

广发行业领先混合型证券投资基金
2016 年年度报告
2016 年 12 月 31 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一七年三月二十八日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 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。

本报告期自 2016 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
§2 基金简介	5
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.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
§6 审计报告	19
6.1 管理层对财务报表的责任.....	20
6.2 注册会计师的责任.....	20
6.3 审计意见.....	20
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	24
7.4 报表附注.....	25
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况.....	51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	52
8.3 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.....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 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.....	57
8.7 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.....	57

8.8	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	57
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	57
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12	投资组合报告附注	57
§9	基金份额持有人信息	58
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
9.3	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	59
§10	开放式基金份额变动	59
§11	重大事件揭示	59
11.1	基金份额持有人大会决议	59
11.2	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	60
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
11.4	基金投资策略的改变	60
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	60
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
11.8	其他重大事件	63
§12	备查文件目录	64
12.1	备查文件目录	64
12.2	存放地点	64
12.3	查阅方式	64

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发行业领先混合型证券投资基金	
基金简称	广发行业领先混合	
基金主代码	270025	
交易代码	270025	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2010 年 11 月 23 日	
基金管理人	广发基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,454,619,051.58 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合 H
下属分级基金的交易代码	270025	960001
报告期末下属分级基金的份额总额	2,447,434,719.19 份	7,184,332.39 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过把握宏观经济周期及行业生命周期的发展趋势，发掘发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业中的领先企业进行投资，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>(一) 资产配置策略</p> <p>1、大类资产配置</p> <p>(1) 研究部综合宏观经济研究员研究的宏观经济形势，策略研究员研究的市场运行趋势，行业研究员研究的行业投资价值形成《资产配置建议书》。(2) 投资决策委员会定期与不定期相结合召开相关会议，根据《资产配置建议书》，综合考虑基金投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，确定本基金股票、债券、现金等的比例。</p> <p>2、行业配置策略</p>

	<p>不同的行业在经济周期的不同阶段呈现出不同的运行态势。本基金将主要通过“广发领先行业评价体系”，对行业进行定性、定量分析，同时，结合国内外宏观经济环境及国家相关政策的变化，选择发展前景良好的行业或处于复苏阶段的行业作为本基金行业配置的重点。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金股票投资采用备选库制度，本基金的备选库包括一级库和二级库。一级库是本基金管理人所管理旗下基金统一的股票投资范围，入选条件主要是根据广发企业价值评估体系，通过研究，筛选出基本面良好的股票进入一级库。二级股票库为本基金的风格库。本基金将根据行业配置阶段形成的行业配置范围，从行业地位、治理结构、经营业绩、竞争优势和创新等方面对领先行业内的股票进行定性分析，并结合（P/E）/G、预期主营业务收入增长率和预期主营业务利润率等定量指标，精选出各领先行业内估值相对合理的优质上市公司，构成本基金的二级库。</p> <p>（三）债券投资策略</p> <p>在债券投资上，坚持稳健投资的原则，控制债券投资风险。具体包括利率预测策略、收益率曲线模拟、债券资产类别配置和债券分析。</p> <p>（四）权证投资策略</p> <p>权证为本基金辅助性投资工具，投资原则为有利于加强基金风险控制，有利于基金资产增值。</p>
业绩比较基准	80%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和风险高于货币型基金、债券型基金，而低于股票型基金，属于证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95588

传真	020-89899158	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	北京市西城区复兴门内大街55 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	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	易会满

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
登载基金年度报告正文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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）	中国 上海
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、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	2016 年		2015 年		2014 年	
	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合 H	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合 H	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合 H
本期已	-420,600.07	-221,974.52	628,816,205.	-1,619.83	600,409,676.1	-

实现收益	5.59		39		1	
本期利润	-1,296,699,194.70	-158,170.83	1,232,067,599.83	2,740.92	587,868,787.72	-
加权平均基金份额本期利润	-0.5636	-0.0232	0.5680	0.0187	0.4345	-
本期加权平均净值利润率	-30.73%	-2.91%	25.90%	1.84%	39.96%	-
本期基金份额净值增长率	-22.70%	-22.66%	60.16%	0.60%	46.98%	-
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合 H	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合 H	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合 H
期末可供分配利润	649,445,942.03	-1,592,444.61	2,037,267,287.73	-1,619.83	450,299,430.67	-
期末可供分配基金份额利润	0.2654	-0.2217	0.8094	-0.0037	0.3772	-
期末基金资产净值	3,619,492,178.07	5,591,887.78	5,990,818,618.97	441,789.47	1,773,818,837.32	-
期末基	1.479	0.778	2.380	1.006	1.486	-

金 份 额 净 值						
3.1.3 累计 期末指标	2016 年末		2015 年末		2014 年末	
	广发行业领 先混合 A	广发行业领 先混合 H	广发行业领 先混合 A	广发行业领 先混合 H	广发行业领 先混合 A	广发行业领先 混合 H
基金份 额累计 净值增 长率	83.96%	-22.20%	137.98%	0.60%	48.59%	-

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）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. 广发行业领先混合 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	-3.73%	0.81%	1.04%	0.58%	-4.77%	0.23%
过去六个月	-3.78%	0.88%	4.03%	0.61%	-7.81%	0.27%
过去一年	-22.70%	1.77%	-8.63%	1.12%	-14.07%	0.65%
过去三年	81.98%	1.98%	38.23%	1.43%	43.75%	0.55%
过去五年	147.28%	1.75%	38.06%	1.30%	109.22%	0.45%
自基金合同生 效起至今	83.96%	1.66%	10.30%	1.26%	73.66%	0.40%

2. 广发行业领先混合 H:

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①—③	②—④

		②		准差④		
过去三个月	-3.83%	0.80%	1.04%	0.58%	-4.87%	0.22%
过去六个月	-3.71%	0.87%	4.03%	0.61%	-7.74%	0.26%
过去一年	-22.66%	1.77%	-8.63%	1.12%	-14.03%	0.65%
自基金合同生效起至今	-22.20%	1.77%	-8.56%	1.12%	-13.64%	0.65%

(1)业绩比较基准:80%×沪深 300 指数+20%×中证全债指数。

(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。

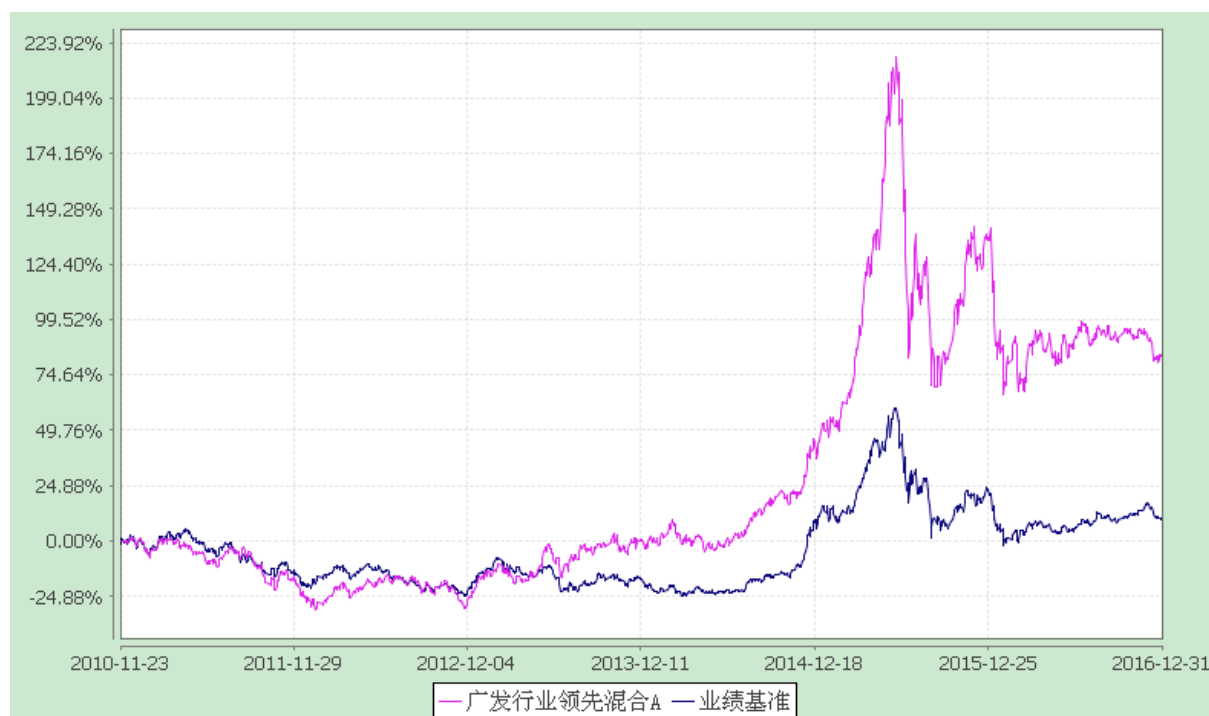
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发行业领先混合型证券投资基金

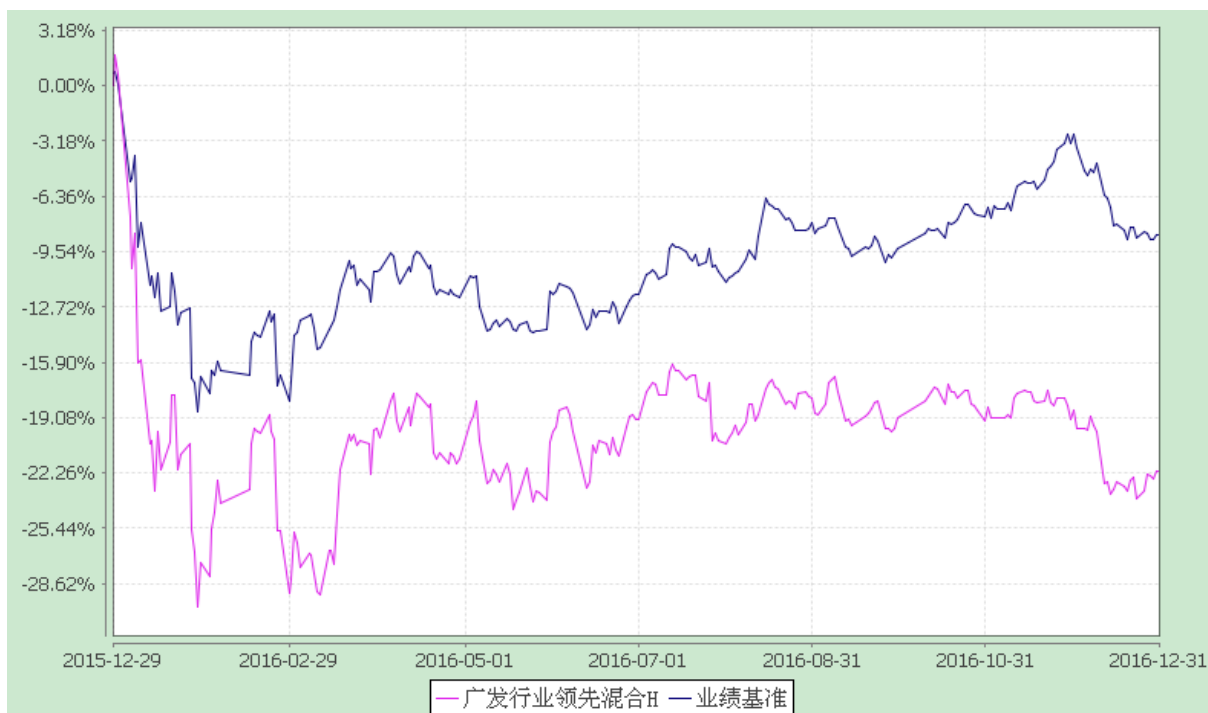
自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010 年 11 月 23 日至 2016 年 12 月 31 日)

1、广发行业领先混合 A



2、广发行业领先混合 H

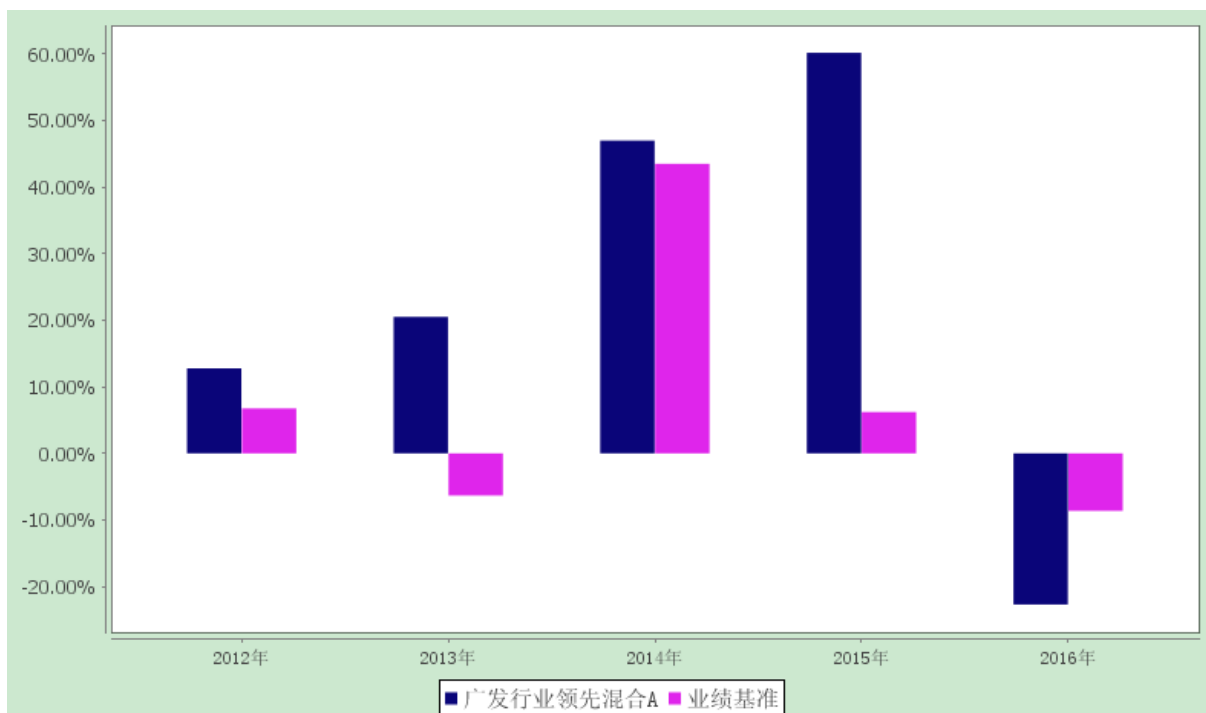


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

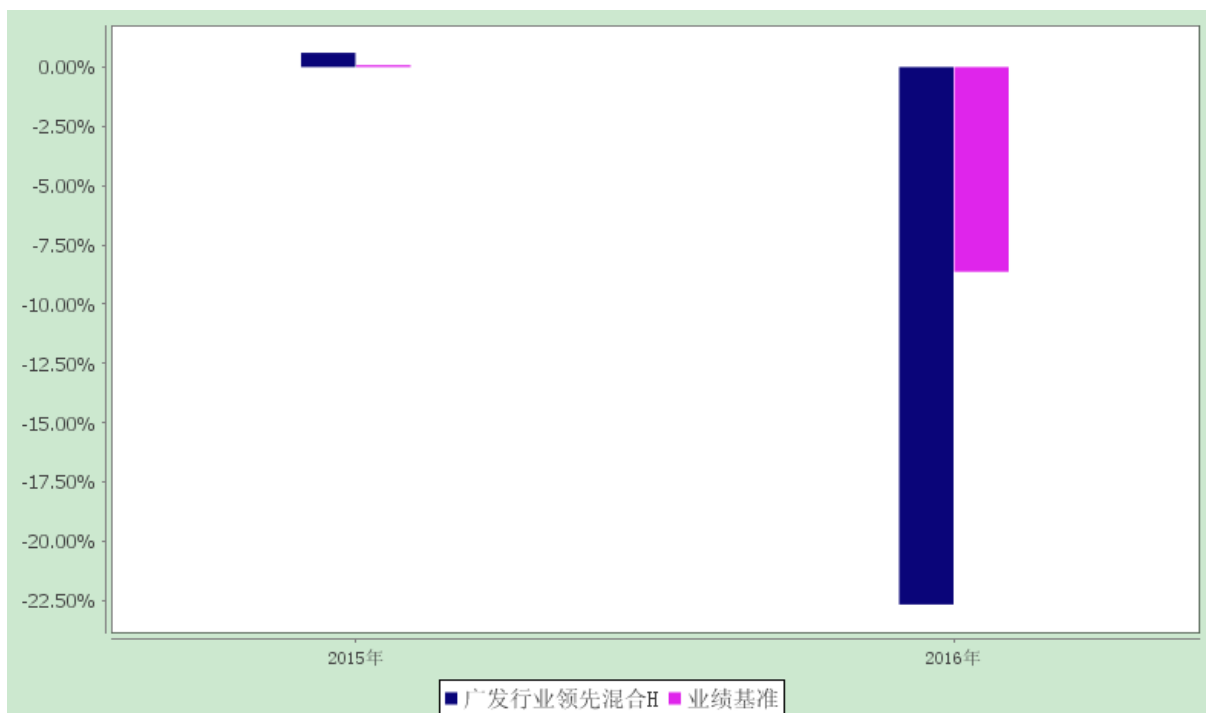
广发行业领先混合型证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、广发行业领先混合 A



2、广发行业领先混合 H



注：H 级合同生效当年(2015 年)按实际存续期计算，未按自然年度折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、广发行业领先混合 A：

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016 年	3.820	752,231,103.41	177,007,949.93	929,239,053.34	-
2015 年	-	-	-	-	-
2014 年	-	-	-	-	-
合计	3.820	752,231,103.41	177,007,949.93	929,239,053.34	-

2、广发行业领先混合 H：

本基金 H 类自合同生效日（2015 年 12 月 29 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、特定客户资产管理、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、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）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、资产配置部、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，还出资设立了瑞元资本管理有限公司、广发国际资产管理有限公司（香港子公司）、广发国际资产管理（英国）有限公司（英国子公司），参股了证通股份有限公司。

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金管理人管理一百二十五只开放式基金---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、广发安瑞回报灵活配置混合型证券投资基金、广发优企精选灵活配置混合型证券投资基金、广发安祥回报灵活配置混合型证券投资基金、广发创新升级灵活配置混合型证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金、广发服务业精选灵活配置混合型证券投资基金、广发中债 7-10 年期国开行债券指数证券投资基金、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、广发集丰债券型证券投资基金、广发沪港深新起点股票型证券投资基金、广发鑫源灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫隆灵活配置混合型证券投资基金、广发安

悦回报灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫惠灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫利灵活配置混合型证券投资基金、广发集瑞债券型证券投资基金、广发鑫盛 18 个月定期开放混合型证券投资基金、广发添利交易型货币市场基金、广发景丰纯债债券型证券投资基金、广发景华纯债债券型证券投资基金、广发汇瑞一年定期开放债券型证券投资基金、广发新常态灵活配置混合型证券投资基金、广发安盈灵活配置混合型证券投资基金、广发睿吉定增主题灵活配置混合型证券投资基金、广发鑫富灵活配置混合型证券投资基金、广发多因子灵活配置混合型证券投资基金，管理资产规模为 3048 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		
刘晓龙	本基金的基金经理；广发新动力混合基金的基金经理；广发多策略混合基金的基金经理；权益投资总监	2010-11-23	-	9 年	男，中国籍，工学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2007 年 2 月至 2010 年 3 月在广发基金管理有限公司研究发展部任行业研究员、研究小组主管，2010 年 3 月 11 日至 2011 年 3 月 10 日任广发聚丰混合基金的基金经理助理，2010 年 11 月 23 日起任广发行业领先混合基金的基金经理，2014 年 3 月 19 日起任广发新动力混合基金的基金经理，2015 年 1 月 14 日至 2016 年 5 月 29 日任广发基金管理有限公司权益投资一部总经理，2015 年 12 月 9 日起任广发多策略混合基金的基金经理，2016 年 5 月 30 日起任广发基金管理有限公司权益投资总监。

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、《广发行业领先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

2016 年的市场，可以说是一个小型的熊市，基本上是 2015 年下半年大熊市的一个延续。全年主板和创业板下跌均超过两位数，只有两个行业的股票获取正收益，赚钱效应很差。

本基金在 2015 年底对行情过于乐观，导致组合中较多弹性比较大的成长股，在 1 月份的熔断过程中下跌较多；由于规模较大，在后续的组合调整过程中，也形成了一定的冲击成本，而且由于市场交投变得比较清淡，组合调整也花了较长的时间。总体上，在熔断之后就逐渐撤出高估值成长股，开始增加价值股和周期股配置比例。但是并没有抓住新能源汽车行业的脉冲式投资机会，所以错失弥补损失的最好机会。2 季度开始，市场逐渐演变成一个窄幅震荡市，多是交易性机会，少趋势性机会，对于规模化资金操作难度较大。全年来看，净值表现不好，2012 年以来首次年度业绩落入后 50%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金 A 类的净值增长率为-22.70%，本基金 H 类的净值增长率为-22.66%，同期业绩比较基准收益率为-8.63%。

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 2017 年，我们认为市场总体上是有机会的一年。

简单的看，我们认为 2017 年全球的经济风险不大，政治风险不小。周期本身的力量是非常强的，全球经济 2011 年之后都经历了一个漫长的下滑期，目前，虽然看不到很强的需求因素，但是中上游的自发去产能持续了几年了，供求关系较好，所以全球看，经济风险不大。但是以特朗普上台作为一个标志性事件，我们看到逆全球化浪潮以及保护主义开始泛滥，必然会加大心理层面的波动。结构上看，目前美国的政治结构对中国中长期有利，短期有压力。

国内来看，经济延续了去年的回升态势，2017 年，房地产下行，基建和民间投资上行，大概率经济比较稳定。资金面不会太宽松，预计稳定略紧，也不构成大的风险。

具体到股票市场层面，2017 年会是分化的一年。一方面，经过了一年半的下跌，市场风险大部分被释放，虽然创业板整体估值仍贵，但是结构已经分化，相当一部分成长股已经落入合理估值区间，加上主板整体估值不高，所以市场的总体风险不大。总体上，我们认为从全年来看，成长和周期的机会大于价值股，原因在于，一个利率上行的周期对于价值股不利，而经过一年的修复，价值股的估值优势在逐渐丧失。

竞争环境良好的周期股，在上半年机会较大，周期上行的延续性会持续发酵，导致行业的基本

面持续上行，带来趋势性投资机会，比如化工、电解铝、钢铁等行业都体现出这种态势。下半年，我们认为内生增长稳定、估值合理的成长股将会成为市场的主流机会。一带一路可能成为 2 季度的主题性投资机会，本基金会结合周期品的基本面适度配置。

需要回避的有两类公司，一类是业绩来自于并购的公司，未来 2 年商誉减值的风险极高；一类是壳公司，其价值会逐步向 20 亿以内靠拢。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人从保护基金份额持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，加强内部风险的控制与防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察稽核部按照规定的权限和程序，独立地开展监察稽核工作，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向监管部门、董事会和公司管理层出具监察稽核报告。本报告期内，基金管理人内部监察稽核通过对本基金投资和交易进行实时监控，对投资证券的研究、决策和交易，以及会计核算和相关信息披露工作进行了重点检查和合规性审核，确保了本基金运作符合持有人利益最大化原则，保障了基金运作过程中的合法合规。

4.7 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其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。

4.8 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，2016 年 11 月 16 日广发行业领先混合 A 类每 10 份基金份额分配 3.82 元，广发行业领先混合 H 类未进行利润分配，上述利润分配符合合同规定。

截至 2016 年 12 月 31 日，广发行业领先混合型证券投资基金 A 类可供分配利润为 649,445,942.03 元，广发行业领先混合型证券投资基金 H 类无可供分配利润。

§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，本基金托管人在对广发行业领先混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，广发行业领先混合型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发行业领先混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，广发行业领先混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 0.382 元。

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

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的广发行业领先混合型证券投资基金 2016 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

德师报(审)字(17)第 P00414 号

广发行业领先混合型证券投资基金全体持有人：

我们审计了后附的广发行业领先混合型证券投资基金(以下简称“广发行业领先混合”)财务报表,包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是广发行业领先混合的基金管理人广发基金管理有限公司管理层的责任,这种责任包括:(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表,并使其实现公允反映;(2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为,广发行业领先混合的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制,公允反映了广发行业领先混合 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度的经营成果和基金净值变动情况。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

中国注册会计师

中国 上海

2017 年 3 月 22 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发行业领先混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	511,383,601.04	655,315,614.21
结算备付金		8,657,256.94	18,693,714.50
存出保证金		1,481,954.78	3,871,386.89
交易性金融资产	7.4.7.2	3,119,453,215.45	5,368,623,425.96
其中：股票投资		3,119,453,215.45	5,368,623,425.96
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	6,690,082.35
应收利息	7.4.7.5	106,366.52	126,337.94
应收股利		-	-
应收申购款		892,080.11	20,578,526.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,641,974,474.84	6,073,899,087.90
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	37,343,309.34
应付赎回款		3,335,589.97	19,934,874.59
应付管理人报酬		4,669,291.09	7,409,785.12
应付托管费		778,215.19	1,234,964.19
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,759,642.16	16,305,240.85
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	347,670.58	410,505.37
负债合计		16,890,408.99	82,638,679.46
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	2,454,619,051.58	2,517,573,075.20
未分配利润	7.4.7.10	1,170,465,014.27	3,473,687,333.24
所有者权益合计		3,625,084,065.85	5,991,260,408.44
负债和所有者权益总计		3,641,974,474.84	6,073,899,087.90

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，广发行业领先 A 基金份额净值人民币 1.479 元，基金份额总额 2,447,434,719.19 份；广发行业领先 H 基金份额净值人民币 0.778 元，基金份额总额 7,184,332.39 份；总份额总额 2,454,619,051.58 份。

7.2 利润表

会计主体：广发行业领先混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		-1,189,143,307.99	1,371,810,939.46
1.利息收入		5,131,402.28	5,572,588.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,131,402.28	5,572,588.70
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-321,283,203.06	751,065,040.89
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-332,856,191.59	738,620,309.82
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	11,572,988.53	12,444,731.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-876,035,315.42	603,255,755.19
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,043,808.21	11,917,554.68
减：二、费用		107,714,057.54	139,740,598.71
1. 管理人报酬		63,617,177.21	70,197,020.08
2. 托管费		10,602,862.86	11,699,503.24
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	33,096,274.18	57,431,217.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	397,743.29	412,857.87

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,296,857,365.53	1,232,070,340.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,296,857,365.53	1,232,070,340.75

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发行业领先混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	2,517,573,075.20	3,473,687,333.24	5,991,260,408.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,296,857,365.53	-1,296,857,365.53
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）	-62,954,023.62	-77,125,900.10	-140,079,923.72
其中：1.基金申购款	1,454,814,605.27	1,237,635,206.41	2,692,449,811.68
2.基金赎回款	-1,517,768,628.89	-1,314,761,106.51	-2,832,529,735.40
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）	-	-929,239,053.34	-929,239,053.34
五、期末所有者权益（基金净值）	2,454,619,051.58	1,170,465,014.27	3,625,084,065.85
项目	上年度可比期间		

	2015 年 1 月 1 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）	1,193,702,252.95	580,116,584.37	1,773,818,837.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,232,070,340.75	1,232,070,340.75
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）	1,323,870,822.25	1,661,500,408.12	2,985,371,230.37
其中：1.基金申购款	5,122,967,961.18	6,694,372,818.14	11,817,340,779.32
2.基金赎回款	-3,799,097,138.93	-5,032,872,410.02	-8,831,969,548.95
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）	2,517,573,075.20	3,473,687,333.24	5,991,260,408.44

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：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

广发行业领先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[2010]950 号文《关于核准广发行业领先股票型证券投资基金募集的批复》的批准，由基金发起人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《广发行业领先股票型证券投资基金基金合同》(后更新为“《广发行业领先混合型证券

投资基金基金合同》”，以下简称“基金合同”)发起，于 2010 年 11 月 23 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2010 年 10 月 25 日至 2010 年 11 月 19 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 4,429,587,850.13 元，有效认购户数为 58,645 户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的银行利息共计人民币 387,044.22 元，折合基金份额 387,044.22 份，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有限公司验资。

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、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金业绩比较基准： $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{中证全债指数}$ 。

本基金自 2015 年 7 月 2 日起增加 H 类基金份额类别，原有的在中国大陆销售的基金份额类别更名为 A 类基金份额，新增在香港地区销售的基金份额类别名为 H 类基金份额。根据中国证监会相关规定，本基金自 2015 年 8 月 7 日起由股票型基金变更为混合型基金，基金名称由“广发行行业领先股票型证券投资基金”变更为“广发行行业领先混合型证券投资基金”。

本基金的财务报表于 2017 年 3 月 22 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 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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。

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成本。卖出回购金融资产款于回购日按账面余额结转。

7.4.4.5 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[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，按交易所上市的同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同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同一股票的市场交易收盘价低于非公

开发股票的初始投资成本，以估值日证券交易所上市的同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同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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 $\times 1.5\%$ 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 $\times 0.25\%$ 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。

7.4.4.11 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，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 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；投资者在不同销售机构可以选择不同的收益分配方式，在同一销售机构只能选择一种收益分配方式，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的收益分配方式为准；
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. 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。

7.4.4.12 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2015]125 号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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. 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、债券免征营业税或增值税。

2. 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。

3. 对 A 类基金份额投资者通过基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，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，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。

4. 对 A 类基金份额投资者通过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。

5. 对 H 类基金份额投资者(包括企业和个人)通过基金取得的股票股息、红利收入，由内地上市公司向基金分配股息红利时，对 H 类基金份额投资者按照 10% 的税率代扣所得税；或发行债券的企业向基金分配利息时，对 H 类基金份额投资者按照 7% 的税率代扣所得税。

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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2016 年 12 月 31 日	2015 年 12 月 31 日
活期存款	511,383,601.04	655,315,614.21
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	511,383,601.04	655,315,614.21

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,116,907,511.73	3,119,453,215.45	2,545,703.72
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	3,116,907,511.73	3,119,453,215.45	2,545,703.72
项目	上年度末		
	2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,490,042,406.82	5,368,623,425.96	878,581,019.14
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	4,490,042,406.82	5,368,623,425.96	878,581,019.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融工具。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	101,803.82	116,183.64
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	666.90	1,742.20
应收结算备付金利息	3,895.80	8,412.10
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	106,366.52	126,337.94

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	7,759,642.16	16,305,240.85
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,759,642.16	16,305,240.85

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	7,670.58	66,005.37
预提费用	340,000.00	344,500.00
合计	347,670.58	410,505.37

7.4.7.9 实收基金

广发行业领先混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	2,517,134,026.65	2,517,134,026.65
本期申购	1,442,505,569.31	1,442,505,569.31
本期赎回（以“-”号填列）	-1,512,204,876.77	-1,512,204,876.77
本期末	2,447,434,719.19	2,447,434,719.19

广发行业领先混合 H

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额	账面金额
上年度末	439,048.55	439,048.55
本期申购	12,309,035.96	12,309,035.96
本期赎回（以“-”号填列）	-5,563,752.12	-5,563,752.12
本期末	7,184,332.39	7,184,332.39

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。

7.4.7.10 未分配利润

广发行业领先混合 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	2,037,267,287.73	1,436,417,304.59	3,473,684,592.32
本期利润	-420,600,075.59	-876,099,119.11	-1,296,699,194.70
本期基金份额交易产生的变动数	-37,982,216.77	-37,706,668.63	-75,688,885.40
其中：基金申购款	907,878,161.28	332,165,657.98	1,240,043,819.26
基金赎回款	-945,860,378.05	-369,872,326.61	-1,315,732,704.66
本期已分配利润	-929,239,053.34	-	-929,239,053.34
本期末	649,445,942.03	522,611,516.85	1,172,057,458.88

广发行业领先混合 H

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	-1,619.83	4,360.75	2,740.92
本期利润	-221,974.52	63,803.69	-158,170.83
本期基金份额交易产生的变动数	-292,775.04	-1,144,239.66	-1,437,014.70
其中：基金申购款	-740,153.01	-1,668,459.84	-2,408,612.85
基金赎回款	447,377.97	524,220.18	971,598.15

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-516,369.39	-1,076,075.22	-1,592,444.61

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	4,929,832.87	5,234,053.55
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	34,878.70	44,915.34
结算备付金利息收入	166,690.71	275,453.01
其他	-	18,166.80
合计	5,131,402.28	5,572,588.70

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	11,570,140,715.15	18,872,593,558.48
减：卖出股票成本总额	11,902,996,906.74	18,133,973,248.66
买卖股票差价收入	-332,856,191.59	738,620,309.82

7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无债券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,572,988.53	12,444,731.07
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,572,988.53	12,444,731.07

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
1.交易性金融资产	-876,035,315.42	603,255,755.19
——股票投资	-876,035,315.42	603,255,755.19
——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	-876,035,315.42	603,255,755.19

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	2,660,045.07	8,292,312.33
手续费返还	-	-
基金转换费收入	383,763.14	3,625,242.35
印花税返还	-	-
其他	-	-
合计	3,043,808.21	11,917,554.68

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	33,096,274.18	57,431,217.52
银行间市场交易费用	-	-
合计	33,096,274.18	57,431,217.52

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费	16,243.29	14,857.87
账户维护费	1,500.00	18,000.00
其他	-	-
合计	397,743.29	412,857.87

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国工商银行股份有限公司	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	基金管理人母公司、代销机构

深圳市前海香江金融控股集团有限公司	基金管理人股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人股东
康美药业股份有限公司	基金管理人股东
广州科技金融创新投资控股有限公司	基金管理人股东
GF International Investment Management Limited (广发国际资产管理有限公司)	基金管理人全资子公司
瑞元资本管理有限公司	基金管理人控股子公司

注：本报告期内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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	1,967,820,665.40	8.92%	399,932,587.22	1.00%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31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	1,833,037.62	9.37%	1,058,104.89	13.64%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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	372,453.83	1.08%	372,453.83	2.28%

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额*佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易)。

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	63,617,177.21	70,197,020.08
其中：支付销售机构的客户维护费	13,732,618.98	12,707,758.95

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12 月31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	10,602,862.86	11,699,503.24
----------------	---------------	---------------

注：本基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合H	广发行业领先混合A	广发行业领先混合H
报告期初持有的基金份额	37,081,876.83	-	29,999,000.00	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	7,082,876.83	-
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	37,081,876.83	-	37,081,876.83	-

报告期末持有的基金份额占基金总额比例	1.52%	-	1.47%	-
--------------------	-------	---	-------	---

注：基金管理人上年度可比期间内持有本基金份额变动的相关费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

7.4.10.4.2 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

广发行业领先混合 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。

广发行业领先混合 H

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。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	511,383,601.04	4,929,832.87	655,315,614.21	5,234,053.55

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.6 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。

7.4.11 利润分配情况

广发行业领先混合 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额	现金形式发放总额	再投资形式发放总	利润分配合计	备注

		场内	场外	分红数		额		
1	2016-11-16	-	2016-11-16	3.820	752,231,103.41	177,007,949.93	929,239,053.34	-
合计				3.820	752,231,103.41	177,007,949.93	929,239,053.34	-

7.4.12 期末（2016 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
300588	熙菱信息	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	4.94	4.94	1,380.00	6,817.20	6,817.20	-
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	3.07	3.07	2,397.00	7,358.79	7,358.79	-
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股流通受限	9.30	9.30	1,006.00	9,355.80	9,355.80	-
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	5.81	5.81	1,628.00	9,458.68	9,458.68	-
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股流通受限	5.37	5.37	1,874.00	10,063.38	10,063.38	-
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	15.28	15.28	682.00	10,420.96	10,420.96	-
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股流通受限	6.55	6.55	1,814.00	11,881.70	11,881.70	-
300588	天铁	2016-1	2017-0	新股	14.11	14.11	1,438.	20,290	20,290	-

7	股份	2-28	1-05	流通受限			00	.18	.18	
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	14.63	14.63	1,562.00	22,852.06	22,852.06	-
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股流通受限	10.44	10.44	2,316.00	24,179.04	24,179.04	-
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股流通受限	7.87	7.87	4,818.00	37,917.66	37,917.66	-
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股流通受限	40.29	40.29	1,582.00	63,738.78	63,738.78	-
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股流通受限	21.30	21.30	3,180.00	67,734.00	67,734.00	-
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股流通受限	23.16	23.16	3,491.00	80,851.56	80,851.56	-
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股流通受限	4.00	4.00	26,695.00	106,780.00	106,780.00	-
300364	中文在线	2016-08-09	2017-08-07	非公开发行流通受限	46.80	39.52	842,022.00	39,406,629.60	33,276,709.44	-

注：截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 日止，本基金无持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2016 年 12 月 31 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。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

本基金本报告期末及上年度末未持有债券投资，因此与债券相关的信用风险不重大。

7.4.13.3 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，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 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分证券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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	511,383,601.04	-	-	-	511,383,601.04
结算备付金	8,657,256.94	-	-	-	8,657,256.94
存出保证金	1,481,954.78	-	-	-	1,481,954.78
交易性金融资产	-	-	-	3,119,453,215.45	3,119,453,215.45
应收利息	-	-	-	106,366.52	106,366.52
应收申购款	-	-	-	892,080.11	892,080.11
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	521,522,812.76	-	-	3,120,451,662.08	3,641,974,474.84
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,335,589.97	3,335,589.97
应付管理人报酬	-	-	-	4,669,291.09	4,669,291.09
应付托管费	-	-	-	778,215.19	778,215.19
应付交易费用	-	-	-	7,759,642.16	7,759,642.16
其他负债	-	-	-	347,670.58	347,670.58
负债总计	-	-	-	16,890,408.99	16,890,408.99
利率敏感度缺口	521,522,812.76	-	-	3,103,561,253.09	3,625,084,065.85
上年度末 2015 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	655,315,614.21	-	-	-	655,315,614.21
结算备付金	18,693,714.50	-	-	-	18,693,714.50
存出保证金	3,871,386.89	-	-	-	3,871,386.89
交易性金融资产	-	-	-	5,368,623,425.96	5,368,623,425.96
应收证券清算款	-	-	-	6,690,082.35	6,690,082.35
应收利息	-	-	-	126,337.94	126,337.94
应收申购款	-	-	-	20,578,526.05	20,578,526.05
资产总计	677,880,715.60	-	-	5,396,018,372.30	6,073,899,087.90
负债					
应付证券清算款	-	-	-	37,343,309.34	37,343,309.34
应付赎回款	-	-	-	19,934,874.59	19,934,874.59
应付管理人报酬	-	-	-	7,409,785.12	7,409,785.12
应付托管费	-	-	-	1,234,964.19	1,234,964.19
应付交易费用	-	-	-	16,305,240.85	16,305,240.85
其他负债	-	-	-	410,505.37	410,505.37
负债总计	-	-	-	82,638,679.46	82,638,679.46
利率敏感度缺口	677,880,715.60	-	-	5,313,379,692.84	5,991,260,408.44

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 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	3,119,453,215.45	86.05	5,368,623,425.96	89.61
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	3,119,453,215.45	86.05	5,368,623,425.96	89.61

7.4.13.4.3.2 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 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	253,934,518.66	280,008,341.19
	业绩比较基准下降 5%	-253,934,518.66	-280,008,341.19

7.4.14 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 7.4.4.5。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 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 3,118,963,515.66 元，无属于第二层级的余额，属于第三层级的余额为 489,699.79 元，其中列入属于第三层级的金融工具为未上市交易的股票(2015 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 4,922,145,083.96 元，第二层级的余额为 446,478,342.00 元，无属于第三层级的余额)。

(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。

2. 除公允价值估值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	3,119,453,215.45	85.65
	其中：股票	3,119,453,215.45	85.65
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	520,040,857.98	14.28
7	其他各项资产	2,480,401.41	0.07
8	合计	3,641,974,474.84	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	96,599,670.00	2.66
C	制造业	1,706,845,446.45	47.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.00
E	建筑业	373,430,852.58	10.30
F	批发和零售业	41,844,402.72	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	257,137.20	0.01

J	金融业	59,110,799.61	1.63
K	房地产业	88,574,137.87	2.44
L	租赁和商务服务业	46,650,000.00	1.29
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	258,490,000.00	7.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	124,071,545.00	3.42
R	文化、体育和娱乐业	323,531,847.68	8.92
S	综合	-	-
	合计	3,119,453,215.45	86.05

8.2.2 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。

8.3 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	002343	慈文传媒	6,075,872	274,447,138.24	7.57
2	600491	龙元建设	13,906,200	160,477,548.00	4.43
3	603588	高能环境	4,900,000	153,370,000.00	4.23
4	300458	全志科技	1,500,000	137,145,000.00	3.78
5	300015	爱尔眼科	4,149,550	124,071,545.00	3.42
6	002053	云南能投	5,999,688	115,134,012.72	3.18
7	300345	红宇新材	10,309,794	113,098,440.18	3.12
8	002384	东山精密	5,697,876	111,735,348.36	3.08
9	002310	东方园林	7,499,909	106,123,712.35	2.93
10	300070	碧水源	6,000,000	105,120,000.00	2.90
11	600409	三友化工	10,049,990	94,369,406.10	2.60
12	603678	火炬电子	1,199,924	90,774,250.60	2.50
13	600376	首开股份	7,499,927	88,574,137.87	2.44
14	600885	宏发股份	2,599,976	83,069,233.20	2.29
15	000951	中国重汽	6,073,646	81,690,538.70	2.25

16	002045	国光电器	5,084,901	63,307,017.45	1.75
17	002281	光迅科技	799,978	62,798,273.00	1.73
18	300197	铁汉生态	4,800,000	60,864,000.00	1.68
19	600079	人福医药	3,000,000	59,850,000.00	1.65
20	002182	云海金属	3,200,000	59,552,000.00	1.64
21	002366	台海核电	1,100,000	58,982,000.00	1.63
22	002043	兔宝宝	5,000,000	57,850,000.00	1.60
23	002572	索菲亚	1,000,000	54,160,000.00	1.49
24	000807	云铝股份	8,000,000	53,600,000.00	1.48
25	300364	中文在线	1,242,022	49,084,709.44	1.35
26	002707	众信旅游	3,000,000	46,650,000.00	1.29
27	000661	长春高新	414,990	46,416,631.50	1.28
28	600068	葛洲坝	5,000,000	45,950,000.00	1.27
29	000960	锡业股份	3,500,000	45,920,000.00	1.27
30	000606	*ST 易桥	3,800,050	43,244,569.00	1.19
31	300089	文化长城	2,336,849	43,021,390.09	1.19
32	300203	聚光科技	1,399,879	42,766,303.45	1.18
33	601328	交通银行	7,000,000	40,390,000.00	1.11
34	002583	海能达	3,039,014	40,145,374.94	1.11
35	000856	*ST 冀装	2,500,000	39,175,000.00	1.08
36	000423	东阿阿胶	700,000	37,709,000.00	1.04
37	601699	潞安环能	4,356,720	35,071,596.00	0.97
38	000983	西山煤电	4,120,600	34,860,276.00	0.96
39	002262	恩华药业	1,599,942	33,438,787.80	0.92
40	000688	建新矿业	2,959,800	26,667,798.00	0.74
41	000422	湖北宜化	2,999,987	23,849,896.65	0.66
42	603939	益丰药房	760,200	22,532,328.00	0.62
43	600643	爱建集团	1,499,921	18,614,019.61	0.51
44	600759	洲际油气	1,500,000	14,730,000.00	0.41
45	300267	尔康制药	1,000,000	13,050,000.00	0.36
46	603108	润达医疗	149,937	4,582,074.72	0.13
47	600996	贵广网络	12,500	234,875.00	0.01
48	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.00
49	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.00
50	603298	杭叉集团	3,641	88,403.48	0.00
51	603228	景旺电子	3,491	80,851.56	0.00
52	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.00
53	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.00
54	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.00
55	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.00
56	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.00
57	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.00
58	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.00
59	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.00

60	603886	元祖股份	2,241	39,665.70	0.00
61	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.00
62	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.00
63	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.00
64	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.00
65	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.00
66	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.00
67	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
68	300579	数字认证	500	15,445.00	0.00
69	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
70	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
71	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
72	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
73	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
74	300591	万里马	2,397	7,358.79	0.00
75	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002343	慈文传媒	283,920,942.16	4.74
2	600029	南方航空	223,083,419.55	3.72
3	600392	盛和资源	190,058,364.85	3.17
4	600111	北方稀土	183,112,011.83	3.06
5	600491	龙元建设	183,090,283.19	3.06
6	000983	西山煤电	178,579,445.72	2.98
7	603588	高能环境	165,243,918.29	2.76
8	300458	全志科技	154,363,223.32	2.58
9	600977	中国电影	135,545,415.96	2.26
10	300015	爱尔眼科	133,916,947.97	2.24
11	000807	云铝股份	133,625,024.56	2.23
12	600115	东方航空	129,393,986.30	2.16
13	600808	马钢股份	128,470,764.48	2.14
14	300345	红宇新材	126,144,502.20	2.11
15	002384	东山精密	125,598,171.82	2.10
16	300009	安科生物	121,482,446.18	2.03
17	300070	碧水源	121,475,980.58	2.03
18	600048	保利地产	117,278,694.94	1.96

19	000960	锡业股份	116,782,280.31	1.95
20	603799	华友钴业	115,465,480.33	1.93

注：本项及下项 8.4.2、8.4.3 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。

8.4.2 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	002466	天齐锂业	319,832,658.75	5.34
2	601021	春秋航空	297,503,255.19	4.97
3	600029	南方航空	252,744,116.81	4.22
4	600111	北方稀土	195,047,962.40	3.26
5	600392	盛和资源	181,135,867.14	3.02
6	002462	嘉事堂	162,556,644.23	2.71
7	002355	兴民智通	156,599,935.74	2.61
8	002481	双塔食品	151,629,170.34	2.53
9	600703	三安光电	149,118,112.81	2.49
10	002157	正邦科技	129,369,088.32	2.16
11	600977	中国电影	129,128,603.51	2.16
12	300113	顺网科技	127,999,037.75	2.14
13	600303	曙光股份	127,468,826.50	2.13
14	300009	安科生物	126,240,427.18	2.11
15	000983	西山煤电	124,537,195.59	2.08
16	600808	马钢股份	123,877,235.68	2.07
17	002714	牧原股份	119,050,127.65	1.99
18	600115	东方航空	118,933,158.37	1.99
19	603678	火炬电子	118,835,118.57	1.98
20	300383	光环新网	106,533,691.43	1.78

8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	10,529,862,011.65
卖出股票的收入（成交）总额	11,570,140,715.15

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,481,954.78
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	106,366.52
5	应收申购款	892,080.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,480,401.41

8.12.4 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。

8.12.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
广发行业领先混合 A	134,643	18,177.21	776,160,844.49	31.71%	1,671,273,874.70	68.29%
广发行业领先混合 H	10	718,433.24	7,184,332.39	100.00%	-	0.00%
合计	134,653	18,229.22	783,345,176.88	31.91%	1,671,273,874.70	68.09%

9.2 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	广发行业领先混合 A	2,506,419.37	0.1024%
	广发行业领先混合 H	-	-
	合计	2,506,419.37	0.1021%

9.3 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	广发行业领先混合 A	>100
	广发行业领先混合 H	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	广发行业领先混合 A	>100
	广发行业领先混合 H	0
	合计	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	广发行业领先混合 A	广发行业领先混合 H
基金合同生效日（2010 年 11 月 23 日）基金份额总额	4,429,587,850.13	-
本报告期期初基金份额总额	2,517,134,026.65	439,048.55
本报告期基金总申购份额	1,442,505,569.31	12,309,035.96
减：本报告期基金总赎回份额	1,512,204,876.77	5,563,752.12
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,447,434,719.19	7,184,332.39

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。自 2016 年 10 月 13 日起，本基金管理人聘任张敬晗为公司的副总经理。相关事项已向中国证券投资基金业协会备案。

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的人事变动。

11.3 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。该案经浙江省义乌市人民法院审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。

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。

除上述事项外，本报告期内无其他涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
国泰君安	4	984,730,805.15	4.46%	917,082.97	4.69%	-
长江证券	3	954,289,812.81	4.33%	798,413.14	4.08%	-
瑞银证券	1	84,386,048.28	0.38%	78,588.13	0.40%	-
招商证券	3	831,168,033.39	3.77%	774,066.00	3.96%	-
财富里昂	1	804,391,453.54	3.65%	588,251.55	3.01%	-
国海证券	1	76,328,761.38	0.35%	71,085.32	0.36%	-
广州证券	2	75,981,872.15	0.34%	55,565.80	0.28%	-
申银万国	3	704,355,776.33	3.19%	655,965.19	3.35%	-
万联证券	4	680,029,676.15	3.08%	633,314.33	3.24%	-
川财证券	2	66,306,024.81	0.30%	48,489.90	0.25%	-
中投证券	3	568,470,872.48	2.58%	508,453.65	2.60%	-
国金证券	1	55,864,858.90	0.25%	52,026.71	0.27%	-
方正证券	6	495,222,279.15	2.25%	362,156.41	1.85%	-
华泰证券	6	471,151,855.15	2.14%	395,389.02	2.02%	-
首创证券	1	373,906,685.95	1.70%	348,217.87	1.78%	-
华安证券	1	350,270,819.53	1.59%	256,149.96	1.31%	-
兴业证券	4	347,497,278.99	1.58%	323,624.81	1.65%	-
华创证券	4	264,031,895.90	1.20%	193,084.22	0.99%	新增 1 个
国信证券	2	257,521,772.31	1.17%	239,830.26	1.23%	-
新时代证券	1	223,511,798.43	1.01%	208,157.68	1.06%	-
广发证券	7	1,967,820,665.40	8.92%	1,833,037.62	9.37%	-
安信证券	5	1,869,420,360.17	8.47%	1,548,281.70	7.91%	-
中金公司	4	180,052,587.37	0.82%	167,683.79	0.86%	新增 2 个
英大证券	2	173,773,593.54	0.79%	127,080.88	0.65%	-
天风证券	3	160,101,315.40	0.73%	117,082.85	0.60%	新增 2 个
民生证券	3	145,877,900.16	0.66%	106,681.61	0.55%	新增 1 个
光大证券	3	1,347,900,083.49	6.11%	1,255,299.87	6.41%	-
东兴证券	2	133,580,014.97	0.61%	97,687.12	0.50%	-
中银国际	2	13,281,077.49	0.06%	9,712.81	0.05%	-
中泰证券	2	1,300,707,899.34	5.90%	1,211,350.44	6.19%	新增 2 个
中信证券	4	1,286,460,010.57	5.83%	1,198,081.58	6.12%	-
东方证券	2	126,086,114.25	0.57%	117,422.58	0.60%	-
太平洋证券	2	126,077,303.48	0.57%	92,200.48	0.47%	-
中信建投	4	1,216,622,435.05	5.52%	1,112,388.04	5.68%	-
信达证券	3	110,312,592.44	0.50%	80,671.86	0.41%	新增 1 个
中原证券	2	107,511,093.50	0.49%	78,623.02	0.40%	-
联讯证券	2	1,064,404,253.17	4.83%	991,281.74	5.07%	-
海通证券	2	1,043,962,606.13	4.73%	972,241.92	4.97%	-
银河证券	3	1,014,895,253.90	4.60%	945,177.10	4.83%	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-

国联证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
平安证券	4	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	0	-	-	-	-	减少 1 个
世纪证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-

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。

11.8 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开展邮储银行个人网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-12-22
2	广发基金管理有限公司关于增加中证金牛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》	2016-11-29
3	广发基金管理有限公司关于增加大有期货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》	2016-11-28
4	广发基金管理有限公司关于广发行业领先混合型证券投资基金 A 类基金份额分红公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-11-14
5	广发基金管理有限公司关于增加弘业期货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》	2016-11-10
6	广发基金管理有限公司关于增加华西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》	2016-11-03
7	广发基金管理有限公司关于增加奕丰金融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》	2016-10-13
8	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-09-20
9	广发基金管理有限公司关于增加上海华信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》	2016-09-05
10	广发基金管理有限公司关于增加中投证券为广发行业领先混合型证券投资基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-08-24
11	广发基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞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》	2016-08-11
12	广发基金管理有限公司关于旗下基金投资中文在线（300364）非公开发行股票的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-08-10
13	广发基金管理有限公司关于增加万得投顾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》	2016-07-29
14	广发基金管理有限公司关于增加广源达信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》	2016-07-18
15	广发基金管理有限公司关于增加蛋卷基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》	2016-07-14
16	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
17	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
18	广发基金管理有限公司关于增加苏宁基金为	《中国证券报》、《证券	2016-06-07

	旗下部分基金代销机构的公告	时报》、《上海证券报》	
19	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
20	广发基金管理有限公司关于增加大智慧财富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》	2016-05-20
21	广发基金管理有限公司关于增加汇成基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》	2016-05-13
22	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
23	广发基金管理有限公司关于增加广发期货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》	2016-02-26
24	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
25	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行实行申购费率优惠的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2016-01-04
26	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

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准广发行业领先股票型证券投资基金募集的文件;
- 2.《广发行业领先股票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.《广发行业领先股票型证券投资基金托管协议》;
- 5.《广发行业领先股票型证券投资基金招募说明书》及其更新版;
- 6.法律意见书;
- 7.基金管理人业务资格批件、营业执照;
- 8.基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 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

12.3 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
二〇一七年三月二十八日