广发核心精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	广发核心精选混合
基金主代码	ZF0008
交易代码	ZF0008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年7月16日
报告期末基金份额总额	354,871,251.17份
投资目标	通过认真、细致的宏观研究,合理配置股票、债券、现金等资产。应用“核心—卫星”投资策略,投资于具有较高投资价值的股票;在利率合理预期的基础上,进行久期管理,稳健地投资于债券市场。在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳健增值。
投资策略	1.资产配置策略 本基金资产配置比例范围为:股票资产占基金资产的60%-95%;现金、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%-40%,其中,基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%,基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。 如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。 2.“核心—卫星”投资策略 本基金采用“核心—卫星”的投资策略,在沪深300指数成分股及其备选成分股中精选成长性较强,质地优良,投资价值高的股票构成“核心股票”,本基金将较长时间的持有核心股票,直到该股票市场价格超过合理价值。一般情况下,本基金持有的“核心股票”的市值不低于本基金股票市值的80%。 本基金投资于沪深300指数成分股(包括备选成分股)外的A股市值不超过本基金股票市值的20%,本基金投资的这部分股票为“卫星股票”。“卫星股票”采用主题投资方法,力争通过适度提前把握市场热点,精选个股,提高基金“卫星股票”的投资收益率。
业绩比较基准	80%*沪深300指数+20%*上证国债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金,而低于股票型基金,属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。
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	-1,891,543.27
2.本期利润	201,550,722.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.5675
4.期末基金资产净值	1,028,183,037.07
5.期末基金份额净值	2.897

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。

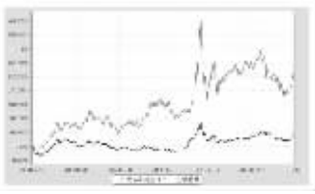
3.2 基金净值表现

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	23.70%	1.52%	23.15%	1.24%	0.55%	0.28%

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

广发核心精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
(2008年7月16日至2019年3月31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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吴兴武	本基金的基金经理;广发轮动配置混合型证券投资基金的基金经理;广发多元新兴股票型证券投资基金的基金经理;广发医疗保健股票型证券投资基金的基金经理	2015-02-17	-	10年	吴兴武先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任摩根士丹利华鑫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、权益投资一部研究员。
程晓	本基金的基金经理;广发大盘成长混合型证券投资基金的基金经理;广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理	2018-11-05	-	13年	程晓先生,金融学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任第一上海证券有限公司研究员、广发基金管理有限公司国际业务部研究员、研发发展部研究员、基金经理助理、广发消费品精选混合型证券投资基金基金经理(自2014年12月8日至2016年2月23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、《广发核心精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

一季度全球经济继续承压,但是积极的一面开始出现,中国货币政策以及财政政策开始转向,美国美联储加息以及缩表开始放缓,同时中美贸易战谈判也越来越接近成功。在这样的环境下,全球市场普遍回升,而国内减费降税的推出也刺激了A股市场进一步上涨。正如我们去年判断的,股市在跌到估值的历史低点后,应该积极的参与投资,市场的过度悲观,往往给投资者创造了良好的买入时机。

从市场表现来看,科技类股票、消费类特别是可选消费类涨幅较高、地产以及相关产业链股票都出现了较大上涨,市场又开始预期经济全面复苏,而我们并不认为经济能够出现市场预期的全面复苏,因此,我们认为未来仍需要用更长的眼光来思考A股的机会,而不应该用短期思维参与市场博弈。

一季度本基金操作较少,基本维持原有持仓,由于仓位较高,一季度跑赢比较基准。

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23.70%,同期业绩比较基准收益率为23.15%。

§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	972,277,157.71	93.99
	其中:股票	972,277,157.71	93.99
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	55,156,513.38	5.33
7	其他各项资产	7,022,275.12	0.68
8	合计	1,034,454,946.21	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	52,780,487.20	5.13
B	采矿业	100,226,043.48	9.75
C	制造业	394,753,401.21	38.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	66,470,075.68	6.46
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	38,266,296.02	3.72
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	32,902.94	0.00
J	金融业	159,916,771.30	15.55
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	52,041,000.00	5.06
M	科学研究和技术服务业	107,790,179.88	10.48
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	972,277,157.71	94.56

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	002202	金风科技	6,633,800	96,521,790.00	9.39
2	600031	三一重工	7,252,161	92,682,617.58	9.01
3	002557	洽洽食品	2,411,667	62,172,775.26	6.05
4	601318	中国平安	775,073	59,758,128.30	5.81
5	300284	苏交科	4,400,058	55,748,734.86	5.42
6	600132	重庆啤酒	1,521,858	53,721,587.40	5.22
7	300498	温氏股份	1,300,012	52,780,487.20	5.13
8	002470	金正大	7,051,187	52,319,807.54	5.09
9	603018	中设集团	2,518,947	52,041,445.02	5.06
10	002027	分众传媒	8,300,000	52,041,000.00	5.06

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	289,027.17
2	应收证券清算款	5,857,784.35
3	应收股利	-
4	应收利息	12,534.36
5	应收申购款	862,929.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,022,275.12

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	002202	金风科技	16,034,100.00	1.56	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	361,746,254.65
本报告期基金总申购份额	22,241,203.03
减:本报告期基金总赎回份额	29,116,206.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	354,871,251.17

§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	4,548,059.43
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	1,819,200.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	2,728,859.43
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.77

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	赎回	2019-01-25	-1,819,200.00	-4,380,187.90	0.30%
合计			-1,819,200.00	-4,380,187.90	

§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核心精选混合型证券投资基金募集的文件

2.《广发核心精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.《广发核心精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

广发沪港深新起点股票型证券投资基金

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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安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	广发沪港深新起点股票
基金主代码	002121
交易代码	002121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月2日
报告期末基金份额总额	2,047,966,215.18份
投资目标	本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票,在深入研究的基础上,精选质地优良的股票进行投资,在严格控制风险的前提下,追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金股票投资比例占基金资产的比例不低于80%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内,本基金将根据对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析,合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。
业绩比较基准	45%×沪深300指数收益率+45%×恒生指数收益率+10%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资于港股通标的股票,需承担汇率风险及境外市场风险。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司

§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	-92,560,416.93
2.本期利润	480,538,537.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.1828
4.期末基金资产净值	2,549,246,232.10
5.期末基金份额净值	1.245

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。

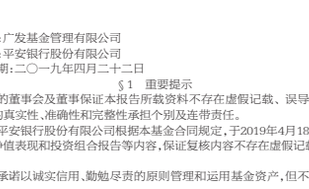
3.2 基金净值表现

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	16.68%	1.21%	18.60%	1.06%	-1.92%	0.15%

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

广发沪港深新起点股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年11月2日至2019年3月31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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李耀柱	本基金的基金经理;广发轮动配置混合型证券投资基金的基金经理;广发多元新兴股票型证券投资基金的基金经理;广发医疗保健股票型证券投资基金的基金经理;广发沪港深新起点股票型证券投资基金的基金经理	2016-11-09	-	9年	李耀柱先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、国际业务部总经理助理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2017年11月9日)、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自2016年8月23日至2018年9月20日)、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自2017年9月21日至2018年10月16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、《广发沪港深新起点股票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。

本投资组合为指数增强型基金。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

一季度,受贸易战缓和、流动性充裕等因素的影响,A股市场出现了一波较为快速的上涨走势。政府陆续出台多项措施稳经济,促改革,市场交投活跃,成交量显著放大,也吸引了外资及国内增量资金的流入。

在本报告期内,本基金仓位保持稳定,利用量化多因子模型进行股票组合的构建。模型在多个长期有效的选股因子上进行均衡配置,以获取稳健持续的超额收益。同时为控制跟踪误差,模型严格控制在行业、市值等风险因子上的暴露。

展望后市,市场的估值从低位有所回升,但仍在历史估值的中位数以下,中长期来看仍具有一定的性价比。需要跟踪的是企业盈利的情况,陆续公布的企业去年年报及今年一季报将影响市场的后期走势和风格,同时也有助于判断本轮宏观经济见底的位置和时间。另外,海外资金及国内场外资金的入市规模和节奏也值得保持关注。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金A类份额净值增长率为16.68%,同期业绩比较基准收益率为18.60%。

§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	2,324,824,915.19	90.75
	其中:股票	2,324,824,915.19	90.75
2	固定收益投资	70,417,000.00	2.75
	其中:债券	70,417,000.00	2.75
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	432,498.99	0.02
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	93,122,423.91	3.64
7	其他各项资产	72,854,229.20	2.84
8	合计	2,561,651,067.29	100.00

注:权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为1,443,801,100.60元,占基金资产净值比例56.64%。

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	-	-
C	制造业	318,166,049.15	12.48
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	81,193,350.00	3.18
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	123,171,512.31	4.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	141,528,718.38	5.55
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	7,235,514.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	209,728,670.75	8.23
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	881,023,814.59	34.56

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值(人民币)	占基金资产净值比例(%)
日常消费品	-	-
电信业务	-	-
医疗保健	238,992,526.93	9.38
通信服务	232,971,461.33	9.14
能源	204,353,370.12	8.02
金融	191,274,534.76	7.50
公用事业	186,334,475.82	7.31
非日常生活消费品	123,346,015.99	4.84
信息技术	113,870,861.63	4.47
房地产	79,712,142.98	3.13
工业	68,179,907.00	2.67
原材料	4,765,804.04	0.19
合计	1,443,801,100.60	56.64

注:(1)以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

(2)由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	00700	腾讯控股	705,424	218,443,140.72	8.57
2	000546	金圆股份	21,035,975	209,728,670.75	8.23
3	600031	三一重工	15,496,109	198,040,273.02	7.77
4	01299	友邦保险	2,818,600	188,948,482.77	7.41
5	01088	中国神华	11,135,500	170,979,377.76	6.71
6	01177	中国生物制药	20,795,000	127,718,240.24	5.01
7	01193	华润燃气	3,848,000	122,128,709.04	4.79
8	600048	保利地产	8,101,302	115,362,540.48	4.53
9	01093	石药集团	6,606,000	82,731,786.80	3.25
10	603939	益丰药房	1,459,000	81,193,350.00	3.18

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	70,417,000.00	2.76
	其中:政策性金融债	70,417,000.00	2.76
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	70,417,000.00	2.76

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	180209	18国开09	500,000	50,135,000.00	1.97
2	180211	18国开11	200,000	20,282,000.00	0.80

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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	02922	金风科技股权	163,172	432,498.99	0.02

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1904	IF1904	-200.00	-232,656,000.00	-9,683,650.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-9,683,650.00
股指期货投资本期收益(元)					-55,675,090.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-15,214,290.00

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	41,033,157.58
2	应收证券清算款	29,679,547.97
3	应收股利	19,086.95
4	应收利息	1,746,995.07
5	应收申购款	375,441.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	72,854,229.20

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	603939	益丰药房	81,193,350.00	3.18	限售股

§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	2,844,440,751.57
本报告期基金总申购份额	146,278,107.21
减:本报告期基金总赎回份额	942,752,643.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,047,966,215.18

§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	40,024,802.68
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	8,805,400.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	31,219,402.68
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.52

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	赎回	2019-01-25	-8,805,400.00	-9,740,775.63	0.25%
合计			-8,805,400.00	-9,740,775.63	

§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沪港深新起点股票型证券投资基金募集的文件

2.《广发沪港深新起点股票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.《广发沪港深新起点股票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

广发沪深300指数增强型发起式证券投资基金

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	104,058,130.74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