

广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资 基金

2019 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇一九年八月二十八日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

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 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
7 投资组合报告	30
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 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贵金属投资明细.....	46
7.9 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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
8 基金份额持有人信息	47

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	48
9	开放式基金份额变动	48
10	重大事件揭示	48
10.1	基金份额持有人大会决议	48
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	48
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4	基金投资策略的改变	49
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.8	其他重大事件	50
11	备查文件目录	50
11.1	备查文件目录	50
11.2	存放地点	51
11.3	查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	广发东财大数据混合
基金主代码	002802
交易代码	002802
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 11 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	102,313,091.62 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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	中证全指指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。
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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	邱春杨	田青
	联系电话	020-83936666	(010)6759 5096
	电子邮箱	qcy@gffunds.com.cn	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		95105828	010-67595096
传真		020-89899158	010-66275853
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝华路 6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号	北京市西城区闹市口大街1号

	保利国际广场南塔31-33楼	院1号楼
邮政编码	510308	100033
法定代表人	孙树明	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	广发基金管理有限公司	广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019年1月1日至2019年6月30日）
本期已实现收益	-6,175,256.25
本期利润	14,673,194.76
加权平均基金份额本期利润	0.1223
本期加权平均净值利润率	13.51%
本期基金份额净值增长率	12.81%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-8,601,650.62
期末可供分配基金份额利润	-0.0841
期末基金资产净值	94,503,230.04
期末基金份额净值	0.9237
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-7.63%

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) 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额, 不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	3.91%	1.41%	1.75%	0.62%	2.16%	0.79%
过去三个月	-6.86%	1.70%	-2.40%	0.81%	-4.46%	0.89%
过去六个月	12.81%	1.50%	12.86%	0.80%	-0.05%	0.70%
过去一年	-4.40%	1.36%	4.64%	0.77%	-9.04%	0.59%
自基金合同生效起至今	-7.63%	1.32%	-1.04%	0.71%	-6.59%	0.61%

注: (1) 业绩比较基准: 中证全指指数收益率×50%+中证全债指数收益率×50%。

(2) 业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2017 年 12 月 11 日至 2019 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，于 2003 年 8 月 5 日成立，注册资本 1.2688 亿元人民币。公司的股东为广发证券股份有限公司、烽火通信科技股份有限公司、深圳市前海香江金融控股集团有限公司、康美药业股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司。公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、受托管理保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）等业务资格。

本基金管理人在董事会下设合规及风险管理委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 32 个部门：宏观策略部、价值投资部、策略投资部、成长投资部、专户投资部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金部、战略与创新业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、北京办事处。此外，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百九十只开放式基金，管理公募基金规模为 4452 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资组合和养老基金投资组合。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）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	2017-12-11	-	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

	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成长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价值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				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 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)。
--	---	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3 日内和 5 日内的同向交易价差进行专项分析，未发现该组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于 0 的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019 年上半年，A 股呈现冲高回落的态势，市场整体表现较为优异。核心指数方面，上证综指涨 19.45%，创业板指涨 20.87%，沪深 300 涨 27.07%，中证 1000 涨 20.12%。行业方面，食品饮料、非银金融、农林牧渔涨幅居前，而传媒，钢铁等板块表现较弱。年初上涨的核心逻辑在于社融、地产等经济基本面数据超预期以及贸易战缓和，在政策持续向好的正向影响下，市场在农历新年后出现了大涨、齐涨的局面。进入 4 月份，随着流动性政策的边际收紧，中美贸易战再起波澜，基本面数据不达预期，市场又出现一定幅度回调并进入调整阶段。此时，市场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、通信为代表的成长板块，以及周期板块出现较大幅度回调。

4.4.2 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 12.81%，同期业绩比较基准收益率为 12.86%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，中国经济短周期仍处于量价齐跌阶段，企业盈利周期处于下行的末尾阶段，中美贸易摩擦不确定性依然存在，同时，我们也看到经济结构调整在进一步深入，全面深化改革在进一步推进，社销等体现经济韧劲的内需数据在进一步改善。我们预计未来货币政策将继续维持稳健偏宽，上市公司盈利将逐步改善，市场增量资金将逐步回流。投资策略方面，我们将以确定性溢价为主线，重点布局现金流稳定、业绩稳健、估值处于低位的行业、行业龙头以及具备长线投资的成长和价值板块。

下半年，组合通过大数据选股模型进行行业配置和个股选择，侧重基本面优质的小盘股和成长股。行业配置上将主要集中在大消费、电子、通信、计算机等自主可控板块。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基

金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	4,937,077.19	20,730,935.53
结算备付金		-	152,727.27
存出保证金		51,367.85	16,596.61
交易性金融资产	6.4.7.2	89,943,397.15	51,481,334.76
其中：股票投资		89,943,397.15	51,481,334.76
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	38,549,049.18
应收利息	6.4.7.5	1,050.72	-483.06
应收股利		-	-
应收申购款		710.10	395.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		94,933,603.01	110,930,555.54
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2019 年 6 月 30 日	2018 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		157,832.48	40,304.96
应付管理人报酬		124,920.01	157,094.97
应付托管费		18,927.27	23,802.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	61,308.64	9,111.57
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	67,384.57	334,015.21
负债合计		430,372.97	564,329.00
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	102,313,091.62	134,789,189.37
未分配利润	6.4.7.10	-7,809,861.58	-24,422,962.83
所有者权益合计		94,503,230.04	110,366,226.54
负债和所有者权益总计		94,933,603.01	110,930,555.54

注:报告截止日 2019 年 6 月 30 日,基金份额净值人民币 0.9237 元,基金份额总额 102,313,091.62 份。

6.2 利润表

会计主体: 广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		16,091,211.88	-3,954,557.53
1.利息收入		115,840.83	704,486.65
其中: 存款利息收入	6.4.7.11	98,589.91	97,158.05
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		17,250.92	607,328.60
其他利息收入		-	-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,879,245.38	-2,089,415.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-5,573,984.79	-3,709,732.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	694,739.41	1,620,317.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	20,848,451.01	-2,942,988.33
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	6,165.42	373,359.78
减：二、费用		1,418,017.12	2,156,084.76
1. 管理人报酬		887,840.43	1,386,213.43
2. 托管费		134,521.25	210,032.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	325,125.39	383,125.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	70,530.05	176,713.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,673,194.76	-6,110,642.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,673,194.76	-6,110,642.29

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	134,789,189.37	-24,422,962.83	110,366,226.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,673,194.76	14,673,194.76
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-32,476,097.75	1,939,906.49	-30,536,191.26

其中：1.基金申购款	792,996.06	-54,352.19	738,643.87
2.基金赎回款	-33,269,093.81	1,994,258.68	-31,274,835.13
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	102,313,091.62	-7,809,861.58	94,503,230.04
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	250,167,141.85	490,267.85	250,657,409.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-6,110,642.29	-6,110,642.29
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-104,832,372.25	704,436.38	-104,127,935.87
其中：1.基金申购款	7,346,833.46	-316,521.23	7,030,312.23
2.基金赎回款	-112,179,205.71	1,020,957.61	-111,158,248.10
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	145,334,769.60	-4,915,938.06	140,418,831.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可〔2016〕978 号《关于准予广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2017 年 11 月 6 日向社会公开发行募集并于 2017 年 12 月 11 日正

式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2017 年 11 月 6 日至 2017 年 12 月 1 日，为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 250,167,141.85 元，有效认购户数为 3,259 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 43,645.11 元，折合基金份额 43,645.11 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于 2019 年 8 月 26 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业

纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 企业所得税

证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25% 计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	4,937,077.19
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	4,937,077.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	89,636,520.33	89,943,397.15	306,876.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	89,636,520.33	89,943,397.15	306,876.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,027.62
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	23.10
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	1,050.72

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	61,308.64
银行间市场应付交易费用	-
合计	61,308.64

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	59.20
预提费用	67,325.37

合计	67,384.57
----	-----------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	134,789,189.37	134,789,189.37
本期申购	792,996.06	792,996.06
本期赎回（以“-”号填列）	-33,269,093.81	-33,269,093.81
本期末	102,313,091.62	102,313,091.62

注：申购含转换转入、红利再投资份（金）额，赎回含转换转出份（金）额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,338,205.41	-19,084,757.42	-24,422,962.83
本期利润	-6,175,256.25	20,848,451.01	14,673,194.76
本期基金份额交易产生的变动数	2,911,811.04	-971,904.55	1,939,906.49
其中：基金申购款	-71,617.15	17,264.96	-54,352.19
基金赎回款	2,983,428.19	-989,169.51	1,994,258.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,601,650.62	791,789.04	-7,809,861.58

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	311.87
结算备付金利息收入	2,815.22
其他	-
合计	98,589.91

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
	卖出股票成交总额
减：卖出股票成本总额	104,854,439.65
买卖股票差价收入	-5,573,984.79

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	694,739.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	694,739.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	20,848,451.01
——股票投资	20,848,451.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	20,848,451.01

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	4,074.38
基金转换费收入	2,091.04
合计	6,165.42

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	325,125.39
银行间市场交易费用	-
合计	325,125.39

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	16,860.15
信息披露费	50,465.22
银行汇划费	3,204.68
合计	70,530.05

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期不存在控制关系或者其他重大利害关系的关联方关系发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人母公司、代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例

广发证券股份有限公司	221,438,872.21	100.00%	287,320,352.93	100.00%
------------	----------------	---------	----------------	---------

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	38,800,000.00	100.00%	3,274,300,000.00	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
广发证券股份有限公司	206,203.16	100.00%	61,308.64	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例
广发证券股份有限公司	267,582.30	100.00%	69,954.09	100.00%

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	887,840.43	1,386,213.43
其中：支付销售机构的客户维护费	190,434.01	489,142.46

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.65% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.65\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	134,521.25	210,032.39

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	4,937,077.19	95,462.82	10,952,060.28	60,942.05

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600480	凌云股份	2019-06-20	2019-07-03	配股流通受限	8.74	8.75	600.00	5,244.00	5,250.00	-

注：截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要是信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资、资产支持证券投资、同业存单投资，因此与其相关的信用风险不重大。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券

外，本基金所持大部分证券均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性、风险价值模型（VAR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,937,077.19	-	-	-	4,937,077.19
存出保证金	51,367.85	-	-	-	51,367.85
交易性金融资产	-	-	-	89,943,397.15	89,943,397.15
应收利息	-	-	-	1,050.72	1,050.72
应收申购款	-	-	-	710.10	710.10
资产总计	4,988,445.04	-	-	89,945,157.97	94,933,603.01
负债					

应付赎回款	-	-	-	157,832.48	157,832.48
应付管理人报酬	-	-	-	124,920.01	124,920.01
应付托管费	-	-	-	18,927.27	18,927.27
应付交易费用	-	-	-	61,308.64	61,308.64
其他负债	-	-	-	67,384.57	67,384.57
负债总计	-	-	-	430,372.97	430,372.97
利率敏感度缺口	4,988,445.04	-	-	89,514,785.00	94,503,230.04
上年度末 2018 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,730,935.53	-	-	-	20,730,935.53
结算备付金	152,727.27	-	-	-	152,727.27
存出保证金	16,596.61	-	-	-	16,596.61
交易性金融资产	-	-	-	51,481,334.76	51,481,334.76
应收证券清算款	-	-	-	38,549,049.18	38,549,049.18
应收利息	-	-	-	-483.06	-483.06
应收申购款	-	-	-	395.25	395.25
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	20,900,259.41	-	-	90,030,296.13	110,930,555.54
负债					
应付赎回款	-	-	-	40,304.96	40,304.96
应付管理人报酬	-	-	-	157,094.97	157,094.97
应付托管费	-	-	-	23,802.29	23,802.29
应付交易费用	-	-	-	9,111.57	9,111.57
其他负债	-	-	-	334,015.21	334,015.21
负债总计	-	-	-	564,329.00	564,329.00
利率敏感度缺口	20,900,259.41	-	-	89,465,967.13	110,366,226.54

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇投资，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、风险价值模型（VAR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	89,943,397.15	95.17	51,481,334.76	46.65
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	89,943,397.15	95.17	51,481,334.76	46.65

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	4,224,591.18	4,414,649.06
业绩比较基准下降 5%	-4,224,591.18	-4,414,649.06	

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、公允价值

(1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为人民币 89,943,397.15 元，无属于第二层级和第三层级的金额（2018 年 12 月 31 日，属于第一层级的余额为人民币 51,481,334.76 元，无属于第二层级和第三层级的金额）。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	89,943,397.15	94.74
	其中：股票	89,943,397.15	94.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-

5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,937,077.19	5.20
8	其他各项资产	53,128.67	0.06
9	合计	94,933,603.01	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	248,572.69	0.26
B	采矿业	470,507.80	0.50
C	制造业	70,902,934.15	75.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	525,427.75	0.56
E	建筑业	515,330.60	0.55
F	批发和零售业	530,488.21	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	462,410.60	0.49
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,426,737.35	9.98
J	金融业	191,736.40	0.20
K	房地产业	660,753.40	0.70
L	租赁和商务服务业	53,265.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	3,535,443.20	3.74
N	水利、环境和公共设施管理业	213,489.00	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,888,677.00	2.00
R	文化、体育和娱乐业	208,080.00	0.22
S	综合	109,544.00	0.12
	合计	89,943,397.15	95.17

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300463	迈克生物	144,700	3,636,311.00	3.85
2	300012	华测检测	317,200	3,425,760.00	3.63
3	300357	我武生物	99,760	3,383,859.20	3.58
4	300595	欧普康视	94,845	3,376,482.00	3.57
5	002821	凯莱英	32,300	3,167,984.00	3.35
6	300016	北陆药业	331,800	2,880,024.00	3.05
7	000333	美的集团	54,700	2,836,742.00	3.00
8	300628	亿联网络	25,600	2,740,992.00	2.90
9	300009	安科生物	164,400	2,613,960.00	2.77
10	300529	健帆生物	39,300	2,450,355.00	2.59
11	603338	浙江鼎力	41,280	2,423,548.80	2.56
12	002557	洽洽食品	94,700	2,391,175.00	2.53
13	002396	星网锐捷	104,000	2,333,760.00	2.47
14	002653	海思科	163,300	2,318,860.00	2.45
15	300476	胜宏科技	201,600	2,278,080.00	2.41
16	300036	超图软件	150,800	2,228,824.00	2.36
17	603989	艾华集团	114,400	2,159,872.00	2.29
18	300294	博雅生物	79,000	2,144,850.00	2.27
19	603660	苏州科达	136,640	2,130,217.60	2.25
20	002677	浙江美大	160,800	2,116,128.00	2.24
21	000739	普洛药业	214,700	2,110,501.00	2.23
22	603808	歌力思	134,241	2,049,860.07	2.17
23	300137	先河环保	241,100	2,008,363.00	2.13
24	300170	汉得信息	143,000	1,943,370.00	2.06
25	002425	凯撒文化	296,400	1,917,708.00	2.03
26	002833	弘亚数控	50,700	1,845,987.00	1.95
27	600763	通策医疗	20,700	1,833,813.00	1.94
28	002614	奥佳华	112,300	1,832,736.00	1.94
29	300531	优博讯	103,300	1,813,948.00	1.92
30	603636	南威软件	171,500	1,723,575.00	1.82
31	603337	杰克股份	83,869	1,718,475.81	1.82
32	000977	浪潮信息	6,400	152,704.00	0.16

33	300014	亿纬锂能	3,100	94,426.00	0.10
34	600745	闻泰科技	2,700	89,694.00	0.09
35	600132	重庆啤酒	1,800	84,888.00	0.09
36	300285	国瓷材料	4,900	83,349.00	0.09
37	601799	星宇股份	1,000	78,960.00	0.08
38	600486	扬农化工	1,400	76,580.00	0.08
39	600728	佳都科技	7,701	75,854.85	0.08
40	600845	宝信软件	2,600	74,048.00	0.08
41	000831	五矿稀土	4,400	71,412.00	0.08
42	600873	梅花生物	14,500	69,455.00	0.07
43	002237	恒邦股份	4,100	68,511.00	0.07
44	600273	嘉化能源	5,800	67,048.00	0.07
45	600604	市北高新	5,000	66,400.00	0.07
46	600675	中华企业	12,480	64,771.20	0.07
47	600305	恒顺醋业	3,500	64,470.00	0.07
48	300771	智莱科技	1,126	62,887.10	0.07
49	300207	欣旺达	5,400	62,208.00	0.07
50	000735	罗牛山	6,300	62,181.00	0.07
51	002185	华天科技	12,200	62,098.00	0.07
52	600797	浙大网新	6,000	61,140.00	0.06
53	002035	华帝股份	5,000	60,900.00	0.06
54	000883	湖北能源	13,800	59,892.00	0.06
55	600323	瀚蓝环境	3,500	59,080.00	0.06
56	002511	中顺洁柔	4,800	58,944.00	0.06
57	300212	易华录	2,400	58,800.00	0.06
58	300180	华峰超纤	4,100	57,482.00	0.06
59	600756	浪潮软件	2,400	57,408.00	0.06
60	300079	数码科技	10,000	56,900.00	0.06
61	002547	春兴精工	4,900	54,978.00	0.06
62	300203	聚光科技	2,300	54,970.00	0.06
63	000516	国际医学	10,800	54,864.00	0.06
64	000917	电广传媒	7,800	54,834.00	0.06
65	600320	振华重工	14,500	54,520.00	0.06
66	600968	海油发展	15,356	54,513.80	0.06
67	600702	舍得酒业	2,000	54,360.00	0.06
68	002023	海特高新	4,400	53,856.00	0.06
69	002124	天邦股份	4,100	53,464.00	0.06
70	002168	惠程科技	6,000	53,100.00	0.06
71	600206	有研新材	4,400	52,580.00	0.06
72	002697	红旗连锁	8,100	52,407.00	0.06
73	300496	中科创达	1,800	52,344.00	0.06
74	000902	新洋丰	4,800	51,504.00	0.05
75	601011	宝泰隆	8,400	51,156.00	0.05
76	600868	梅雁吉祥	13,600	51,136.00	0.05

77	002383	合众思壮	4,500	51,120.00	0.05
78	000968	蓝焰控股	4,400	51,084.00	0.05
79	300098	高新兴	6,400	51,072.00	0.05
80	600711	盛屯矿业	9,400	50,854.00	0.05
81	000591	太阳能	15,300	50,184.00	0.05
82	300038	数知科技	5,300	49,608.00	0.05
83	002042	华孚时尚	6,800	49,368.00	0.05
84	002449	国星光电	3,700	49,136.00	0.05
85	000683	远兴能源	18,800	49,068.00	0.05
86	000301	东方盛虹	8,900	48,861.00	0.05
87	603317	天味食品	1,156	48,494.20	0.05
88	600621	华鑫股份	3,200	47,648.00	0.05
89	002648	卫星石化	3,200	47,616.00	0.05
90	300567	精测电子	900	47,268.00	0.05
91	601058	赛轮轮胎	15,900	47,223.00	0.05
92	600330	天通股份	6,000	47,160.00	0.05
93	601636	旗滨集团	12,100	47,069.00	0.05
94	600803	新奥股份	4,500	47,025.00	0.05
95	002419	天虹股份	3,600	47,016.00	0.05
96	600490	鹏欣资源	9,500	46,930.00	0.05
97	600677	航天通信	2,700	46,899.00	0.05
98	600667	太极实业	6,200	46,810.00	0.05
99	002203	海亮股份	4,300	46,526.00	0.05
100	000040	东旭蓝天	7,000	46,480.00	0.05
101	002025	航天电器	1,900	46,322.00	0.05
102	600988	赤峰黄金	7,500	45,900.00	0.05
103	600708	光明地产	8,200	45,756.00	0.05
104	002597	金禾实业	2,500	45,600.00	0.05
105	000059	华锦股份	7,100	45,440.00	0.05
106	600185	格力地产	9,300	45,291.00	0.05
107	600612	老凤祥	1,000	44,700.00	0.05
108	002126	银轮股份	6,000	44,640.00	0.05
109	601588	北辰实业	11,900	44,625.00	0.05
110	002488	金固股份	5,300	44,149.00	0.05
111	002151	北斗星通	1,900	44,137.00	0.05
112	600596	新安股份	4,100	44,116.00	0.05
113	002436	兴森科技	6,700	43,885.00	0.05
114	300616	尚品宅配	580	43,859.60	0.05
115	000035	中国天楹	7,300	43,800.00	0.05
116	600562	国睿科技	2,800	43,008.00	0.05
117	000799	酒鬼酒	1,700	42,925.00	0.05
118	300078	思创医惠	4,200	42,882.00	0.05
119	600641	万业企业	3,600	42,552.00	0.05
120	600559	老白干酒	3,250	42,542.50	0.05

121	000921	海信家电	3,400	42,432.00	0.04
122	601375	中原证券	8,000	42,320.00	0.04
123	300339	润和软件	3,000	42,300.00	0.04
123	603128	华贸物流	4,500	42,300.00	0.04
124	300747	锐科激光	300	42,003.00	0.04
125	002376	新北洋	3,500	41,825.00	0.04
126	300118	东方日升	4,100	41,738.00	0.04
127	600459	贵研铂业	2,300	41,561.00	0.04
128	002643	万润股份	4,100	41,410.00	0.04
129	000875	吉电股份	12,900	41,022.00	0.04
130	002073	软控股份	7,000	40,880.00	0.04
131	600108	亚盛集团	11,700	40,716.00	0.04
132	000592	平潭发展	11,600	40,600.00	0.04
133	000836	富通鑫茂	9,100	40,495.00	0.04
134	002531	天顺风能	6,700	40,468.00	0.04
135	002387	维信诺	3,100	40,455.00	0.04
136	600720	祁连山	4,600	40,434.00	0.04
137	000793	华闻传媒	12,000	40,320.00	0.04
138	603678	火炬电子	2,000	40,300.00	0.04
139	300292	吴通控股	6,700	40,200.00	0.04
140	000036	华联控股	7,800	39,858.00	0.04
141	600546	山煤国际	7,400	39,812.00	0.04
142	000901	航天科技	3,200	39,808.00	0.04
143	300054	鼎龙股份	5,000	39,750.00	0.04
144	002145	中核钛白	9,600	39,648.00	0.04
145	601929	吉视传媒	16,300	39,609.00	0.04
146	600326	西藏天路	5,200	39,520.00	0.04
147	300149	量子生物	2,600	39,390.00	0.04
148	300355	蒙草生态	9,600	39,360.00	0.04
149	000697	炼石航空	3,500	39,270.00	0.04
150	002234	民和股份	1,400	39,186.00	0.04
151	002716	金贵银业	5,000	39,000.00	0.04
152	600783	鲁信创投	2,200	38,984.00	0.04
153	002618	丹邦科技	2,900	38,889.00	0.04
154	600175	美都能源	15,400	38,808.00	0.04
155	603043	广州酒家	1,200	38,796.00	0.04
156	600269	赣粤高速	8,700	38,628.00	0.04
157	600197	伊力特	2,000	38,600.00	0.04
158	600110	诺德股份	8,700	38,541.00	0.04
159	300369	绿盟科技	3,000	38,430.00	0.04
160	000818	航锦科技	3,600	38,340.00	0.04
160	002413	雷科防务	6,000	38,340.00	0.04
161	600740	山西焦化	4,500	38,205.00	0.04
162	600123	兰花科创	5,200	38,064.00	0.04

163	300185	通裕重工	19,600	38,024.00	0.04
164	600360	华微电子	5,850	37,966.50	0.04
165	000733	振华科技	2,300	37,904.00	0.04
166	600217	中再资环	5,200	37,596.00	0.04
167	600226	瀚叶股份	11,800	37,524.00	0.04
168	601222	林洋能源	8,000	37,520.00	0.04
169	300367	东方网力	3,800	37,506.00	0.04
170	600337	美克家居	9,100	37,492.00	0.04
171	300145	中金环境	8,600	37,324.00	0.04
172	002421	达实智能	10,000	37,300.00	0.04
173	300068	南都电源	3,300	37,290.00	0.04
174	002429	兆驰股份	13,600	37,264.00	0.04
175	600067	冠城大通	7,900	37,209.00	0.04
176	601666	平煤股份	8,900	37,202.00	0.04
177	603323	苏农银行	6,710	37,173.40	0.04
178	300772	运达股份	2,336	37,095.68	0.04
179	300053	欧比特	3,700	36,926.00	0.04
180	300085	银之杰	2,600	36,894.00	0.04
181	600210	紫江企业	9,100	36,855.00	0.04
182	000672	上峰水泥	3,000	36,810.00	0.04
183	300699	光威复材	1,120	36,624.00	0.04
184	300184	力源信息	3,600	36,504.00	0.04
185	600456	宝钛股份	1,600	36,496.00	0.04
186	000789	万年青	3,640	36,472.80	0.04
187	002156	通富微电	4,300	36,464.00	0.04
188	600502	安徽水利	7,800	36,270.00	0.04
189	600363	联创光电	2,700	36,072.00	0.04
190	600057	厦门象屿	8,100	36,045.00	0.04
191	601918	新集能源	11,700	36,036.00	0.04
192	600116	三峡水利	4,500	35,910.00	0.04
193	002567	唐人神	3,100	35,805.00	0.04
194	000933	神火股份	8,500	35,785.00	0.04
195	002568	百润股份	2,000	35,760.00	0.04
196	000936	华西股份	4,000	35,720.00	0.04
197	000918	嘉凯城	5,400	35,640.00	0.04
198	300458	全志科技	1,700	35,530.00	0.04
199	000996	中国中期	2,600	35,438.00	0.04
199	002537	海联金汇	4,700	35,438.00	0.04
200	002139	拓邦股份	6,100	35,380.00	0.04
201	000016	深康佳 A	8,400	35,280.00	0.04
202	002698	博实股份	3,900	35,256.00	0.04
203	000070	特发信息	2,880	35,222.40	0.04
204	600020	中原高速	6,700	35,175.00	0.04
205	300222	科大智能	2,700	35,154.00	0.04

206	002430	杭氧股份	2,900	34,974.00	0.04
207	002497	雅化集团	5,000	34,950.00	0.04
208	002657	中科金财	2,000	34,800.00	0.04
209	002596	海南瑞泽	4,300	34,744.00	0.04
210	000603	盛达矿业	3,100	34,658.00	0.04
211	002036	联创电子	3,770	34,495.50	0.04
212	600331	宏达股份	10,700	34,347.00	0.04
213	600512	腾达建设	12,000	34,200.00	0.04
214	002080	中材科技	3,770	34,156.20	0.04
215	000560	我爱我家	7,100	33,938.00	0.04
216	300176	派生科技	2,300	33,810.00	0.04
217	002091	江苏国泰	5,900	33,689.00	0.04
218	600033	福建高速	10,300	33,681.00	0.04
219	002047	宝鹰股份	6,000	33,660.00	0.04
220	600764	中国海防	1,200	33,456.00	0.04
221	000582	北部湾港	3,700	33,300.00	0.04
222	603718	海利生物	2,400	33,288.00	0.04
223	600668	尖峰集团	2,600	33,280.00	0.04
224	002458	益生股份	1,700	33,167.00	0.04
225	603605	珀莱雅	500	33,090.00	0.04
226	000555	神州信息	2,900	33,002.00	0.03
227	603039	泛微网络	444	32,944.80	0.03
228	600622	光大嘉宝	6,760	32,921.20	0.03
229	600846	同济科技	3,700	32,819.00	0.03
230	600059	古越龙山	3,700	32,782.00	0.03
231	002292	奥飞娱乐	5,100	32,691.00	0.03
232	600990	四创电子	700	32,564.00	0.03
233	300322	硕贝德	2,100	32,550.00	0.03
234	601369	陕鼓动力	4,900	32,487.00	0.03
235	002313	日海智能	1,600	32,320.00	0.03
236	000034	神州数码	2,500	32,250.00	0.03
237	300047	天源迪科	3,843	32,165.91	0.03
238	002318	久立特材	4,400	32,164.00	0.03
239	000869	张裕 A	1,000	32,120.00	0.03
240	000951	中国重汽	2,000	32,100.00	0.03
241	600742	一汽富维	3,000	32,010.00	0.03
241	603588	高能环境	3,000	32,010.00	0.03
242	300077	国民技术	4,200	32,004.00	0.03
243	600477	杭萧钢构	9,720	31,881.60	0.03
244	600105	永鼎股份	6,600	31,812.00	0.03
245	000851	高鸿股份	5,400	31,752.00	0.03
245	600200	江苏吴中	5,400	31,752.00	0.03
246	600491	龙元建设	4,600	31,740.00	0.03
247	000088	盐田港	5,800	31,668.00	0.03

248	300102	乾照光电	5,400	31,482.00	0.03
249	002389	航天彩虹	2,800	31,248.00	0.03
250	000550	江铃汽车	1,600	31,024.00	0.03
251	002104	恒宝股份	4,300	30,917.00	0.03
252	600577	精达股份	10,200	30,906.00	0.03
253	000546	金圆股份	3,200	30,848.00	0.03
254	603345	安井食品	600	30,840.00	0.03
255	600602	云赛智联	4,000	30,680.00	0.03
256	300223	北京君正	1,100	30,602.00	0.03
257	300379	东方通	1,500	30,600.00	0.03
258	002261	拓维信息	5,000	30,550.00	0.03
259	002446	盛路通信	3,200	30,496.00	0.03
260	600966	博汇纸业	8,000	30,480.00	0.03
261	002326	永太科技	3,700	30,340.00	0.03
262	300177	中海达	3,450	30,084.00	0.03
263	000751	锌业股份	8,500	30,005.00	0.03
264	300353	东土科技	2,300	29,992.00	0.03
265	600495	晋西车轴	6,300	29,862.00	0.03
266	002117	东港股份	2,850	29,782.50	0.03
267	300310	宜通世纪	4,000	29,760.00	0.03
268	002428	云南锗业	3,900	29,757.00	0.03
269	300101	振芯科技	2,900	29,725.00	0.03
270	002115	三维通信	2,500	29,700.00	0.03
271	000429	粤高速 A	3,900	29,445.00	0.03
272	000620	新华联	7,100	29,394.00	0.03
273	600997	开滦股份	4,800	29,376.00	0.03
274	002097	山河智能	4,700	29,328.00	0.03
275	601069	西部黄金	1,900	29,260.00	0.03
276	002108	沧州明珠	7,500	29,250.00	0.03
277	002067	景兴纸业	8,500	29,240.00	0.03
278	600986	科达股份	6,900	29,187.00	0.03
279	002222	福晶科技	2,600	29,042.00	0.03
280	000507	珠海港	4,700	28,999.00	0.03
281	002705	新宝股份	2,500	28,750.00	0.03
282	002215	诺普信	4,100	28,700.00	0.03
283	000666	经纬纺机	2,300	28,635.00	0.03
284	002171	楚江新材	4,500	28,620.00	0.03
284	300130	新国都	1,800	28,620.00	0.03
285	600531	豫光金铅	5,700	28,557.00	0.03
286	002649	博彦科技	3,200	28,512.00	0.03
287	000828	东莞控股	3,100	28,427.00	0.03
288	300205	天喻信息	1,900	28,424.00	0.03
289	002192	融捷股份	1,400	28,420.00	0.03
290	002474	榕基软件	3,300	28,347.00	0.03

291	000810	创维数字	3,200	28,288.00	0.03
292	600063	皖维高新	10,100	28,280.00	0.03
293	300183	东软载波	1,800	28,224.00	0.03
294	300020	银江股份	3,500	28,210.00	0.03
295	603399	吉翔股份	2,500	28,125.00	0.03
296	002303	美盈森	5,800	28,014.00	0.03
297	000676	智度股份	3,100	27,962.00	0.03
298	600076	康欣新材	6,200	27,900.00	0.03
299	000910	大亚圣象	2,500	27,850.00	0.03
300	002746	仙坛股份	1,800	27,846.00	0.03
301	601677	明泰铝业	2,700	27,837.00	0.03
302	000801	四川九洲	4,600	27,830.00	0.03
303	002301	齐心集团	2,400	27,816.00	0.03
304	600400	红豆股份	7,600	27,740.00	0.03
305	002031	巨轮智能	13,200	27,720.00	0.03
306	000688	国城矿业	2,600	27,716.00	0.03
307	002167	东方锆业	3,700	27,713.00	0.03
308	300474	景嘉微	700	27,622.00	0.03
309	300091	金通灵	5,500	27,335.00	0.03
310	000928	中钢国际	4,700	27,307.00	0.03
311	300456	耐威科技	1,000	27,300.00	0.03
312	603026	石大胜华	900	27,234.00	0.03
313	600308	华泰股份	6,100	27,206.00	0.03
314	000935	四川双马	1,700	27,183.00	0.03
315	300495	美尚生态	2,000	27,140.00	0.03
316	000976	华铁股份	4,800	27,072.00	0.03
317	002267	陕天然气	3,300	27,027.00	0.03
318	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.03
319	002307	北新路桥	4,000	26,880.00	0.03
320	603118	共进股份	2,900	26,854.00	0.03
321	600987	航民股份	4,060	26,836.60	0.03
322	300232	洲明科技	2,760	26,716.80	0.03
323	002851	麦格米特	1,350	26,689.50	0.03
324	601949	中国出版	4,100	26,650.00	0.03
325	002564	天沃科技	4,600	26,588.00	0.03
326	002367	康力电梯	3,600	26,568.00	0.03
327	300666	江丰电子	700	26,544.00	0.03
328	002206	海利得	6,400	26,432.00	0.03
329	002585	双星新材	5,200	26,312.00	0.03
330	002733	雄韬股份	1,300	26,286.00	0.03
331	002095	生意宝	1,100	26,246.00	0.03
332	601908	京运通	7,500	26,175.00	0.03
333	002258	利尔化学	2,000	26,100.00	0.03
334	000520	长航凤凰	7,600	26,068.00	0.03

335	600626	申达股份	3,800	25,992.00	0.03
336	601700	风范股份	4,300	25,972.00	0.03
337	600255	梦舟股份	13,300	25,669.00	0.03
338	600963	岳阳林纸	5,300	25,652.00	0.03
339	600096	云天化	4,300	25,628.00	0.03
340	000811	冰轮环境	2,900	25,607.00	0.03
341	000731	四川美丰	4,400	25,564.00	0.03
342	000889	中嘉博创	2,000	25,540.00	0.03
343	002298	中电兴发	3,600	25,488.00	0.03
344	600300	维维股份	7,600	25,460.00	0.03
345	300131	英唐智控	4,800	25,440.00	0.03
346	002668	奥马电器	4,900	25,382.00	0.03
347	300679	电连技术	910	25,352.60	0.03
348	600391	航发科技	1,700	25,313.00	0.03
349	300044	赛为智能	3,500	25,270.00	0.03
350	300034	钢研高纳	1,700	25,228.00	0.03
351	600571	信雅达	2,700	25,164.00	0.03
352	600662	强生控股	4,800	25,152.00	0.03
353	600172	黄河旋风	7,800	25,116.00	0.03
354	002341	新纶科技	4,300	25,112.00	0.03
355	002293	罗莱生活	2,530	25,072.30	0.03
356	300045	华力创通	2,800	25,032.00	0.03
357	601886	江河集团	3,500	24,885.00	0.03
358	002542	中化岩土	5,500	24,805.00	0.03
359	000030	富奥股份	5,300	24,751.00	0.03
360	300096	易联众	2,600	24,700.00	0.03
361	002327	富安娜	3,300	24,651.00	0.03
362	300075	数字政通	2,200	24,640.00	0.03
363	002061	浙江交科	4,100	24,518.00	0.03
364	601139	深圳燃气	4,300	24,467.00	0.03
365	002364	中恒电气	2,500	24,400.00	0.03
366	600239	云南城投	8,400	24,360.00	0.03
367	000155	川能动力	5,700	24,225.00	0.03
368	600261	阳光照明	6,600	24,222.00	0.03
369	002647	仁东控股	1,700	24,140.00	0.03
370	300198	纳川股份	6,200	24,118.00	0.03
371	000687	华讯方舟	3,400	24,004.00	0.03
372	300618	寒锐钴业	400	24,000.00	0.03
373	002079	苏州固锝	3,300	23,991.00	0.03
374	600133	东湖高新	3,800	23,978.00	0.03
375	600322	天房发展	6,600	23,958.00	0.03
376	600681	百川能源	3,220	23,956.80	0.03
377	002867	周大生	700	23,933.00	0.03
378	000973	佛塑科技	5,800	23,896.00	0.03

379	601952	苏垦农发	3,100	23,808.00	0.03
380	601388	怡球资源	10,600	23,744.00	0.03
381	002055	得润电子	2,200	23,716.00	0.03
382	300219	鸿利智汇	3,200	23,616.00	0.02
383	002619	艾格拉斯	6,900	23,598.00	0.02
384	002240	威华股份	2,800	23,492.00	0.02
385	000601	韶能股份	4,900	23,471.00	0.02
386	600075	新疆天业	4,400	23,364.00	0.02
387	600106	重庆路桥	7,260	23,304.60	0.02
388	300602	飞荣达	900	23,292.00	0.02
389	002355	兴民智通	2,800	23,268.00	0.02
390	000957	中通客车	3,100	23,250.00	0.02
391	300506	名家汇	2,470	23,218.00	0.02
392	002283	天润曲轴	5,900	23,187.00	0.02
393	600676	交运股份	4,600	23,184.00	0.02
394	601113	华鼎股份	3,300	23,133.00	0.02
395	000584	哈工智能	3,200	23,104.00	0.02
396	300568	星源材质	1,000	23,050.00	0.02
397	002721	金一文化	3,700	23,014.00	0.02
398	002003	伟星股份	3,400	22,984.00	0.02
399	300128	锦富技术	5,800	22,968.00	0.02
399	300252	金信诺	2,200	22,968.00	0.02
400	300007	汉威科技	1,800	22,842.00	0.02
401	600480	凌云股份	2,600	22,750.00	0.02
402	002245	澳洋顺昌	5,200	22,724.00	0.02
403	300236	上海新阳	700	22,708.00	0.02
404	002717	岭南股份	4,500	22,680.00	0.02
405	603458	勘设股份	1,015	22,654.80	0.02
406	601163	三角轮胎	1,800	22,572.00	0.02
407	600130	波导股份	5,700	22,515.00	0.02
408	600856	中天能源	7,100	22,507.00	0.02
409	002484	江海股份	3,700	22,422.00	0.02
410	600800	天津磁卡	3,700	22,385.00	0.02
411	601101	昊华能源	3,600	22,356.00	0.02
412	000797	中国武夷	4,900	22,295.00	0.02
413	002443	金洲管道	3,100	22,289.00	0.02
414	300031	宝通科技	1,800	22,248.00	0.02
415	300303	聚飞光电	6,700	22,177.00	0.02
416	601126	四方股份	3,700	22,126.00	0.02
417	002182	云海金属	2,900	22,069.00	0.02
418	300502	新易盛	900	22,068.00	0.02
419	300594	朗进科技	500	22,055.00	0.02
420	603113	金能科技	2,000	22,040.00	0.02
421	002747	埃斯顿	2,500	21,975.00	0.02

422	000525	红太阳	1,700	21,947.00	0.02
423	300228	富瑞特装	3,600	21,888.00	0.02
424	002510	天汽模	5,400	21,870.00	0.02
425	002630	华西能源	7,100	21,868.00	0.02
426	300300	汉鼎宇佑	2,100	21,798.00	0.02
427	300309	吉艾科技	3,300	21,780.00	0.02
428	600715	文投控股	5,600	21,672.00	0.02
429	300065	海兰信	1,800	21,636.00	0.02
430	000913	钱江摩托	2,100	21,630.00	0.02
431	002148	北纬科技	3,400	21,624.00	0.02
432	300237	美晨生态	5,500	21,615.00	0.02
433	300157	恒泰艾普	4,200	21,546.00	0.02
434	002515	金字火腿	3,700	21,497.00	0.02
435	300409	道氏技术	1,700	21,471.00	0.02
436	603096	新经典	400	21,448.00	0.02
437	600581	八一钢铁	5,800	21,402.00	0.02
438	600114	东睦股份	3,400	21,386.00	0.02
439	600508	上海能源	2,200	21,318.00	0.02
440	300021	大禹节水	3,600	21,276.00	0.02
441	002204	大连重工	5,800	21,228.00	0.02
442	002611	东方精工	5,500	21,175.00	0.02
443	002343	慈文传媒	2,800	21,168.00	0.02
444	000802	北京文化	2,100	21,147.00	0.02
445	002043	兔宝宝	3,500	21,140.00	0.02
446	603357	设计总院	1,680	21,050.40	0.02
447	300438	鹏辉能源	1,300	21,034.00	0.02
448	600569	安阳钢铁	7,200	21,024.00	0.02
449	000055	方大集团	4,100	20,992.00	0.02
450	300373	扬杰科技	1,400	20,986.00	0.02
451	300343	联创股份	2,900	20,880.00	0.02
452	600550	保变电气	5,500	20,845.00	0.02
453	002582	好想你	2,300	20,838.00	0.02
454	002224	三力士	3,500	20,720.00	0.02
455	000925	众合科技	2,900	20,590.00	0.02
456	002121	科陆电子	4,200	20,580.00	0.02
457	002448	中原内配	3,700	20,572.00	0.02
458	600707	彩虹股份	4,100	20,541.00	0.02
459	000407	胜利股份	5,300	20,511.00	0.02
460	002197	证通电子	2,700	20,466.00	0.02
461	002226	江南化工	3,800	20,444.00	0.02
462	300323	华灿光电	3,300	20,394.00	0.02
463	603359	东珠生态	1,200	20,340.00	0.02
464	000822	山东海化	4,000	20,320.00	0.02
465	002060	粤水电	6,300	20,286.00	0.02

466	600798	宁波海运	5,500	20,240.00	0.02
467	002320	海峡股份	2,250	20,115.00	0.02
468	000065	北方国际	2,300	20,079.00	0.02
469	601366	利群股份	3,200	20,064.00	0.02
470	300288	朗玛信息	1,500	19,965.00	0.02
471	603393	新天然气	840	19,656.00	0.02
472	000639	西王食品	2,300	19,642.00	0.02
473	002229	鸿博股份	2,600	19,630.00	0.02
474	300311	任子行	2,600	19,526.00	0.02
475	000821	京山轻机	2,400	19,464.00	0.02
476	300083	劲胜智能	6,500	19,435.00	0.02
477	300398	飞凯材料	1,560	19,359.60	0.02
478	002253	川大智胜	1,300	19,318.00	0.02
479	600278	东方创业	1,600	19,264.00	0.02
480	600136	当代明诚	1,800	19,260.00	0.02
480	600568	中珠医疗	9,000	19,260.00	0.02
481	603881	数据港	600	19,092.00	0.02
482	603980	吉华集团	2,100	19,026.00	0.02
483	300364	中文在线	4,100	18,901.00	0.02
484	000615	京汉股份	3,500	18,865.00	0.02
485	300332	天壕环境	4,000	18,800.00	0.02
486	002912	中新赛克	200	18,774.00	0.02
487	002279	久其软件	2,700	18,711.00	0.02
488	600318	新力金融	2,500	18,675.00	0.02
489	002545	东方铁塔	2,900	18,473.00	0.02
490	002314	南山控股	6,100	18,300.00	0.02
491	600180	瑞茂通	2,300	18,101.00	0.02
492	002239	奥特佳	9,400	18,048.00	0.02
493	600684	珠江实业	4,500	18,045.00	0.02
494	002309	中利集团	2,600	17,888.00	0.02
495	002089	*ST 新海	8,300	17,679.00	0.02
496	600054	黄山旅游	1,900	17,651.00	0.02
497	300336	新文化	4,200	17,514.00	0.02
498	000711	京蓝科技	3,100	17,329.00	0.02
499	300178	腾邦国际	2,800	17,220.00	0.02
500	300424	航新科技	1,100	16,654.00	0.02
501	002305	南国置业	6,500	16,575.00	0.02
501	002622	融钰集团	5,100	16,575.00	0.02
502	002662	京威股份	4,500	15,435.00	0.02
503	300429	强力新材	1,520	15,139.20	0.02
504	300467	迅游科技	800	14,736.00	0.02
505	002501	*ST 利源	7,300	10,074.00	0.01
506	300761	立华股份	91	4,876.69	0.01
507	002356	*ST 赫美	1,600	4,400.00	0.00

508	603045	福达合金	128	2,379.52	0.00
509	600887	伊利股份	64	2,138.24	0.00
510	600872	中炬高新	46	1,970.18	0.00
511	002304	洋河股份	16	1,944.96	0.00
512	603515	欧普照明	52	1,677.00	0.00
513	603706	东方环宇	65	1,327.95	0.00
514	300674	宇信科技	41	1,155.79	0.00
515	600779	水井坊	7	355.74	0.00
516	300755	华致酒行	1	35.21	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300036	超图软件	3,682,525.26	3.34
2	300463	迈克生物	3,634,584.40	3.29
3	300476	胜宏科技	3,603,120.14	3.26
4	300016	北陆药业	3,504,614.50	3.18
5	603660	苏州科达	3,467,522.60	3.14
6	002138	顺络电子	3,435,031.00	3.11
7	300529	健帆生物	3,402,263.00	3.08
8	603989	艾华集团	3,395,721.16	3.08
9	603636	南威软件	3,371,154.40	3.05
10	002287	奇正藏药	3,329,231.00	3.02
11	002821	凯莱英	3,313,073.00	3.00
12	300009	安科生物	3,303,121.00	2.99
13	300012	华测检测	3,273,714.00	2.97
14	002262	恩华药业	3,257,316.00	2.95
15	603338	浙江鼎力	3,237,383.94	2.93
16	002614	奥佳华	3,195,543.00	2.90
17	603808	歌力思	3,195,273.50	2.90
18	002653	海思科	3,182,204.97	2.88
19	300137	先河环保	3,182,132.80	2.88
20	300595	欧普康视	3,181,263.46	2.88
21	300294	博雅生物	3,167,607.72	2.87
22	002557	洽洽食品	3,157,238.93	2.86
23	000739	普洛药业	3,136,431.00	2.84
24	002677	浙江美大	3,061,681.00	2.77
25	603337	杰克股份	3,041,151.00	2.76

26	002396	星网锐捷	2,978,975.00	2.70
27	300628	亿联网络	2,886,488.10	2.62
28	002425	凯撒文化	2,878,415.00	2.61
29	300531	优博讯	2,835,598.00	2.57
30	002833	弘亚数控	2,767,173.06	2.51
31	300357	我武生物	2,640,145.00	2.39
32	300170	汉得信息	2,276,845.00	2.06

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	9,009,447.01	8.16
2	601888	中国国旅	6,185,915.00	5.60
3	002304	洋河股份	5,590,130.22	5.07
4	600809	山西汾酒	5,041,581.00	4.57
5	600887	伊利股份	4,812,201.50	4.36
6	000858	五粮液	4,797,397.00	4.35
7	600872	中炬高新	4,312,462.70	3.91
8	002262	恩华药业	3,949,948.81	3.58
9	002050	三花智控	3,573,072.71	3.24
10	002287	奇正藏药	3,550,218.00	3.22
11	002138	顺络电子	3,544,705.82	3.21
12	603589	口子窖	2,953,364.42	2.68
13	600298	安琪酵母	2,192,861.00	1.99
14	600779	水井坊	2,084,525.06	1.89
15	600702	舍得酒业	1,977,640.00	1.79
16	300529	健帆生物	1,907,862.00	1.73
17	603636	南威软件	1,827,835.03	1.66
18	601318	中国平安	1,786,569.00	1.62
19	603027	千禾味业	1,746,692.00	1.58
20	002653	海思科	1,580,189.00	1.43

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	122,468,051.03
卖出股票收入（成交）总额	99,280,454.86

7.5 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。

7.6 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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	51,367.85
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,050.72
5	应收申购款	710.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,128.67

7.12.4 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。

7.12.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,696	60,326.12	0.00	0.00%	102,313,091.62	100.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	99.90	0.0001%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017 年 12 月 11 日）基金份额总额	250,167,141.85
本报告期期初基金份额总额	134,789,189.37
本报告期基金总申购份额	792,996.06
减：本报告期基金总赎回份额	33,269,093.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	102,313,091.62

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2019 年 6 月 4 日发布公告，自 2019 年 6 月 1 日起，聘任窦刚先生担任公司首席信息官。

托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	221,438,872.21	100.00%	206,203.16	100.00%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-

注：1、交易席位选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易席位选择流程：

- (1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择

标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
广发证券	-	-	38,800,000.00	100.00%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下基金参与科创板投资及相关风险揭示的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-21
2	关于增加晋中银行为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-06-05
3	关于增加和耕传承为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-16
4	关于增加汇林保大为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-05-08
5	关于调整旗下基金首次申购、追加申购及定期定额投资最低数额限制的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-04-01
6	关于增加基煜基金为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019-03-05

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

(一) 中国证监会注册广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金的文件

- (二)《广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四)《广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (五)法律意见书

11.2 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

11.3 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
二〇一九年八月二十八日