广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金

2019 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:平安银行股份有限公司
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。

基金托管人平安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	广发汇安18个月定期债券	
基金主代码	004386	
基金运作方式	契约型、定期开放式	
基金合同生效日	2017年3月31日	
报告期末基金份额总额	500,108,545.26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政策比例的前提下,投资于具有较高流动性的投资品种,通过合理配置组合剩限结构等方式,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	中债综合指数 (财富 收益率×90%+银行1 年期定期存款利率 (税后)×10%。	
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等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	平安银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发汇安18个月定期债券A	广发汇安18个月定期债券C
下属分级基金的交易代码	004386	004387
报告期末下属分级基金的份额总额	500,100,261.48份	8,283.78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)	
	广发汇安18个月定期债券A	广发汇安18个月定期债券C
1.本期已实现收益	6,046,973.42	90.61
2.本期利润	5,191,194.94	76.45
3.加权平均基金份额本期利润	0.0104	0.0092
4.期末基金资产净值	544,640,533.41	8,973.41
5.期末基金份额净值	1.0891	1.0833

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、广发汇安18个月定期债券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	0.96%	0.07%	0.62%	0.05%	0.34%	0.02%

2、广发汇安18个月定期债券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	0.87%	0.07%	0.62%	0.05%	0.25%	0.02%

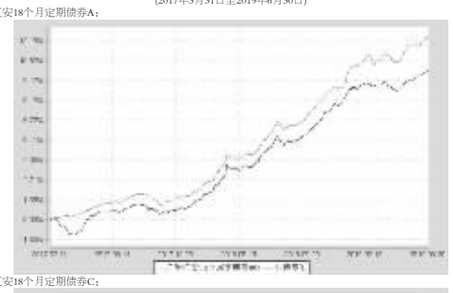
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金

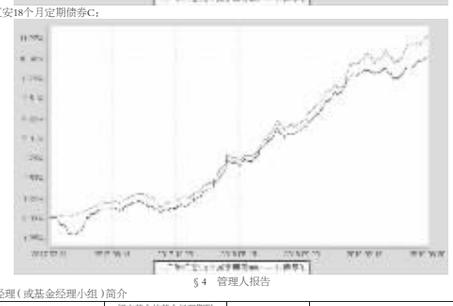
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年3月31日至2019年6月30日)

1. 广发汇安18个月定期债券A:



2. 广发汇安18个月定期债券C:



§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		
代宇	本基金的基金经理;广发聚利债券型证券投资基金(LOF)的基金经理;广发聚财信用债券型证券投资基金的基金经理;广发集利一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发双债添利债券型证券投资基金的基金经理;广发集丰债券型证券投资基金的基金经理;广发汇享一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金的基金经理;广发上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理;广发汇智3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发景秀纯债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;债券投资部副总经理	2017-03-31	-	14年	代宇女士,金融学硕士,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2011年8月5日至2014年8月4日),广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理(自2013年6月5日至2015年7月24日)、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13日至2018年11月11日)、广发安心回报混合型证券投资基金基金经理(自2015年5月14日至2018年1月12日)、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2015年4月15日至2018年3月14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11月28日至2018年6月12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2月8日至2018年10月29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)、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2017年6月27日至2019年1月18日)、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年7月26日至2019年1月18日)、广发安坤回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2016年8月19日至2019年1月22日)、广发安泰回报混合型证券投资基金基金经理(自2015年5月14日至2019年1月22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)、广发汇瑞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6月13日至2019年4月10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0.96%,C类基金份额净值增长率为0.87%,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	826,001,619.72	97.21
	其中:债券	785,939,000.00	92.50
	资产支持证券	40,062,619.72	4.72
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	3,630,554.02	0.43
7	其他资产	20,040,654.90	2.36
8	合计	849,672,828.64	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	82,136,000.00	15.08
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	262,769,000.00	48.25
5	企业短期融资券	50,421,000.00	9.26
6	中期票据	390,613,000.00	71.72
7	可转债 (可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	785,939,000.00	144.30

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	143109	18国证债	500,000	50,610,000.00	9.29
2	155028	18闽经债	500,000	50,480,000.00	9.27
3	101762054	17浙国资MTN002	400,000	42,168,000.00	7.74
4	101759035	17余杭城建MTN001	400,000	41,616,000.00	7.64
5	1820010	18厦门银行01	400,000	41,288,000.00	7.58

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

序号	证券代码	证券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比 (%)
1	156099	同煤联02	400,000	40,062,619.72	7.36

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,招银金融租赁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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,040,654.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,040,654.90

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	广发汇安18个月定期债券A	广发汇安18个月定期债券C
本报告期期初基金份额总额	500,100,261.48	8,283.78
本报告期基金总申购份额	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	-	-
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	500,100,261.48	8,283.78

§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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190630	499,999,000.00	0.00	0.00	499,999,000.00	99.98%
产品持有风险							

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的持有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发汇安18个月定期开放债券型证券投资基金募集的文件

2.《广发汇安18个月定期开放债券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.《广发汇安18个月定期开放债券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.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

广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金

2019 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	广发创新升级混合
基金主代码	002939
交易代码	002939
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年8月24日
报告期末基金份额总额	1,291,947,081.66份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,本基金通过深度挖掘并精选因创新实现转型或升级的优质上市企业,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。
业绩比较基准	50%×沪深300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	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	37,843,603.93
2.本期利润	12,083,574.59
3.加权平均基金份额本期利润	0.0093
4.期末基金资产净值	1,535,699,716.60
5.期末基金份额净值	1.1887

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

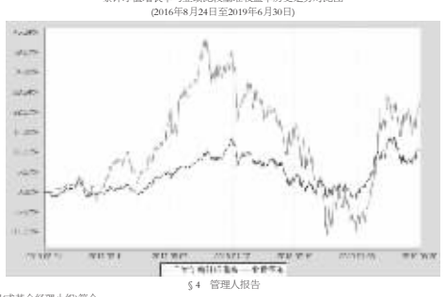
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.56%	1.41%	-0.29%	0.75%	0.85%	0.66%

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

广发创新升级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

(2016年8月24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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘格菘	本基金的基金经理;广发小盘成长混合型证券投资基金(LOF)的基金经理;广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发双赢丰收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;广发集盛债券型证券投资基金的基金经理;成长投资部总经理	2017-07-05	-	9年	刘格菘先生,经济学博士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任中邮创业基金管理有限公司研究员、基金经理,融通基金管理有限公司权益投资部总经理、基金经理,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、北京权益投资部总经理,广发行业领先混合型证券投资基金基金经理(自2017年6月19日至2019年5月31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,无侵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

2019年二季度受国内经济下行、中美问题再起波折的影响,A股整体出现一定调整。其中沪深300指数和中证1000指数分别回调1.2%和10.0%,食品饮料、家用电器和银行等行业涨幅居前。

从全球宏观环境来看,2019年二季度全球经济出现疲软迹象,美国和欧元区核心经济指标均有所下行;从国内宏观环境来看,5月和6月制造业PMI均为49.4%,连续两个月位于荣枯线以下,国内经济特征呈现地产坚韧,但其他经济指标均有所回落的态势。此外,二季度中美问题突发波折,从贸易领域向科技领域扩散,受人民币贬值预期、中美贸易问题影响,二季度外资阶段性流出A股。整体来看,二季度宏观环境对权益资产并不友好,A股整体估值也出现一定的收缩。

2019年二季度,基于国内宏观经济仍有一定下行压力、中美问题将长期化的判断,本基金在二季度对仓位进行了适当调整。在行业配置上,本基金在二季度继续保持对成长类行业的重点配置,主要是生物医药、科技及且主可控、新能源等逆周期和确定性成长行业,重点行业中对生物医药行业的配置有所侧重。

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0.56%,同期业绩比较基准收益率为-0.29%。

§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	1,408,691,311.39	89.35
	其中:股票	1,408,691,311.39	89.35
2	固定收益投资	4,741,694.10	0.30
	其中:债券	4,741,694.10	0.30
	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	162,274,124.01	10.29
7	其他资产	922,234.92	0.06
8	合计	1,576,629,364.42	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	14,200.00	0.00
C	制造业	1,122,805,336.65	73.11
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	-	-
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	226,609,211.98	14.76
J	金融业	12,920.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26,594,327.76	1.73
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	32,655,315.00	2.13
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,408,691,311.39	91.73

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	300601	康泰生物	2,861,826	150,245,865.00	9.78
2	300661	圣邦股份	1,196,720	121,790,194.40	7.93
3	600703	三安光电	9,399,908	106,030,962.24	6.90
4	300529	健帆生物	1,654,895	103,182,703.25	6.72
5	601012	隆基股份	4,069,710	94,050,998.10	6.12
6	002049	紫光国微	1,899,961	83,807,279.71	5.46
7	600536	中国软件	1,500,194	80,515,411.98	5.24
8	300226	上海钢联	980,000	73,460,800.00	4.78
9	300014	亿纬锂能	2,400,000	73,104,000.00	4.76
10	002415	海康威视	2,600,000	71,708,000.00	4.67

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)	4,741,694.10	0.31
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,741,694.10	0.31

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	110054	通成转债	38,610	4,741,694.10	0.31

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
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-2,805,180.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的期货合约,并根据对证券市场和期货市场运行趋势的研判,以及对股指期货合约的估值定价,与股票现货产品进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作,由此获得股票组合产生的超额收益。本基金在运用股指期货时,将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征,对市系统性风险以及特殊情况下的流动性风险,以改善投资组合的风险收益特性。

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	627,995.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	40,917.95
5	应收申购款	253,321.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	922,234.92

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	1,463,569,219.70
本报告期基金总申购份额	172,086,562.98
减:本报告期基金总赎回份额	343,708,701.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,291,947,081.66

§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	6,669,904.85
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	6,669,904.85
报告期期末管理人持有的本基金份额	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.00

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	2019-06-26	-6,669,904.85	-7,745,797.85	0.30%
合计			-6,669,904.85	-7,745,797.85	

§8影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190401-20190630	547,187,792.52	43,458,496.31	237,850,815.95	352,795,472.88	27.31%
产品持有风险							

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的持有风险主要包括:当投资者持有份额占比较为集中时,个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对,完善流动性风险管控机制,切实保护持有人利益。

§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创新升级灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2.《广发创新升级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.《广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

5.法律意见书

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

广发创业板交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2019 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