

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 3 季度报告

2022 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：二〇二二年十月二十六日

§ 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 10 月 24 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 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	40,795,653.36 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	21,521,872.43 份	19,273,780.93 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 7 月 1 日-2022 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	247,986.53	220,483.60
2.本期利润	-918,994.30	-824,574.93
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0424	-0.0428

4.期末基金资产净值	27,024,783.54	24,246,356.60
5.期末基金份额净值	1.256	1.258

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	-3.24%	0.49%	-8.83%	0.73%	5.59%	-0.24%
过去六个月	-8.39%	0.64%	-5.45%	0.90%	-2.94%	-0.26%
过去一年	-21.70%	1.07%	-13.15%	0.85%	-8.55%	0.22%
过去三年	27.64%	1.72%	30.68%	0.90%	-3.04%	0.82%
过去五年	29.09%	1.56%	31.45%	0.88%	-2.36%	0.68%
自基金合同生效起至今	25.60%	1.39%	13.36%	0.88%	12.24%	0.51%

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	-3.31%	0.48%	-8.83%	0.73%	5.52%	-0.25%
过去六个月	-8.44%	0.63%	-5.45%	0.90%	-2.99%	-0.27%
过去一年	-21.72%	1.07%	-13.15%	0.85%	-8.57%	0.22%

过去三年	27.59%	1.72%	30.68%	0.90%	-3.09%	0.82%
过去五年	29.16%	1.56%	31.45%	0.88%	-2.29%	0.68%
自基金合同生效起至今	25.80%	1.39%	13.36%	0.88%	12.44%	0.51%

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 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		
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、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助理(自2021年6月17日至2022年8月24日)。
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；	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。

	广发美国房地 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，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 2 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 年三季度，A 股市场整体出现了较大幅度的回调。主要宽基指数中，沪深 300 指数下跌 15.16%，中证 500 指数下跌 11.47%，中证 1000 指数下跌 12.45%，创业板指下跌 18.56%。

三季度市场呈现出与二季度迥异的走势，这是外在因素与内在因素共同作用的结果。外在因素方面，国内外宏观环境是主要矛盾。从 2 月份开始的俄乌冲突导致了能源、粮食等价格飙升并维持高位，并使国外主要经济体的通胀水平居高不下。美联储为了遏制通胀持续大幅加息，美债收益率随之大幅上行。10 年期美债利率在 6 月底上行到 3.02%，至 9 月底已经飙升至 3.84%。美债利率的快速上行，对 A 股市场的估值形成压制，其中成长股受到的压制更为明显。国内方面，海外经济的不景气使得国内出口增速存在下滑的风险；同时，国内的投资和消费的复苏节奏偏缓，国内经济复苏的斜率偏低，从而引发市场对上市公司盈利的担忧。内在因素方面，部分高景气的

细分赛道经历了二季度的大幅反弹之后，整体交易拥挤度偏高，股价波动加大，在没有增量利好出现的情况下，出现明显的回调。从风格的角度来看，三季度整体上是价值风格跑赢成长风格，背后反映的是市场回调期间资金寻求防御并在低拥挤度的板块里寻找机会。

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-3.24%，E 类基金份额净值增长率为-3.31%，同期业绩比较基准收益率为-8.83%。

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	22,440,791.51	43.53
	其中：普通股	22,440,791.51	43.53
	存托凭证	-	-
2	固定收益投资	83,532.34	0.16
	其中：债券	83,532.34	0.16
	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	10,191,390.33	19.77

	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	18,697,927.08	36.27
7	其他资产	137,097.67	0.27
8	合计	51,550,738.93	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	48,195.00	0.09
B	采矿业	-	-
C	制造业	15,060,894.14	29.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	461,824.00	0.90
E	建筑业	246,855.00	0.48
F	批发和零售业	579,155.00	1.13
G	交通运输、仓储和邮政业	195,789.00	0.38
H	住宿和餐饮业	229,138.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,070,257.37	4.04
J	金融业	103,480.00	0.20
K	房地产业	814,630.00	1.59
L	租赁和商务服务业	1,110,166.00	2.17
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	936,696.00	1.83
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	428,720.00	0.84
S	综合	154,992.00	0.30
	合计	22,440,791.51	43.77

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	15,689	1,072,029.37	2.09
2	002037	保利联合	90,900	1,027,170.00	2.00
3	301102	兆讯传媒	31,600	837,400.00	1.63
4	603517	绝味食品	10,800	541,080.00	1.06
5	603600	永艺股份	48,300	461,265.00	0.90
6	300860	锋尚文化	11,500	428,720.00	0.84
7	605089	味知香	7,600	387,600.00	0.76
8	000407	胜利股份	74,400	362,328.00	0.71
9	605259	绿田机械	9,500	316,350.00	0.62
10	600533	栖霞建设	71,100	302,175.00	0.59

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）	83,532.34	0.16
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	83,532.34	0.16

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	123160	泰福转债	406	40,601.33	0.08
2	110086	精工转债	270	31,618.76	0.06
3	118020	芳源转债	60	6,000.53	0.01
4	118014	高测转债	40	5,311.72	0.01

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	25,123.51

2	应收证券清算款	109,566.30
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,407.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	137,097.67

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
报告期期初基金份额总额	21,956,468.43	19,266,330.63
报告期期间基金总申购份额	84,909.42	423,663.80
减：报告期期间基金总赎回份额	519,505.42	416,213.50
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	21,521,872.43	19,273,780.93

§ 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。

广发基金管理有限公司
二〇二二年十月二十六日