

# 广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券 投资基金

2024 年中期报告

2024 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

送出日期：二〇二四年八月三十日

## 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。本中期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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	58
<b>10 重大事件揭示</b> .....	58
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
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.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	61
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	61
<b>12 备查文件目录</b> .....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## 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成长灵活配置混合型证券投资基金	
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	
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	
报告期末基金份额总额	1,117,116,356.37 份	
基金合同存续期	不定期	
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	484,436,458.62 份	632,679,897.75 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。

### 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	兴业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军
	联系电话	020-83936666
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn
客户服务电话	95105828	95561
传真	020-34281105	021-62159217

注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	福建省福州市台江区江滨中大道398号兴业银行大厦
办公地址	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	上海市浦东新区银城路167号4楼
邮政编码	510308	200120
法定代表人	葛长伟	吕家进

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广东省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	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室

## 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（2024年1月1日至2024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
本期已实现收益	-122,687,139.17	-147,436,367.13
本期利润	-179,338,225.69	-152,568,915.11
加权平均基金份额本期利润	-0.2957	-0.1986
本期加权平均净值利润率	-24.26%	-16.33%
本期基金份额净值增长率	-13.79%	-13.76%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024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
期末可供分配利润	82,037,619.79	108,679,831.79
期末可供分配基金份额利润	0.1693	0.1718
期末基金资产净值	566,474,078.41	741,359,729.54
期末基金份额净值	1.169	1.172
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2024年6月30日)</b>	
	广发百发大数据成长混 合 A	广发百发大数据成长混 合 E
基金份额累计净值增长率	21.70%	22.00%

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）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

广发百发大数据成长混合 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	-4.49%	1.21%	-2.92%	0.55%	-1.57%	0.66%
过去三个月	-3.79%	1.34%	-2.71%	0.66%	-1.08%	0.68%
过去六个月	-13.79%	1.80%	-3.25%	0.80%	-10.54%	1.00%
过去一年	-15.66%	1.36%	-9.44%	0.69%	-6.22%	0.67%
过去三年	-30.10%	1.21%	-23.03%	0.75%	-7.07%	0.46%
自基金合同生效起至今	21.70%	1.35%	2.76%	0.84%	18.94%	0.51%

广发百发大数据成长混合 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	-4.48%	1.22%	-2.92%	0.55%	-1.56%	0.67%
过去三个月	-3.70%	1.34%	-2.71%	0.66%	-0.99%	0.68%
过去六个月	-13.76%	1.80%	-3.25%	0.80%	-10.51%	1.00%
过去一年	-15.62%	1.36%	-9.44%	0.69%	-6.18%	0.67%
过去三年	-30.05%	1.21%	-23.03%	0.75%	-7.02%	0.46%

自基金合同生效起至今	22.00%	1.35%	2.76%	0.84%	19.24%	0.51%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	-------

注：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，由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数每日按照合同规定比例采取再平衡，再用每日连乘的计算方式得到基准指数的时间序列。

### 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成长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 11 月 18 日至 2024 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



#### 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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、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、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、QDII、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

###### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
叶帅	本基金的基金经理	2022-04-21	-	7.5 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、

				<p>广发美国房地产指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 9 月 16 日至 2022 年 11 月 16 日)、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 9 月 16 日至 2022 年 11 月 16 日)、广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 12 月 15 日至 2023 年 1 月 10 日)、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 9 月 16 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金(QDII-LOF)基金经理(自 2021 年 9 月 16 日至 2023 年 2 月 22 日)、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基金经理(自 2021 年 9 月 16 日至 2023 年 9 月 22 日)。</p>
--	--	--	--	--

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 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 14 次，其中 13 次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，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，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 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

2024 年上半年，A 股市场整体经历了较大的波动、结构上分化明显。主要宽基指数中，沪深 300 上涨 0.89%，中证 500 下跌 8.96%，中证 1000 下跌 16.84%，国证 2000 下跌 19.67%。从行业上来看，高股息的防御型行业（例如银行、煤炭、公用事业）延续强势，体现了投资者对于确定性的追逐，并且愿意为之付出远超历史平均水平的溢价。风格上，价值继续大幅跑赢成长、大市值则远好于小市值。

本基金在报告期内围绕“精选具有较高成长性的股票”的目标进行投资，并将选股范围主要锚定在安全边际较高的中小盘池子。从风险规避的角度，我们从去年第三季度开始逐步拓宽了在市值层面的选择范围并注意规避尾部风险，主要原因是我们观察到小盘股尤其是微盘股从去年三季度至今先后经历了推升泡沫化的过度拥挤、短期扰动下的情绪恐慌、恐慌过后的宽幅震荡三个阶段，小市值风格的尾部风险可能在相当一段时间内都需要被谨慎对待，过度暴露小市值敞口可能会使得组合承受与收益不匹配的波动。但是我们并不为因为这个担忧而彻底转向大市值风格投资，即使短期来看大市值风格似乎是市场的共识。我们认为在大部分时候真正的 alpha 都不来自于拥抱“共识”，而是来自于低关注度下的价值发现。

#### 4.4.2 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-13.79%，E 类基金份额净值增长率为-13.76%，同期业绩比较基准收益率为-3.25%。

#### 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 2024 年下半年，宏观经济层面我们并不悲观，国内经济稳中向好是大概率事件，而定价国内经济确定性的交易思路值得重视。从长期的视角来看，我们依然认为中小盘风格投资是值得深耕的领域，并相对看好小盘股在经济复苏阶段的业绩和股价弹性。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、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投资品种的估值数据。

#### 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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 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成长灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	58,803,875.82	120,635,834.93
结算备付金		6,755,604.00	26,758,986.14
存出保证金		387,138.07	682,745.94
交易性金融资产	6.4.7.2	1,248,910,795.32	2,216,108,308.23
其中：股票投资		1,195,539,151.92	2,189,891,490.24

基金投资		-	-
债券投资		53,371,643.40	26,216,817.99
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	28,000,000.00	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		6,603,578.59	4,232,439.29
应收股利		-	-
应收申购款		9,910.42	3,052,041.19
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,349,470,902.22	2,371,470,355.72
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		20,590,616.67	4,684,479.92
应付赎回款		17,347,965.79	4,017,958.26
应付管理人报酬		1,337,026.91	2,347,410.74
应付托管费		111,418.93	195,617.54
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		30.47	26.17
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	2,250,035.50	3,349,530.56
负债合计		41,637,094.27	14,595,023.19
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	1,117,116,356.37	1,736,105,794.52
未分配利润	6.4.7.9	190,717,451.58	620,769,538.01
净资产合计		1,307,833,807.95	2,356,875,332.53
负债和净资产总计		1,349,470,902.22	2,371,470,355.72

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，广发百发大数据成长混合 A 基金份额净值人民币 1.169 元，基金份额总额 484,436,458.62 份；广发百发大数据成长混合 E 基金份额净值人民币 1.172 元，基金份

额总额 632,679,897.75 份；总份额总额 1,117,116,356.37 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-321,046,907.17	124,878,567.51
1.利息收入		378,051.16	1,328,534.20
其中：存款利息收入	6.4.7.10	156,840.93	694,240.94
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		221,210.23	634,293.26
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-260,329,732.29	56,720,892.38
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-280,041,019.79	35,671,968.25
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,866,465.62	1,452,779.26
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	17,844,821.88	19,596,144.87
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.18	-61,783,634.50	65,837,131.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	688,408.46	992,009.86
<b>减：二、营业总支出</b>		10,860,233.63	14,977,943.98
1. 管理人报酬		9,930,546.64	14,039,494.36
2. 托管费		827,545.57	850,878.38
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		10.36	15.89

8. 其他费用	6.4.7.21	102,131.06	87,555.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-331,907,140.80</b>	<b>109,900,623.53</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-331,907,140.80</b>	<b>109,900,623.53</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-331,907,140.80	109,900,623.53

注：比较数据已根据更新发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行重新列示：即将上年度利润表中的“证券出借利息收入”合并于“其他利息收入”中列示。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,736,105,794.52	620,769,538.01	2,356,875,332.53
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,736,105,794.52	620,769,538.01	2,356,875,332.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-618,989,438.15	-430,052,086.43	-1,049,041,524.58
（一）、综合收益总额	-	-331,907,140.80	-331,907,140.80
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-618,989,438.15	-98,144,945.63	-717,134,383.78
其中：1.基金申购款	65,761,459.26	19,800,903.74	85,562,363.00
2.基金赎回款	-684,750,897.41	-117,945,849.37	-802,696,746.78
（三）、本期向基金份额持有人分	-	-	-

配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	1,117,116,356.37	190,717,451.58	1,307,833,807.95
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	694,055,099.39	193,786,749.13	887,841,848.52
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	694,055,099.39	193,786,749.13	887,841,848.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	859,210,928.47	407,567,012.42	1,266,777,940.89
（一）、综合收益总额	-	109,900,623.53	109,900,623.53
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	859,210,928.47	382,071,037.85	1,241,281,966.32
其中：1.基金申购款	1,141,586,022.55	480,047,291.26	1,621,633,313.81
2.基金赎回款	-282,375,094.08	-97,976,253.41	-380,351,347.49
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-84,404,648.96	-84,404,648.96
四、本期期末净资产	1,553,266,027.86	601,353,761.55	2,154,619,789.41

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：葛长伟，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成长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

会（“中国证监会”）证监许可[2015]1549 号《关于准予广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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成长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 11 月 2 日向社会公开发行募集并于 2015 年 11 月 18 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金募集期为 2015 年 11 月 2 日至 2015 年 11 月 13 日，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 672,707,591.90 元，有效认购户数为 16,323 户。其中广发百发大数据成长混合 A 类基金（“A 类基金”）募集资金净额为人民币 550,925,982.95 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 45,721.31 元；广发百发大数据成长混合 E 类基金（“E 类基金”）募集资金净额为人民币 121,730,503.68 元，认购资金在募集期间的利息为人民币 5,383.96 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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

#### (1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

#### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。金融商品转让，按照卖出价扣除买入价后的余额为销售额。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中

发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

### （3）企业所得税

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，暂不征收企业所得税。

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配取得的股息红利所得，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，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### （5）境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	58,803,875.82
等于：本金	58,800,361.91
加：应计利息	3,513.91
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	58,803,875.82

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,288,563,162.12	-	1,195,539,151.92	-93,024,010.20	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	52,724,329.00	701,166.80	53,371,643.40	-53,852.40
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	52,724,329.00	701,166.80	53,371,643.40	-53,852.40
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,341,287,491.12	701,166.80	1,248,910,795.32	-93,077,862.60	

#### 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

**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	28,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	28,000,000.00	-

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 债权投资**

本基金本报告期末无债权投资。

**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 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	13,054.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,141,505.33
其中：交易所市场	2,141,505.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,475.38
合计	2,250,035.50

**6.4.7.8 实收基金**

金额单位：人民币元

广发百发大数据成长混合 A		
项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	889,589,388.05	889,589,388.05
本期申购	37,114,921.53	37,114,921.53

本期赎回（以“-”号填列）	-442,267,850.96	-442,267,850.96
本期末	484,436,458.62	484,436,458.62

金额单位：人民币元

广发百发大数据成长混合 E		
项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	846,516,406.47	846,516,406.47
本期申购	28,646,537.73	28,646,537.73
本期赎回（以“-”号填列）	-242,483,046.45	-242,483,046.45
本期末	632,679,897.75	632,679,897.75

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。

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

广发百发大数据成长混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	542,915,108.53	-226,100,057.18	316,815,051.35
本期期初	542,915,108.53	-226,100,057.18	316,815,051.35
本期利润	-122,687,139.17	-56,651,086.52	-179,338,225.69
本期基金份额交易产生的变动数	-214,954,077.35	159,514,871.48	-55,439,205.87
其中：基金申购款	22,037,019.13	-10,209,998.06	11,827,021.07
基金赎回款	-236,991,096.48	169,724,869.54	-67,266,226.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	205,273,892.01	-123,236,272.22	82,037,619.79

单位：人民币元

广发百发大数据成长混合 E			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	519,526,830.12	-215,572,343.46	303,954,486.66
本期期初	519,526,830.12	-215,572,343.46	303,954,486.66
本期利润	-147,436,367.13	-5,132,547.98	-152,568,915.11
本期基金份额交易产生的变动数	-102,160,999.72	59,455,259.96	-42,705,739.76
其中：基金申购款	16,979,147.85	-9,005,265.18	7,973,882.67
基金赎回款	-119,140,147.57	68,460,525.14	-50,679,622.43
本期已分配利润	-	-	-

本期末	269,929,463.27	-161,249,631.48	108,679,831.79
-----	----------------	-----------------	----------------

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	94,709.52
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	58,208.60
其他	3,922.81
合计	156,840.93

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-280,041,019.79
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-280,041,019.79

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	3,887,354,271.14
减：卖出股票成本总额	4,159,691,305.59
减：交易费用	7,703,985.34
买卖股票差价收入	-280,041,019.79

#### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	432,534.76

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,433,930.86
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,866,465.62

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	19,644,476.41
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,916,678.00
减：应计利息总额	293,661.51
减：交易费用	206.04
买卖债券差价收入	1,433,930.86

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	17,844,821.88
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	17,844,821.88

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

1.交易性金融资产	-61,783,634.50
——股票投资	-60,073,834.97
——债券投资	-1,709,799.53
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-61,783,634.50

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	406,595.61
基金转换费收入	281,812.85
合计	688,408.46

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	35,803.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,331.98
其他	323.70
合计	102,131.06

#### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	738,580,448.56	10.39%	-	-

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	828,222.00	1.60%	-	-

##### 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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	201,000,000.00	8.59%	-	-

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	550,936.42	10.39%	550,936.42	25.73%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

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；

4、自 2024 年 7 月 1 日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月	2023年1月1日至2023年6月

	30日	30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,930,546.64	14,039,494.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	545,955.28	1,133,302.38
应支付基金管理人的净管理费	9,384,591.36	12,906,191.98

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

根据本基金管理人 2023 年 7 月 8 日发布的《关于调低旗下部分基金管理费率及托管费率并修订基金合同等法律文件的公告》，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金的管理费年费率由 1.65% 调整为本费率。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月 30日	2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	827,545.57	850,878.38

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**

**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	广发百发大数据成长混合A	广发百发大数据成长混合E
报告期初持有的基金份额	22,438,294.69	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	22,438,294.69	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总额比例	4.63%	-	-	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

**6.4.10.5.2 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**

**广发百发大数据成长混合 A**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**广发百发大数据成长混合 E**

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.6 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
兴业银行股份有限公司	58,803,875.82	94,709.52	90,526,144.35	168,626.52

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率

计息。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 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（2024 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	受限期	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
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股流通受限	86.96	174.93	175.00	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,287.00	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	新股流通受限	20.56	20.56	1,051.00	21,608.56	21,608.56	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	1,258.00	20,379.60	20,077.68	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	1,045.00	16,396.05	19,635.55	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股流通受限	16.16	32.27	481.00	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	866.00	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股流通受限	55.82	91.24	150.00	5,972.74	13,686.00	-
30156	中仑	2024-0	6 个月	新股	11.88	18.98	711.00	8,446.	13,494	-

5	新材	6-13		流通受限				68	.78	
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	202.00	9,079.90	13,317.86	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股流通受限	26.00	37.49	298.00	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股流通受限	19.86	42.51	247.00	4,905.42	10,499.97	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股流通受限	8.90	16.97	576.00	5,126.40	9,774.72	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新股流通受限	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	219.00	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	306.00	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	222.00	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股流通受限	72.46	68.06	66.00	4,782.36	4,491.96	-

60338 1	永臻 股份	2024-0 6-19	6 个月	新股 流通 受限	23.35	25.13	178.00	4,156. 30	4,473. 14	-
00135 9	平安 电工	2024-0 3-19	6 个月	新股 流通 受限	17.39	20.60	184.00	3,199. 76	3,790. 40	-
60331 2	西典 新能	2024-0 1-04	6 个月	新股 流通 受限	29.02	25.36	130.00	3,772. 60	3,296. 80	-
60308 2	北自 科技	2024-0 1-23	6 个月	新股 流通 受限	21.28	29.49	107.00	2,276. 96	3,155. 43	-
60337 5	盛景 微	2024-0 1-17	6 个月	新股 流通 受限	38.18	38.90	72.00	2,748. 96	2,800. 80	-
00138 7	雪祺 电气	2024-0 1-04	6 个月	新股 流通 受限	15.38	15.25	173.00	2,045. 54	2,638. 25	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股等，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

截至本报告期末 2024 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
00083 6	ST 富 通	2024-06 -18	重大事 项停牌	0.00	-	-	239,000.00	356,982.00	0.00	-

#### 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 2024 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 2024 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，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。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理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，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

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。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	52,538,870.08	20,443,835.56
合计	52,538,870.08	20,443,835.56

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以内的国债、政策性金融债、央行票据、超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	832,773.32	5,772,982.43
未评级	-	-
合计	832,773.32	5,772,982.43

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

### 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，本基金所持大部分投资品种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。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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资产。本基金管理人通过久期、凸性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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	58,803,875.82	-	-	-	58,803,875.82
结算备付金	6,755,604.00	-	-	-	6,755,604.00
存出保证金	387,138.07	-	-	-	387,138.07
交易性金融资产	53,371,643.40	-	-	1,195,539,151.92	1,248,910,795.32
买入返售金融资产	28,000,000.00	-	-	-	28,000,000.00
应收清算款	-	-	-	6,603,578.59	6,603,578.59
应收申购款	-	-	-	9,910.42	9,910.42
资产总计	147,318,261.29	-	-	1,202,152,640.93	1,349,470,902.22
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	20,590,616.67	20,590,616.67
应付赎回款	-	-	-	17,347,965.79	17,347,965.79
应付管理人报酬	-	-	-	1,337,026.91	1,337,026.91
应付托管费	-	-	-	111,418.93	111,418.93
应交税费	-	-	-	30.47	30.47
其他负债	-	-	-	2,250,035.50	2,250,035.50
负债总计	-	-	-	41,637,094.27	41,637,094.27
利率敏感度缺口	147,318,261.29	-	-	1,160,515,546.66	1,307,833,807.95
<b>上年度末 2023年12月31日</b>					
	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	120,635,834.93	-	-	-	120,635,834.93
结算备付金	26,758,986.14	-	-	-	26,758,986.14
存出保证金	682,745.94	-	-	-	682,745.94

交易性金融资产	26,216,817.99	-	-	2,189,891,490.24	2,216,108,308.23
应收清算款	-	-	-	4,232,439.29	4,232,439.29
应收申购款	-	-	-	3,052,041.19	3,052,041.19
资产总计	174,294,385.00	-	-	2,197,175,970.72	2,371,470,355.72
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	4,684,479.92	4,684,479.92
应付赎回款	-	-	-	4,017,958.26	4,017,958.26
应付管理人报酬	-	-	-	2,347,410.74	2,347,410.74
应付托管费	-	-	-	195,617.54	195,617.54
应交税费	-	-	-	26.17	26.17
其他负债	-	-	-	3,349,530.56	3,349,530.56
负债总计	-	-	-	14,595,023.19	14,595,023.19
利率敏感度缺口	174,294,385.00	-	-	2,182,580,947.53	2,356,875,332.53

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
	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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
分析	市场利率上升 25 个基点	-26,662.22	-18,429.27
	市场利率下降 25 个基点	26,725.61	18,468.21

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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，以及标准差、跟踪误差、beta 值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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	1,195,539,151.92	91.41	2,189,891,490.24	92.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	832,773.32	0.06	5,772,982.43	0.24
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	1,196,371,925.24	91.48	2,195,664,472.67	93.16

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上升 5%	37,793,907.01	60,520,618.88
	下降 5%	-37,793,907.01	-60,520,618.88

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末
---------------	-----

	2024 年 6 月 30 日
第一层次	1,196,068,245.86
第二层次	52,584,481.19
第三层次	258,068.27
合计	1,248,910,795.32

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 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	1,195,539,151.92	88.59
	其中：普通股	1,187,256,901.92	87.98
	存托凭证	8,282,250.00	0.61
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	53,371,643.40	3.96
	其中：债券	53,371,643.40	3.96
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	28,000,000.00	2.07
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	65,559,479.82	4.86
8	其他各项资产	7,000,627.08	0.52
9	合计	1,349,470,902.22	100.00

## 7.2 报告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

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	6,908,758.71	0.53
B	采矿业	45,564,751.57	3.48
C	制造业	847,281,118.08	64.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,288,039.62	3.46
E	建筑业	2,922,572.62	0.22
F	批发和零售业	8,008,821.68	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	141,322,092.16	10.81
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,730,556.54	3.50
J	金融业	1,764,969.13	0.13
K	房地产业	2,865,900.00	0.22
L	租赁和商务服务业	3,953,920.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	4,892,550.40	0.37
N	水利、环境和公共设施管理业	27,810,395.81	2.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,299,760.00	0.10
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	9,924,945.60	0.76
S	综合	-	-
	合计	1,195,539,151.92	91.41

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

### 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601021	春秋航空	815,321	45,927,031.93	3.51
2	601111	中国国航	3,977,900	29,356,902.00	2.24
3	603885	吉祥航空	2,189,800	24,065,902.00	1.84
4	600029	南方航空	3,804,700	22,409,683.00	1.71
5	688510	航亚科技	846,300	15,580,383.00	1.19
6	002053	云南能投	1,281,100	15,488,499.00	1.18
7	002322	理工能科	827,098	13,250,109.96	1.01
8	300547	川环科技	807,900	13,209,165.00	1.01
9	300401	花园生物	868,700	12,457,158.00	0.95
10	002463	沪电股份	336,940	12,298,310.00	0.94
11	300181	佐力药业	773,000	11,687,760.00	0.89
12	002130	沃尔核材	818,900	11,562,868.00	0.88
13	603992	松霖科技	566,800	10,423,452.00	0.80
14	600765	中航重机	506,780	10,338,312.00	0.79
15	300627	华测导航	340,800	10,172,880.00	0.78
16	600459	贵研铂业	748,235	10,108,654.85	0.77
17	000887	中鼎股份	814,800	9,973,152.00	0.76
18	002906	华阳集团	371,900	9,952,044.00	0.76
19	000883	湖北能源	1,632,100	9,808,921.00	0.75
20	002371	北方华创	30,600	9,788,634.00	0.75
21	688099	晶晨股份	164,800	9,775,936.00	0.75
22	000423	东阿阿胶	142,700	8,933,020.00	0.68
23	002155	湖南黄金	492,210	8,909,001.00	0.68
24	002126	银轮股份	494,600	8,610,986.00	0.66
25	002380	科远智慧	468,372	8,571,207.60	0.66
26	603579	荣泰健康	550,770	8,514,904.20	0.65
27	300005	探路者	1,691,500	8,474,415.00	0.65
28	688150	莱特光电	436,800	8,473,920.00	0.65
29	605333	沪光股份	298,100	8,302,085.00	0.63
30	689009	九号公司	225,000	8,282,250.00	0.63
31	003006	百亚股份	347,800	8,242,860.00	0.63
32	002835	同为股份	484,500	8,183,205.00	0.63
33	000975	山金国际	481,400	7,842,006.00	0.60
34	301345	涛涛车业	139,340	7,677,634.00	0.59
35	002847	盐津铺子	170,000	7,270,900.00	0.56
36	000544	中原环保	918,700	7,230,169.00	0.55
37	603228	景旺电子	219,100	6,967,380.00	0.53
38	603786	科博达	108,000	6,928,200.00	0.53

39	002475	立讯精密	171,673	6,748,465.63	0.52
40	600115	中国东航	1,676,900	6,724,369.00	0.51
41	300502	新易盛	61,000	6,438,550.00	0.49
42	600183	生益科技	304,900	6,421,194.00	0.49
43	002469	三维化学	1,121,300	6,391,410.00	0.49
44	600968	海油发展	1,547,150	6,374,258.00	0.49
45	300623	捷捷微电	366,700	6,343,910.00	0.49
46	603605	珀莱雅	55,900	6,204,341.00	0.47
47	002139	拓邦股份	580,500	6,164,910.00	0.47
48	605183	确成股份	388,400	6,004,664.00	0.46
49	603309	维力医疗	533,100	5,869,431.00	0.45
50	603889	新澳股份	753,861	5,834,884.14	0.45
51	600323	瀚蓝环境	275,700	5,762,130.00	0.44
52	600872	中炬高新	252,900	5,738,301.00	0.44
53	000598	兴蓉环境	748,600	5,629,472.00	0.43
54	600235	民丰特纸	1,223,266	5,627,023.60	0.43
55	600886	国投电力	307,100	5,601,504.00	0.43
56	301309	万得凯	219,000	5,597,640.00	0.43
57	002595	豪迈科技	146,300	5,584,271.00	0.43
58	002282	博深股份	860,200	5,496,678.00	0.42
59	601168	西部矿业	304,100	5,458,595.00	0.42
60	603699	纽威股份	317,200	5,430,464.00	0.42
61	603355	莱克电气	250,000	5,400,000.00	0.41
62	001209	洪兴股份	389,100	5,369,580.00	0.41
63	600521	华海药业	313,708	5,348,721.40	0.41
64	001206	依依股份	409,300	5,329,086.00	0.41
65	603348	文灿股份	192,100	5,319,249.00	0.41
66	300308	中际旭创	37,240	5,134,651.20	0.39
67	002332	仙琚制药	447,500	5,105,975.00	0.39
68	603277	银都股份	169,500	5,091,780.00	0.39
69	300498	温氏股份	254,100	5,036,262.00	0.39
70	600660	福耀玻璃	104,500	5,005,550.00	0.38
71	603871	嘉友国际	280,332	4,959,073.08	0.38
72	688050	爱博医疗	66,940	4,908,040.80	0.38
73	688517	金冠电气	349,694	4,888,722.12	0.37
74	603722	阿科力	106,800	4,832,700.00	0.37
75	603558	健盛集团	483,500	4,810,825.00	0.37
76	301206	三元生物	194,850	4,789,413.00	0.37
77	603515	欧普照明	271,735	4,711,884.90	0.36
78	002020	京新药业	450,000	4,711,500.00	0.36
79	003023	彩虹集团	293,025	4,673,748.75	0.36
80	605122	四方新材	478,838	4,654,305.36	0.36
81	002083	孚日股份	1,086,906	4,597,612.38	0.35
82	300926	博俊科技	227,634	4,557,232.68	0.35

83	001296	长江材料	318,868	4,543,869.00	0.35
84	603195	公牛集团	58,400	4,503,808.00	0.34
85	603903	中持股份	640,400	4,489,204.00	0.34
86	688307	中润光学	215,200	4,452,488.00	0.34
87	603096	新经典	262,000	4,427,800.00	0.34
88	688616	西力科技	390,400	4,427,136.00	0.34
89	603610	麒盛科技	444,400	4,390,672.00	0.34
90	601899	紫金矿业	246,201	4,325,751.57	0.33
91	002811	郑中设计	641,600	4,273,056.00	0.33
92	603681	永冠新材	334,941	4,270,497.75	0.33
93	688226	威腾电气	243,488	4,256,170.24	0.33
94	688678	福立旺	383,000	4,147,890.00	0.32
95	603897	长城科技	235,500	4,133,025.00	0.32
96	600262	北方股份	247,000	4,058,210.00	0.31
97	000680	山推股份	419,500	3,888,765.00	0.30
98	603507	振江股份	113,900	3,738,198.00	0.29
99	600547	山东黄金	135,400	3,707,252.00	0.28
100	603759	海天股份	619,900	3,676,007.00	0.28
101	300218	安利股份	234,300	3,533,244.00	0.27
102	301299	卓创资讯	81,300	3,414,600.00	0.26
103	301280	珠城科技	86,435	3,353,678.00	0.26
104	688767	博拓生物	133,653	3,350,680.71	0.26
105	605286	同力日升	136,200	3,313,746.00	0.25
106	603165	荣晟环保	311,983	3,313,259.46	0.25
107	600052	东望时代	762,600	3,271,554.00	0.25
108	605155	西大门	354,720	3,245,688.00	0.25
109	688178	万德斯	310,898	3,205,358.38	0.25
110	002161	远望谷	686,400	3,171,168.00	0.24
111	603201	常润股份	129,400	3,131,480.00	0.24
112	603173	福斯达	140,300	3,045,913.00	0.23
113	300422	博世科	639,500	3,044,020.00	0.23
114	300950	德固特	198,600	3,026,664.00	0.23
115	603161	科华控股	200,700	3,004,479.00	0.23
116	003041	真爱美家	245,740	3,000,485.40	0.23
117	000550	江铃汽车	138,100	2,998,151.00	0.23
118	003036	泰坦股份	372,700	2,977,873.00	0.23
119	002887	绿茵生态	457,400	2,977,674.00	0.23
120	603706	东方环宇	202,600	2,968,090.00	0.23
121	002616	长青集团	684,200	2,955,744.00	0.23
122	301276	嘉曼服饰	140,847	2,952,153.12	0.23
123	603321	梅轮电梯	431,700	2,948,511.00	0.23
124	301004	嘉益股份	31,900	2,902,900.00	0.22
125	603298	杭叉集团	147,560	2,898,078.40	0.22
126	603182	嘉华股份	275,000	2,893,000.00	0.22

127	688480	赛恩斯	103,700	2,889,082.00	0.22
128	300868	杰美特	137,700	2,884,815.00	0.22
129	000897	津滨发展	1,398,000	2,865,900.00	0.22
130	300694	蠡湖股份	336,300	2,861,913.00	0.22
131	002448	中原内配	493,000	2,829,820.00	0.22
132	605007	五洲特纸	223,000	2,816,490.00	0.22
133	688028	沃尔德	170,274	2,797,601.82	0.21
134	301187	欧圣电气	112,600	2,730,550.00	0.21
135	601500	通用股份	508,860	2,717,312.40	0.21
136	688592	司南导航	65,111	2,681,270.98	0.21
137	002381	双箭股份	398,000	2,670,580.00	0.20
138	688138	清溢光电	120,900	2,599,350.00	0.20
139	688578	艾力斯	40,700	2,594,218.00	0.20
140	601633	长城汽车	98,600	2,494,580.00	0.19
141	001234	泰慕士	143,500	2,438,065.00	0.19
142	300857	协创数据	42,500	2,422,500.00	0.19
143	603150	万朗磁塑	95,393	2,388,640.72	0.18
144	688253	英诺特	62,070	2,365,487.70	0.18
145	688115	思林杰	99,984	2,357,622.72	0.18
146	688267	中触媒	118,100	2,345,466.00	0.18
147	002752	昇兴股份	456,500	2,309,890.00	0.18
148	001211	双枪科技	151,100	2,302,764.00	0.18
149	300673	佩蒂股份	174,100	2,284,192.00	0.17
150	300864	南大环境	116,200	2,277,520.00	0.17
151	688408	中信博	24,600	2,265,168.00	0.17
152	603051	鹿山新材	102,000	2,226,660.00	0.17
153	688159	有方科技	57,800	2,188,308.00	0.17
154	300750	宁德时代	12,100	2,178,363.00	0.17
155	603059	倍加洁	109,500	2,161,530.00	0.17
156	301105	鸿铭股份	84,700	2,116,653.00	0.16
157	001338	永顺泰	214,300	2,100,140.00	0.16
158	300840	酷特智能	223,900	2,071,075.00	0.16
159	603817	海峡环保	432,581	2,059,085.56	0.16
160	300230	永利股份	608,682	2,045,171.52	0.16
161	600066	宇通客车	79,000	2,038,200.00	0.16
162	300752	隆利科技	146,800	1,993,544.00	0.15
163	300679	电连技术	49,500	1,991,385.00	0.15
164	300566	激智科技	142,000	1,986,580.00	0.15
165	688501	青达环保	144,947	1,982,874.96	0.15
166	600114	东睦股份	137,600	1,980,064.00	0.15
167	600489	中金黄金	131,400	1,944,720.00	0.15
168	002963	豪尔赛	188,253	1,925,828.19	0.15
169	301308	江波龙	20,300	1,923,222.00	0.15
170	002026	山东威达	231,100	1,918,130.00	0.15

171	605128	上海沿浦	68,436	1,908,680.04	0.15
172	688338	赛科希德	87,300	1,890,045.00	0.14
173	688129	东来技术	151,000	1,885,990.00	0.14
174	688610	埃科光电	56,000	1,883,280.00	0.14
175	300783	三只松鼠	82,900	1,813,023.00	0.14
176	603239	浙江仙通	129,800	1,779,558.00	0.14
177	301160	翔楼新材	47,500	1,769,375.00	0.14
178	003000	劲仔食品	145,300	1,750,865.00	0.13
179	603809	豪能股份	212,528	1,717,226.24	0.13
180	688484	南芯科技	46,200	1,714,020.00	0.13
181	000543	皖能电力	192,900	1,707,165.00	0.13
182	688273	麦澜德	86,200	1,706,760.00	0.13
183	300280	紫天科技	110,000	1,676,400.00	0.13
184	002979	雷赛智能	89,600	1,630,720.00	0.12
185	600000	浦发银行	194,400	1,599,912.00	0.12
186	688766	普冉股份	16,380	1,591,644.60	0.12
187	300836	佰奥智能	39,300	1,563,747.00	0.12
188	603530	神马电力	57,000	1,509,930.00	0.12
189	301185	鸥玛软件	104,100	1,491,753.00	0.11
190	603611	诺力股份	85,900	1,463,736.00	0.11
191	002045	国光电器	106,700	1,454,321.00	0.11
192	300976	达瑞电子	31,700	1,453,445.00	0.11
193	688078	龙软科技	63,007	1,451,051.21	0.11
194	601225	陕西煤业	55,900	1,440,543.00	0.11
195	002241	歌尔股份	73,800	1,439,838.00	0.11
196	301222	浙江恒威	57,100	1,413,796.00	0.11
197	600097	开创国际	170,577	1,403,848.71	0.11
198	301026	浩通科技	60,300	1,384,488.00	0.11
199	300100	双林股份	127,800	1,376,406.00	0.11
200	002461	珠江啤酒	183,600	1,362,312.00	0.10
201	301157	华塑科技	41,600	1,356,160.00	0.10
202	300307	慈星股份	225,000	1,338,750.00	0.10
203	300708	聚灿光电	147,300	1,325,700.00	0.10
204	002106	莱宝高科	121,062	1,319,575.80	0.10
205	301127	天源环保	111,500	1,317,930.00	0.10
206	603380	易德龙	65,600	1,317,248.00	0.10
207	301028	东亚机械	149,600	1,311,992.00	0.10
208	000526	学大教育	21,100	1,299,760.00	0.10
209	603088	宁波精达	171,100	1,288,383.00	0.10
210	600285	羚锐制药	52,400	1,268,604.00	0.10
211	605319	无锡振华	71,500	1,265,550.00	0.10
212	002753	永东股份	216,734	1,259,224.54	0.10
213	300049	福瑞股份	24,900	1,253,466.00	0.10
214	300837	浙矿股份	60,000	1,245,600.00	0.10

215	603025	大豪科技	90,000	1,243,800.00	0.10
216	301056	森赫股份	159,900	1,226,433.00	0.09
217	603535	嘉诚国际	75,800	1,223,412.00	0.09
218	002845	同兴达	92,400	1,221,528.00	0.09
219	000600	建投能源	193,200	1,217,160.00	0.09
220	688533	上声电子	47,000	1,215,890.00	0.09
221	301133	金钟股份	55,800	1,215,882.00	0.09
222	002296	辉煌科技	117,400	1,210,394.00	0.09
223	600897	厦门空港	95,000	1,197,950.00	0.09
224	301053	远信工业	60,000	1,197,600.00	0.09
225	603893	瑞芯微	20,200	1,195,234.00	0.09
226	301012	扬电科技	47,700	1,181,052.00	0.09
227	300979	华利集团	19,400	1,180,490.00	0.09
228	605018	长华集团	130,100	1,178,706.00	0.09
229	300872	天阳科技	88,700	1,175,275.00	0.09
230	002674	兴业科技	114,900	1,174,278.00	0.09
231	000758	中色股份	228,700	1,161,796.00	0.09
232	002267	陕天然气	152,300	1,151,388.00	0.09
233	603577	汇金通	165,000	1,145,100.00	0.09
234	603365	水星家纺	72,700	1,137,755.00	0.09
235	600979	广安爱众	338,300	1,136,688.00	0.09
236	603269	海鸥股份	115,720	1,136,370.40	0.09
237	601113	华鼎股份	346,400	1,136,192.00	0.09
238	603408	建霖家居	85,900	1,133,021.00	0.09
239	688289	圣湘生物	64,400	1,132,152.00	0.09
240	002615	哈尔斯	181,300	1,124,060.00	0.09
241	603048	浙江黎明	77,400	1,123,848.00	0.09
242	688607	康众医疗	90,400	1,122,768.00	0.09
243	000990	诚志股份	150,700	1,121,208.00	0.09
244	603112	华翔股份	106,400	1,118,264.00	0.09
245	003003	天元股份	140,000	1,115,800.00	0.09
246	688076	诺泰生物	14,200	1,111,576.00	0.08
247	002919	名臣健康	95,540	1,109,219.40	0.08
248	301062	上海艾录	108,600	1,108,806.00	0.08
249	600727	鲁北化工	174,700	1,100,610.00	0.08
250	603676	卫信康	137,300	1,099,773.00	0.08
251	002098	浔兴股份	195,500	1,098,710.00	0.08
252	300758	七彩化学	102,200	1,098,650.00	0.08
253	000551	创元科技	125,700	1,097,361.00	0.08
254	688768	容知日新	46,700	1,093,247.00	0.08
255	600559	老白干酒	60,100	1,092,618.00	0.08
256	300980	祥源新材	69,300	1,092,168.00	0.08
257	300203	聚光科技	107,900	1,088,711.00	0.08
258	688662	富信科技	44,600	1,088,240.00	0.08

259	300331	苏大维格	67,500	1,085,400.00	0.08
260	301008	宏昌科技	61,260	1,069,599.60	0.08
261	600004	白云机场	112,700	1,068,396.00	0.08
262	002340	格林美	167,600	1,067,612.00	0.08
263	001207	联科科技	73,400	1,065,768.00	0.08
264	603214	爱婴室	93,900	1,060,131.00	0.08
265	300535	达威股份	89,700	1,058,460.00	0.08
266	002981	朝阳科技	57,440	1,051,726.40	0.08
267	300251	光线传媒	124,600	1,047,886.00	0.08
268	600312	平高电气	53,800	1,046,410.00	0.08
269	600784	鲁银投资	219,800	1,041,852.00	0.08
270	300791	仙乐健康	41,340	1,041,768.00	0.08
271	688026	洁特生物	104,400	1,039,824.00	0.08
272	688095	福昕软件	22,600	1,035,306.00	0.08
273	001202	炬申股份	91,300	1,034,429.00	0.08
274	002432	九安医疗	25,500	1,033,770.00	0.08
275	000639	西王食品	434,020	1,032,967.60	0.08
276	000528	柳工	92,300	1,032,837.00	0.08
277	600480	凌云股份	104,300	1,025,269.00	0.08
278	300969	恒帅股份	14,800	1,023,124.00	0.08
279	000921	海信家电	31,400	1,012,336.00	0.08
280	300550	和仁科技	107,100	1,012,095.00	0.08
281	301550	斯菱股份	21,100	1,010,901.00	0.08
282	605555	德昌股份	53,600	997,496.00	0.08
283	688101	三达膜	87,400	994,612.00	0.08
284	301033	迈普医学	25,400	993,394.00	0.08
285	301061	匠心家居	21,060	988,977.60	0.08
286	688234	天岳先进	21,000	985,320.00	0.08
287	002292	奥飞娱乐	164,500	983,710.00	0.08
288	688108	赛诺医疗	108,900	973,566.00	0.07
289	000422	湖北宜化	80,400	958,368.00	0.07
290	000913	钱江摩托	60,300	950,328.00	0.07
291	002273	水晶光电	55,300	938,994.00	0.07
292	000589	贵州轮胎	181,400	919,698.00	0.07
293	300558	贝达药业	27,900	908,145.00	0.07
294	002128	电投能源	42,800	903,080.00	0.07
295	605111	新洁能	29,400	899,346.00	0.07
296	600487	亨通光电	56,300	887,851.00	0.07
297	603296	华勤技术	15,260	842,809.80	0.06
298	300408	三环集团	28,500	831,915.00	0.06
299	300628	亿联网络	22,500	827,325.00	0.06
300	000900	现代投资	225,800	826,428.00	0.06
301	605116	奥锐特	32,700	818,481.00	0.06
302	603337	杰克股份	30,900	813,288.00	0.06

303	301030	仕净科技	32,620	803,104.40	0.06
304	300160	秀强股份	170,800	799,344.00	0.06
305	002897	意华股份	21,200	798,392.00	0.06
306	605499	东鹏饮料	3,700	798,275.00	0.06
307	301498	乖宝宠物	14,800	796,240.00	0.06
308	301106	骏成科技	27,440	788,900.00	0.06
309	002969	嘉美包装	276,500	788,025.00	0.06
310	603193	润本股份	42,800	787,092.00	0.06
311	300233	金城医药	51,700	771,364.00	0.06
312	603733	仙鹤股份	43,800	770,004.00	0.06
313	002965	祥鑫科技	25,090	767,001.30	0.06
314	601808	中海油服	44,500	765,400.00	0.06
315	601866	中远海发	295,600	762,648.00	0.06
316	301082	久盛电气	70,040	758,533.20	0.06
317	603993	洛阳钼业	88,800	754,800.00	0.06
318	688435	英方软件	29,900	746,304.00	0.06
319	300893	松原股份	26,100	745,677.00	0.06
320	000651	格力电器	18,900	741,258.00	0.06
321	300801	泰和科技	47,100	708,855.00	0.05
322	688169	石头科技	1,800	706,680.00	0.05
323	000869	张裕 A	33,000	704,550.00	0.05
324	600420	国药现代	65,000	694,200.00	0.05
325	600916	中国黄金	71,300	685,906.00	0.05
326	002697	红旗连锁	147,800	684,314.00	0.05
327	605305	中际联合	26,460	682,403.40	0.05
328	605488	福莱新材	52,000	676,000.00	0.05
329	603103	横店影视	48,700	674,008.00	0.05
330	001309	德明利	7,720	667,008.00	0.05
331	002608	江苏国信	85,900	665,725.00	0.05
332	000725	京东方 A	162,300	663,807.00	0.05
333	002891	中宠股份	31,700	661,579.00	0.05
334	300953	震裕科技	12,100	655,820.00	0.05
335	603317	天味食品	57,100	651,511.00	0.05
336	000899	赣能股份	67,300	650,791.00	0.05
337	603198	迎驾贡酒	11,200	644,000.00	0.05
338	301291	明阳电气	21,400	643,070.00	0.05
339	688631	莱斯信息	10,300	638,806.00	0.05
340	601969	海南矿业	99,300	629,562.00	0.05
341	002204	大连重工	147,400	629,398.00	0.05
342	600738	丽尚国潮	167,300	613,991.00	0.05
343	688016	心脉医疗	6,258	613,596.90	0.05
344	603590	康辰药业	23,900	610,406.00	0.05
345	601088	中国神华	13,700	607,869.00	0.05
346	688036	传音控股	7,700	589,358.00	0.05

347	002991	甘源食品	9,700	588,305.00	0.04
348	601636	旗滨集团	90,500	583,725.00	0.04
349	002035	华帝股份	92,400	575,652.00	0.04
350	688398	赛特新材	32,647	573,934.26	0.04
351	300724	捷佳伟创	10,400	561,704.00	0.04
352	601600	中国铝业	70,000	534,100.00	0.04
353	688325	赛微微电	16,905	530,309.85	0.04
354	300515	三德科技	53,300	526,071.00	0.04
355	001301	尚太科技	11,800	509,996.00	0.04
356	300860	锋尚文化	23,940	503,697.60	0.04
357	000400	许继电气	14,000	481,740.00	0.04
358	688336	三生国健	23,050	469,067.50	0.04
359	300761	立华股份	20,700	468,648.00	0.04
360	605258	协和电子	14,500	454,720.00	0.03
361	000650	仁和药业	76,100	448,990.00	0.03
362	601699	潞安环能	24,600	445,998.00	0.03
363	301383	天键股份	16,940	442,472.80	0.03
364	688019	安集科技	3,510	441,558.00	0.03
365	601919	中远海控	28,400	439,916.00	0.03
366	002345	潮宏基	91,906	433,796.32	0.03
367	000807	云铝股份	31,200	421,512.00	0.03
368	688061	灿瑞科技	15,274	419,729.52	0.03
369	002984	森麒麟	17,200	414,348.00	0.03
370	300415	伊之密	19,900	413,522.00	0.03
371	000860	顺鑫农业	24,100	403,434.00	0.03
372	600132	重庆啤酒	6,400	388,480.00	0.03
373	601689	拓普集团	7,100	380,631.00	0.03
374	605088	冠盛股份	17,900	373,036.00	0.03
375	002492	恒基达鑫	80,002	368,009.20	0.03
376	301223	中荣股份	25,011	367,911.81	0.03
377	002593	日上集团	114,670	366,944.00	0.03
378	601218	吉鑫科技	130,600	364,374.00	0.03
379	605003	众望布艺	22,688	364,142.40	0.03
380	603658	安图生物	7,900	363,953.00	0.03
381	688426	康为世纪	19,535	363,351.00	0.03
382	688581	安杰思	7,420	363,060.60	0.03
383	002853	皮阿诺	48,400	359,612.00	0.03
384	603711	香飘飘	25,900	358,715.00	0.03
385	300335	迪森股份	92,284	357,139.08	0.03
386	002082	万邦德	83,987	353,585.27	0.03
387	603238	诺邦股份	35,500	353,580.00	0.03
388	601616	广电电气	121,447	353,410.77	0.03
389	600448	华纺股份	179,306	353,232.82	0.03
390	003027	同兴环保	28,700	353,010.00	0.03

391	603856	东宏股份	34,666	352,899.88	0.03
392	603839	安正时尚	80,700	352,659.00	0.03
393	600697	欧亚集团	35,076	352,513.80	0.03
394	002286	保龄宝	63,912	352,155.12	0.03
395	605068	明新旭腾	26,700	351,906.00	0.03
396	003016	欣贺股份	56,158	351,549.08	0.03
397	002910	庄园牧场	56,700	351,540.00	0.03
398	300086	康芝药业	99,800	350,298.00	0.03
399	603095	越剑智能	26,700	350,037.00	0.03
400	603116	红蜻蜓	77,652	349,434.00	0.03
401	301088	戎美股份	31,176	349,171.20	0.03
402	301355	南王科技	36,400	349,076.00	0.03
403	600082	海泰发展	174,103	348,206.00	0.03
404	002486	嘉麟杰	240,100	348,145.00	0.03
405	688613	奥精医疗	27,324	347,834.52	0.03
406	688367	工大高科	28,501	347,712.20	0.03
407	600249	两面针	94,674	347,453.58	0.03
408	000153	丰原药业	64,561	347,338.18	0.03
409	603585	苏利股份	35,561	347,075.36	0.03
410	002852	道道全	48,200	347,040.00	0.03
411	002365	永安药业	47,921	345,989.62	0.03
412	002638	勤上股份	232,108	345,840.92	0.03
413	600527	江南高纤	240,100	345,744.00	0.03
414	301063	海锅股份	24,093	345,493.62	0.03
415	001332	锡装股份	14,503	345,461.46	0.03
416	603797	联泰环保	110,700	345,384.00	0.03
417	603012	创力集团	77,185	344,245.10	0.03
418	605288	凯迪股份	11,116	344,151.36	0.03
419	000626	远大控股	82,771	343,499.65	0.03
420	300692	中环环保	74,176	343,434.88	0.03
421	301235	华康医疗	19,700	341,795.00	0.03
422	603086	先达股份	89,894	341,597.20	0.03
423	603700	宁水集团	36,108	338,693.04	0.03
424	300658	延江股份	80,196	338,427.12	0.03
425	002557	洽洽食品	12,000	338,280.00	0.03
426	688485	九州一轨	43,313	337,841.40	0.03
427	003042	中农联合	28,800	337,248.00	0.03
428	688203	海正生材	39,581	336,438.50	0.03
429	301115	建科股份	24,145	335,132.60	0.03
430	301227	森鹰窗业	17,800	334,818.00	0.03
431	600575	淮河能源	86,012	334,586.68	0.03
432	300420	五洋自控	152,677	334,362.63	0.03
433	003011	海象新材	24,830	332,970.30	0.03
434	600731	湖南海利	71,446	330,080.52	0.03

435	301093	华兰股份	17,126	329,846.76	0.03
436	603538	美诺华	29,517	329,704.89	0.03
437	002661	克明食品	44,089	329,344.83	0.03
438	002809	红墙股份	45,887	329,009.79	0.03
439	605336	帅丰电器	29,182	328,881.14	0.03
440	605287	德才股份	26,094	328,523.46	0.03
441	688069	德林海	24,319	326,847.36	0.02
442	605208	永茂泰	52,456	326,800.88	0.02
443	002722	物产金轮	28,905	326,626.50	0.02
444	301098	金埔园林	43,121	326,425.97	0.02
445	688670	金迪克	27,700	326,306.00	0.02
446	002743	富煌钢构	88,139	325,232.91	0.02
447	688199	久日新材	24,243	324,856.20	0.02
448	002696	百洋股份	82,019	323,975.05	0.02
449	001230	劲旅环境	23,295	323,567.55	0.02
450	300877	金春股份	29,822	323,270.48	0.02
451	688669	聚石化学	28,438	321,918.16	0.02
452	688455	科捷智能	40,089	321,914.67	0.02
453	300599	雄塑科技	64,493	320,530.21	0.02
454	600858	银座股份	81,465	320,157.45	0.02
455	605500	森林包装	52,025	319,953.75	0.02
456	301335	天元宠物	20,116	319,643.24	0.02
457	603937	丽岛新材	41,186	319,603.36	0.02
458	002054	德美化工	64,404	316,223.64	0.02
459	603982	泉峰汽车	39,517	316,136.00	0.02
460	002012	凯恩股份	92,421	315,155.61	0.02
461	688679	通源环境	44,893	312,455.28	0.02
462	603808	歌力思	49,340	312,322.20	0.02
463	002551	尚荣医疗	133,943	312,087.19	0.02
464	688350	富淼科技	27,049	308,629.09	0.02
465	605189	富春染织	28,631	305,206.46	0.02
466	600227	赤天化	261,300	303,108.00	0.02
467	605136	丽人丽妆	54,758	301,716.58	0.02
468	300800	力合科技	29,100	301,476.00	0.02
469	002594	比亚迪	1,200	300,300.00	0.02
470	601857	中国石油	28,500	294,120.00	0.02
471	688265	南模生物	13,645	284,361.80	0.02
472	605016	百龙创园	13,400	272,958.00	0.02
473	688018	乐鑫科技	2,600	256,568.00	0.02
474	002029	七匹狼	40,400	203,616.00	0.02
475	600026	中远海能	10,500	163,905.00	0.01
476	603823	百合花	15,700	151,819.00	0.01
477	600269	赣粤高速	24,358	125,930.86	0.01
478	601827	三峰环境	14,672	124,565.28	0.01

479	601128	常熟银行	16,210	122,709.70	0.01
480	603633	徕木股份	14,840	117,384.40	0.01
481	002635	安洁科技	7,600	117,344.00	0.01
482	002952	亚世光电	5,700	117,135.00	0.01
483	600548	深高速	11,010	117,036.30	0.01
484	600483	福能股份	9,503	110,804.98	0.01
485	600035	楚天高速	25,484	109,326.36	0.01
486	688259	创耀科技	2,704	108,051.84	0.01
487	601107	四川成渝	20,411	107,157.75	0.01
488	688020	方邦股份	3,189	106,385.04	0.01
489	002765	蓝黛科技	22,221	104,438.70	0.01
490	301358	湖南裕能	3,000	94,380.00	0.01
491	688508	芯朋微	2,542	92,452.54	0.01
492	601328	交通银行	5,669	42,347.43	0.00
493	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
494	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
495	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
496	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
497	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
498	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
499	835438	戈碧迦	1,100	14,300.00	0.00
500	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
501	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
502	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
503	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00
504	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
505	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
506	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
507	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
508	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
509	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
510	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
511	603810	丰山集团	857	7,164.52	0.00
512	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
513	603216	梦天家居	693	6,361.74	0.00
514	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
515	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
516	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
517	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
518	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
519	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
520	603661	恒林股份	100	4,221.00	0.00
521	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
522	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00

523	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
524	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
525	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
526	000836	ST 富通	239,000	0.00	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	002381	双箭股份	23,470,670.97	1.00
2	000651	格力电器	22,623,926.75	0.96
3	301301	川宁生物	21,619,540.81	0.92
4	601966	玲珑轮胎	20,110,349.00	0.85
5	300893	松原股份	19,939,026.53	0.85
6	688150	莱特光电	17,756,364.71	0.75
7	000550	江铃汽车	16,923,904.00	0.72
8	300547	川环科技	16,836,056.60	0.71
9	002475	立讯精密	16,794,509.35	0.71
10	002053	云南能投	16,616,102.61	0.71
11	688510	航亚科技	16,076,920.96	0.68
12	688036	传音控股	14,643,510.49	0.62
13	603579	荣泰健康	13,798,198.50	0.59
14	601702	华峰铝业	13,012,174.00	0.55
15	002859	洁美科技	12,456,660.00	0.53
16	605098	行动教育	12,390,255.80	0.53
17	002322	理工能科	12,318,320.00	0.52
18	300181	佐力药业	12,198,445.00	0.52
19	001296	长江材料	11,874,693.70	0.50
20	688090	瑞松科技	11,643,806.20	0.49

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	301301	川宁生物	35,571,835.75	1.51
2	600519	贵州茅台	27,014,482.06	1.15
3	000651	格力电器	23,462,923.60	1.00
4	300893	松原股份	22,245,188.18	0.94
5	002381	双箭股份	21,695,346.96	0.92
6	601966	玲珑轮胎	19,784,789.00	0.84
7	002615	哈尔斯	15,895,482.38	0.67
8	600919	江苏银行	15,753,391.00	0.67
9	601702	华峰铝业	15,619,240.47	0.66
10	605098	行动教育	15,100,858.50	0.64
11	301026	浩通科技	14,469,781.64	0.61
12	601137	博威合金	14,296,004.00	0.61
13	300501	海顺新材	14,266,021.00	0.61
14	002521	齐峰新材	14,190,991.28	0.60
15	601318	中国平安	13,909,219.00	0.59
16	603365	水星家纺	13,900,060.59	0.59
17	002753	永东股份	13,611,031.25	0.58
18	300740	水羊股份	13,550,278.50	0.57
19	300889	爱克股份	12,744,464.25	0.54
20	000550	江铃汽车	12,730,542.00	0.54

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,225,412,802.24
卖出股票收入（成交）总额	3,887,354,271.14

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	52,538,870.08	4.02
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）	832,773.32	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	53,371,643.40	4.08

**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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019709	23 国债 16	394,000	40,015,233.70	3.06
2	019733	24 国债 02	104,000	10,516,799.12	0.80
3	019740	24 国债 09	20,000	2,006,837.26	0.15
4	123198	金埔转债	9,810	832,773.32	0.06

**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 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金本报告期末投资股指期货。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

**7.11.2 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末投资国债期货。

**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中，中国南方航空股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国民用航空局的处罚。

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。

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	387,138.07
2	应收清算款	6,603,578.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	9,910.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,000,627.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123198	金埔转债	832,773.32	0.06

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
广发百发大数据成长混合 A	1,770	273,692.91	456,990,973.06	94.33%	27,445,485.56	5.67%
广发百发大数据成长混合 E	1,294	488,933.46	617,222,037.04	97.56%	15,457,860.71	2.44%
合计	3,064	364,594.11	1,074,213,010.10	96.16%	42,903,346.27	3.84%

### 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	广发百发大数据成长混合 A	351,271.46	0.0725%
	广发百发大数据成长混合 E	2,172,640.34	0.3434%
	合计	2,523,911.80	0.2259%

### 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	广发百发大数据成长混合 A	0
	广发百发大数据成长混合 E	>100
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发百发大数据成长混合 A	0
	广发百发大数据成长混合 E	0~10
	合计	0~10

## 9 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
基金合同生效日（2015 年 11 月 18 日）基金份额总额	550,971,704.26	121,735,887.64
本报告期期初基金份额总额	889,589,388.05	846,516,406.47
本报告期基金总申购份额	37,114,921.53	28,646,537.73
减：本报告期基金总赎回份额	442,267,850.96	242,483,046.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	484,436,458.62	632,679,897.75

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金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

本基金管理人于 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 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	
国泰君安	2	2,284,607,840.24	32.13%	1,704,112.90	32.13%	-
中信建投证券	2	786,167,319.09	11.06%	586,398.91	11.06%	-
中信证券	4	780,459,977.83	10.98%	582,307.18	10.98%	-
广发证券	2	738,580,448.56	10.39%	550,936.42	10.39%	-
中泰证券	1	587,499,322.28	8.26%	438,212.02	8.26%	-
东吴证券	2	574,369,514.13	8.08%	428,419.29	8.08%	-
国投证券	4	542,048,355.19	7.62%	404,316.25	7.62%	-
民生证券	2	540,201,125.72	7.60%	402,932.62	7.60%	-
信达证券	2	276,881,439.12	3.89%	206,527.85	3.89%	-
海通证券	1	102,180.00	0.00%	84.31	0.00%	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
中国银河	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (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、交易单元选择流程：

(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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
国泰君安	12,678,225.06	24.48%	611,000,000.00	26.11%	-	-
中信建投证券	119.95	0.00%	28,000,000.00	1.20%	-	-
中信证券	1,999,732.60	3.86%	162,000,000.00	6.92%	-	-
广发证券	828,222.00	1.60%	201,000,000.00	8.59%	-	-
中泰证券	28,002,535.10	54.06%	345,000,000.00	14.75%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	544,000.00	1.05%	809,700,000.00	34.61%	-	-
民生证券	-	-	105,000,000.00	4.49%	-	-
信达证券	7,746,548.05	14.95%	78,000,000.00	3.33%	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

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旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240416-20240630	258,798,119.04	-	-	258,798,119.04	23.17%
	2	20240101-20240630	418,366,697.30	7,423,245.73	19,475,851.24	406,314,091.79	36.37%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

## 12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 12.3 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

二〇二四年八月三十日