

广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金

2020 年第 3 季度报告

2020 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年十月二十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 10 月 26 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 2020 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	广发百发大数据成长混合
基金主代码	001734
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 11 月 18 日
报告期末基金份额总额	44,410,381.06 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，精选具有较高成长性的股票进行投资，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	本基金业绩比较基准： $50\% \times$ 创业板指数收益率 + $50\% \times$ 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	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发百发大数据成长混合 A	广发百发大数据成长混合 E
下属分级基金的交易代码	001734	001735
报告期末下属分级基金的份额总额	33,906,869.14 份	10,503,511.92 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 (2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 30 日)	
	广发百发大数据成长混合 A	广发百发大数据成长混合 E
1.本期已实现收益	3,861,164.03	1,115,178.77
2.本期利润	1,293,245.10	361,655.67
3.加权平均基金份额本期利润	0.0349	0.0331
4.期末基金资产净值	45,136,685.44	14,009,983.47
5.期末基金份额净值	1.331	1.334

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、广发百发大数据成长混合 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	0.68%	2.11%	2.75%	1.03%	-2.07%	1.08%
过去六个月	26.88%	1.95%	17.21%	0.89%	9.67%	1.06%
过去一年	35.26%	2.07%	29.11%	0.92%	6.15%	1.15%
过去三年	36.79%	1.60%	29.88%	0.87%	6.91%	0.73%
自基金合同生效起至今	33.10%	1.34%	12.00%	0.88%	21.10%	0.46%

2、广发百发大数据成长混合 E:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.68%	2.11%	2.75%	1.03%	-2.07%	1.08%
过去六个月	26.93%	1.95%	17.21%	0.89%	9.72%	1.06%
过去一年	35.29%	2.06%	29.11%	0.92%	6.18%	1.14%
过去三年	36.96%	1.59%	29.88%	0.87%	7.08%	0.72%
自基金合同生效起至今	33.40%	1.34%	12.00%	0.88%	21.40%	0.46%

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成长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 11 月 18 日至 2020 年 9 月 30 日)

1. 广发百发大数据成长混合 A:



2. 广发百发大数据成长混合 E:



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理期限		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；量化 投资部副总 经理	2015- 11-18	-	11 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)、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 25 日至 2016 年 5 月 26 日)、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2015 年 9 月 14 日至 2019 年 8 月 21 日)、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 16 日至 2019 年 8 月 21 日)、广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理(自 2017 年 12 月 11 日至 2020 年 8 月 11 日)。

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关

法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未发生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。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度以来，国内经济基本面继续延续复苏的态势，在企业盈利边际改善和流动性宽松等因素的推动下，A 股估值和风险偏好得以修复，新能源、医药、部分消费和周期细分行业相对强势，在此过程中创业板的弹性高于市场整体，部分行业的估值也站上了历史高位。但伴随北上资金的流出，IPO 提速抽离了市场资金，投资者情绪出现冷却，行情回归震荡。进入 9 月份之后，中美关系的反复和美国大选的临近压制了市场情绪。美国科技股在经历 8 月份的大幅上涨后，9 月回调幅度较大，A 股科技股也继续调整，以茅台为代表的消费板块也出现了调整。

在三季度，本基金行业配置上继续集中在电子、医药、计算机、通信等板块，降低了计算机和通信的持仓，增加了新能源的配置比例，持仓结构上依然以科技成长为主，风格上以高质量和高成长为主。

展望四季度，中国经济整体复苏的趋势没有改变，疫情对中国经济的影响在边际减小，在需求复苏的带动下，企业盈利将进一步修复。同时，国内货币和财政政策短期或难给予市场额外刺激，美国大选等事件也将在四季度成为影响市场的不确定因素，大选前后仍可能发生各类地缘政治事件。基于上述判断，我们预计结构性行情将依然是市场主线，从中长期看，科技成长的大逻辑并没有发生变化，当前市场的悲观预期将会逐步修正。组合配置上，我们将继续优化量化选股模型，自下而上寻找景气度往上的科技成长股。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类基金份额净值增长率为 0.68%，E 类基金份额净值增长率为 0.68%，同期业绩比较基准收益率为 2.75%。

§ 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	55,710,867.41	93.68
	其中：股票	55,710,867.41	93.68
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	3,732,634.24	6.28
7	其他资产	26,714.36	0.04
8	合计	59,470,216.01	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,659,213.67	67.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,420,184.80	17.62
J	金融业	4,829,408.94	8.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	802,060.00	1.36
S	综合	-	-
	合计	55,710,867.41	94.19

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	59,720	3,837,010.00	6.49
2	300274	阳光电源	124,700	3,428,003.00	5.80
3	300059	东方财富	140,520	3,371,074.80	5.70
4	000725	京东方 A	577,000	2,833,070.00	4.79
5	300383	光环新网	120,000	2,683,200.00	4.54
6	000100	TCL 科技	400,000	2,460,000.00	4.16
7	002475	立讯精密	42,419	2,423,397.47	4.10
8	300661	圣邦股份	7,800	2,334,930.00	3.95
9	300124	汇川技术	34,500	1,997,550.00	3.38
10	300394	天孚通信	33,700	1,893,603.00	3.20

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有股指期货。

(2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	23,568.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	398.80
5	应收申购款	2,747.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,714.36

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发百发大数据成长混合A	广发百发大数据成长混合E
本报告期期初基金份额总额	47,570,010.89	12,972,215.88
本报告期基金总申购份额	1,648,775.93	1,777,018.52
减：本报告期基金总赎回份额	15,311,917.68	4,245,722.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	33,906,869.14	10,503,511.92

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，基金管理人不存在运用固有资金（认）申购、赎回或买卖本基金的情况。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1. 中国证监会注册广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
4. 《广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
5. 法律意见书
6. 基金管理人业务资格批件、营业执照
7. 基金托管人业务资格批件、营业执照

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：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
二〇二〇年十月二十八日