

# 广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券 投资基金

## 2016 年半年度报告

### 2016 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：二〇一六年八月二十六日

## 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 8 月 23 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 2016 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	6
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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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	14
<b>5 托管人报告</b>	<b>15</b>
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真实、准确和完整发表意见	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
6.4 报表附注	23
<b>7 投资组合报告</b>	<b>46</b>
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	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>	<b>56</b>

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.....	56
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.....	56
9	<b>开放式基金份额变动</b> .....	57
10	<b>重大事件揭示</b> .....	57
10.1	基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
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	报告期内改聘会计师事务所情况.....	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.....	58
10.8	其他重大事件.....	59
11	<b>备查文件目录</b> .....	60
11.1	备查文件目录.....	60
11.2	存放地点.....	60
11.3	查阅方式.....	61

## 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	
交易代码	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	550,673,634.14 份	
基金合同存续期	不定期	
下属二级基金的基金简称	广发百发大数据成长混合 A	广发百发大数据成长混合 E
下属二级基金的交易代码	001734	001735
报告期末下属分级基金的份额总额	470,773,075.38 份	79,900,558.76 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	<p>(一) 资产配置策略，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。</p> <p>(二) 股票投资策略，本基金充分利用百度公司互联网行为大数据，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，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</p>
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。

## 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	段西军	张志永
	联系电话	020-83936666	021-62677777-212004
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		95105828, 020-83936999	95561
传真		020-89899158	021-62159217
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	福建省福州市湖东路154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	上海市江宁路168号兴业大厦 20楼
邮政编码		510308	200041
法定代表人		孙树明	高建平

## 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	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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（2016年1月1日至2016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	-34,918,099.28	-7,351,874.11
本期利润	-27,571,871.65	-6,723,467.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0543	-0.0718
本期加权平均净值利润率	-5.82%	-7.70%
本期基金份额净值增长率	-4.69%	-4.59%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2016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
期末可供分配利润	-29,293,182.88	-4,904,866.49
期末可供分配基金份额利润	-0.0622	-0.0614
期末基金资产净值	449,454,519.89	76,352,283.79
期末基金份额净值	0.955	0.956
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2016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	-4.50%	-4.40%

注：（1）上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	1.81%	0.56%	1.93%	0.98%	-0.12%	-0.42%
过去三个月	0.84%	0.87%	-0.05%	0.99%	0.89%	-0.12%
过去六个月	-4.69%	1.25%	-8.14%	1.42%	3.45%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-4.50%	1.12%	-7.22%	1.35%	2.72%	-0.23%

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	1.81%	0.56%	1.93%	0.98%	-0.12%	-0.42%
过去三个月	0.84%	0.87%	-0.05%	0.99%	0.89%	-0.12%

过去六个月	-4.59%	1.24%	-8.14%	1.42%	3.55%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-4.40%	1.11%	-7.22%	1.35%	2.82%	-0.24%

(1) 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。

(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 2016 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



注：（1）本基金合同生效日期为 2015 年 11 月 18 日，至披露时点本基金成立未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

## 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、社保基金境内投资管理人、受托管理保险资金投资管理人、合格境内机构投资者境外证券投资管理（QDII）和特定客户资产管理等业务资格。

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 25 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、另类投资部、数据策略投资部、国际业务部、产品营销管理部、机构理财部、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，还出资设立了广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、瑞元资本管理有限公司，参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金管理人管理九十八只开放式基金——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、广发聚康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，管理资产规模为 2341 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合和社保基金投资组合。

#### 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；广发百发大数据精选混合基金的基金经理；数据策略投资部副总经理	2015-11-18	-	7 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

					<p>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。</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成长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，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

自年初熔断触发的暴跌以来，2016 年上半年市场整体表现疲弱，“V”字震荡整理的走势贯穿了一二季度。在预期不明朗的盘整阶段，市场行情多以存量博弈为主，热点板块此起彼伏，风格切换鲜明利落，捕捉阶段收益的难度在不断增加。

回顾上半年，大数据选股模型凭借对热点主题的跟踪布局，顺利完成了样本风格的切换——一季度中主要倚重计算机、机械、电子等行业，成长风格居多，而二季度上述行业逐步转移至化工、汽车、食品饮料、有色金属等行业均衡分布，紧贴周期品、消费升级等主题，也体现了市场风险偏好的调整态势。

组合在一季度基本保持较为保守的低仓位水平运作，规避风险，并伴随市场 3 月份展开反弹而逐步提升仓位。同时，考虑到成长风格股票的弹性特点，组合重点关注仓位的动态调整，在市场热点表现疲弱时及时止盈，锁定波段利润。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发百发大数据成长混合基金 A 类净值增长率为-4.69%，E 类净值增长率为-4.59%，同期业绩比较基准收益率为-8.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

现阶段，国内宏观经济探底企稳仍需以时间置换空间，难以一蹴而就。市场对流动性、汇率以及国际环境等因素预期逐渐趋于相对稳定，下半年重点在于把握局部行情与结构性机会。

流动性方面，2014 年 11 月以来，央行实行了 6 次降息，更进一步的宽松空间有限。目前，货币政策的态度已由积极刺激转为稳健审慎。汇率方面，去年汇改以来人民币币值波动率陡升，经受了急剧走弱的压力。随着英国脱欧等事件的演进，各个经济体的不稳定因素也逐渐上浮，市场也重新调整了人民币贬值预期，股票市场也逐步脱敏。国际环境方面，局部的不稳定因素以及美国经济复苏步伐的疑虑，对美联储加息计划形成了掣肘，为风险资产的局部趋势预留了空间。

预期不明朗、情绪敏感、信心脆弱等修复阶段的市场特征，反映到行情模式中往往表现为急涨急跌，窄幅震荡，热点切换快速频繁。年初至今的多次震荡整理，上方累积的前期压力也在逐步消

融，当具备相对稳定的环境、持续走强的热点以及渐显明朗的预期等因素，局部的趋势性机会也是可以期待的。但是，在存量模式行情中，重点仍在于通过大数据选股模型紧跟热点主题与风格切换，优选标的，争取把握贯穿整理阶段的结构性的机会。

组合目前以较为合理的仓位水平迎接下半年行情，一方面凭借大数据选股模型紧跟市场热点与潜力题材，另一方面根据市场具体环境调整仓位及组合整体风格，争取更好地平衡风险与收益，同时辅以申购新股、现金管理等多样方式增厚收益。

#### 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及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

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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：2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016 年 6 月 30 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	240,456,877.73	668,319,979.34
结算备付金		10,714,791.28	908,948.73
存出保证金		936,597.09	40,119.86
交易性金融资产	6.4.7.2	174,859,022.85	5,936,983.99
其中：股票投资		174,859,022.85	5,930,983.99
基金投资		-	-

债券投资		-	6,000.00
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		105,224,948.47	-
应收利息	6.4.7.5	155,087.10	241,101.43
应收股利		-	-
应收申购款		6,896.17	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		532,354,220.69	675,447,133.35
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>	<b>上年度末 2015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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,663,153.11	-
应付管理人报酬		720,373.45	938,284.79
应付托管费		43,658.98	56,865.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	937,636.37	357,882.27
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	182,595.10	37,500.00
负债合计		6,547,417.01	1,390,532.81
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	550,673,634.14	672,707,591.90
未分配利润	6.4.7.1 0	-24,866,830.46	1,349,008.64
所有者权益合计		525,806,803.68	674,056,600.54
负债和所有者权益总计		532,354,220.69	675,447,133.35

注：报告截止日 2016 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 0.955 元，基金份额总额 470,773,075.38 份；广发百发大数据成长混合 E 基金份额净值人民币 0.956 元，基金份额总额 79,900,558.76 份；总份额总额 550,673,634.14 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	上年度可比期间 {shangNianDuKeBiQiJian_t-1} {word_merge}
一、收入		{cfid-pt_ShouRuJinE_t-2#merge}
1. 利息收入		{cfid-pt_LiXiShouRu_t-2#merge}

其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	{cfid-pt_CunKuanLiXiShouRu_t-2#merge}
债券利息收入		{cfid-pt_ZhaiQuanLiXiShouRu_t-2#merge}
资产支持证券利息收入		{cfid-pt_ZiChanZhiChiZhengQuanLiXiShouRu_t-2#merge}
买入返售金融资产收入		{cfid-pt_MaiRuFanShouJinRongZiChanShouRu_t-2#merge}
其他利息收入		{cfid-pt_QiTaLiXiShouRu_t-2#merge}
2. 投资收益（损失以“-”填列）		{cfid-pt_TouZiShouYi_t-2#merge}

其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	{cfid-pt_GuPiaoTouZiShouYi_t-2#merge}
基金投资收益		{cfid-pt_JiJinTouZiShouYi_t-2#merge}
债券投资收益	6.4.7.1 3	{cfid-pt_ZhaiQuanTouZiShouYi_t-2#merge}
资产支持证券投资收益		{cfid-pt_ZiChanZhiChiZhengQuanTouZiShouYi_t-2#merge}
贵金属投资收益		{cfid-pt_GuiJinShuTouZiShouYi_t-2#merge}
衍生工具收益	6.4.7.1 4	{cfid-pt_YanShengGongJuShouYi_t-2#merge}
股利收益	6.4.7.1 5	{cfid-pt_GuLiShouYi_t-2#merge}

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	{cfid-pt_GongYunJiaZhiBianDongSunYi_t-2#merge}
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		{cfid-pt_HuiDuiShouYi_t-2#merge}
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	{cfid-pt_QiTaShouRu_t-2#merge}
<b>减：二、费用</b>		
		{cfid-pt_FeiYongJinE_t-2#merge}
1. 管理人报酬		{cfid-pt_GuanLiRenBaoChou_t-2#merge}

2. 托管费		{cfid-pt_TuoGuanFei_t-2#merge}
3. 销售服务费		{cfid-pt_XiaoShouFuWuFei_t-2#merge}
4. 交易费用	6.4.7.1 8	{cfid-pt_JiaoYiFeiYong_t-2#merge}
5. 利息支出		{cfid-pt_LiXiZhiChu_t-2#merge}
其中：卖出回购金融资产支出		{cfid-pt_MaiChuHuiGouJinRongZiChanZhiChu_t-2#merge}
6. 其他费用	6.4.7.1 9	{cfid-pt_QiTaFeiYong_t-2#merge}
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		{cfid-pt_LiRunZongE_t-2#merge}

减：所得税费用		{cfid-pt_SuoDeShuiFeiYong_t-2#merge}
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		
		{cfid-pt_JingLiRun_t-2#merge}

### 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成长灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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）	672,707,591.90	1,349,008.64	674,056,600.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-34,295,338.66	-34,295,338.66
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）	-122,033,957.76	8,079,499.56	-113,954,458.20
其中：1. 基金申购款	8,149,704.59	-594,964.40	7,554,740.19

2. 基金赎回款	-130,183,662.35	8,674,463.96	-121,509,198.39
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）	550,673,634.14	-24,866,830.46	525,806,803.68

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（“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》、《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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的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)。本基金业绩比较基准=50%×创业板指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

本基金的财务报表于 2016 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及相关规定(以下简称“企业会计准则”)及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 2016 年 6 月 30 日的财务状况以及 2016 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### 1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资和衍生工具投资(主要为权证投资)等,其中股票投资和债券投资在资产负债表中作为交易性金融资产列报,衍生工具投资在资产负债表中作为衍生金融资产列报。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

###### 2. 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求,本基金将持有的金融负债在初始确认时全部划分为其他金融负债。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该等金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益；应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一的金融资产，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。

##### 1. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

###### (1) 股票投资

买入股票于交易日按股票的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价，于股权分置实施复牌日冲减股票投资成本；股票持有期间获得的股票股利(包括送红股和公积金转增股本)以及因股权分置改革而获得的股票，于除息日按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。卖出股票按移动加权平均法结转成本。

###### (2) 债券投资

买入债券于交易日按债券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券，于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊，确定应归属于债券部分的成本。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

卖出债券于交易日确认债券投资收益。卖出债券按移动加权平均法结转成本。

###### (3) 权证投资

买入权证于交易日按公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益。

获赠的权证(包括配股权证),在除权日按照持有的股数及获赠比例,计算确定增加的权证数量,成本为零。

配售及认购新发行的分离交易可转换债券而取得的权证,于实际取得日按照估值方法对分离交易可转换债券的认购成本进行分摊,确定应归属于权证部分的成本。

卖出权证于交易日确认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

## 2. 贷款及应收款项

### 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始确认金额。买入返售金融资产于返售日按账面余额结转。

## 3. 其他金融负债

### 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

卖出回购金融资产款于交易日按照应收或实际收到的金额入账,相关交易费用计入初始确认金额。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

## 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

1. 对存在活跃市场的投资品种,如估值日有市价的,采用市价确定公允价值;估值日无市价,且最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,采用最近交易市价确定公允价值。

2. 对存在活跃市场的投资品种,如估值日无市价,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时,应参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价,确定公允价值。

3. 当投资品种不再存在活跃市场,且其潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上或基金管理人估值委员会认为必要时,应采用市场参与者普遍认同,且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术,确定投资品种的公允价值。

4 对于交易所市场和银行间市场交易的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),采用第三方估值机构所提供的估值确定公允价值,另有规定的除外。

具体投资品种的估值方法如下：

#### (1) 股票投资

交易所上市流通的股票以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价为公允价值。

本基金对于长期停牌股票的期末估值参照中国证监会 2008 年 9 月 12 日发布的证监会公告 [2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》规定，若长期停牌股票的潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，经基金管理人估值委员会同意，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素(如指数收益法)，调整最近交易市价，确定公允价值。

由于上市公司送股、转增股、配股和公开增发新股等形成的流通暂时受限制的股票投资，按交易所上市的另一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

首次公开发行但未上市股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本计量。首次公开发行有明确锁定期的股票，于同一股票上市后按交易所上市的另一股票的市场交易收盘价作为公允价值。

非公开发行有明确锁定期的股票，若在证券交易所上市的另一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票初始投资成本，以估值日证券交易所上市的另一股票的市场交易收盘价为公允价值；若在证券交易所上市的另一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票初始投资成本，按中国证监会相关规定处理。

#### (2) 债券投资

银行间和交易所市场上市交易的债券(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，采用第三方估值机构(中央国债登记结算公司或中证指数有限公司)提供的估值净价确定公允价值。

交易所市场上市交易的可转换债券按估值日收盘价减去收盘价中所含债券应收利息后的净价作为公允价值。

未上市或未挂牌转让的债券、以及在交易所市场挂牌转让的资产支持证券和私募债券按成本估值。

#### (3) 权证投资

交易所上市流通的权证以其估值日在证券交易所上市的收盘价为公允价值。

首次公开发行但尚未上市的权证在上市交易前，采用估值技术确定公允价值，如估值技术难以可靠计量，则以成本计量。

配售及认购分离交易可转换债券所获得的权证自实际取得日至在交易所上市交易前，采用估值技术确定公允价值。如估值技术难以可靠计量，则按成本计量。

因持有股票而享有的配股权，以及停止交易但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后确定最能反映公允价值的价格。

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次的输入值确定公允价值计量层次。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次输入值是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。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。申购、赎回、转换及红利再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回、转入、转出及红利再投资等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配(未分配利润)已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配(未分配利润)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### 1. 利息收入

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

(2) 除贴息债外的债券利息收入在持有债券期内，按债券的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认债券利息收入。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含利率后，逐日确认债券利息收入。

(3) 买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

## 2. 投资收益

(1) 股票投资收益于交易日按卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本的差额确认。

(2) 债券投资收益于交易日按卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认。

(3) 衍生工具投资收益于交易日按交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本后的差额确认。

(4) 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

## 3. 公允价值变动收益

公允价值变动收益于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产/负债的公允价值变动形成的利得或损失确认，并于相关金融资产/负债卖出或到期时转出计入投资收益。

### 6.4.4.10 费用的确认和计量

1. 本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 $\times 1.65\%$ 的年费率逐日计提。

2. 本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 $\times 0.10\%$ 的年费率逐日计提。

3. 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的交易费用发生时按照确定的金额计入交易费用。

4. 卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息支出。

### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 6.4.4.12 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 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[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不缴纳营业税。
2. 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、债券免征营业税和增值税。
3. 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。
4. 对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴个人所得税，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，其中股权登记日在2015年9月8日之前的，暂减按25%计入应纳税所得额，股权登记日在2015年9月8日之后的，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。
5. 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。

6. 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。

7. 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，暂免予缴纳印花税、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 2016 年 6 月 30 日
活期存款	240,456,877.73
定期存款	-
其他存款	-
合计	240,456,877.73

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	166,896,700.96	174,859,022.85	7,962,321.89
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	166,896,700.96	174,859,022.85	7,962,321.89

##### 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
----	-----

	2016 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	152,268.90
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	421.50
应收结算备付金利息	2,396.70
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	155,087.10

#### 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 2016 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	937,636.37
银行间市场应付交易费用	-
合计	937,636.37

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,579.90
预提费用	179,015.20
合计	182,595.10

#### 6.4.7.9 实收基金

广发百发大数据成长混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	550,971,704.26	550,971,704.26
本期申购	3,511,307.59	3,511,307.59
本期赎回（以“-”号填列）	-83,709,936.47	-83,709,936.47

本期末	470,773,075.38	470,773,075.38
-----	----------------	----------------

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

广发百发大数据成长混合 E

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	121,735,887.64	121,735,887.64
本期申购	4,638,397.00	4,638,397.00
本期赎回（以“-”号填列）	-46,473,725.88	-46,473,725.88
本期末	79,900,558.76	79,900,558.76

注：本期申购含转换转入份(金)额，本期赎回含转换转出份(金)额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

广发百发大数据成长混合 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	1,114,971.21	-10,084.67	1,104,886.54
本期利润	-34,918,099.28	7,346,227.63	-27,571,871.65
本期基金份额交易产生的变动数	4,509,945.19	638,484.43	5,148,429.62
其中：基金申购款	-240,663.66	-22,598.14	-263,261.80
基金赎回款	4,750,608.85	661,082.57	5,411,691.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-29,293,182.88	7,974,627.39	-21,318,555.49

广发百发大数据成长混合 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	246,350.27	-2,228.17	244,122.10
本期利润	-7,351,874.11	628,407.10	-6,723,467.01
本期基金份额交易产生的变动数	2,200,657.35	730,412.59	2,931,069.94
其中：基金申购款	-296,273.20	-35,429.40	-331,702.60
基金赎回款	2,496,930.55	765,841.99	3,262,772.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,904,866.49	1,356,591.52	-3,548,274.97

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,527,792.01
定期存款利息收入	118,650.00
其他存款利息收入	6,441.69
结算备付金利息收入	57,459.39
其他	-
合计	2,710,343.09

#### 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,062,147,129.92
减：卖出股票成本总额	1,100,389,260.68
买卖股票差价收入	-38,242,130.76

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	252,398.91
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	204,000.00
减：应收利息总额	22.55
买卖债券差价收入	48,376.36

#### 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 2016年1月1日至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	663,023.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	663,023.65

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	7,974,634.73
——股票投资	7,974,634.73
——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	7,974,634.73

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	223,893.43
手续费返还	-
基金转换费收入	89,327.41
印花税返还	-
其他	13,500.00
合计	326,720.84

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	2,773,355.49
银行间市场交易费用	-
期货交易费用	-
合计	2,773,355.49

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	149,179.94
银行汇划费	3,034.51
合计	182,049.71

#### 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
兴业银行股份有限公司	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	广发证券股份有限公司

**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**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。

**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	上年度可比期间
	{shangNianDuKeBiQiJian_t-1} {word_merge}

当期发生的基金应支付的管理费	{cfid-pt_DangQiYingZhiFuDeGuanLiFei_t-2#merge}
其中：支付销售机构的客户维护费	{cfid-pt_YingZhiFuGeiXiaoShouJiGouDeKeHuWeiHuFei_t-2#merge}

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	上年度可比期间 {shangNianDuKeBiQiJian_t-1} {word_merge}
----	---

<p>当期发生的基金应支付的托管费</p>	<p>{cfid-pt_DangQiYingZhiFuDeTuoGuanFei_t-2#merge}</p>

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 广发百发大数据成长混合 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。

### 广发百发大数据成长混合 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	240,456,877.73	2,646,442.01

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（2016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
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股流通受限	5.80	5.80	971.00	5,631.80	5,631.80	-
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股流通受限	8.49	8.49	1,602.00	13,600.98	13,600.98	-
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股流通受限	12.98	12.98	4,383.00	56,891.34	56,891.34	-

注：截至本报告期末 2016 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	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-----	----------	--------	--------	----

						盘单 价					
000710	天兴仪表	2016-06-15	重大事项停牌	22.12	-	-	6,400.00	158,512.62	141,568.00	-	
000802	北京文化	2016-06-01	重大事项停牌	23.52	2016-08-22	21.86	37,600.00	902,708.26	884,352.00	-	
000893	东凌国际	2016-01-15	重大事项停牌	12.58	2016-07-12	12.00	50.00	862.73	629.00	-	
000936	华西股份	2016-05-24	重大事项停牌	8.22	2016-07-13	9.04	154,800.00	1,258,223.00	1,272,456.00	-	
002212	南洋股份	2016-05-03	重大事项停牌	11.28	2016-08-17	12.41	16,700.00	148,700.30	188,376.00	-	
002249	大洋电机	2016-06-08	重大事项停牌	11.97	2016-07-28	10.77	72,600.00	705,644.60	869,022.00	-	
002291	星期六	2016-04-05	重大事项停牌	13.89	2016-08-02	12.50	155,800.00	1,805,463.50	2,164,062.00	-	
002319	乐通股份	2016-06-02	重大事项停牌	17.28	-	-	110,400.00	1,833,096.99	1,907,712.00	-	
002387	黑牛食品	2016-05-25	重大事项停牌	16.26	2016-08-03	17.55	91,800.00	1,509,573.00	1,492,668.00	-	
002432	九安医疗	2016-06-20	重大事项停牌	18.14	2016-07-13	19.95	75.00	1,377.63	1,360.50	-	
002452	长高集团	2016-06-14	重大事项停牌	12.02	2016-07-12	10.82	58,600.00	713,472.71	704,372.00	-	
002576	通达动力	2016-06-14	重大事项停牌	18.83	-	-	10,700.00	201,810.34	201,481.00	-	
002587	奥拓电子	2016-04-19	重大事项停牌	14.45	2016-07-28	14.00	115,455.00	1,454,210.07	1,668,324.75	-	
002663	普邦园林	2016-04-28	重大事项停牌	7.36	-	-	274,200.00	1,858,490.40	2,018,112.00	-	
002682	龙洲股份	2016-04-06	重大事项停牌	12.69	2016-07-20	13.96	61,100.00	744,823.96	775,359.00	-	
300052	中青宝	2016-06-08	重大事项停牌	22.03	-	-	2,500.00	64,599.60	55,075.00	-	
300300	汉鼎宇佑	2016-05-10	重大事项停牌	30.56	-	-	42,100.00	1,211,542.00	1,286,576.00	-	
300308	中际装备	2016-03-11	重大事项停牌	12.36	-	-	70,300.00	1,063,603.43	868,908.00	-	
300323	华灿光电	2016-04-18	重大事项停牌	8.99	-	-	18,700.00	142,637.20	168,113.00	-	
300372	欣泰电气	2016-05-23	重大事项停牌	14.55	2016-07-12	13.10	109,200.00	1,569,891.00	1,588,860.00	-	
300413	快乐购	2016-06-20	重大事项停牌	24.35	-	-	19.00	541.73	462.65	-	

600139	西部资源	2016-04-11	重大事项停牌	12.31	2016-08-15	12.99	208,149.00	1,963,041.63	2,562,314.19	-
600358	国旅联合	2016-04-05	重大事项停牌	13.50	2016-08-05	12.57	77,400.00	878,770.41	1,044,900.00	-
600577	精达股份	2016-05-03	重大事项停牌	4.18	-	-	449,300.00	2,047,661.15	1,878,074.00	-
600653	中华控股	2016-05-05	重大事项停牌	3.93	-	-	32,200.00	124,802.98	126,546.00	-
601611	中国核建	2016-06-30	重大事项停牌	20.92	2016-07-01	23.01	14,118.00	48,989.46	295,348.56	-

#### 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 2016 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 2016 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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 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 2016年6月30日	上年末 2015年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	6,000.00
未评级	-	-
合计	-	6,000.00

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剩余期限在一年以上的国债、政策性金融债及央行票据。

#### 6.4.13.3 流动性风险

开放式基金的流动性是指基金管理人为满足投资者赎回要求，在一定时间内将一定数量的基金资产按正常市场价格变现的能力。流动性风险指因市场交易量不足，导致不能以适当价格及时进行证券交易的风险，或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的违约风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，在一定程度上减轻了投资变现压力。本基金所持大部分交易性金融资产在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。本基金所持有的其他金融负债以及可赎回基金份额净值(所有者权益)的合同约定到期日均为无固定期限且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人在对市场特征和发展形势等方面进行分析和判断的基础上，由投资决策委员会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，由基金绩效评估与风险管理组具体计算与监控各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控。

#### 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 2016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	240,456,877.73	-	-	-	240,456,877.73
结算备付金	10,714,791.28	-	-	-	10,714,791.28
存出保证金	936,597.09	-	-	-	936,597.09
交易性金融资产	-	-	-	174,859,022.85	174,859,022.85
应收证券清算款	-	-	-	105,224,948.47	105,224,948.47
应收利息	-	-	-	155,087.10	155,087.10
应收申购款	-	-	-	6,896.17	6,896.17
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	252,108,266.10	-	-	280,245,954.59	532,354,220.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,663,153.11	4,663,153.11
应付管理人报酬	-	-	-	720,373.45	720,373.45
应付托管费	-	-	-	43,658.98	43,658.98
应付交易费用	-	-	-	937,636.37	937,636.37
其他负债	-	-	-	182,595.10	182,595.10
负债总计	-	-	-	6,547,417.01	6,547,417.01
利率敏感度缺口	252,108,266.10	-	-	273,698,537.58	525,806,803.68
<b>上年度末</b>					
<b>2015 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	668,319,979.34	-	-	-	668,319,979.34
结算备付金	908,948.73	-	-	-	908,948.73
存出保证金	40,119.86	-	-	-	40,119.86
交易性金融资产	6,000.00	-	-	5,930,983.99	5,936,983.99
应收利息	-	-	-	241,101.43	241,101.43
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	669,275,047.93	-	-	6,172,085.42	675,447,133.

					35
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	938,284.79	938,284.79
应付托管费	-	-	-	56,865.75	56,865.75
应付交易费用	-	-	-	357,882.27	357,882.27
其他负债	-	-	-	37,500.00	37,500.00
负债总计	-	-	-	1,390,532.81	1,390,532.81
利率敏感度缺口	669,275,047.93	-	-	4,781,552.61	674,056,600.54

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

本基金本报告期末未持有债券投资，上年度末持有的债券占基金资产净值较小，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 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	174,859,022.85	33.26	5,930,983.99	0.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	6,000.00	0.00

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	174,859,022.85	33.26	5,936,983.99	0.88

#### 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 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	9,237,876.98	270,223.42
业绩比较基准下降 5%	-9,237,876.98	-270,223.42	

#### 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附注 6.4.4.5。

###### (ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 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 150,617,867.08 元，第二层级的余额为 24,165,031.65 元，第三层级的余额为 76,124.12 元（2015 年 12 月 31 日，第一层级的余额为 935,182.99 元，第二层级的余额为 4,995,801.00 元，第三层级的余额为 6,000.00 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的债券）。

###### (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	174,859,022.85	32.85
	其中：股票	174,859,022.85	32.85
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	251,171,669.01	47.18
7	其他各项资产	106,323,528.83	19.97
8	合计	532,354,220.69	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	3,319,260.84	0.63
B	采矿业	6,521,259.19	1.24
C	制造业	120,609,418.68	22.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,680,766.90	0.89
E	建筑业	4,104,501.44	0.78
F	批发和零售业	3,612,941.72	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	5,046,727.02	0.96

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,089,859.05	1.92
J	金融业	3,862,558.00	0.73
K	房地产业	7,703,758.67	1.47
L	租赁和商务服务业	1,745,625.00	0.33
M	科学研究和技术服务业	2,066,798.10	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	607,915.50	0.12
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	884,934.22	0.17
S	综合	2,698.52	0.00
	合计	174,859,022.85	33.26

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

### 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	002168	深圳惠程	205,600	2,894,848.00	0.55
2	002226	江南化工	270,800	2,594,264.00	0.49
3	600139	西部资源	208,149	2,562,314.19	0.49
4	600543	莫高股份	185,600	2,535,296.00	0.48
5	002211	宏达新材	206,800	2,452,648.00	0.47
6	600303	曙光股份	157,900	2,344,815.00	0.45
7	600719	大连热电	312,900	2,327,976.00	0.44
8	002068	黑猫股份	292,700	2,283,060.00	0.43
9	600213	亚星客车	178,700	2,280,212.00	0.43
10	002625	龙生股份	51,300	2,256,174.00	0.43
11	600525	长园集团	161,400	2,235,390.00	0.43
12	600268	国电南自	289,100	2,191,378.00	0.42
13	002121	科陆电子	185,900	2,184,325.00	0.42

14	002426	胜利精密	221,000	2,176,850.00	0.41
15	002291	星期六	155,800	2,164,062.00	0.41
16	000697	炼石有色	92,900	2,122,765.00	0.40
17	600137	浪莎股份	71,700	2,100,093.00	0.40
18	600831	广电网络	160,300	2,077,488.00	0.40
19	000783	长江证券	177,600	2,060,160.00	0.39
20	002178	延华智能	186,400	2,046,672.00	0.39
21	600883	博闻科技	140,857	2,043,835.07	0.39
22	300177	中海达	133,319	2,021,116.04	0.38
23	002663	普邦园林	274,200	2,018,112.00	0.38
24	600302	标准股份	239,042	2,007,952.80	0.38
25	002098	浔兴股份	171,900	1,997,478.00	0.38
26	002410	广联达	137,650	1,968,395.00	0.37
27	002078	太阳纸业	394,700	1,926,136.00	0.37
28	002319	乐通股份	110,400	1,907,712.00	0.36
29	600577	精达股份	449,300	1,878,074.00	0.36
30	000525	红太阳	143,100	1,871,748.00	0.36
31	000584	友利控股	196,700	1,870,617.00	0.36
32	002724	海洋王	84,400	1,861,864.00	0.35
33	600052	浙江广厦	267,200	1,838,336.00	0.35
34	002629	仁智油服	151,500	1,836,180.00	0.35
35	000572	海马汽车	353,100	1,832,589.00	0.35
36	601877	正泰电器	97,000	1,828,450.00	0.35
37	601901	方正证券	235,300	1,802,398.00	0.34
38	002163	中航三鑫	249,900	1,789,284.00	0.34
39	000559	万向钱潮	114,400	1,784,640.00	0.34
40	002203	海亮股份	228,700	1,776,999.00	0.34
41	600328	兰太实业	146,900	1,765,738.00	0.34
42	600331	宏达股份	320,600	1,750,476.00	0.33
43	000882	华联股份	427,300	1,743,384.00	0.33
44	002528	英飞拓	195,450	1,735,596.00	0.33
45	002231	奥维通信	110,734	1,711,947.64	0.33
46	601028	玉龙股份	238,700	1,704,318.00	0.32
47	600191	华资实业	121,934	1,693,663.26	0.32
48	002069	*ST 獐岛	199,800	1,688,310.00	0.32
49	601700	风范股份	231,400	1,686,906.00	0.32
50	002205	国统股份	70,600	1,683,104.00	0.32
51	603885	吉祥航空	63,700	1,672,125.00	0.32
52	600960	渤海活塞	166,200	1,668,648.00	0.32
53	002587	奥拓电子	115,455	1,668,324.75	0.32
54	601608	中信重工	308,100	1,654,497.00	0.31
55	600586	金晶科技	381,400	1,640,020.00	0.31
56	603116	红蜻蜓	69,100	1,636,288.00	0.31
57	600202	哈空调	158,100	1,630,011.00	0.31

58	601118	海南橡胶	291,300	1,628,367.00	0.31
59	002097	山河智能	157,133	1,616,898.57	0.31
60	600588	用友网络	81,800	1,601,644.00	0.30
61	300372	欣泰电气	109,200	1,588,860.00	0.30
62	600814	杭州解百	149,200	1,580,028.00	0.30
63	001896	豫能控股	183,000	1,577,460.00	0.30
64	002439	启明星辰	60,106	1,552,537.98	0.30
65	603227	雪峰科技	78,700	1,511,040.00	0.29
66	600730	中国高科	106,759	1,508,504.67	0.29
67	601021	春秋航空	31,300	1,500,522.00	0.29
68	002387	黑牛食品	91,800	1,492,668.00	0.28
69	002005	德豪润达	250,600	1,481,046.00	0.28
70	002084	海鸥卫浴	136,500	1,476,930.00	0.28
71	600697	欧亚集团	48,000	1,423,680.00	0.27
72	600555	海航创新	245,100	1,404,423.00	0.27
73	600233	大杨创世	72,100	1,403,066.00	0.27
74	601106	中国一重	263,300	1,371,793.00	0.26
75	002215	诺普信	131,600	1,360,744.00	0.26
76	002132	恒星科技	306,500	1,348,600.00	0.26
77	002288	超华科技	130,600	1,292,940.00	0.25
78	300300	汉鼎宇佑	42,100	1,286,576.00	0.24
79	000936	华西股份	154,800	1,272,456.00	0.24
80	002405	四维图新	50,550	1,243,530.00	0.24
81	600425	青松建化	292,200	1,241,850.00	0.24
82	600531	豫光金铅	145,500	1,214,925.00	0.23
83	000631	顺发恒业	248,200	1,208,734.00	0.23
84	300068	南都电源	50,450	1,102,837.00	0.21
85	600279	重庆港九	153,900	1,097,307.00	0.21
86	000951	中国重汽	113,800	1,087,928.00	0.21
87	600358	国旅联合	77,400	1,044,900.00	0.20
88	002333	罗普斯金	103,800	1,011,012.00	0.19
89	603567	珍宝岛	46,000	1,005,100.00	0.19
90	002450	康得新	54,937	939,422.70	0.18
91	603369	今世缘	67,800	909,876.00	0.17
92	600370	三房巷	173,555	905,957.10	0.17
93	002546	新联电子	72,800	893,256.00	0.17
94	000802	北京文化	37,600	884,352.00	0.17
95	002302	西部建设	121,929	880,327.38	0.17
96	002249	大洋电机	72,600	869,022.00	0.17
97	300308	中际装备	70,300	868,908.00	0.17
98	300444	双杰电气	26,812	787,468.44	0.15
99	002682	龙洲股份	61,100	775,359.00	0.15
100	600116	三峡水利	99,600	774,888.00	0.15
101	002750	龙津药业	48,371	724,597.58	0.14

102	600885	宏发股份	23,200	712,472.00	0.14
103	002452	长高集团	58,600	704,372.00	0.13
104	002707	众信旅游	34,400	698,320.00	0.13
105	603268	松发股份	15,600	622,908.00	0.12
106	300187	永清环保	45,300	607,020.00	0.12
107	002228	合兴包装	107,300	596,588.00	0.11
108	002560	通达股份	49,800	577,182.00	0.11
109	002593	日上集团	64,100	488,442.00	0.09
110	000564	西安民生	49,900	479,040.00	0.09
111	601611	中国核建	14,118	295,348.56	0.06
112	300168	万达信息	10,400	270,296.00	0.05
113	000606	*ST 易桥	26,800	268,804.00	0.05
114	300516	久之洋	1,473	258,025.41	0.05
115	002576	通达动力	10,700	201,481.00	0.04
116	002212	南洋股份	16,700	188,376.00	0.04
117	300323	华灿光电	18,700	168,113.00	0.03
118	601127	小康股份	6,947	165,824.89	0.03
119	603737	三棵树	1,327	154,038.16	0.03
120	002540	亚太科技	17,400	151,728.00	0.03
121	000710	天兴仪表	6,400	141,568.00	0.03
122	600165	新日恒力	10,000	132,200.00	0.03
123	600653	申华控股	32,200	126,546.00	0.02
124	002506	协鑫集成	13,700	94,804.00	0.02
125	600105	永鼎股份	8,666	81,200.42	0.02
126	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.01
127	601966	玲珑轮胎	4,383	56,891.34	0.01
128	300052	中青宝	2,500	55,075.00	0.01
129	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.01
130	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
131	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.00
132	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.00
133	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
134	002771	真视通	93	9,760.35	0.00
135	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
136	603868	飞科电器	93	5,500.95	0.00
137	600570	恒生电子	78	5,208.06	0.00
138	300449	汉邦高科	86	4,914.04	0.00
139	002095	生意宝	79	4,423.21	0.00
140	002657	中科金财	79	4,340.26	0.00
141	600571	信雅达	70	3,858.40	0.00
142	000938	紫光股份	50	3,044.00	0.00
143	300400	劲拓股份	69	2,495.73	0.00
144	603598	引力传媒	100	2,405.00	0.00
145	603555	贵人鸟	93	2,318.49	0.00

146	002502	骅威文化	90	2,214.00	0.00
147	002690	美亚光电	87	2,004.48	0.00
148	002745	木林森	56	1,903.44	0.00
149	300059	东方财富	80	1,776.00	0.00
150	300005	探路者	99	1,687.95	0.00
151	600200	江苏吴中	84	1,627.08	0.00
152	603989	艾华集团	50	1,621.00	0.00
153	600456	宝钛股份	80	1,609.60	0.00
154	603000	人民网	96	1,594.56	0.00
155	300490	华自科技	54	1,566.00	0.00
156	600371	万向德农	94	1,522.80	0.00
157	000821	京山轻机	86	1,515.32	0.00
158	300188	美亚柏科	55	1,465.20	0.00
159	002579	中京电子	91	1,426.88	0.00
160	002432	九安医疗	75	1,360.50	0.00
161	300270	中威电子	79	1,345.37	0.00
162	002295	精艺股份	84	1,318.80	0.00
163	002446	盛路通信	40	1,266.40	0.00
164	600898	三联商社	99	1,238.49	0.00
165	002322	理工环科	65	1,231.10	0.00
166	600590	泰豪科技	89	1,197.94	0.00
167	002311	海大集团	75	1,182.75	0.00
168	600774	汉商集团	65	1,180.40	0.00
169	002156	通富微电	80	1,128.00	0.00
170	002787	华源包装	22	1,088.34	0.00
171	601012	隆基股份	83	1,083.15	0.00
172	000532	力合股份	59	1,071.44	0.00
173	600528	中铁二局	88	1,021.68	0.00
174	002009	天奇股份	59	963.47	0.00
175	002303	美盈森	75	921.75	0.00
176	600410	华胜天成	80	897.60	0.00
177	603099	长白山	50	895.50	0.00
178	002761	多喜爱	21	847.98	0.00
179	002245	澳洋顺昌	66	842.82	0.00
180	002041	登海种业	50	777.00	0.00
181	002689	远大智能	97	751.75	0.00
182	300352	北信源	40	746.80	0.00
183	002325	洪涛股份	80	735.20	0.00
184	601566	九牧王	47	725.68	0.00
185	002115	三维通信	63	723.87	0.00
186	002575	群兴玩具	62	703.70	0.00
187	000819	岳阳兴长	26	691.08	0.00
188	000893	东凌国际	50	629.00	0.00
189	300092	科新机电	40	612.00	0.00

190	000977	浪潮信息	26	609.70	0.00
191	002123	荣信股份	29	602.91	0.00
192	300027	华谊兄弟	43	582.22	0.00
193	300350	华鹏飞	16	571.20	0.00
194	600527	江南高纤	83	566.06	0.00
195	600517	置信电气	58	551.58	0.00
196	002334	英威腾	61	542.90	0.00
197	002501	利源精制	50	540.00	0.00
198	000521	美菱电器	82	494.46	0.00
199	300389	艾比森	20	491.40	0.00
200	300337	银邦股份	60	472.20	0.00
201	300413	快乐购	19	462.65	0.00
202	600184	光电股份	20	452.80	0.00
203	600868	梅雁吉祥	86	442.90	0.00
204	000518	四环生物	61	411.14	0.00
205	002419	天虹商场	33	394.68	0.00
206	300018	中元股份	30	381.30	0.00
207	000573	粤宏远A	50	377.00	0.00
208	000078	海王生物	50	371.50	0.00
209	002214	大立科技	30	369.90	0.00
210	300024	机器人	14	355.46	0.00
211	002737	葵花药业	9	337.23	0.00
212	600399	抚顺特钢	50	323.50	0.00
213	002503	搜于特	25	310.50	0.00
214	002681	奋达科技	18	303.84	0.00
215	600460	士兰微	38	301.34	0.00
216	601231	环旭电子	28	299.60	0.00
217	000713	丰乐种业	27	284.04	0.00
218	300286	安科瑞	9	267.21	0.00
219	002337	赛象科技	33	257.40	0.00
220	002402	和而泰	9	243.45	0.00
221	600959	江苏有线	15	209.40	0.00
222	603686	龙马环卫	5	182.35	0.00
223	002154	报喜鸟	32	154.56	0.00
224	300281	金明精机	10	148.40	0.00
225	600601	方正科技	30	129.00	0.00
226	002427	尤夫股份	5	100.35	0.00
227	002723	金莱特	2	49.48	0.00
228	002093	国脉科技	3	37.23	0.00
229	002678	珠江钢琴	1	12.27	0.00
230	600075	新疆天业	1	11.51	0.00
231	601908	京运通	1	7.67	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	002232	启明信息	8,167,821.54	1.21
2	002178	延华智能	8,014,562.72	1.19
3	300141	和顺电气	7,941,936.53	1.18
4	600075	新疆天业	7,679,173.40	1.14
5	000410	沈阳机床	7,602,923.26	1.13
6	002115	三维通信	7,485,810.20	1.11
7	002432	九安医疗	7,473,699.70	1.11
8	600730	中国高科	7,252,968.53	1.08
9	002097	山河智能	7,237,818.80	1.07
10	601700	风范股份	7,236,698.07	1.07
11	300005	探路者	6,879,069.03	1.02
12	300177	中海达	6,843,465.00	1.02
13	000802	北京文化	6,732,511.00	1.00
14	600868	梅雁吉祥	6,693,876.00	0.99
15	000650	仁和药业	6,645,220.31	0.99
16	600836	界龙实业	6,639,647.00	0.99
17	002501	利源精制	6,578,793.00	0.98
18	600161	天坛生物	6,524,224.90	0.97
19	300024	机器人	6,458,243.60	0.96
20	300146	汤臣倍健	6,352,452.60	0.94

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	300141	和顺电气	9,119,309.00	1.35
2	600075	新疆天业	8,093,265.60	1.20
3	002232	启明信息	7,669,502.78	1.14
4	002432	九安医疗	7,073,770.39	1.05
5	002115	三维通信	7,005,339.56	1.04
6	000410	沈阳机床	6,884,040.00	1.02

7	000650	仁和药业	6,483,497.50	0.96
8	300005	探路者	6,398,626.92	0.95
9	300024	机器人	6,382,411.96	0.95
10	002093	国脉科技	6,225,792.76	0.92
11	002178	延华智能	6,138,330.45	0.91
12	300033	同花顺	6,122,543.00	0.91
13	600868	梅雁吉祥	6,109,178.09	0.91
14	002097	山河智能	6,012,533.00	0.89
15	002579	中京电子	5,997,031.14	0.89
16	002424	贵州百灵	5,967,420.20	0.89
17	300146	汤臣倍健	5,957,329.00	0.88
18	600105	永鼎股份	5,805,573.00	0.86
19	600590	泰豪科技	5,781,287.21	0.86
20	601010	文峰股份	5,741,922.00	0.85

#### 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	1,261,342,664.81
卖出股票的收入（成交）总额	1,062,147,129.92

#### 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 根据公开市场信息，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，也未出现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	936,597.09
2	应收证券清算款	105,224,948.47
3	应收股利	-
4	应收利息	155,087.10
5	应收申购款	6,896.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	106,323,528.83

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600139	西部资源	2,562,314.19	0.49	重大事项停牌

## 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	9,295	50,647.99	-	0.00%	470,773,075.38	100.00%
广发百发大数据成长混合 E	3,211	24,883.39	4,971,478.93	6.22%	74,929,079.83	93.78%
合计	12,506	44,032.76	4,971,478.93	0.90%	545,702,155.21	99.10%

### 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	-	-
	广发百发大数据成长混合 E	634,276.75	0.7938%
	合计	634,276.75	0.1152%

### 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、基金投资和研发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	50~100
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发百发大数据成长混合 A	0
	广发百发大数据成长混合 E	50~100
	合计	50~100

## 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	550,971,704.26	121,735,887.64
本报告期基金总申购份额	3,511,307.59	4,638,397.00
减：本报告期基金总赎回份额	83,709,936.47	46,473,725.88
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	470,773,075.38	79,900,558.76

## 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

自 2016 年 4 月 30 日起，王志伟不再担任本基金管理人的董事长。自 2016 年 5 月 26 日起，孙树明担任本基金管理人的新任董事长。自 2016 年 5 月 5 日起，本基金管理人聘任魏恒江为公司的副总经理。

相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

### 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，涉及本基金管理人的诉讼事项有两起，分别是：

1、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，请求银行赔偿损失。该案尚在浙江省义乌市人民法院审理中。

2、喇永强诉平安银行股份有限公司宁波慈溪支行和我公司合同纠纷一案，在浙江省慈溪市人民法院审理过程中，原告向法院申请撤回对我公司的起诉，经法院裁定准许后我公司不再参与该诉讼。

### 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

2016 年 4 月 18 日，本基金管理人收到中国证监会关于责令整改的行政监管措施决定书（【2016】34 号）。中国证监会指出我司对火炬电子的跟踪研究报告未及时更新。我司高度重视该问题的整改，进一步梳理了股票入库的流程，并强化了研究报告的跟踪要求。

本报告期内本基金的基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚的情况。

### 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	
中投证券	2	385,636,665.83	16.61%	89,198.17	5.93%	新增 2 个
东北证券	2	1,936,297,920.21	83.39%	1,416,020.31	94.07%	新增 2 个

中信证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
兴业证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

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
中投证券	-	-	94,800,000.00	15.71%	-	-
东北证券	252,398.91	100.00%	508,600,000.00	84.29%	-	-

### 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旗下基金（除 QDII 基金）资产净值公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-06-30
2	广发基金管理有限公司关于增加天津银行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》	2016-06-27
3	广发基金管理有限公司关于增加德州银行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》	2016-06-06
4	广发基金管理有限公司关于增加宁波银行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》	2016-06-01
5	广发基金管理有限公司关于增加富滇银行为	《中国证券报》、《证券时	2016-05-24

	旗下部分基金代销机构的公告	报》、《上海证券报》	
6	广发基金管理有限公司关于增加徽商银行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》	2016-05-17
7	广发基金管理有限公司关于增加首创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》	2016-05-05
8	广发基金管理有限公司关于增加鼎信汇金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》	2016-03-30
9	广发基金管理有限公司关于增加华宝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》	2016-03-17
10	广发基金管理有限公司关于增加诺亚正行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》	2016-03-09
11	广发基金管理有限公司关于增加北京增财基金销售有限公司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》	2016-02-18
12	广发基金管理有限公司关于增加厦门鑫鼎盛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》	2016-02-02
13	广发基金管理有限公司关于增加江南农商行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》	2016-01-14
14	广发基金管理有限公司关于广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-06
15	广发基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下部分基金开放时间的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-04

## 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成长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成长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成长灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- (五) 法律意见书
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照

### 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](mailto:services@gf-funds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇一六年八月二十六日