

广发新动力混合型证券投资基金
2017 年年度报告摘要
2017 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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 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 2017 年 1 月 1 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	广发新动力混合
基金主代码	000550
交易代码	000550
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 3 月 19 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	416,410,887.39 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金力图把握中国经济发展和结构转型的方向和脉络，投资于新经济周期中具备高成长性的上市公司，积极把握由此带来的获利机会，力争实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	<p>（一）资产配置策略本基金采用自上而下为主的分析模式，以宏观基本面分析和策略研究为基础，结合政策面和资金面等多种因素的影响，对股票、债券等大类资产的估值水平及投资价值进行评估，以此制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。（二）股票投资策略本基金力争前瞻性地研判驱动中国经济发展和结构转型的新增长动力，重点投资于能从新经济周期中受益、具备高成长性的上市公司，以此为基础构建股票投资组合。</p> <p>（三）债券投资策略在债券投资方面，本基金将坚持稳健投资原则，对各类债券品种进行配置。本基金根据对利率走势的预测、债券等级、债券期限结构、风险结构、不同品种流动性的高低等因素，构造债券组合，为投资者获得稳定的收益。债券投资策略的关键是对未来利率走向的预测，并及时调整债券组合使其保持对利率波动的合理敏感性。本基金将在利率合理预期的基础上，通过久期管理，稳健地进行债券投资，控制债券投资风险。（四）金融衍生品投资策略</p>

业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+中证全债指数×20%。
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	贺倩
	联系电话	020-83936666	010-66060069
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105828,020-83936999	95599
传真		020-89899158	010-68121816

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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	87,248,378.27	-174,227,942.68	530,750,397.31
本期利润	82,824,389.82	-751,801,311.56	955,158,077.64
加权平均基金份额本期利润	0.1548	-0.7230	0.6542
本期基金份额净值增长率	6.09%	-19.71%	57.34%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配基金份额利润	0.8222	0.6548	0.7550

期末基金资产净值	943,186,554.22	1,441,798,405.19	4,148,236,006.94
期末基金份额净值	2.265	2.135	2.659

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

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	-3.94%	1.07%	3.91%	0.64%	-7.85%	0.43%
过去六个月	2.67%	0.96%	7.91%	0.56%	-5.24%	0.40%
过去一年	6.09%	0.86%	17.35%	0.51%	-11.26%	0.35%
过去三年	34.02%	1.86%	13.36%	1.35%	20.66%	0.51%
自基金合同生效起至今	126.50%	1.73%	74.67%	1.28%	51.83%	0.45%

注：（1）业绩比较基准： $80\% \times \text{沪深 300 指数} + 20\% \times \text{中证全债指数}$ 。

（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 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

广发新动力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的历史走势对比图

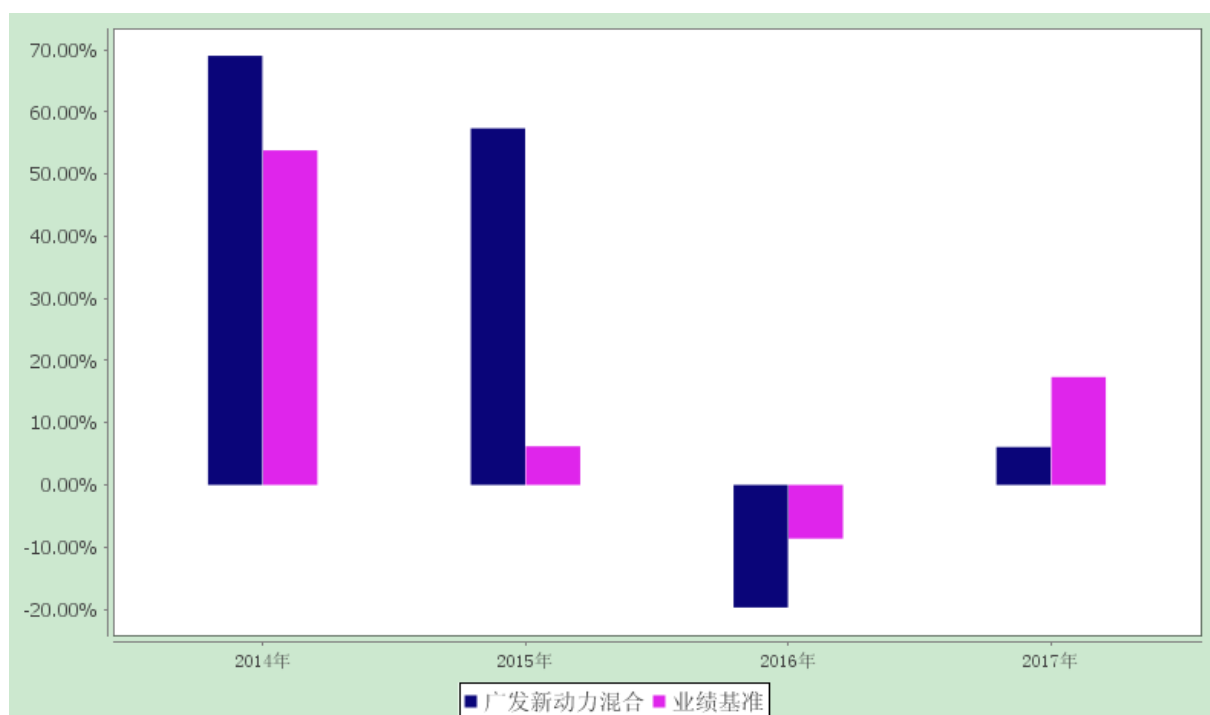
(2014 年 3 月 19 日至 2017 年 12 月 31 日)



3.2.3 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

广发新动力混合型证券投资基金

基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年（2014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

本基金过去三年未进行利润分配。

§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。公司拥有公募基金管理、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、保险保障基金委托资产管理投资管理人、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 29 个部门：权益投资一部、权益投资二部、固定收益管理总部、指数投资部、量化投资部、资产配置部、数据策略投资部、国际业务部、研究发展部、产品设计部、营销管理部、机构理财部、渠道管理总部、养老金与战略业务部、北京分公司、广州分公司、上海分公司、互联网金融部、中央交易部、基金会计部、注册登记部、信息技术部、合规稽核部、金融工程与风险管理部、规划发展部、人力资源部、财务部、综合管理部、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），参股了证通股份有限公司。

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金管理人管理 161 只开放式基金，管理资产规模为 2799 亿元。同时，公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资和养老基金投资组合。

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；权益投资总监	2014-03-19	2017-03-28	11 年	刘晓龙先生，工学硕士，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、研究小组主管、基

					金经理助理、权益投资一部总经理、权益投资总监、广发行业领先混合型证券投资基金基金经理（自 2010 年 11 月 23 日至 2017 年 3 月 29 日）、广发新动力混合型证券投资基金基金经理（自 2014 年 3 月 19 日至 2017 年 3 月 28 日）、广发多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 9 日至 2017 年 3 月 28 日）。
马文文	本基金的基金经理	2016-11-08	-	5 年	马文文先生，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、研究发展部总经理助理、权益投资一部研究员。现任广发新动力混合型证券投资基金基金经理（自 2016 年 11 月 8 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、《广发新动力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。

公司金融工程与风险管理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

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 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

复盘 2017 年，A 股主要指数走势延续了 2016 年 Q4 的趋势，大盘蓝筹和中小创继续保持显著分化。价值蓝筹股显著上涨，主力板块为白酒、家电、保险、医药、电子等；虽然其中有一路一带、周期等也有靓丽表现，但随着金融市场监管、利率上行等回调也比较显著。另一方面，创业板基本保持下跌趋势，并在 7 月创下 2015 年股灾以来的新低，中小企业内生盈利增速放缓，是导致其遭遇“戴维斯双杀”关键因素。整个上半年，上证综指、深证成指、创业板指涨/跌幅分别为 6.56%、8.48% 和-10.67%。

数据上看，宏观经济继续企稳，表现出很强的韧性，PMI 指数持续回升，在 4 季度有所回落，但整体趋稳，主要经济指标继续改善；另一方面，通胀温和，尽管货币政策边际和结构上有收紧，

但不至于显著影响市场流动性，国内加息的概率仍然不大。总体来看宏观层面表现出的东西暂时还无法显著改变市场趋势，因此也为投资个人擅长的风格资产提供了比较温和的环境。

由于年初对市场风格的变化预估不足，本基金在成长股上配置较多导致年初表现显著落后于家电、白酒、建材等强势板块。随后二季度做了相应调整，增加了消费、电子、金融等板块的配置，期间有选择性的参与了周期和新能源汽车板块，减少了成长股配置比例，使组合配置偏向均衡，但由于仓位中成长股占比相对较多，而家电等板块配置偏低，导致基金表现一般，四季度则由于电子股回撤和停牌股集中复牌下跌等因素导致净值出现较大回撤。

4.4.2 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 6.09%，同期业绩比较基准收益率为 17.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

基本面本身来看，经济没有突变的迹象，全球经济复苏的境况会持续，随着金融去杠杆的持续进行，货币层面仍以稳健偏紧为主，不排除上半年资金紧张的情况会出现，同时市场对经济增长出现分歧较大，宏观影响会比 2017 年更大。

股市层面，目前波动加大，结构性的震荡行情不断出现。市场总体比较均衡，难以指数级别的向上或者向下突破。指数不动，寻找个股结构性行情成为市场比较普遍的认识。前期强势的家电、白酒、建材板块需要新的基本面的兑现，市场热点有分散化的趋势。

2018 年，随着蓝筹白马股的 2017 年大幅上涨，基本面有兑现，但向上空间可能没有 2017 年那么大，基金计划在此范围内择机做减持，降低配置幅度。除此之外重点关注符合以下三个条件的品种：1) 行业景气度向上；2) 具备核心竞争力和护城河；3) 管理层执行力强。

本基金将以更审慎、中性的态度面对 A 股市场，合理控制仓位和配置方向，相对看好部分消费、电子等绩优价值个股应该还有挖掘空间，成长领域重点看好新能源汽车和消费电子板块。

在 2018 年，本基金希望能为投资者带来较好的收益。

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、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理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、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。合规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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—广发基金管理有限公司 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何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

本托管人认为，广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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

本托管人认为，广发基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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 洪锐明 江丽雅签字出具了德师报(审)字(18)第 P01532 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：广发新动力混合型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
资产：	-	-
银行存款	157,447,954.66	326,715,207.60
结算备付金	2,466,156.75	55,478,533.42
存出保证金	521,342.03	809,351.36
交易性金融资产	811,921,312.90	1,064,054,695.04
其中：股票投资	811,921,312.90	1,064,054,695.04
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	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	-
应收利息	29,910.59	84,783.82
应收股利	-	-
应收申购款	305,065.93	259,743.03

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	972,691,742.86	1,447,402,314.27
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 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	24,699,563.14	-
应付赎回款	1,722,846.54	1,750,276.96
应付管理人报酬	1,275,514.95	1,958,591.42
应付托管费	212,585.82	326,431.93
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,247,778.10	1,220,423.42
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	346,900.09	348,185.35
负债合计	29,505,188.64	5,603,909.08
所有者权益:	-	-
实收基金	416,410,887.39	675,425,921.50
未分配利润	526,775,666.83	766,372,483.69
所有者权益合计	943,186,554.22	1,441,798,405.19
负债和所有者权益总计	972,691,742.86	1,447,402,314.27

注: 报告截止日 2017 年 12 月 31 日, 基金份额净值人民币 2.265 元, 基金份额总额 416,410,887.39 份。

7.2 利润表

会计主体：广发新动力混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
一、收入	112,708,166.28	-698,996,833.52
1.利息收入	1,813,494.74	3,300,029.47
其中：存款利息收入	1,813,494.74	3,300,029.47
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）	114,845,782.19	-128,703,929.26
其中：股票投资收益	108,269,702.88	-136,253,962.66
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	6,576,079.31	7,550,033.40
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,423,988.45	-577,573,368.88
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	472,877.80	3,980,435.15
减：二、费用	29,883,776.46	52,804,478.04
1. 管理人报酬	17,953,274.18	34,056,240.68
2. 托管费	2,992,212.37	5,676,040.18

3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	8,518,706.21	12,662,394.40
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	419,583.70	409,802.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	82,824,389.82	-751,801,311.56
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	82,824,389.82	-751,801,311.56

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发新动力混合型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	675,425,921.50	766,372,483.69	1,441,798,405.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	82,824,389.82	82,824,389.82
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）	-259,015,034.11	-322,421,206.68	-581,436,240.79
其中：1.基金申购款	52,402,995.72	64,656,945.59	117,059,941.31
2.基金赎回款	-311,418,029.83	-387,078,152.27	-698,496,182.10
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)	416,410,887.39	526,775,666.83	943,186,554.22
项目	上年度可比期间 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)	1,560,004,705.07	2,588,231,301.87	4,148,236,006.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-751,801,311.56	-751,801,311.56
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)	-884,578,783.57	-1,070,057,506.62	-1,954,636,290.19
其中：1.基金申购款	385,633,712.56	440,817,432.92	826,451,145.48
2.基金赎回款	-1,270,212,496.13	-1,510,874,939.54	-2,781,087,435.67
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)	675,425,921.50	766,372,483.69	1,441,798,405.19

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

广发新动力股票型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许

可[2014]126 号文《关于核准广发新动力股票型证券投资基金募集的批复》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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》等有关规定和《广发新动力股票型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于 2014 年 3 月 19 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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金募集期为 2014 年 2 月 24 日至 2014 年 3 月 14 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 274,230,584.97 元，有效认购户数为 7,927 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 39,731.94 元，折合基金份额 39,731.94 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(特殊普通合伙)验资。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》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准予上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、可转换债券、资产支持证券、中小企业私募债等）、权证、货币市场工具、股指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为沪深 300 指数×80%+中证全债指数×20%。

本基金的财务报表于 2018 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（以下简称“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 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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

为确保证券投资基金估值的合理性和公允性，根据《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）和中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（中基协发[2017]6号）的相关规定，本基金自2017年11月3日起，对所持有的流通受限股票的估值技术进行变更。新的估值技术为市价折扣法，考虑了估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值以及该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣的影响，其中剩余限售期对应的流动性折扣为关键输入值，流动性折扣越高，对应流通受限股票的公允价值越低。上述流通受限股票是指在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售份、通过大宗交易取得的带限售期股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票。

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《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》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；2018年1月1日起，公开募集证券投资基金运营过程中发生的其他增值税应税行为，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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、对基金取得的股票股息、红利收入，由上市公司在收到相关扣收税款当月的法定申报期内向主管税务机关申报缴纳，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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国农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	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
广发期货有限公司	与基金管理人受同一控制

注：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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
广发证券股份有限公司	3,575,231,541.97	61.90%	7,458,734,582.21	96.26%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017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	3,329,623.65	67.42%	515,407.90	41.31%
关联方名称	上年度可比期间 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	6,946,325.31	97.04%	1,008,637.55	82.65%

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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	17,953,274.18	34,056,240.68
其中：支付销售机构的客户维护费	4,192,015.72	5,497,488.32

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 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 2 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。

7.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,992,212.37	5,676,040.18

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 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 2 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。

7.4.8.3 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。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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	上年度可比期间
----	----	---------

	2017年1月1日至2017年12月31 日	2016年1月1日至2016年12月31 日
报告期初持有的基金份额	24,710,873.15	24,710,873.15
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	24,710,873.15	-
报告期末持有的基金份额	-	24,710,873.15
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.66%

注：基金管理人本报告期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。

7.4.8.4.2 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

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。

7.4.8.5 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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016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
中国农业银行股份有限公司	157,447,954.66	1,455,406.54	326,715,207.60	2,833,557.48

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

7.4.8.6 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。

7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股流通受限	13.60	13.60	1,187.00	16,143.20	16,143.20	-
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	17.01	17.01	954.00	16,227.54	16,227.54	-
603161	科华控股	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	16.75	16.75	1,239.00	20,753.25	20,753.25	-
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股流通受限	8.88	8.88	3,640.00	32,323.20	32,323.20	-
300364	中文在线	2016-08-09	2018-08-15	非公开发行流通受限	46.80	8.62	529,962.00	9,916,138.44	4,568,272.44	2017年8月1日除权除息，比例每10股派现金红利0.40元，每10股转增15股

注：截至本报告期末 2017 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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	----------	--------	--------	----

						价				
300364	中文在线	2017-12-28	重大事项停牌	9.23	2018-01-05	10.00	1.00	18.71	9.23	

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 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。

7.4.10 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 2017 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 807,267,584.04 元，属于第二层级的余额为 85,456.42 元，属于第三层级的余额为 4,568,272.44 元（2016 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 1,063,564,995.25 元，属于第三层级的余额为 489,699.79 元，无属于第二层级的金额）。

(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。

于 2017 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三层级的余额为人民

币 4,568,272.44 元；本报告期内由第二层级转入第三层级的金额为人民币 6,958,395.48 元，转出第三层级的金额为人民币 489,699.79 元，计入公允价值变动损益的金额为人民币-2,390,123.04 元（均为权益工具产生），除上述变动外，该层级金融资产无其他变动；本基金本期末持有的该层级金融工具为新发、增发而持有的流通受限的股票，金额为人民币 4,568,272.44 元，估值技术为市价折扣法，重大不可观察输入值为折扣率，与公允价值负相关。

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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	811,921,312.90	83.47
	其中：股票	811,921,312.90	83.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	159,914,111.41	16.44
8	其他各项资产	856,318.55	0.09
9	合计	972,691,742.86	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	9,395,416.80	1.00
B	采矿业	-	-

C	制造业	649,951,501.76	68.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.00
E	建筑业	6,620,096.55	0.70
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	10,844,756.40	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	69,143,267.88	7.33
K	房地产业	61,349,525.44	6.50
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	32,323.20	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	4,568,281.67	0.48
S	综合	-	-
	合计	811,921,312.90	86.08

8.2.2 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。

8.3 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

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	002456	欧菲光	3,837,024	79,004,324.16	8.38
2	000858	五粮液	950,000	75,886,000.00	8.05
3	600519	贵州茅台	91,005	63,475,077.45	6.73
4	002384	东山精密	1,903,329	54,168,743.34	5.74
5	300476	胜宏科技	1,668,170	39,952,671.50	4.24
6	000568	泸州老窖	570,031	37,622,046.00	3.99

7	601601	中国太保	896,672	37,140,154.24	3.94
8	600048	保利地产	2,562,000	36,252,300.00	3.84
9	600887	伊利股份	1,000,066	32,192,124.54	3.41
10	601318	中国平安	457,318	32,003,113.64	3.39

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	002456	欧菲科技	86,021,770.31	5.97
2	002384	东山精密	72,412,447.20	5.02
3	300145	中金环境	68,755,499.86	4.77
4	000858	五粮液	68,579,700.03	4.76
5	000725	京东方 A	62,819,463.25	4.36
6	600519	贵州茅台	60,718,735.01	4.21
7	600048	保利地产	59,437,925.78	4.12
8	002680	长生生物	58,541,571.04	4.06
9	601601	中国太保	51,790,172.00	3.59
10	300476	胜宏科技	49,980,709.76	3.47
11	000651	格力电器	49,713,596.70	3.45
12	002431	棕榈股份	48,333,030.21	3.35
13	000606	神州易桥	47,559,403.98	3.30
14	002635	安洁科技	45,934,908.71	3.19
15	000002	万科 A	45,859,570.54	3.18
16	000568	泸州老窖	45,775,188.86	3.17
17	002685	华东重机	45,749,988.72	3.17
18	600258	首旅酒店	39,971,085.36	2.77
19	002053	云南能投	39,794,893.72	2.76
20	002241	歌尔股份	38,157,807.47	2.65
21	601186	中国铁建	38,150,795.10	2.65
22	601939	建设银行	37,552,695.89	2.60
23	603111	康尼机电	36,395,154.50	2.52
24	002310	东方园林	36,181,620.28	2.51
25	002475	立讯精密	35,902,401.32	2.49
26	600702	舍得酒业	35,009,535.56	2.43
27	601318	中国平安	33,487,675.56	2.32
28	300115	长盈精密	33,444,820.87	2.32
29	002217	合力泰	32,848,088.76	2.28
30	600887	伊利股份	32,565,299.58	2.26

31	600585	海螺水泥	31,891,746.48	2.21
32	601398	工商银行	31,399,238.90	2.18
33	002138	顺络电子	30,188,823.76	2.09
34	002517	恺英网络	29,587,426.73	2.05
35	601699	潞安环能	29,153,783.68	2.02

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	600409	三友化工	78,594,326.06	5.45
2	002384	东山精密	75,753,887.13	5.25
3	603588	高能环境	62,175,658.51	4.31
4	300070	碧水源	61,655,420.71	4.28
5	000606	神州易桥	59,554,652.82	4.13
6	002431	棕榈股份	58,729,757.50	4.07
7	000651	格力电器	57,158,979.09	3.96
8	300345	红宇新材	57,115,482.13	3.96
9	002343	慈文传媒	55,420,136.20	3.84
10	002120	韵达股份	54,969,084.56	3.81
11	600068	葛洲坝	49,178,441.88	3.41
12	002680	长生生物	46,529,908.38	3.23
13	000725	京东方 A	46,407,544.00	3.22
14	300015	爱尔眼科	46,035,495.51	3.19
15	600258	首旅酒店	45,579,876.31	3.16
16	600491	龙元建设	43,469,909.92	3.01
17	603678	火炬电子	42,403,664.51	2.94
18	601908	京运通	42,026,997.88	2.91
19	300197	铁汉生态	41,177,106.05	2.86
20	000636	风华高科	40,652,464.66	2.82
21	601939	建设银行	39,482,970.55	2.74
22	000807	云铝股份	39,428,312.49	2.73
23	002456	欧菲科技	38,733,445.62	2.69
24	601186	中国铁建	38,591,483.61	2.68

25	300458	全志科技	37,234,390.06	2.58
26	600461	洪城水业	37,106,097.61	2.57
27	002241	歌尔股份	35,694,110.89	2.48
28	000820	神雾节能	35,586,531.75	2.47
29	600079	人福医药	35,282,214.25	2.45
30	002310	东方园林	34,416,400.46	2.39
31	002812	创新股份	33,629,830.90	2.33
32	600585	海螺水泥	32,497,930.96	2.25
33	000951	中国重汽	32,394,737.84	2.25
34	601398	工商银行	32,235,251.80	2.24
35	002138	顺络电子	32,065,058.79	2.22
36	002466	天齐锂业	31,658,680.63	2.20
37	002217	合力泰	31,360,735.30	2.18
38	002517	恺英网络	31,183,134.82	2.16
39	000932	华菱钢铁	31,173,739.62	2.16
40	601699	潞安环能	31,115,638.59	2.16
41	002705	新宝股份	30,002,874.76	2.08
42	000856	冀东装备	29,641,704.60	2.06

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	2,711,714,192.29
卖出股票的收入（成交）总额	3,067,693,288.86

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。

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序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	521,342.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	29,910.59
5	应收申购款	305,065.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	856,318.55

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

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
48,046	8,666.92	9,887.24	0.00%	416,401,000.15	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	34,982.15	0.0084%

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2014年3月19日)基金份额总额	274,230,584.97
本报告期期初基金份额总额	675,425,921.50
本报告期基金总申购份额	52,402,995.72
减：本报告期基金总赎回份额	311,418,029.83
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	416,410,887.39

§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

本基金托管人于 2016 年 8 月 29 日任命史静欣女士为中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理，负责管理证券投资基金托管业务。因工作需要，余晓晨先生于 2017 年 3 月 8 日不再担任中国农业银行股份有限公司托管业务部/养老金管理中心副总经理职务。

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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一审审理后，判决原告败诉，驳回其诉讼请求。原告不服一审判决，向金华市中级人民法院提起上诉，二审法院现已审理终结，驳回原告上诉，维持原判。

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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
太平洋证券	2	659,448,402.09	11.42%	482,258.62	9.77%	新增 2 个
广发证券	3	3,575,231,541.97	61.90%	3,329,623.65	67.42%	-

天风证券	1	1,540,755,499.61	26.68%	1,126,758.91	22.82%	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	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。

广发基金管理有限公司

二〇一八年三月二十七日