广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发百发大数据成长混合
基金主代码	001734
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年11月18日
报告期末基金份额总额	167,984,137.27份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过大类资产的灵活配置,精选具有较高成长性的股票进行投资,力求实现基金资产的持续稳定增值。
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,以规避或分散市场风险,提高基金风险调整后的收益。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:50%×创业板指数收益率+50%×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	兴业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	广发百发大数据成长混合A / 广发百发大数据成长混合E
下属分级基金的交易代码	001734 / 001735
报告期末下属分级基金的份额总额	147,528,835.28份 / 20,455,301.99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1月1日-2019年3月31日)	
	广发百发大数据成长混合A	广发百发大数据成长混合E
1.本期已实现收益	-5,519,429.74	-811,168.42
2.本期利润	23,732,697.72	3,440,073.58
3.加权平均基金份额本期利润	0.1590	0.1599
4.期末基金资产净值	139,013,978.09	19,312,870.74
5.期末基金份额净值	0.942	0.944

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、广发百发大数据成长混合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	20.46%	1.40%	18.43%	0.99%	2.03%	0.41%

2、广发百发大数据成长混合E:

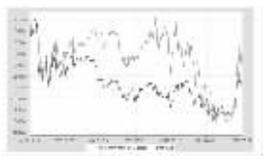
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	20.41%	1.42%	18.43%	0.99%	1.98%	0.43%

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

广发百发大数据策略成长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的历史走势对比图
(2015年11月18日至2019年3月31日)

1. 广发百发大数据成长混合A:

2. 广发百发大数据成长混合E:



§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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季峰	本基金的基金经理;广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金的基金经理;广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发百发大数据成长灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;量化投资部副总经理	2015-11-18	-	10年	季峰先生,管理学博士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾在深圳证券交易所从事博士后研究,曾任广发基金管理有限公司数量投资部研究员、数据策略投资部副总经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年10月21日至2016年5月26日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2015年2月13日至2016年5月26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2015年3月25日至2016年5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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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》及其配套法规、《广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金合同》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

本季度内,得益于美联储货币政策态度转向鸽派,流动性边际宽松提振风险偏好持续修复, 国内权益市场也获得快速反弹的机会。在经济下行尚未触底的背景下,行情的驱动力主要来源于确定性机会与超跌反弹, 一方面猪肉涨价逻辑支撑农林牧渔行业持续走强,备受各方机构重视,另一方面,5G等调整明显的行业受到贸易摩擦缓和等利好影响,快速收复失地。整体而言,成长股的强势表现贯穿了一季度,但在季末阶段出现成长风格动量衰竭、周期板块轮动明显等现象。

期间,组合运用大数据成长风格化选股策略,一方面提升整体仓位,另一方面配合行情提升成长与周期板块的配置比例,既获得了季度内的趋势收益,也布局了下一阶段潜在的板块轮动机会。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内, 广发百发大数据精选混合基金A类净值增长率为20.46%,E类净值增长率为20.41%,同期业绩比较基准收益率为18.43%。

§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	131,079,113.96	82.37
	其中:股票	131,079,113.96	82.37
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	27,967,597.73	17.58
7	其他各项资产	78,440.70	0.05
8	合计	159,125,152.39	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	90,881.24	0.06
B	采矿业	-	-
C	制造业	81,832,040.08	51.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	457.14	0.00
E	建筑业	2,697.86	0.00
F	批发和零售业	2,638.33	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,602,396.77	23.75
J	金融业	7,590.00	0.00
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	5,981,171.94	3.78
N	水利、环境和公共设施管理业	490.70	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,937,600.00	1.86
R	文化、体育和娱乐业	2,621,149.90	1.66
S	综合	-	-
	合计	131,079,113.96	82.79

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	300357	我武生物	98,900	4,715,552.00	2.98
2	300170	汉得信息	233,300	3,952,102.00	2.50
3	300572	安车检测	48,400	3,743,740.00	2.36
4	300016	北陆药业	349,400	3,539,422.00	2.24
5	300595	欧普康视	59,800	3,484,546.00	2.20
6	300226	上海钢联	40,600	3,408,370.00	2.15
7	300529	健帆生物	53,800	3,347,974.00	2.11
8	000858	五粮液	34,700	3,296,500.00	2.08
9	300352	北信源	527,632	3,292,423.68	2.08
10	300383	光环新网	171,600	3,217,500.00	2.03

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根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	62,532.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,199.65
5	应收申购款	1,708.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	78,440.70

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	广发百发大数据成长混合A	广发百发大数据成长混合E
本报告期期初基金份额总额	150,330,460.90	22,143,901.60
本报告期基金总申购份额	3,516,233.57	207,657.43
减:本报告期基金总赎回份额	6,317,869.19	1,896,257.04
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	147,528,835.28	20,455,301.99

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2.《广发百发大数据策略成长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.《广发百发大数据策略成长灵活配置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:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,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
二〇一九年四月二十二日

广发策略优选混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

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。

本报告期自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	1,844,614,430.18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1月1日-2019年3月31日)
1.本期已实现收益	-122,048,490.93
2.本期利润	773,984,263.87
3.加权平均基金份额本期利润	0.4156
4.期末基金资产净值	3,159,912,729.21
5.期末基金份额净值	1.7130

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。

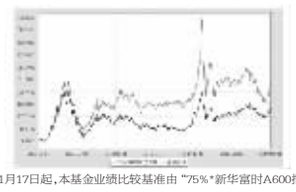
3.2 基金净值表现

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	32.02%	1.56%	21.82%	1.16%	10.20%	0.40%

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3月31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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王小松	本基金的基金经理;广发绩优长逸灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发内需增长灵活配置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;广发策略优选混合型证券投资基金的基金经理;量化投资部副总经理	2014-12-24	-	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20日)。
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;广发转型升级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;策略投资部副总经理	2014-03-17	-	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)。

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》及其配套法规、《广发策略优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,在严格控制风险的基础上,为基金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

2019年1季度,A股主要全面上涨。全季,上证50、沪深300、中小板综指和创业板综涨幅分别为23.78%、28.62%、33.79%和33.43%。

2019年1季度, 中国经济整体延续了去年4季度趋弱的态势:2月的PMI持续低于50的荣枯线,但随着政府托底措施逐步发力,信贷放量、社融企稳,中美贸易谈判稳步推进,消费者和企业家的信心均在后半段有所恢复,3月PMI明显反弹达到50.5%。从高频数据来看,重卡、工程机械销量持续景气,重点电厂日均耗煤显著反弹,一二线城市二手房销售大幅反弹,水泥、钢铁、煤炭等大宗工业品价格稳步走高,更值得关注的一些变化在于,白酒消费在一季度的景气程度非常超预期,3月百货的同店以及定制家居、家电的到访客流均明显反弹,制造业投资相关设备订单大幅好转,种种迹象显示中国经济增速快速下滑阶段已经过去,未来一到两个季度大概率筑底成功。这种变化除了经济自身运行规律的影响外,政策调整以及消费者、企业家信心的剧烈波动也是重要原因。从外部环境来看,美国经济总体平稳,美联储货币政策有明显转向,日、欧的情况则没有那么乐观,总体偏弱。经济企稳概率提升,投资者信心恢复,货币政策偏向宽松,国际形势趋于缓和,再加上估值已经到了非常低的位置,各方面条件配合下,A股市场在1季度出现大幅反弹,所有指数和绝大部分行业都有较好表现,无论是白马蓝筹,还是过去几年跌幅巨大的中小市值股票。

虽然目前的局面相比去年4季度有明显好转,但我们仍需对大趋势、大格局有更清晰的认知。目前全球政治经济所面临的诸多困难和混局其实仍是2008年危机的延续,背后的原因在于全球化走到了尽头,当年所面临的诸多问题目前依然存在,且未有明显改善,包括债务过高、新增长动力缺乏、贫富分化、劳动生产率提升过慢等等,全球需要寻找新的增长模式和治理结构。国内亦是如此,某些问题是全球问题在中国的显现,有些则是更多来自自身,毕竟改革开放四十年了,需要有效将其推向更深层。虽然战略上谨慎,但战术上可以更乐观积极一些,毕竟2018年困扰A股市场最重要的两个问题,金融监管和贸易战已经出现明显缓和甚至转向,市场大幅下跌以后已经反映了绝大部分悲观预期。更应看到的是, 虽然我们面临诸多内外部的风险因素,但中国经济已经走在了正确的发展道路上,十九大报告清晰的为中国经济的未来指明了方向,更加强调经济增长的质量而非速度,社会的主要矛盾已经转化为"人民日益增长的美好生活需要和不平衡不充分的发展之间的矛盾"。作为二级市场投资者,我们理应对中国经济和中国的资本市场抱有更多的信心,保持理性、相信未来、迎接挑战。当然,经过Q1的大幅反弹后,未来市场更多的会是结构性机会而非系统性机会。

报告期内,本基金较好的把握时机,在季初明显提升了仓位,配置的主要方向包括保险、地产、建筑、新能源、电子、计算机和大众消费品,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,本基金净值增长率为32.02%,同期业绩比较基准收益率为21.82%。

§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	2,790,149,215.57	87.17
	其中:股票	2,790,149,215.57	87.17
2	固定收益投资	4,203,000.00	0.13
	其中:债券	4,203,000.00	0.13
	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	380,850,021.66	11.90
7	其他各项资产	25,467,415.66	0.80
8	合计	3,200,669,652.89	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	187,225,036.50	5.93
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,493,889,423.54	47.28
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	62,211,294.82	1.97
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	338,553,750.67	10.71
J	金融业	227,706,625.90	7.21
K	房地产业	192,246,176.21	6.08
L	租赁和商务服务业	185,226,443.77	5.86
M	科学研究和技术服务业	103,090,474.16	3.26
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,790,149,215.57	88.30

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	002127	南极电商	16,403,786	185,226,443.77	5.86
2	300207	欣旺达	13,908,710	165,652,736.10	5.24
3	601318	中国平安	1,991,079	153,512,190.90	4.86
4	002202	金风科技	9,934,187	142,270,710.85	4.50
5	000860	顺鑫农业	1,980,600	120,083,778.00	3.80
6	603517	绝味食品	2,194,011	107,989,221.42	3.42
7	600271	航天信息	3,826,923	106,895,099.04	3.38
8	300383	光环新网	5,074,852	95,153,475.00	3.01
9	000002	万科A	3,079,690	94,608,076.80	2.99
10	002714	牧原股份	1,489,560	94,303,410.50	2.98

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	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
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)	4,203,000.00	0.13
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,203,000.00	0.13

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	113529	艳味转债	42,030	4,203,000.00	0.13

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根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	569,326.40
2	应收证券清算款	24,558,778.02
3	应收股利	-
4	应收利息	63,686.18
5	应收申购款	275,625.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,467,415.66

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002127	南极电商	41,783,053.62	1.32	限售股
2	002202	金风科技	37,551,640.00	1.19	限售股
3	002202	金风科技	27,290,227.35	0.86	配股流通受限

§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	1,871,419,934.47
本报告期基金总申购份额	22,006,482.82
减:本报告期基金总赎回份额	48,811,987.11
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,844,614,430.18

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00。投资者可免费查阅,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
二〇一九年四月二十二日

广发天天红发起式货币市场基金

2019年第一季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:广发银行股份有限公司
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责任。

基金托管人广发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。

本报告期自2019年1月1日起至3月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发天天红
基金主代码	000389
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2013年10月22日
报告期末基金份额总额	31,562,296,317.73份
投资目标	在严格控制风险、保持较高流动性的基础上,力争实现稳定的、高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上,分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势,并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,对基金资产组合进行积极管理。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金属于货币市场基金,长期风险收益水平低于股票型基金、混合型基金和债券型基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	广发银行股份有限公司
下属分级基金的基