

# 广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金

## 2022 年第 2 季度报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年七月二十日

## § 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 2022 年 7 月 18 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 2022 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	广发百发大数据成长混合
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	41,222,799.06 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	50%×创业板指数收益率+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	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	21,956,468.43 份	19,266,330.63 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 (2022 年 4 月 1 日-2022 年 6 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	-2,021,596.83	-1,357,674.51
2.本期利润	-1,695,938.93	-392,712.00
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0761	-0.0226

4.期末基金资产净值	28,507,407.18	25,060,538.18
5.期末基金份额净值	1.298	1.301

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 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	-5.32%	0.78%	3.71%	1.05%	-9.03%	-0.27%
过去六个月	-21.14%	1.21%	-6.58%	1.02%	-14.56%	0.19%
过去一年	-25.45%	1.38%	-6.87%	0.90%	-18.58%	0.48%
过去三年	46.17%	1.75%	50.07%	0.90%	-3.90%	0.85%
过去五年	38.23%	1.56%	46.68%	0.87%	-8.45%	0.69%
自基金合同生效起至今	29.80%	1.42%	24.34%	0.89%	5.46%	0.53%

##### 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	-5.31%	0.77%	3.71%	1.05%	-9.02%	-0.28%
过去六个月	-21.10%	1.20%	-6.58%	1.02%	-14.52%	0.18%
过去一年	-25.40%	1.38%	-6.87%	0.90%	-18.53%	0.48%

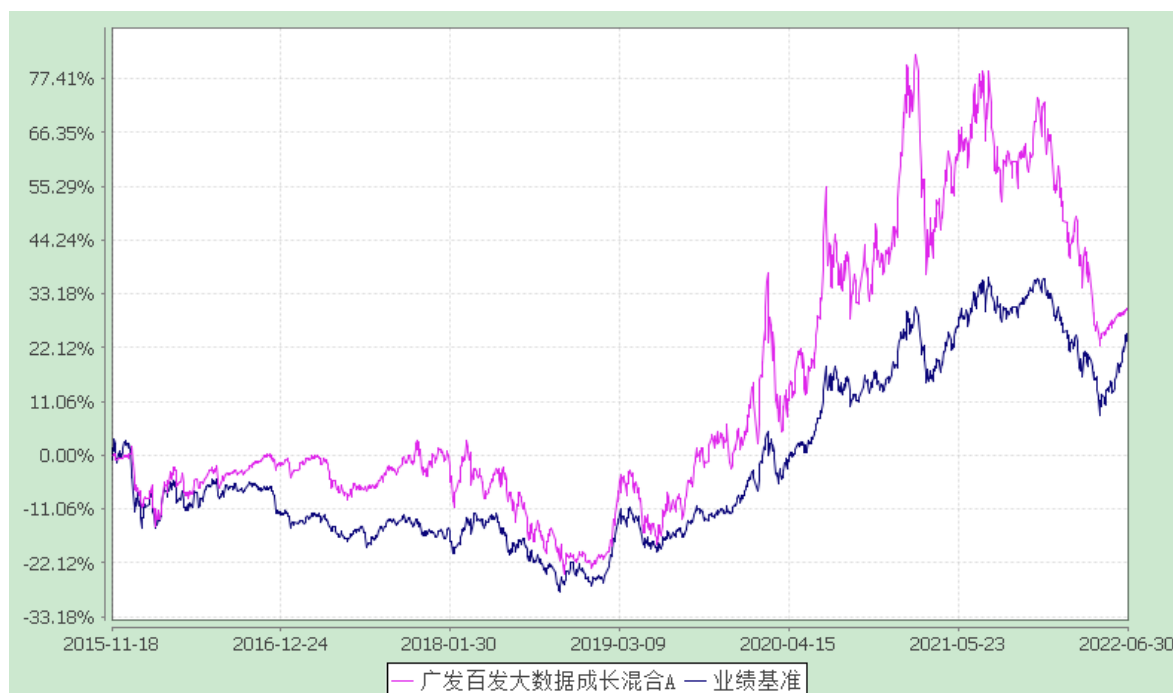
过去三年	46.34%	1.75%	50.07%	0.90%	-3.73%	0.85%
过去五年	38.40%	1.56%	46.68%	0.87%	-8.28%	0.69%
自基金合同生效起至今	30.10%	1.41%	24.34%	0.89%	5.76%	0.52%

### 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 2022 年 6 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		
胡骏	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	2021-12-29	-	7年	胡骏先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司量化投资部研究员。
叶帅	本基金的基金经理；广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)的基金经理；广发美国房的基金经理	2022-04-21	-	6年	叶帅先生，数学博士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾先后任广发基金管理有限公司量化投资部研究员、指数投资部研究员、投资经理。

	地产指数证券投资基金的基金经理；广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发全球医疗保健指数证券投资基金的基金经理；广发粤港澳大湾区创新 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				
--	--	--	--	--	--

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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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 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，本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% 的交易共有 7 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，有关投资经理按规定履行了审批程序。

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

2022 年二季度，A 股市场整体先跌后涨，呈现出右侧长尾的“V”字形走势。市场主要宽基指数中，沪深 300 指数上涨 6.21%，中证 500 指数上涨 2.04%，中证 1000 指数上涨 3.30%，创业板指上涨 5.68%。季度初，市场主要受到了俄乌冲突、美债利率上行、国内疫情的三重压制。从 2 月份开始的俄乌冲突导致了原油、天然气等能源价格大幅飙升并维持高位，部分其他资源品价格也出现较大涨幅；上游价格的上涨一方面使得市场对通胀的担忧愈演愈烈，另一方面也使得中游企业利润受到挤压、下游需求的不确定性增加，从而使得市场对大部分企业盈利状况的担忧加剧。在通胀高企的背景下，美联储加息预期不断上调，美债收益率也大幅上行，对 A 股市场的整体估值形成压制。国内疫情多点散发，对经济也形成了阶段性冲击。在这些不利因素的综合作用下，在季度初，A 股市场先后经历了估值和盈利的打击，整体延续下行趋势。4 月底，随着国内疫情得到有效控制、复工复产稳步推进，市场预期逐步转为乐观，前期超跌的高端制造等板块率先开始反弹；随后铜、铝、铁矿石等上游原材料的价格



进入下跌通道，市场逐步预期中游利润修复、下游需求复苏；同时国内也出台了一系列促进经济发展的政策，进一步增强了市场信心；虽然美债利率仍有向上波动，但是 A 股市场已经基本免疫。综合这些利好因素，4 月底以来 A 股市场整体实现了较大幅度的反弹，其中需求刚性叠加政策刺激的高端制造板块表现最佳。从风格的角度来看，二季度整体上是成长风格跑赢价值风格，背后反映的也是市场对于疫情复苏的乐观预期，以及在反弹阶段风险偏好的逐步提升与不断强化。

报告期内，本基金严格按照既定投资规则操作，积极寻找市场关注度较低、估值较低、公司治理较好或者治理有改善、预期成长性较好的股票，并在市值维度拓宽选股范围，挖掘全市场内符合本基金投资理念、具备较高投资价值的股票。

#### 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-5.32%，E 类基金份额净值增长率为-5.31%，同期业绩比较基准收益率为 3.71%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## § 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	15,548,920.34	28.88
	其中：普通股	15,548,920.34	28.88
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	77,312.09	0.14
	其中：债券	77,312.09	0.14
	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	10,700,000.00	19.87
	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	25,419,945.23	47.22
7	其他资产	2,090,667.22	3.88
8	合计	53,836,844.88	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	7,790,076.40	14.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	514,518.80	0.96
E	建筑业	524,328.00	0.98
F	批发和零售业	348,837.00	0.65
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	4,568,773.14	8.53
J	金融业	-	-
K	房地产业	356,134.00	0.66
L	租赁和商务服务业	354,395.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	181,384.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	534,804.00	1.00
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	172,002.00	0.32
S	综合	203,668.00	0.38
	合计	15,548,920.34	29.03

### 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	600941	中国移动	69,889	4,211,511.14	7.86
2	603889	新澳股份	49,700	314,104.00	0.59
3	002790	瑞尔特	37,100	290,493.00	0.54
4	300818	耐普矿机	6,100	247,416.00	0.46
5	603611	诺力股份	13,700	238,106.00	0.44
6	300504	天邑股份	12,900	229,104.00	0.43
7	002955	鸿合科技	9,500	206,815.00	0.39
8	000551	创元科技	23,600	203,668.00	0.38
9	300801	泰和科技	7,600	197,752.00	0.37
10	603165	荣晟环保	13,100	191,260.00	0.36

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	77,312.09	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	77,312.09	0.14
----	----	-----------	------

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	132026	G 三峡 EB2	390	43,698.16	0.08
2	110086	精工转债	270	33,613.93	0.06

#### 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

##### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-4.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

#### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金本报告期末未持有国债期货。

(2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，山东泰和水处理科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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	23,189.61
2	应收证券清算款	2,050,528.72
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,948.89
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,090,667.22

#### 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	600941	中国移动	4,211,511.14	7.86	新股流通受限

## § 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
报告期期初基金份额总额	22,813,004.12	11,352,068.72
报告期期间基金总申购份额	194,934.06	15,061,612.91
减：报告期期间基金总赎回份额	1,051,469.75	7,147,351.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	21,956,468.43	19,266,330.63

## § 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 [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二二年七月二十日