.00	8.82
4	企业债券	166,140,000.00	16.08
5	企业短期融资券	130,442,000.00	12.62
6	中期票据	825,647,000.00	79.89
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,213,365,000.00	117.41

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	101562033	15宁河西MTN001	700,000	71,414,000.00	6.91
2	180212	18国开12	700,000	70,784,000.00	6.85
3	101353010	13中煤MTN002	500,000	51,680,000.00	5.00
4	101751041	17汇金MTN001	500,000	51,445,000.00	4.98
5	101800603	18首开集团MTN001	500,000	51,195,000.00	4.95

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1909	IF1909	1.00	1,137,540.00	-3,720.00	买入股指期货多头合约是为了更有效地进行流动性管理。
公允价值变动总额合计(元)					-3,720.00
股指期货投资本期收益(元)					16,019.42
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-3,720.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,旨在配合基金日常投资管理需要,以更有效地跟踪标的指数和进行流动性管理,实现投资目标。

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本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	18,181.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	26,868,725.26
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,886,906.48

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	2,010,156,676.67
本报告期基金总申购份额	281,493.39
减:本报告期基金总赎回份额	992,063,492.07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,018,374,677.99

§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	10,117,676.67
本报告期买入/申购总份额	281,493.39
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	10,399,170.06
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.02

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2019-04-17	281,493.39	283,294.95	0.00%
合计			281,493.39