

广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券 投资基金

2017 年半年度报告

2017 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：二〇一七年八月二十五日

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 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.....	6
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	42
8 基金份额持有人信息	42

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
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	43
9 开放式基金份额变动	44
10 重大事件揭示	44
10.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
10.4 基金投资策略的改变	44
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况	45
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	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
11 备查文件目录	46
11.1 备查文件目录	46
11.2 存放地点	46
11.3 查阅方式	46

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	广发百发大数据精选混合	
基金主代码	001741	
交易代码	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	
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	
报告期末基金份额总额	129,139,217.89 份	
基金合同存续期	不定期	
下属二级基金的基金简称	广发百发大数据精选混合 A	广发百发大数据精选混合 E
下属二级基金的交易代码	001741	001742
报告期末下属分级基金的份额总额	41,726,212.13 份	87,413,005.76 份

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	<p>（一）大类资产配置</p> <p>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。</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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95566
传真		020-89899158	(010)66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街1 号
办公地址		广州市海珠区琶洲大道东1号 保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		510308	100818
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	中国证券报、上海证券报、证券时报
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（2017年1月1日至2017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

本期已实现收益	-542,166.74	-1,085,809.78
本期利润	434,320.95	396,662.75
加权平均基金份额本期利润	0.0095	0.0041
本期加权平均净值利润率	0.93%	0.40%
本期基金份额净值增长率	0.00%	-0.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017 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
期末可供分配利润	-648,918.85	-1,398,966.76
期末可供分配基金份额利润	-0.0156	-0.0160
期末基金资产净值	41,510,729.16	86,922,346.04
期末基金份额净值	0.995	0.994
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017 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
基金份额累计净值增长率	-0.50%	-0.60%

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

广发百发大数据精选混合 A

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	3.00%	0.84%	3.15%	0.32%	-0.15%	0.52%
过去三个月	-4.23%	0.85%	1.61%	0.34%	-5.84%	0.51%
过去六个月	0.00%	0.74%	3.38%	0.31%	-3.38%	0.43%
过去一年	3.75%	0.78%	5.77%	0.36%	-2.02%	0.42%
自基金合同生效起至今	-0.50%	1.06%	4.97%	0.71%	-5.47%	0.35%

广发百发大数据精选混合 E

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	2.90%	0.81%	3.15%	0.32%	-0.25%	0.49%

过去三个月	-4.33%	0.84%	1.61%	0.34%	-5.94%	0.50%
过去六个月	-0.10%	0.73%	3.38%	0.31%	-3.48%	0.42%
过去一年	3.65%	0.77%	5.77%	0.36%	-2.12%	0.41%
自基金合同生效起至今	-0.60%	1.06%	4.97%	0.71%	-5.57%	0.35%

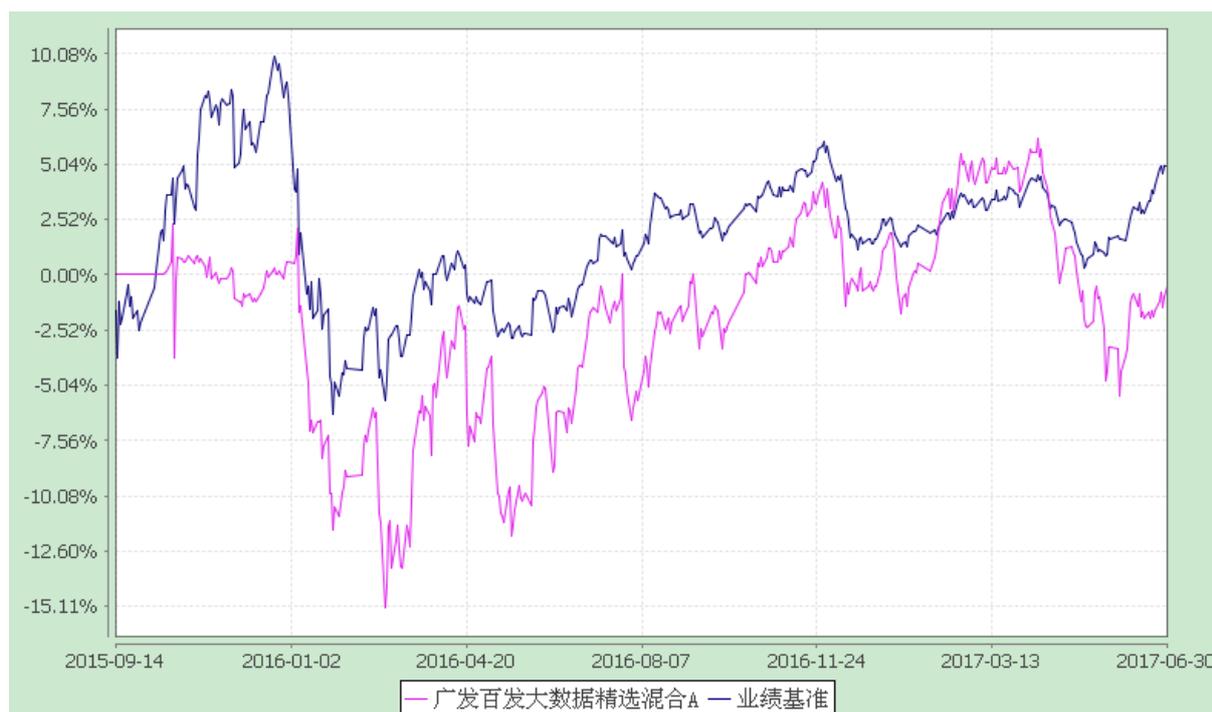
(1) 业绩比较基准： $50\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 50\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

(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

广发百发大数据策略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
 (2015 年 9 月 14 日至 2017 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



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、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 26 个部门：综合管理部、财务部、人力资源部、监察稽核部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、中央交易部、规划发展部、研究发展部、权益投资一部、权益投资二部、固定收益部、数量投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、北京分公司、广州

分公司、上海分公司、互联网金融部、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）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金管理人管理一百四十四只开放式基金——广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金（LOF）、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金、广发增强债券型证券投资基金、广发核心精选股票型证券投资基金、广发沪深 300 指数证券投资基金、广发聚瑞股票型证券投资基金、广发中证 500 指数证券投资基金（LOF）、广发内需增长灵活配置混合型证券投资基金、广发全球精选股票型证券投资基金、广发行业领先股票型证券投资基金、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、广发标普全球农业指数证券投资基金、广发聚利债券型证券投资基金、广发制造业精选股票型证券投资基金、广发聚财信用债证券投资基金、广发深证 100 指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、广发理财年年红债券型证券投资基金、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金，广发双债添利债券型证券投资基金、广发纯债债券型证券投资基金、广发理财 30 天债券型证券投资基金、广发新经济股票型发起式证券投资基金、广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、广发轮动配置股票型证券投资基金、广发聚鑫债券型证券投资基金、广发理财 7 天债券型证券投资基金、广发美国房地产指数证券投资基金、广发集利一年定期开放债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、广发聚优灵活配置混合型证券投资基金、广发天天红发起式货币市场基金、广发亚太中高收益债券型证券投资基金、广发现金宝场内实时申赎货币市场基金、广发全球医疗保健指数证券投资基金、广发成长优选灵活配置混合型证券投资基金、广发钱袋子货币市场基金、广发天天利货币市场基金、广发集鑫债券型证券投资基金、广发竞争优势灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金、广发主题领先灵活配置混合型证券投资基金、广发活期宝货币基金、广发逆向策略灵活配置混合型证券投资基金、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发对冲套利定期开放混合型发起式证券投资基金、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金、广发中证环保产业指数型证券投资基金、广发聚安混合型证券投资基金、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金、广发聚宝混合型证券投资基金、

广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指可选消费交易型开放式证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发安心回报混合型证券投资基金、广发安泰回报混合型证券投资基金、广发聚泰混合型证券投资基金、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证医疗指数分级证券投资基金、广发改革先锋灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金、广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金、广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金和广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金、广发新兴产业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发稳安保本混合型证券投资基金、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金、广发安享灵活配置混合型证券投资基金、广发稳鑫保本混合型证券投资基金、广发沪港深新机遇股票型证券投资基金、广发集裕债券型证券投资基金、广发稳裕保本混合型证券投资基金、广发安泽回报混合型证券投资基金、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金、广发汇平一年定期开放债券型证券投资基金、广发集富纯债债券型证券投资基金、广发集安债券型证券投资基金、广发集源债券型证券投资基金、广发中证环保产业交易型开

放式指数证券投资基金、广发汇富一年定期开放债券型证券投资基金、广发景源纯债债券型证券投资基金、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）、广发景祥纯债债券型证券投资基金、广发鑫瑞混合型证券投资基金、广发汇安 18 个月定期开放债券型证券投资基金、广发多元新兴股票型证券投资基金、广发创业板交易型开放式指数证券投资基金、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、广发创新驱动灵活配置混合型证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金、广发汇祥一年定期开放债券型证券投资基金，管理资产规模为 2518 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）及基金经理助理的简介

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；广发百发 100 指数基金的基金经理；广发百发大数据成长混合基金的基金经理；广发百发大数据价值混合基金的基金经理；数据策略投资部副总经理	2015-09-14	-	8 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 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，2017 年 6 月 16 日起任广发百发大数据价值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 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》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 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

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。

本报告期内，本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

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

回顾上半年，市场的风格切换一直在延续。一方面，随着白酒、家电、乃至银行保险等板块的持续走强，蓝筹白马的集中度也持续攀高。热点板块集中，资金抱团避险，缺乏轮动调整的风格行

情延续压力逐渐浮现；另一方面，随着政策监管趋严的情况，市场投资风格重心正在发生变化，价值投资占据主导地位。组合保持相对稳定的风格敞口，由于市场整体情绪相对正面，仓位水平在中等偏上范围调整。

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 0.00%，E 类净值增长率为-0.10%，同期业绩比较基准收益率为 3.38%。

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，机会或初现于三季度——一方面银行间市场跨过半年关口后整体市场流动性压力或能得到局部缓解；另一方面 A 股纳入 MSCI 新兴市场指数对市场情绪的提振，看点并非 158 亿美元的增量资金，应该着眼于国际化步伐加速过程中产生的风险偏好、投资风格、市场结构等多方面变化，带来的空间拓展与衍生机会值得期待。立于当前时点，下半年产品投资策略的重点将落于对基本面的深入挖掘，看好两类标的——一是质地优良、成长稳健甚至有望成为细分领域龙头的小市值标的，在此轮风格切换中承压而被错杀，风格板块带动下出现布局良机值得重点挖掘；二是盈利能力突出、发展稳定、估值合理的白马龙头，今年以来气势如虹、越发受到资金青睐认可的。随着未来 MSCI 加深对国内市场认可、经济寻底明朗化等趋势上浮，该类优质资产的良好表现或将延续。今年以来此类绩优白马股已经积累不少涨幅，或会在三季度陆续迎来调整，但调整后各板块后市表现或出现分化——家电利润增速临近高点，白酒业绩或具备持续性，短期的调整会挤压部分板块泡沫，但也会凸显出核心绩优白马的配置机会。

下半年的操作思路在于，一方面坚持运用大数据选股策略保持组合风格稳定，同时结合当前市场热点遴选标的，另一方面根据市场整体环境调控仓位，尽量减少市场局部调整传导的冲击。

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、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核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、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。监察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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

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：广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资 产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	26,762,712.92	51,460,559.62
结算备付金		6,812,739.50	7,151,983.29
存出保证金		67,725.83	75,285.27
交易性金融资产	6.4.7.2	95,837,030.11	104,279,751.22
其中：股票投资		95,837,030.11	104,279,751.22
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		655,793.10	88,735.17
应收利息	6.4.7.5	31,897.91	5,750.82
应收股利		-	-
应收申购款		80,634.72	85,887.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		130,248,534.09	163,147,953.20
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 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		843,390.60	521,620.95
应付管理人报酬		174,481.49	230,877.87
应付托管费		26,436.58	34,981.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	631,952.93	627,479.76

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	139,197.29	320,257.69
负债合计		1,815,458.89	1,735,217.78
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	129,139,217.89	162,281,457.85
未分配利润	6.4.7.1 0	-706,142.69	-868,722.43
所有者权益合计		128,433,075.20	161,412,735.42
负债和所有者权益总计		130,248,534.09	163,147,953.20

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，广发百发大数据精选混合 A 基金份额净值人民币 0.995 元，基金份额总额 41,726,212.13 份；广发百发大数据精选混合 E 基金份额净值人民币 0.994 元，基金份额总额 87,413,005.76 份；总份额总额 129,139,217.89 份。

6.2 利润表

会计主体：广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		3,251,623.62	-11,568,780.44
1. 利息收入		380,199.89	415,570.47
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	140,874.54	392,766.51
债券利息收入		67.90	11.15
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		239,257.45	22,792.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		353,894.81	-19,983,600.46
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-133,411.94	-20,419,907.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	23,807.40	24,012.23
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	463,499.35	412,294.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	2,458,960.22	7,799,502.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	58,568.70	199,746.91
减：二、费用		2,420,639.92	3,835,212.67
1. 管理人报酬		1,190,009.88	1,787,057.59
2. 托管费		180,304.52	270,766.28
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	903,436.70	1,599,081.60
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	146,888.82	178,307.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		830,983.70	-15,403,993.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		830,983.70	-15,403,993.11

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	162,281,457.85	-868,722.43	161,412,735.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	830,983.70	830,983.70
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）	-33,142,239.96	-668,403.96	-33,810,643.92
其中：1. 基金申购款	16,933,867.66	491,528.23	17,425,395.89
2. 基金赎回款	-50,076,107.62	-1,159,932.19	-51,236,039.81

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）	129,139,217.89	-706,142.69	128,433,075.20
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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）	283,676,726.52	1,540,933.77	285,217,660.29
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-15,403,993.11	-15,403,993.11
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）	-76,454,012.49	5,352,292.66	-71,101,719.83
其中：1. 基金申购款	21,506,092.68	-1,348,771.09	20,157,321.59
2. 基金赎回款	-97,960,105.17	6,701,063.75	-91,259,041.42
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）	207,222,714.03	-8,510,766.68	198,711,947.35

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

广发百发大数据策略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[2015]1699 号文核准，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》（“基金合同”）发起，于 2015 年 9 月 14 日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为 2015 年 8 月 18 日至 2015 年 9 月 7 日，本基金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 496,941,998.01 元，有效认购户数为 11,060 户。其中广发百发大数据精选混合基金 A 类基金（“A 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额为人民币 181,837,029.61 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 16,829.92 元；广发百发大数据精选混合基金 E 类基金（“E 类基金”）扣除认购费用后的募集资金净额 315,019,006.37 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 69,132.11 元。认购资金在募集期间产生的利息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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同等有关规定，本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证、股指期货等权益类金融工具，以及债券等固定收益类金融工具（包括国内依法发行上市的国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券、中小企业私募债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金等）、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0-95%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金业绩比较基准： $50\% \times \text{中证 800 指数收益率} + 50\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

本基金的财务报表于 2017 年 8 月 22 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。

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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 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

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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、债券免征营业税或增值税。
2. 对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，暂不缴纳企业所得税。
3. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。
4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。
5. 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税。
6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	2,762,712.92
定期存款	24,000,000.00
其中：存款期限 1-3 个月	24,000,000.00
其他存款	-
合计	26,762,712.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	94,465,586.01	95,837,030.11	1,371,444.10
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	94,465,586.01	95,837,030.11	1,371,444.10

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 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,693.43
应收定期存款利息	25,600.00
应收其他存款利息	27.45
应收结算备付金利息	1,577.03
应收债券利息	-
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	31,897.91

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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	631,952.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	631,952.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	348.57
预提费用	138,848.72
合计	139,197.29

6.4.7.9 实收基金

广发百发大数据精选混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	53,362,594.46	53,362,594.46
本期申购	4,828,508.12	4,828,508.12
本期赎回（以“-”号填列）	-16,464,890.45	-16,464,890.45
本期末	41,726,212.13	41,726,212.13

广发百发大数据精选混合 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额	账面金额

上年度末	108,918,863.39	108,918,863.39
本期申购	12,105,359.54	12,105,359.54
本期赎回（以“-”号填列）	-33,611,217.17	-33,611,217.17
本期末	87,413,005.76	87,413,005.76

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

广发百发大数据精选混合 A

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	167,321.09	-440,815.56	-273,494.47
本期利润	-542,166.74	976,487.69	434,320.95
本期基金份额交易产生的变动数	-274,073.20	-102,236.25	-376,309.45
其中：基金申购款	136,990.95	533.52	137,524.47
基金赎回款	-411,064.15	-102,769.77	-513,833.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-648,918.85	433,435.88	-215,482.97

广发百发大数据精选混合 E

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	304,128.50	-899,356.46	-595,227.96
本期利润	-1,085,809.78	1,482,472.53	396,662.75
本期基金份额交易产生的变动数	-617,285.48	325,190.97	-292,094.51
其中：基金申购款	347,980.15	6,023.61	354,003.76
基金赎回款	-965,265.63	319,167.36	-646,098.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,398,966.76	908,307.04	-490,659.72

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	82,417.23
定期存款利息收入	25,600.00
其他存款利息收入	485.13
结算备付金利息收入	32,372.18
其他	-
合计	140,874.54

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	301,297,873.59
减：卖出股票成本总额	301,431,285.53
买卖股票差价收入	-133,411.94

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	602,875.30
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	579,000.00
减：应收利息总额	67.90
买卖债券差价收入	23,807.40

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 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	463,499.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	463,499.35

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	2,458,960.22
——股票投资	2,458,960.22
——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	-
合计	2,458,960.22

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
基金赎回费收入	26,902.77
手续费返还	-
基金转换费收入	31,665.93
印花税返还	-
其他	-
合计	58,568.70

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	903,436.70
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	-
合计	903,436.70

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	119,012.93
银行汇划费	8,040.10
合计	146,888.82

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

本报告期内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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	590,313,380.78	100.00%	739,719,448.31	63.79%

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 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	602,875.30	100.00%	63,893.40	52.36%

6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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	1,504,400,000.00	100.00%	203,900,000.00	91.15%
------------	------------------	---------	----------------	--------

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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 金总额的比例
广发证券股份有限公司	549,764.48	100.00%	351,759.18	55.66%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016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 金总额的比例
广发证券股份有限公司	688,902.77	69.17%	99,745.11	26.75%

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 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,190,009.88	1,787,057.59
其中：支付销售机构的客户维护费	197,028.42	138,299.44

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，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	180,304.52	270,766.28

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

广发百发大数据精选混合 A

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。

广发百发大数据精选混合 E

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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016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
中国银行股份有限公司	2,762,712.92	82,417.23	22,010,297.25	312,635.07

注：本基金的部分银行存款由基金托管人中国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（2017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
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股流通受限	8.11	8.11	942.00	7,639.62	7,639.62	-
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股流通受限	8.48	8.48	1,257.00	10,659.36	10,659.36	-
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股流通受限	10.93	10.93	1,259.00	13,760.87	13,760.87	-
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股流通受限	6.20	6.20	2,966.00	18,389.20	18,389.20	-
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股流通受限	18.02	18.02	1,313.00	23,660.26	23,660.26	-

注：截至本报告期末 2017 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项停牌	6.85	-	-	200.00	1,368.22	1,370.00	-
000755	*ST 三维	2017-04-05	重大事项停牌	6.75	-	-	800.00	6,613.74	5,400.00	-
300151	昌红科技	2017-04-11	重大事项停牌	11.53	2017-08-18	10.38	500.00	5,278.68	5,765.00	-
002619	巨龙管业	2017-05-24	重大事项停牌	6.37	-	-	1,260.00	12,033.00	8,026.20	-
300109	新开源	2017-03-27	重大事项停牌	46.46	-	-	500.00	21,341.25	23,230.00	-
600193	创兴资源	2017-06-01	重大事项停牌	6.77	-	-	40,200.00	300,594.00	272,154.00	-
002486	嘉麟杰	2017-02-28	重大事项停牌	8.64	-	-	33,700.00	285,829.00	291,168.00	-
002729	好利来	2017-05-25	重大事项停牌	69.04	2017-08-18	62.06	6,300.00	499,063.00	434,952.00	-

000838	财信发展	2017-05-02	重大事项停牌	6.59	-	-	71,000.00	500,946.00	467,890.00	-
002654	万润科技	2017-05-10	重大事项停牌	9.28	-	-	81,700.00	969,600.00	758,176.00	-
002122	天马股份	2017-04-24	重大事项停牌	10.30	2017-07-24	11.15	83,600.00	949,549.00	861,080.00	-
300413	快乐购	2017-04-05	重大事项停牌	20.29	-	-	42,900.00	992,917.64	870,441.00	-
600460	士兰微	2017-05-12	重大事项停牌	6.07	2017-08-15	6.68	144,400.00	960,173.22	876,508.00	-
601608	中信重工	2017-04-19	重大事项停牌	5.54	2017-07-26	5.26	167,200.00	948,267.00	926,288.00	-
000682	东方电子	2016-10-10	重大事项停牌	5.20	2017-08-07	5.60	233,800.00	1,291,408.14	1,215,760.00	-

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 2017 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 2017 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体系的理念，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监察稽核部负责，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。监察稽核部对公司总裁负责。

本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总裁和风险控制委员会、督察长、监察稽核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，因此与债券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。

6.4.13.4 市场风险

本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的，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。本基金持有的利率敏感性资产主要是债券投资。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 2017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	26,762,712.92	-	-	-	26,762,712.92
结算备付金	6,812,739.50	-	-	-	6,812,739.50
存出保证金	67,725.83	-	-	-	67,725.83
交易性金融资产	-	-	-	95,837,030.11	95,837,030.11
应收证券清算款	-	-	-	655,793.10	655,793.10
应收利息	-	-	-	31,897.91	31,897.91
应收申购款	-	-	-	80,634.72	80,634.72
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	33,643,178.25	-	-	96,605,355.84	130,248,534.

					09
负债					
应付赎回款	-	-	-	843,390.60	843,390.60
应付管理人报酬	-	-	-	174,481.49	174,481.49
应付托管费	-	-	-	26,436.58	26,436.58
应付交易费用	-	-	-	631,952.93	631,952.93
其他负债	-	-	-	139,197.29	139,197.29
负债总计	-	-	-	1,815,458.89	1,815,458.89
利率敏感度缺口	33,643,178.25	-	-	94,789,896.95	128,433,075.20
上年度末 2016 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	51,460,559.62	-	-	-	51,460,559.62
结算备付金	7,151,983.29	-	-	-	7,151,983.29
存出保证金	75,285.27	-	-	-	75,285.27
交易性金融资产	-	-	-	104,279,751.22	104,279,751.22
应收证券清算款	-	-	-	88,735.17	88,735.17
应收利息	-	-	-	5,750.82	5,750.82
应收申购款	-	-	-	85,887.81	85,887.81
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	58,687,828.18	-	-	104,460,125.02	163,147,953.20
负债					
应付赎回款	-	-	-	521,620.95	521,620.95
应付管理人报酬	-	-	-	230,877.87	230,877.87
应付托管费	-	-	-	34,981.51	34,981.51
应付交易费用	-	-	-	627,479.76	627,479.76
其他负债	-	-	-	320,257.69	320,257.69
负债总计	-	-	-	1,735,217.78	1,735,217.78
利率敏感度缺口	58,687,828.18	-	-	102,724,907.24	161,412,735.42

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。

6.4.13.4.3 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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	95,837,030.11	74.62	104,279,751.22	64.60
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	95,837,030.11	74.62	104,279,751.22	64.60

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	上年度末
		2017 年 6 月 30 日	2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	3,667,063.29	10,500,615.80

	业绩比较基准下降 5%	-3,667,063.29	-10,500,615.80
--	-------------	---------------	----------------

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

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层级参见本基金最近一期年报。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2017 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 88,744,712.60 元，属于第二层级的余额为 7,018,208.20 元，属于第三层级的余额为 74,109.31 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票（2016 年 12 月 31 日，第一层级的余额为 93,531,126.39 元，第二层级的余额为 10,406,140.12 元，第三层级的余额为 342,484.71 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票）。

(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。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

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	95,837,030.11	73.58
	其中：股票	95,837,030.11	73.58
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	33,575,452.42	25.78
7	其他各项资产	836,051.56	0.64
8	合计	130,248,534.09	100.00

7.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	70,634,980.28	55.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	315,022.80	0.25
E	建筑业	278,545.34	0.22
F	批发和零售业	872,345.52	0.68
G	交通运输、仓储和邮政业	14,558,950.44	11.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,165,385.62	0.91
J	金融业	4,700,731.00	3.66
K	房地产业	858,490.00	0.67
L	租赁和商务服务业	2,450,656.00	1.91
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,923.11	0.00
S	综合	-	-
	合计	95,837,030.11	74.62

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	000895	双汇发展	385,522	9,156,147.50	7.13
2	002831	裕同科技	87,260	6,544,500.00	5.10
3	600298	安琪酵母	250,000	6,467,500.00	5.04
4	600062	华润双鹤	231,900	6,361,017.00	4.95
5	002271	东方雨虹	169,900	6,303,290.00	4.91
6	000999	华润三九	157,982	5,015,928.50	3.91
7	601318	中国平安	94,100	4,668,301.00	3.63
8	600004	白云机场	210,100	3,878,446.00	3.02
9	000429	粤高速A	438,186	3,742,108.44	2.91
10	600377	宁沪高速	306,900	3,007,620.00	2.34
11	300003	乐普医疗	133,200	2,945,052.00	2.29
12	002456	欧菲光	155,625	2,827,706.25	2.20
13	603111	康尼机电	229,118	2,795,239.60	2.18
14	000651	格力电器	65,000	2,676,050.00	2.08
15	603968	醋化股份	115,200	2,587,392.00	2.01
16	600352	浙江龙盛	268,900	2,562,617.00	2.00
17	000089	深圳机场	268,800	2,513,280.00	1.96
18	002027	分众传媒	178,100	2,450,656.00	1.91
19	000858	五粮液	22,800	1,269,048.00	0.99
20	000682	东方电子	233,800	1,215,760.00	0.95
21	300136	信维通信	28,900	1,156,578.00	0.90
22	002372	伟星新材	61,740	1,153,303.20	0.90
23	002410	广联达	61,000	1,146,800.00	0.89
24	002311	海大集团	62,429	1,140,577.83	0.89
25	600132	重庆啤酒	44,297	1,032,563.07	0.80

26	000568	泸州老窖	19,800	1,001,484.00	0.78
27	603885	吉祥航空	62,200	944,196.00	0.74
28	002242	九阳股份	47,100	926,457.00	0.72
29	601608	中信重工	167,200	926,288.00	0.72
30	600460	士兰微	144,400	876,508.00	0.68
31	300413	快乐购	42,900	870,441.00	0.68
32	002122	天马股份	83,600	861,080.00	0.67
33	002654	万润科技	81,700	758,176.00	0.59
34	000838	财信发展	71,000	467,890.00	0.36
35	002729	好利来	6,300	434,952.00	0.34
36	601588	北辰实业	63,000	390,600.00	0.30
37	000982	*ST 中绒	76,400	378,944.00	0.30
38	002718	友邦吊顶	6,400	372,800.00	0.29
39	600115	东方航空	50,000	340,000.00	0.26
40	600008	首创股份	47,800	314,524.00	0.24
41	002486	嘉麟杰	33,700	291,168.00	0.23
42	600193	创兴资源	40,200	272,154.00	0.21
43	002097	山河智能	15,700	139,573.00	0.11
44	002615	哈尔斯	12,084	136,549.20	0.11
45	600350	山东高速	21,500	133,300.00	0.10
46	300476	胜宏科技	5,500	129,965.00	0.10
47	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.03
48	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.02
49	300109	新开源	500	23,230.00	0.02
50	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
51	601878	浙商证券	1,000	17,010.00	0.01
52	601336	新华保险	300	15,420.00	0.01
53	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
54	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
55	002619	巨龙管业	1,260	8,026.20	0.01
56	300671	富满电子	942	7,639.62	0.01
57	300151	昌红科技	500	5,765.00	0.00
58	603138	海量数据	125	5,560.00	0.00
59	000755	*ST 三维	800	5,400.00	0.00
60	603179	新泉股份	95	4,171.45	0.00
61	603388	元成股份	92	3,456.44	0.00
62	603303	得邦照明	92	3,071.88	0.00
63	603717	天域生态	90	2,934.90	0.00
64	002843	泰嘉股份	77	2,291.52	0.00
65	002315	焦点科技	84	2,094.96	0.00
66	603626	科森科技	31	2,020.58	0.00
67	300592	华凯创意	83	1,923.11	0.00
68	603628	清源股份	82	1,828.60	0.00
69	600867	通化东宝	100	1,824.00	0.00

70	300591	万里马	126	1,726.20	0.00
71	603008	喜临门	92	1,638.52	0.00
72	002855	捷荣技术	95	1,630.20	0.00
73	603133	碳元科技	45	1,510.20	0.00
74	300596	利安隆	69	1,487.64	0.00
75	300009	安科生物	90	1,476.90	0.00
76	601933	永辉超市	200	1,416.00	0.00
77	300007	汉威电子	73	1,405.98	0.00
78	002055	得润电子	61	1,386.53	0.00
79	600050	中国联通	200	1,370.00	0.00
80	603517	绝味食品	37	1,290.19	0.00
81	603768	常青股份	46	1,170.24	0.00
82	002518	科士达	80	1,169.60	0.00
83	300603	立昂技术	34	1,114.52	0.00
84	002342	巨力索具	100	1,007.00	0.00
85	603996	中新科技	50	855.00	0.00
86	300597	吉大通信	47	806.52	0.00
87	600689	上海三毛	47	650.95	0.00
88	002774	快意电梯	41	574.00	0.00
89	002634	棒杰股份	69	568.56	0.00
90	002507	涪陵榨菜	50	562.00	0.00
91	603817	海峡环保	29	498.80	0.00
92	002532	新界泵业	60	489.00	0.00
93	600876	洛阳玻璃	23	437.92	0.00
94	600507	方大特钢	50	426.50	0.00
95	002745	木林森	11	411.29	0.00
96	603668	天马科技	21	309.54	0.00
97	603615	茶花股份	15	296.85	0.00
98	002419	天虹股份	19	273.22	0.00
99	002038	双鹭药业	8	233.20	0.00
100	002523	天桥起重	40	212.80	0.00
101	002251	步步高	10	123.90	0.00
102	002084	海鸥卫浴	12	106.68	0.00
103	603690	至纯科技	6	102.18	0.00
104	002607	亚夏汽车	20	91.40	0.00
105	002211	宏达新材	10	82.70	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	000895	双汇发展	12,421,854.93	7.70
2	600298	安琪酵母	9,620,295.84	5.96
3	601398	工商银行	7,773,377.00	4.82
4	002271	东方雨虹	7,236,629.94	4.48
5	000089	深圳机场	6,719,648.21	4.16
6	002831	裕同科技	6,359,655.20	3.94
7	600062	华润双鹤	6,336,762.55	3.93
8	000999	华润三九	6,316,169.29	3.91
9	300433	蓝思科技	6,120,628.17	3.79
10	300003	乐普医疗	6,012,385.00	3.72
11	603111	康尼机电	5,964,492.78	3.70
12	002456	欧菲光	5,882,641.67	3.64
13	002027	分众传媒	5,719,679.00	3.54
14	601318	中国平安	4,657,886.00	2.89
15	600004	白云机场	3,861,579.00	2.39
16	000429	粤高速 A	3,859,651.66	2.39
17	600377	宁沪高速	2,999,478.00	1.86
18	603968	醋化股份	2,575,332.00	1.60
19	600352	浙江龙盛	2,575,304.00	1.60
20	601006	大秦铁路	2,506,448.00	1.55

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	601398	工商银行	7,892,686.00	4.89
2	300433	蓝思科技	6,042,058.00	3.74
3	000089	深圳机场	4,095,777.00	2.54
4	000895	双汇发展	3,593,805.00	2.23
5	300003	乐普医疗	3,412,909.08	2.11
6	600298	安琪酵母	3,388,434.00	2.10
7	603111	康尼机电	3,371,333.00	2.09
8	002456	欧菲光	3,227,800.50	2.00
9	002027	分众传媒	2,964,061.00	1.84
10	600867	通化东宝	2,541,876.00	1.57
11	601006	大秦铁路	2,501,751.80	1.55
12	600295	鄂尔多斯	1,903,923.27	1.18

13	601933	永辉超市	1,843,318.00	1.14
14	300329	海伦钢琴	1,827,949.16	1.13
15	601008	连云港	1,791,406.00	1.11
16	600246	万通地产	1,787,376.77	1.11
17	600801	华新水泥	1,713,620.00	1.06
18	600331	宏达股份	1,695,596.00	1.05
19	600320	振华重工	1,605,189.00	0.99
20	000897	津滨发展	1,593,469.00	0.99

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

买入股票的成本（成交）总额	290,529,604.20
卖出股票的收入（成交）总额	301,297,873.59

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 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。

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	67,725.83
2	应收证券清算款	655,793.10
3	应收股利	-
4	应收利息	31,897.91
5	应收申购款	80,634.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	836,051.56

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

份额级别	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
广发百发大数据精选混合 A	1,148	36,346.87	1,024,262.91	2.45%	40,701,949.22	97.55%
广发百发大数据精选混合 E	3,526	24,790.98	49,701.79	0.06%	87,363,303.97	99.94%
合计	4,674	27,629.27	1,073,964.70	0.83%	128,065,253.19	99.17%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	广发百发大数据精选混合 A	-	-
	广发百发大数据精选混合 E	693,041.38	0.7928%
	合计	693,041.38	0.5367%

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	份额级别	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	广发百发大数据精选混合 A	0
	广发百发大数据精选混合 E	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发百发大数据精选混合 A	0
	广发百发大数据精选混合 E	0
	合计	0

9 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
基金合同生效日（2015 年 9 月 14 日）基金份额总额	181,853,859.53	315,088,138.48
本报告期期初基金份额总额	53,362,594.46	108,918,863.39
本报告期基金总申购份额	4,828,508.12	12,105,359.54
减：本报告期基金总赎回份额	16,464,890.45	33,611,217.17
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	41,726,212.13	87,413,005.76

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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

吴明芳诉平安银行股份有限公司义乌福田小微企业专营支行财产损害赔偿纠纷一案，我公司系本案第三人。原告认为银行未尽适当推介义务导致投资损失，请求银行赔偿。该案经浙江省义乌市人民法院一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

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和托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	3	590,313,380.78	100.00%	549,764.48	100.00%	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
天风证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	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	602,875.30	100.00%	1,504,400,000.00	100.00%	-	-

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	广发基金管理有限公司关于增加大有期货为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-03-31
2	广发基金管理有限公司关于增加方正证券为旗下部分基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-03-30

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

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：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。

广发基金管理有限公司

二〇一七年八月二十五日