广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发百发大数据成长混合	
基金主代码	001734	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年11月18日	
报告期末基金份额总额	173,677,989.71份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过大类资产的灵活配置，精选具有较高成长性的股票进行投资，力求实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金在宏观经济分析基础上，结合政策面、市场资金面，积极把握市场发展趋势，根据经济周期不同阶段各类资产市场表现变化情况，对股票、债券和现金等大类资产投资比例进行战略配置和调整，以规避或分散市场风险，提高基金风险调整后的收益。	
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:50%×创业板指数收益率+50%×中证全债指数收益率。	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发百发大数据成长混合A	广发百发大数据成长混合E
下属分级基金的交易代码	001734	001735
报告期末下属分级基金的份额总额	151,495,318.55份	22,182,671.16份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	广发百发大数据成长混合A	广发百发大数据成长混合E
1.本期已实现收益	-7,984,965.29	-1,176,341.83
2.本期利润	-9,213,555.79	-1,411,532.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0603	-0.0616
4.期末基金资产净值	128,567,549.05	18,855,528.52
5.期末基金份额净值	0.849	0.850

注:（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发百发大数据成长混合A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.50%	1.25%	-5.40%	0.76%	-1.10%	0.49%

2、广发百发大数据成长混合E:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.59%	1.24%	-5.40%	0.76%	-1.19%	0.48%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2015年11月18日至2018年9月30日)

1. 广发百发大数据成长混合A:

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季峰	本基金的基金经理;广发百发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;广发百发大数据价值混合基金的基金经理;广发东财大数据精选基金的基金经理;量化投资部副总经理	2015-11-18	-	9年	季峰先生,管理学博士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾在深圳证券交易所从事博士后研究，曾任广发基金管理有限公司数量投资部研究员、数据策略投资部副总经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2014年10月21日至2016年5月26日）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2015年2月13日至2016年5月26日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2015年3月25日至2016年5月26日）。现任广发基金管理有限公司量化投资部副总经理、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金基金经理（自2014年11月24日起任职）、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年9月14日起任职）、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经理（自2015年11月18日起任职）、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年6月16日起任职）、广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017

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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。本报告期内基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司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,投资的债券必须来自公司债券库。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。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需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度,市场整体持续震荡下行。虽然,电子、军工等行业一度快速修复,但区间内整体行情仍然维持周期、金融相对领先,成长板块持续承压的格局。市场悲观情绪主要来源于宏观环境——从最新的9月PMI数据来看,PMI主要分项全面下滑,反映经济尚处于下行区间。此外,海外风险事件的持续发酵也给市场增加了不确定性,美联储加息、鹰派言论叠加油价的上行,使得美债收益率向上突破3.2%,压制股票市场的估值,推助避险情绪在全球范围蔓延。

面对存在下行压力的国内经济环境及美联储加息和美债收益率持续上行所带来的汇率风险，国内对冲政策持续稳步推进——央行通过定向降准与货币工具持续释放边际宽松信号,维持市场流动性稳定。此外,减税、降费等积极财政政策仍有空间。经历了近三个季度的调整,市场风险偏好已经在低位徘徊，尚等待外部风险缓释与内生经济的积极信号提振后市。

三季度期间,由于成长风格持续承压尚待修复,组合适当地降低仓位,部分缓释了局部市场急跌带来的冲击。四季度,产品运作重点将在于规避潜在的系统性风险,在保持风格稳定的基础上,机会一方面在于把握市场企稳修复带来的波段收益，另一方面在于成长风格中部分超跌的绩优标的。

4.5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-6.50%,E类净值增长率为-6.59%,同期业绩比较基准收益率为-5.40%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	67,956,071.19	33.66
	其中:股票	67,956,071.19	33.66
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	51,500,000.00	25.51
	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	82,328,732.30	40.78
7	其他各项资产	120,607.17	0.06
8	合计	201,905,410.66	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	305.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	57,655,655.80	39.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	269.61	0.00
E	建筑业	3,335.16	0.00
F	批发和零售业	2,452,045.17	1.66
G	交通运输、仓储和邮政业	329,112.00	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,921.47	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,509,408.00	5.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	477.40	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,541.08	0.00
S	综合	-	-
	合计	67,956,071.19	46.10

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603517	绝味食品	225,625	9,453,687.50	6.41
2	600276	恒瑞医药	148,200	9,410,700.00	6.38
3	601888	中国国旅	110,400	7,509,408.00	5.09
4	002304	洋河股份	28,800	3,686,400.00	2.50
5	600585	海螺水泥	98,400	3,620,136.00	2.46
6	300122	智飞生物	70,100	3,432,096.00	2.33
7	600031	三一重工	345,100	3,064,488.00	2.08
8	000661	长春高新	10,900	2,583,300.00	1.75
9	000858	五粮液	37,200	2,527,740.00	1.71
10	002727	一心堂	95,100	2,449,776.00	1.66

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1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,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责和处罚的情况。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	84,778.88
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,030.27
5	应收申购款	2,798.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	120,607.17

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发百发大数据成长混合A	广发百发大数据成长混合E
本报告期期初基金份额总额	154,895,957.96	23,114,332.94
本报告期基金总申购份额	291,441.58	988,004.96
减:本报告期基金总赎回份额	3,692,080.99	1,919,666.74
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	151,495,318.55	22,182,671.16

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

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

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

（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

（八）《广发百发大数据策略成长灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅: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。

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

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:二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发百发大数据价值混合	
基金主代码	001731	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年6月16日	
报告期末基金份额总额	56,339,999.65份	
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，本基金通过大类资产的灵活配置，精选具有较高投资价值的股票进行投资，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%×沪深300指数收益率+50%×中证全债指数收益率。	
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高收益风险特征的基金。	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	广发百发大数据价值混合A	广发百发大数据价值混合E
下属分级基金的交易代码	001731	001732
报告期末下属分级基金的份额总额	51,207,170.87份	5,132,828.78份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)	
	广发百发大数据价值混合A	广发百发大数据价值混合E
1.本期已实现收益	-247,136.31	-19,840.27
2.本期利润	-2,610,925.15	-299,204.53
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0494	-0.0572
4.期末基金资产净值	47,396,182.80	4,806,095.10
5.期末基金份额净值	0.926	0.936

注:（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、广发百发大数据价值混合A:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.22%	1.37%	-0.35%	0.67%	-4.87%	0.70%

2、广发百发大数据价值混合E:

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.36%	1.38%	-0.35%	0.67%	-5.01%	0.71%

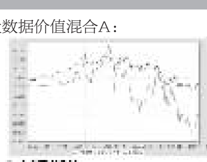
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

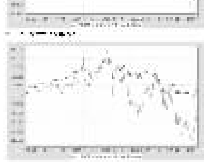
广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2017年6月16日至2018年9月30日)

1. 广发百发大数据价值混合A:





注: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本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
季峰	本基金的基金经理;广发百发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;广发百发大数据成长混合基金的基金经理;广发东财大数据精选基金的基金经理;量化投资部副总经理	2017-06-16	-	9年	季峰先生,管理学博士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾在深圳证券交易所从事博士后研究，曾任广发基金管理有限公司数量投资部研究员、数据策略投资部副总经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自2014年10月21日至2016年5月26日）、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2015年2月13日至2016年5月26日）、广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金基金经理（自2015年3月25日至2016年5月26日）。现任广发基金管理有限公司量化投资部副总经理、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金基金经理（自2014年11月24日起任职）、广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2015年9月14日起任职）、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经理（自2015年11月18日起任职）、广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年6月16日起任职）、广发东财大数据精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年12月11日起任职）。

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报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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价值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。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司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,投资的债券必须来自公司债券库。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。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需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾三季度,市场整体持续震荡下行。虽然,电子、军工等行业一度快速修复,但区间内整体行情仍然维持周期、金融相对领先,成长板块持续承压的格局。市场悲观情绪主要来源于宏观环境——从最新的9月PMI数据来看,PMI主要分项全面下滑,反映经济尚处于下行区间。此外,海外风险事件的持续发酵也给市场增加了不确定性,美联储加息、鹰派言论叠加油价的上行,使得美债收益率向上突破3.2%,压制股票市场的估值,推助避险情绪在全球范围蔓延。

面对存在下行压力的国内经济环境及美联储加息和美债收益率持续上行所带来的汇率风险，国内对冲政策持续稳步推进——央行通过定向降准与货币工具持续释放边际宽松信号,维持市场流动性稳定。此外,减税、降费等积极财政政策仍有空间。经历了近三个季度的调整,市场风险偏好已经在低位徘徊，尚等待外部风险缓释与内生经济的积极信号提振后市。

三季度期间,组合保持整体仓位稳定,虽然医药板块阶段承压影响整体风格表现，但组合坚持的绩优龙头配置策略在中长期内仍具备突出的配置价值。四季度,产品运作重点将在于规避潜在的系统性风险,在保持风格稳定的基础上,把握市场企稳修复带来的波段收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

本报告期内，广发百发大数据价值混合基金A类净值增长率为-5.22%,E类净值增长率为-5.36%,同期业绩比较基准收益率为-0.35%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	41,215,592.89	73.90
	其中:股票	41,215,592.89	73.90
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	1,500,000.00	2.69
	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	12,881,000.57	23.10
7	其他各项资产	175,927.07	0.32
8	合计	55,772,520.53	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	31,916,476.90	61.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	196,425.00	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,200,649.00	2.30
J	金融业	5,242,391.97	10.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,659,650.02	5.09
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,215,592.89	78.95

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	603589	口子窖	79,593	4,099,039.50	7.85
2	600519	贵州茅台	5,000	3,650,000.00	6.99
3	002304	洋河股份	22,100	2,828,800.00	5.42
4	601888	中国国旅	39,101	2,659,650.02	5.09
5	603369	今世缘	104,900	2,098,000.00	4.02
6	600559	老白干酒	109,740	2,001,657.60	3.83
7	000568	泸州老窖	34,800	1,653,348.00	3.17
8	601601	中国太保	44,747	1,588,965.97	3.04
9	600426	华鲁恒升	87,200	1,500,712.00	2.87
10	600276	恒瑞医药	21,180	1,344,930.00	2.58

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,271.45
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,485.90
5	应收申购款	149,169.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	175,927.07

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

项目	广发百发大数据价值混合A	广发百发大数据价值混合E
本报告期期初基金份额总额	48,653,565.13	5,397,053.15
本报告期基金总申购份额	5,965,858.02	522,621.05
减:本报告期基金总赎回份额	3,412,252.28	786,845.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	51,207,170.87	5,132,828.78

§7基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

项目	广发百发大数据价值混合A	广发百发大数据价值混合E
报告期期初管理人持有的本基金份额	-	-
本报告期买入/申购总份额	5,289,947.09	-
本报告期卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,289,947.09	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	9.39	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2018-07-05	5,289,947.09	5,000,000.00	-
合计			5,289,947.09	5,000,000.00	

注:申购费1000元。

§8 备查文件目录

8.1备查文件目录

（一）中国证监会注册广发百发大数据策略价值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价值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价值灵活配置混合型证券投资基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）《广发百发大数据策略价值灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅: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。

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日

广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金

2018年第三季度报告

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一八年十月二十五日

§1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发电子信息传媒股票
基金主代码	005310
交易代码	005310
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017年12月11日
报告期末基金份额总额	60,341,852.33份
投资目标	本基金重点关注电子信息传媒（TMT）产业上市公司的投资机会，通过自下而上的深度挖掘,精选个股,力争为基金份额持有人获取长期稳健的超额回报。
投资策略	本基金在研究宏观经济基本面、政策面和资金面等多种因素的基础上，判断宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响,评估股票、债券及货币市场工具等大类资产的估值水平和投资价值,根据大类资产的风险收益特征进行灵活配置,确定合适的资产配置比例,并适时进行调整。
业绩比较基准	中证全指信息技术指数收益率*80%+中证全指电信业务指数收益率*10%+银行活期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金是股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,属于高收益风险特征的基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2018年7月1日-2018年9月30日)
1.本期已实现收益	-4,828,295.15
2.本期利润	-3,166,270.40
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0525
4.期末基金资产净值	45,919,995.32
5.期末基金份额净值	0.7610

注:（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-5.65%	1.88%	-9.41%	1.62%	3.76%	0.26%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年12月11日至2018年9月30日)

注:（1）本基金合同生效日期为2017年12月11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本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张继枫	本基金的基金经理;广发聚祥灵活混合基金的基金经理;研究发展部总经理助理	2017-12-11	-	5年	张继枫先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司研究发展部研究员。现任广发基金管理有限公司研究发展部总经理助理、广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自2017年6月9日起任职)、广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金基金经理(自2017年12月11日起任职)。
观富钦	本基金的基金经理	2018-02-13	-	7年	观富钦先生,管理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书,曾任广州证券股份有限公司研究所分析师、中投证券有限责任公司研究总部分析师、广发基金管理有限公司研究发展部研究员。现任广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金基金经理(自2018年2月13日起任职)。

注:1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发电子信息传媒产业精选股票型发起式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。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司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,投资的债券必须来自公司债券库。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。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需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本投资组合为主动型开放式基金。本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况；与本公司管理的被动型投资组合发生过同日反向交易的情况，但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年三季度创业板的整体调整幅度依旧比较大，除了通信行业因为中兴通讯的影响而涨幅为正以外,传媒、电子、计算机三个行业跌幅明显。究其原因,一方面受贸易战（特别是电子和通信行业）以及政策变化（如税收/社保新规、游戏版号审批放缓等）的直接影响以外,更大的背景则是贸易战可能加剧以及国内需求可能进一步放缓的双重隐忧冲击下，市场的风险偏好也在下降，进而导致戴维斯双杀的局面出现。管理人认为,尽管系统性风险无法规避,但国内的TMT龙头企业在过去的10年已经在成本端或者渠道端逐步建立了牢固的优势，预计未来将会充分受益于下一轮硬件创新周期。

在三季度,本基金配置继续以电子、计算机为主,持仓公司主要为各子行业的龙头公司。并且出于加强风险控制的考虑,特别是考虑到宏观经济的不确定性在加大，管理人在三季度继续降低持仓公司的集中度以分散风险。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金净值增长率为-5.65%,同期业绩比较基准收益率为-9.41%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	42,533,595.94	91.43
	其中:股票	42,533,595.94	91.43
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	3,393,836.91	7.30
7	其他各项资产	592,187.93	1.27
8	合计	46,519,620.78	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	30,077,788.94	65.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,937,462.00	17.29
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,518,345.00	9.84
S	综合	-	-
	合计	42,533,595.94	92.63

5.2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002465	海格通信	243,155	2,139,764.00	4.66
2	603039	泛微网络	24,300	2,139,129.00	4.66
3	002376	新北洋	114,687	2,033,400.51	4.43
4	002912	中新赛克	21,650	2,019,079.00	4.40
5	600271	航天信息	71,900	2,000,977.00	4.36
6	000977	浪潮信息	81,700	1,967,336.00	4.28
7	002138	顺络电子	115,600	1,907,400.00	4.15
8	600845	宝信软件	77,600	1,901,976.00	4.14
9	002371	北方华创	40,200	1,891,812.00	4.12
10	603019	中科曙光	40,100	1,879,888.00	4.09

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有股指期货。

（2）本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

（1）本基金本报告期末未持有国债期货。

（2）本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.12018年9月7日，山东新北洋信息技术股份有限公司（新北洋:002376）因存在内幕信息知情人登记不完整和未制作重大事项进程备忘录等问题,违反了《关于上市公司建立内幕信息知情人登记管理制度的规定》的相关条款规定,被中国证券监督管理委员会山东监管局出具了警示函。除上述证券外,本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	18,848.03
2	应收证券清算款	540,223.72
3	应收股利	-
4	应收利息	759.31
5	应收申购款	32,356.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	592,187.93

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	58,493,054.56
本报告期基金总申购份额	14,973,853.66
减:本报告期基金总赎回份额	13,125,055.89
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,341,852.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	19,809,349.06
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	19,809,349.06
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	32.83

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

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

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	19,809,349.06	32.83%	10,001,600.16	16.57%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	19,809,349.06	32.83%	10,001,600.16	16.57%	三年

§9影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20180701-20180930	19,809,349.06	0.00	0.00	19,809,349.06	32.83%
	2	20180701-20180930	17,223,769.42	-	-	17,223,769.42	28.54%
产品特有风险							
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: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;极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请;若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元,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。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。							

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（一）中国证监会注册广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金的文件

（二）《广发电子信息传媒产业精选股票型发起式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）《广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金托管协议》

（五）法律意见书

（六）《广发电子信息传媒产业精选股票型发起式证券投资基金招募说明书》及其更新版

10.2 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

10.3 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。

广发基金管理有限公司

二〇一八年十月二十五日