

# 广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

## 2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 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：二〇一六年十月二十四日

## § 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 2016 年 10 月 20 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 2016 年 7 月 1 日起至 9 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	187,571,323.68 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	（一）大类资产配置 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

	<p>调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后的收益。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>在股票投资策略方面，本基金充分利用百度互联网行为大数据，并通过相应的数据挖掘和分析手段，将涉及的上市公司的数据进行自动分析、归并、统计和计算，同时引入量化投资模型，精选股票进行投资。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>（四）金融衍生品投资策略 1、股指期货投资策略 2、权证投资策略 3、国债期货投资策略</p>	
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	61,692,170.86 份	125,879,152.82 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 (2016 年 7 月 1 日-2016 年 9 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	3,359,088.41	6,960,240.57
2.本期利润	1,251,781.48	2,655,670.94
3.加权平均基金份额本期利润	0.0196	0.0199
4.期末基金资产净值	60,310,099.45	123,018,645.89
5.期末基金份额净值	0.978	0.977

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	1.98%	0.93%	2.70%	0.42%	-0.72%	0.51%

###### 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	①-③	②-④
----	--------	-----------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	1.88%	0.91%	2.70%	0.42%	-0.82%	0.49%

### 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 2016 年 9 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:



注：本基金建仓期为基金合同生效后 3 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季峰	本基金的基金经理；广发百发 100 指数基金的基金经理；广发百发大数据成	2015-09-14	-	7 年	男，中国籍，管理学博士，持有中国证券投资基金业从业证书，2009 年 8 月至 2011 年 8 月在深圳证券交易所综合研究所从事博士后研究工作，2011 年 9 月至 2014 年 10 月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员，2014 年 10 月 21 日至 2016 年 5 月 25 日任广发中证全指可选消费 ETF 的基金经理，2014 年 11 月 24 日起任广发百发 100 指数基金的基金经理，2015 年 2 月 13 日至 2016 年

	长混合基金的基金经理；数据策略投资部副总经理			5 月 25 日任广发养老指数基金的基金经理，2015 年 3 月 18 日起任广发基金管理有限公司数据策略投资部副总经理，2015 年 3 月 25 日至 2016 年 5 月 25 日任广发环保指数基金的基金经理，2015 年 9 月 14 日起任广发百发大数据精选混合基金的基金经理，2015 年 11 月 18 日起任广发百发大数据成长混合基金的基金经理。
--	------------------------	--	--	--

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发百发大数据策略精选灵活配置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。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。监察稽核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业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾三季度，各大央行趋于观望，在美联储加息落定之前全球市场短期流动性仍维持着相对平稳状态。关注点更多落在局部的潜在风险事件上，譬如德银陷入危机，美国大选动向以及日本央行的预期管理等。7月初，市场在消化了流动性跨半年关口、美联储议息、英国脱欧等潜在冲击后，市场迎来短暂的反弹。随后，市场预期波动扩大，多空因素交错的格局造就了后续波段式整理震荡。一方面，“壳资源”概念受到监管新规的压制，银行理财分类监管也削弱了增量资金预期，市场的局部泡沫也随即受到挤压；另一方面，供给侧改革、PPP、深港通等热点概念提振市场情绪，支撑市场超跌修复。季末临近长假，市场骤冷规避潜在风险，观望情绪浓重。

三季度内，市场主要表现为反弹回落的整理走势。由于三季度中高股息、PPP、供给侧改革等多类热点题材轮番走俏，市场风格表现较为均衡，组合凭借大数据选股模型覆盖了部分热点，保持较高仓位水平收割风格化热点带来的阶段收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发百发大数据精选混合基金 A 类净值增长率为 1.98%，E 类净值增长率为 1.88%，同期业绩比较基准收益率为 2.70%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度，美国政经事件带来的不确定性将成为影响全球股市的关键——年底美国大选与美联储议息的结果预期波动举足轻重，对市场存在较强的牵引作用。倘若加息落定，将加剧非美元市场的资本外流与币值走弱的压力，新兴经济及大宗

商品出口国尤甚。因此，四季度需要密切留意投资操作的时间窗口，合理规避过剧波动，同时重点关注热点板块轮换催生的冲刺机会。

反观国内市场，亦需谨慎操作——宏观经济方面，过剩产能、资产泡沫与不良债务等问题仍然是当下的暗礁，基建、房地产以及民间投资增速存在回落压力；流动性方面，目前全球市场处于进退维谷的处境，边际再宽松的空间有限，国内的流动性环境处于审慎思路的调控之下相对稳定；经济增长压力的消化需要充足的时间，以及宏观政策操作空间，而房地产市场结构性矛盾的化解显得尤为关键。在宏观背景明朗化前，市场或将持续摸索中前行，预计一定时间内入市资金规模将以小增量为主，风险偏好核心或将体现稳健化、低波动、长期限等倾向。

长假之后，房地产调控新规等重点消息尚未引起市场剧烈波动，而年底的美国大选与美联储议息前夕市场波动亦将加剧。预估未来市场热点板块或发生成长风格的轮动，组合将结合具体市场动向及时调整仓位，合理锁定季度盈利。此外，组合将持续提高多策略运用能力，通过流动性管理、申购新股等多样手段提高资金运用效率与综合收益。

## § 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	163,891,245.61	88.67
	其中：股票	163,891,245.61	88.67
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	20,733,316.15	11.22
7	其他各项资产	205,413.49	0.11
8	合计	184,829,975.25	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	2,394,018.00	1.31
B	采矿业	11,308,937.00	6.17
C	制造业	107,582,702.85	58.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,440,524.00	5.15
E	建筑业	5,686,996.48	3.10
F	批发和零售业	3,522,614.54	1.92
G	交通运输、仓储和邮政业	3,422,885.25	1.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,731,995.11	4.22
J	金融业	1,488,862.63	0.81
K	房地产业	5,413,067.25	2.95
L	租赁和商务服务业	1,819,184.00	0.99
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	8,877.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,631,707.50	0.89
S	综合	2,438,874.00	1.33
	合计	163,891,245.61	89.40

### 5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

### 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	002293	罗莱生活	421,400	5,756,324.00	3.14
2	002529	海源机械	279,500	5,260,190.00	2.87
3	601238	广汽集团	175,121	3,905,198.30	2.13
4	002426	胜利精密	304,800	3,188,208.00	1.74
5	601028	玉龙股份	200,800	2,074,264.00	1.13
6	601633	长城汽车	186,200	1,990,478.00	1.09
7	002602	世纪华通	63,800	1,678,578.00	0.92
8	002636	金安国纪	80,700	1,533,300.00	0.84
9	002619	巨龙管业	71,900	1,531,470.00	0.84
10	300358	楚天科技	78,080	1,514,752.00	0.83

### 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 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	80,106.69
2	应收证券清算款	57,722.48
3	应收股利	-
4	应收利息	3,847.13
5	应收申购款	63,737.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	205,413.49

### 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	002602	世纪华通	1,678,578.00	0.92	重大事项停牌

## § 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	66,719,496.24	140,503,217.79
本报告期基金总申购份额	3,080,724.14	6,341,614.57

减：本报告期基金总赎回份额	8,108,049.52	20,965,679.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	61,692,170.86	125,879,152.82

## § 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 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

（二）《广发百发大数据策略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）《广发百发大数据策略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

### 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>。

投资者如对本报告有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话 95105828 或 020-83936999，或发电子邮件：[services@gf-funds.com.cn](mailto:services@gf-funds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇一六年十月二十四日