广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度报告摘要

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年三月二十八日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月22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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年9月14日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	广发百发大数据精选混合	
基金主代码	001741	
交易代码	001741	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年9月14日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	283,676,726.52份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发百发大数据精选混合A	广发百发大数据精选混合E
下属分级基金的交易代码	001741	001742
报告期末下属分级基金的份额总额	94,065,403.06份	189,611,323.46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	(一)大类资产配置 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。 (二)股票投资策略 在股票投资策略方面,本基金充分利用百度互联网行为大数据,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。 (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。 (四)金融衍生品投资策略1.股指期货投资策略2.权证投资策略3.国债期货投资策略
业绩比较基准	50%×中证800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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	段西军	王永民
	联系电话	020-83936666	010-66594896
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95566
传真		020-89899158	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要的管理人互联网网址	http://www.gffunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2015年9月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	广发百发大数据精选混合A	广发百发大数据精选混合E
本期已实现收益	335,842.42	640,438.13
本期利润	358,482.27	654,042.90
加权平均基金份额本期利润	0.0024	0.0024
本期加权平均净值利润率	0.24%	0.24%
本期基金份额净值增长率	0.60%	0.50%
3.1.2期末数据和指标	2015年末	
	广发百发大数据精选混合A	广发百发大数据精选混合E
期末可供分配基金份额利润	0.0059	0.0052
期末基金资产净值	94,617,169.98	190,600,490.31
期末基金份额净值	1.006	1.005

注:(1)本基金合同生效日为2015年9月14日,至披露时点不满一年。

(2)述基金财务指标不包括持有人认购和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。

(3)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。

(4)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

1.广发百发大数据精选混合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
过去三个月	0.60%	0.99%	10.76%	0.86%	-10.16%	0.13%
自基金合同生效起至今	0.60%	0.90%	8.14%	0.95%	-7.54%	-0.05%

2.广发百发大数据精选混合E:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长标准差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	0.50%	0.99%	10.76%	0.86%	-10.26%	0.13%
自基金合同生效起至今	0.50%	0.90%	8.14%	0.95%	-7.64%	-0.05%

1.业绩比较基准:50%×中证800指数收益率+50%×中证全债指数收益率。

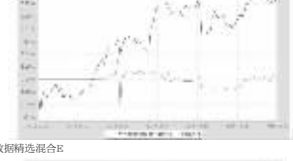
2.业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

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精选灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来份额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9月14日至2015年12月31日)



2.广发百发大数据精选混合E

注:(1)本基金合同生效日期为2015年9月14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3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。

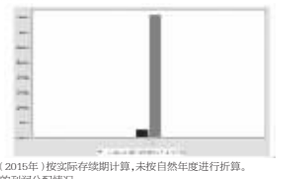
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1.广发百发大数据精选混合A

2.广发百发大数据精选混合E



注:合同生效当年(2015年)按实际存续期计算,未按自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自合同生效日(2015年9月14日)至报告期末未进行利润分配。

§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24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、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2015年12月31日,本基金管理人管理八十八只开放式基金---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、广发聚宝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东回报灵活配置混合型证券投资基金,管理资产规模为3300.24亿元。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;广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理;广发百发100指数基金的基金经理;广发养老指数基金的基金经理;广发环保指数基金的基金经理;广发百发大数据成长混合基金的基金经理;数据策略投资部副总经理	2015-09-14	-	6年	男,中国籍,管理学博士,持有中国证券投资基金业证书,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量投资研究员,2014年10月21日任广发中证全指可选消费ETF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日起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资部副总经理,2015年3月25日起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。

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、《广发百发大数据策略精选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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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。公司原则上禁止不同组合间的同日反向交易(指数型基金除外);对于不同投资组合间的同时同向交易,公司可以启用公平交易模块,确保交易的公平。

公司监察稽核部对非公开发行股票申购和以公司名义进行的债券一级市场申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易的原则;对银行间债券交易根据市场公认的第三方信息,对投资组合和交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,并由相关投资组合经理对交易价格异常情况进行合理性解释;公司开发了专门的系统对不同投资组合同日、3日内和5日内的股票同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析,发现异常情况再做进一步的调查和核实。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好。通过对本年度该组合与公司其余各组合的同日、3日内和5日内的同向交易价差进行专项分析,未发现本组合与其他组合在不同的时间窗口下同向交易存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于0的情况,表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

报告期内,未出现涉及本基金的交易所公开竞价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5%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

2015年,是百发大数据策略落地以来走过的第一个完整年度,也是市场风起云涌、大开大合的一个不凡年度。

2014年末,以沪港通为契机,券商带领金融蓝筹板块异军突起,为波澜壮阔的牛市拉开了序幕。适逢国内经济行至产业结构转型、置换驱动内核的分水岭,改革预期持续升温,代表新兴产业的成长股在2015年一季度接力领跑。随着增量资金推动行情扩张与逐利情绪蔓延,互联网金融、新能源汽车、国企改革、"一带一路"等热点概念轮番上阵,各宽基指数屡创今年新高。

6月初,大盘表现滞涨,传媒、建筑、金融、轻工等行业热点轮动频繁、切换快速,后继无力的泡沫随后急剧坍塌,杠杆资金的集中出逃将市场带往恐慌的深渊,同时面对着个股大面积跌停、停牌等极端状况。所幸监管层联合机构力挽狂澜,成功稳定市场,为缓和恐慌情绪争取了时间与空间。虽然,此后汇率异动引发市场二次探底,但杠杆水平处于低位的市场增强了纠偏和修复能力。2015年的四季度,市场围绕锂电池、券商以及TMT等热点板块,促进风险偏好的局部回暖,以修复反弹为跌宕起伏的2015年行情写下句点。

百发大数据选股策略落地运行至今,一年有余,其间与投资者一道登峰涉谷、苦乐与共---在普涨行情中凭借大数据选股的优势抓住了国企改革、"一带一路"、金融互联等多个热点题材;在市场不稳定的阶段及时合理调整仓位,避免亏损扩大;在黎明前的黑暗中守候时机,有局后市,每一次俯身都为了更好地冲刺。

百发大数据策略精选混合型基金成立于2015年9月,启航于市场两次剧震后的情绪敏感时点。因此,稳健、审慎的态度一直贯穿于组合的操作思路中,以合理的仓位水平平衡风险与收益,凭借大数据选股与择时对冲辅助策略争取锁定波段利润。面对云诡波谲的外围环境和阴晴不定的市场情绪,组合稳健的运行特点逐步占据出相对优势,组合参考大数据择时对冲信号在市场过热阶段及时减仓,加强回撤控制。

得益于主动型基金框架的优化,组合在原生大数据选股策略的基础上被赋予了更为灵活的拓展空间---在市场震荡不稳的阶段中,组合可以保持稳健的态度,因应具体环境调整仓位;在市场趋稳走暖的阶段中,组合可以立足大数据选股优势,通过持续优化扩大收益,未来,主动型基金的框架将能容纳更多成熟稳健的新策略,借力大数据策略体系搭建社程提升组合收益驱动力。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,广发百发大数据精选混合基金A类净值增长率为0.60%,E类净值增长率为0.50%,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

新的一年已至,国内的经济转型与改革亦将步入深水区,多空因素交织下的行情云谲波诡。辨明相对确定的背景,绘制稳健、灵活、富弹性的策略线路,则能为这迷航寻找明灯,无远弗届。

立于国内经济转型迈进的起点,需要辨明三个基本背景。

其一,经济转型、产业结构调整以及产能替代是渐进文互的过程,或许漫长但不乏机会。国内经济的整体趋势始终以经济转型、调整结构为契机,"去产能、去库存、去杠杆、降成本、补短板"多管齐下,供需同调,可期迎来更为密集的施政窗口期,现阶段,孤立地观察汇率、股市、债市以及实体经济等多市场层级和领域的应对措施,难以窥一斑而知全豹,成效显现需要一定时间。但在遏制经济下滑的既定方向上,可合理谨慎地布局新兴产业与转型机遇。一旦以点带面地初现转机,丰厚的利润回报是可期的。

其二,国内资本市场的供给端改革温和推进,流动性溢价短期内或可持续。国内资本市场短期内仍会维持供不应求的现状,热点主题的流动性溢价也将并存。在风险偏好没有显著提升之前,趋势性机会少于结构性机会,受追捧的热点主题将获得更高的安全边际。存量模式下的热点切换频繁,则赋予大数据选股模型更大的责任---精准识别当期热点,遴选业绩优良、题材稀缺、治理稳健的优质新兴产业标的,辅以因应市场环境的仓位管理与持续优化择时策略,相信能够为投资者在改革的激流中披沙沥金。

其三,内外环境有待趋稳,提防事件冲击引发市场恐慌情绪。随着美国进入加息周期,美元与非美元阵营的分歧加剧,外汇市场波动扩大有待稳定。此外,还存在着信用风险、产能出清衍生风险、国际地缘冲突等多类潜在冲击,因此,组合将会更为重视仓位管理策略,依据市场具体的运行特点来调整仓位,同时开发多类策略对组合持仓进行持续监控和优化。

组合承载着策略优化的期望,在极端行情中实现了回撤的有效控制,体现主动管理、稳健运行的优化价值。在选股策略方面,组合未来的主线将一如既往地重视新兴产业的入口,如精准医疗、健康管理、智能制造、新能源与体验革新等领域。持续关注经济转型的机遇,重点布局新兴产业的崛起,才是百发大数据"精选"题中应有之义。此外,借力百发大数据策略体系的丰富与拓展,主动型基金的框架之下能容纳更多更优秀稳健的策略,自如应对各类市场环境。

期待百发大数据策略能够在新的市场阶段中,建立更为丰富、多元、互联的策略体系,以更为灵活、成熟、稳健的姿态为投资者构建可持续收益。

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"(三)基金收益分配原则"的相关规定,本基金本年度未进行利润分配,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

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称"本托管人")在对广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《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有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《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,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期的基金财务会计报告经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师签字出具了德师报(审)字(16)第P0798号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日
资产:	-
银行存款	282,132,747.39
结算备付金	2,963,409.98
存出保证金	235,876.58
交易性金融资产	5,197,492.81
其中:股票投资	5,191,492.81
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	-
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	-
应收利息	40,067.38
应收股利	-
应收申购款	305,050.24
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	290,874,644.38
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日
负债:	-
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	3,662,026.95
应付管理人报酬	435,728.23
应付托管费	66,019.43
应付销售服务费	-
应付交易费用	1,368,157.64
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	125,051.84
负债合计	5,656,984.09
所有者权益:	-
实收基金	283,676,726.52
未分配利润	1,540,933.77
所有者权益合计	285,217,660.29
负债和所有者权益总计	290,874,644.38

注:1.报告截止日2015年12月31日,广发百发大数据精选混合A基金份额净值人民币1.006元,基金份额总额94,065,403.06份;广发百发大数据精选混合E基金份额净值人民币1.005元,基金份额总额189,611,323.46份;总份额总额283,676,726.52份。

2.本会计期间为2015年9月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:广发百发大数据策略精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年9月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年9月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
一.收入	5,807,357.36
1.利息收入	1,667,076.28
其中:存款利息收入	1,574,297.99
债券利息收入	0.92
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	92,777.37
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	3,295,907.63
其中:股票投资收益	3,295,907.63
基金投资收益	-
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
贵金属投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	36,244.62
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	808,128.83
减:二.费用	4,794,832.19
1.管理人报酬	2,102,712.02
2.托管费	318,592.71
3.销售服务费	-
4.交易费用	2,232,127.54
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	141,399.92
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)	1,012,525.17
减:所得税费用	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)	1,012,525.17

7.3 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精选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2015年9月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年9月14日(基金合同生效日)至2015年12月31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)	496,941,998.01	-	496,941,998.01
二.本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	-	1,012,525.17	1,012,525.17
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)	-213,265,271.49	528,408.60	-212,736,862.89
其中:1.基金申购款	17,667,582.87	-72,738.24	17,594,844.63
2.基金赎回款	-230,932,854.36	601,146.84	-230,331,707.52
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)	283,676,726.52	1,540,933.77	285,217,660.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:王志伟,主管会计工作负责人:窦刚,会计机构负责人:张晓蓉

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发百发大数据策略精选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]1699号文核准,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精选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9月14日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为2015年8月18日至2015年9月7日,本基金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406,941,998.01元,有效认购户数为11,060户。其中广发百发大数据精选混合基金A类基金("A类基金")扣除认购费用后的募集资金净额为人民币181,837,029.61元,认购资金在募集期间的利息为人民币16,829.92元;广发百发大数据精选混合基金E类基金("E类基金")扣除认购费用后的募集资金净额315,019,006.37元,认购资金在募集期间的利息为人民币69,132.11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》和基金合同等有关规定,本基金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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金,基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例为0-95%;每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基企业债比较基准:50%×中证800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3月23日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

7.4.2 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制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2015年12月31日的财务状况以及2015年9月14日(基金合同生效日)起至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。本会计期间为2015年9月14日(基金合同生效日)起至2015年12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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,且转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