广发安悦回报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: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	广发安悦回报混合
基金主代码	002120
交易代码	002120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月7日
报告期末基金份额总额	700,015,699.94份
投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,通过对不同资产类别的优化配置,充分挖掘市场潜在的投资机会,力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上,判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势,分析不同政策对各类资产的市场影响,评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值,根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置,确定合适的资产配置比例,并适时进行调整。
业绩比较基准	30%×沪深300指数收益率+70%×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	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4月1日-2019年6月30日)
1.本期已实现收益	4,536,313.33
2.本期利润	11,872,069.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.0170
4.期末基金资产净值	751,046,973.18
5.期末基金份额净值	1.073

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

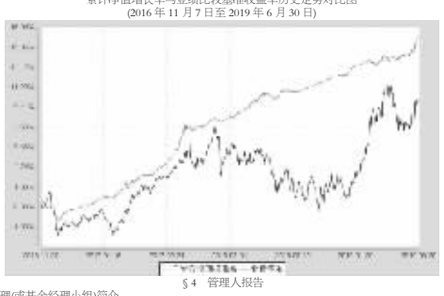
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.61%	0.15%	0.08%	0.44%	1.53%	-0.29%

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

广发安悦回报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11月7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
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;广发聚盛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;广发鑫慧灵活配置混合型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;广发景纯债券型证券投资基金的基金经理;广发汇瑞3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发景颐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;广发理财年年红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;广发聚益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;广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发稳健回报债券型证券投资基金的基金经理;广发汇兴3个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发景润纯债债券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;广发汇禾定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇盈6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇鼎定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;债券投资总经理	2016-11-07	-	16年	谢军先生,金融学硕士,CFA,持有中国证券投资基金从业证书,曾任广发基金管理有限公司固定收益部研究员、投资经理、固定收益部总经理助理、固定收益部副总经理、固定收益部总经理,广发货币市场基金基金经理(自2006年9月12日至2010年4月29日),广发聚祥债券混合型证券投资基金基金经理(自2011年3月15日至2014年3月20日)、广发聚源定期开放债券型证券投资基金基金经理(自2013年5月8日至2014年8月17日),广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2017年1月10日至2018年1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2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)、广发稳安灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自2019年2月15日至2019年4月10日)、广发安泽回报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)。
洪杰	本基金的基金经理;广发汇兴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;广发鑫慧灵活配置混合型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;广发汇鼎6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇盛定期开放债券型发起式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;广发汇禾定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇盈6个月定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发鼎裕灵活配置混合型证券投资基金的基金经理;广发汇禾定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;广发汇鼎定期开放债券型发起式证券投资基金的基金经理;债券投资总经理	2019-01-10	-	6年	洪杰先生,管理学硕士,持有中国证券投资基金从业证书,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。

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年二季度,市场对经济基本面的悲观预期增强,流动性政策的边际收紧、中美贸易战再起波澜,社零、工业增加值、制造业投资等数据不达预期,核心指数由高位出现一定幅度回调。期间上证综指跌3.62%,创业板指跌10.75%,沪深300跌1.21%,中证1000跌9.98%。年初一轮的估值修复在进入二季度之后,由于市场再次担忧基本面出现下滑,资金开始偏好有业绩支撑的核心资产。食品饮料、家电、农牧、医药、金融等板块表现优异;计算机、通信为代表的成长股以及周期股出现较大幅度回调。

二季度期间,组合通过大数据选股模型,采用相对灵活的配置方法,继续保持了高仓位运行。配置上采用集中方式,风格上以核心资产为主,主要集中在大消费、金融、新能源等板块。

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1.61%,同期业绩比较基准收益率为0.08%。

§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	80,092,992.41	9.63
	其中:股票	80,092,992.41	9.63
2	固定收益投资	735,249,545.60	88.37
	其中:债券	705,249,545.60	84.77
	资产支持证券	30,000,000.00	3.61
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	2,717,887.75	0.33
7	其他资产	13,928,715.11	1.67
8	合计	831,989,140.87	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	363,431.25	0.05
C	制造业	47,430,537.92	6.32
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,159,516.70	0.95
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,225,191.84	0.96
G	交通运输、仓储和邮政业	15,658,728.00	2.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.01
J	金融业	33,369.94	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	2,159,006.40	0.29
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	0.00
S	综合	-	-
	合计	80,092,992.41	10.66

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	600132	重庆啤酒	209,989	9,903,081.24	1.32
2	600519	贵州茅台	9,000	8,856,000.00	1.18
3	603288	海天味业	80,000	8,400,000.00	1.12
4	600009	上海机场	100,000	8,378,000.00	1.12
5	600004	白云机场	400,040	7,280,728.00	0.97
6	600900	长江电力	399,973	7,159,516.70	0.95
7	600529	山东药玻	280,000	6,378,400.00	0.85
8	603708	家家悦	259,912	5,931,191.84	0.79
9	603899	晨光文具	109,920	4,833,182.40	0.64
10	300760	迈瑞医疗	15,000	2,448,000.00	0.33

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	70,463,000.00	9.38
	其中:政策性金融债	40,064,000.00	5.33
4	企业债券	257,143,000.00	34.24
5	企业短期融资券	60,237,000.00	8.02
6	中期票据	80,945,000.00	10.78
7	可转债(可交换债)	13,616,545.60	1.81
8	同业存单	222,845,000.00	29.67
9	其他	-	-
10	合计	705,249,545.60	93.90

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	011900475	19国资SCP002	500,000	50,145,000.00	6.68
2	111915187	19民生银行CD187	500,000	48,490,000.00	6.46
3	111912045	19北京银行CD045	500,000	48,485,000.00	6.46
4	180312	18进出12	400,000	40,064,000.00	5.33
5	111910227	19兴业银行CD227	400,000	38,792,000.00	5.17

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)	占基金资产净值比例(%)
1	149993	花期65A1	300,000	30,000,000.00	3.99

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,中国民生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	156,871.83
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	13,771,843.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,928,715.11

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	132008	17山高EB	1,002,000.00	0.13

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	700,015,840.72
本报告期基金总申购份额	0.95
减:本报告期基金总赎回份额	141.73
本报告期基金分拆分动份额	-
本报告期期末基金份额总额	700,015,699.94

§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

本报告期内本基金管理人不持有本基金份额。

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

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	700,013,000.00	0.00	0.00	700,013,000.00	100.00%
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日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密切评估并合理应对,交易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安悦回报灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2.《广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发安悦回报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

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

广发百发大数据策略精选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	广发百发大数据精选混合
基金主代码	001741
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年9月14日
报告期末基金份额总额	55,336,990.10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	50%×中证800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	广发百发大数据精选混合A	广发百发大数据精选混合E
下属分级基金的交易代码	001741	001742
报告期末下属分级基金的份额总额	15,934,607.88份	39,402,382.22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)	
	广发百发大数据精选混合A	广发百发大数据精选混合E
1.本期已实现收益	-665,056.27	-1,606,281.67
2.本期利润	-582,607.83	-1,526,066.47
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0361	-0.0369
4.期末基金资产净值	14,909,765.04	36,844,175.43
5.期末基金份额净值	0.936	0.935

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、广发百发大数据精选混合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	-3.60%	1.34%	-1.48%	0.77%	-2.12%	0.57%

2、广发百发大数据精选混合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	-3.61%	1.34%	-1.48%	0.77%	-2.13%	0.57%

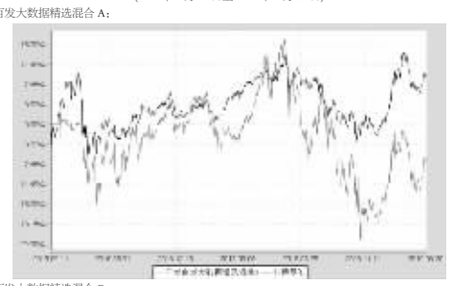
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

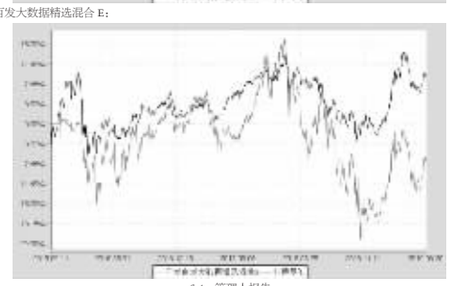
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年9月14日至2019年6月30日)

1. 广发百发大数据精选混合A:



2. 广发百发大数据精选混合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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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;广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金A类份额的基金经理;广发百发大数据精选灵活配置混合型证券投资基金E类份额的基金经理;量化投资部副总经理	2015-09-14	-	10年	季峰先生,管理学博士,持有中国证券投资基金从业证书,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),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4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)。

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年度,市场对经济基本面的悲观预期增强,流动性政策的边际收紧、中美贸易战再起波澜,社零、工业增加值、制造业投资等数据不达预期,核心指数由高位出现一定幅度回调。期间上证综指跌3.62%,创业板指跌10.75%,沪深300跌1.21%,中证1000跌9.98%。年初一轮的估值修复在进入二季度之后,由于市场再次担忧基本面出现下滑,资金开始偏好有业绩支撑的核心资产。食品饮料、家电、农牧、医药、金融等板块表现优异;计算机、通信为代表的成长股以及周期股出现较大幅度回调。

二季度期间,组合通过大数据选股模型,采用相对灵活的配置方法,继续保持了高仓位运行。配置上采用集中方式,风格上以核心资产为主,主要集中在大消费、金融、新能源等板块。

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-3.60%,E类基金份额净值增长率为-3.61%,同期业绩比较基准收益率为-1.48%。

§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	44,449,744.82	85.18
	其中:股票	44,449,744.82	85.18
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	7,700,312.19	14.76
7	其他资产	30,247.69	0.06
8	合计	52,180,304.70	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	2,600,805.00	5.03
B	采矿业	3,224,999.40	6.23
C	制造业	16,603,692.42	32.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,320,137.00	2.55
E	建筑业	1,423,845.00	2.75
F	批发和零售业	1,468,198.00	2.84
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	2,812,791.00	5.43
J	金融业	5,867,691.00	11.34
K	房地产业	4,365,270.00	8.43
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,973,596.00	5.75
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	1,788,720.00	3.46
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	44,449,744.82	85.89

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	300347	泰格医药	23,200	1,788,720.00	3.46
2	601899	紫金矿业	466,000	1,756,820.00	3.39
3	000596	古井贡酒	13,700	1,623,587.00	3.14
4	601318	中国平安	17,700	1,568,397.00	3.03
5	300146	汤臣倍健	80,200	1,555,880.00	3.01
6	600340	华夏幸福	47,400	1,543,818.00	2.98
7	000063	中兴通讯	47,400	1,541,922.00	2.98
8	000333	美的集团	29,707	1,540,605.02	2.98
9	601966	玲珑轮胎	90,600	1,540,200.00	2.98
10	300760	迈瑞医疗	9,400	1,534,080.00	2.96

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	20,719.06
2	应收证券清算款	7,558.56
3	应收股利	-
4	应收利息	881.52
5	应收申购款	1,088.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,247.69

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在在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发百发大数据精选混合A	广发百发大数据精选混合E
本报告期期初基金份额总额	16,430,932.76	43,415,413.24
本报告期基金总申购份额	209,077.41	162,550.96
减:本报告期基金总赎回份额	705,402.29	4,175,581.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,934,607.88	39,402,382.22

§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

项目	广发百发大数据精选混合A	广发百发大数据精选混合E
本报告期期初基金份额总额	18,293,848.26	-
本报告期买入申购份额	-	-
本报告期卖出赎回份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	18,293,848.26	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	28.70	-

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