

**广发理财年年红债券型证券投资基金**  
**2016 年年度报告摘要**  
**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

### 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 2016 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	广发理财年年红债券
基金主代码	270043
交易代码	270043
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 7 月 19 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	-份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求为投资者获取稳健的收益。
投资策略	本基金主要投资于固定收益类金融工具，具体包括企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、短期融资券、高收益债券、中期票据、资产支持证券、债券回购及银行存款等。在封闭期内，本基金采用买入并持有策略，对所投资固定收益品种的剩余期限与基金的剩余封闭期进行期限匹配，主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。在开放期，本基金原则上将使基金资产保持现金状态。基金管理人将采取各种有效管理措施，保障基金运作安排，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。
业绩比较基准	在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的银行一年期定期存款利率（税后）。
风险收益特征	本基金为债券型基金，属证券投资基金中的较低风险品种，风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

### 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

### 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	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-77,391.65	4,331,861.62	4,597,756.81
本期利润	-77,391.65	4,331,861.62	4,597,756.81
加权平均基金份额本期利润	-	0.0432	0.0587
本期基金份额净值增长率	-	4.33%	6.10%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配基金份额利润	-	-	0.1208
期末基金资产净值	-153,965.12	-76,573.47	101,801,346.32
期末基金份额净值	-	-	1.016

注：（1）根据基金合同的规定及本基金暂停运作的安排，本基金第三个封闭期到期后暂停进入开放期、不接受申购，本基金所有份额已于该封闭期的最后 1 日日终，即 2015 年 8 月 14 日将全部

基金份额自动赎回，详见基金管理人于 2015 年 8 月 13 日发布的《关于广发理财年年红债券型证券投资基金第三期运作期到期后暂停下一运作期运作、不接受申购等安排的公告》。暂停运作期间所发生的基金费用，由基金管理人承担。

(2) 以上 2015 年的本期基金份额净值增长率以及基金份额累计净值增长率的计算截止期间为 2015 年 8 月 14 日，其他指标为完整年度的数据。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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

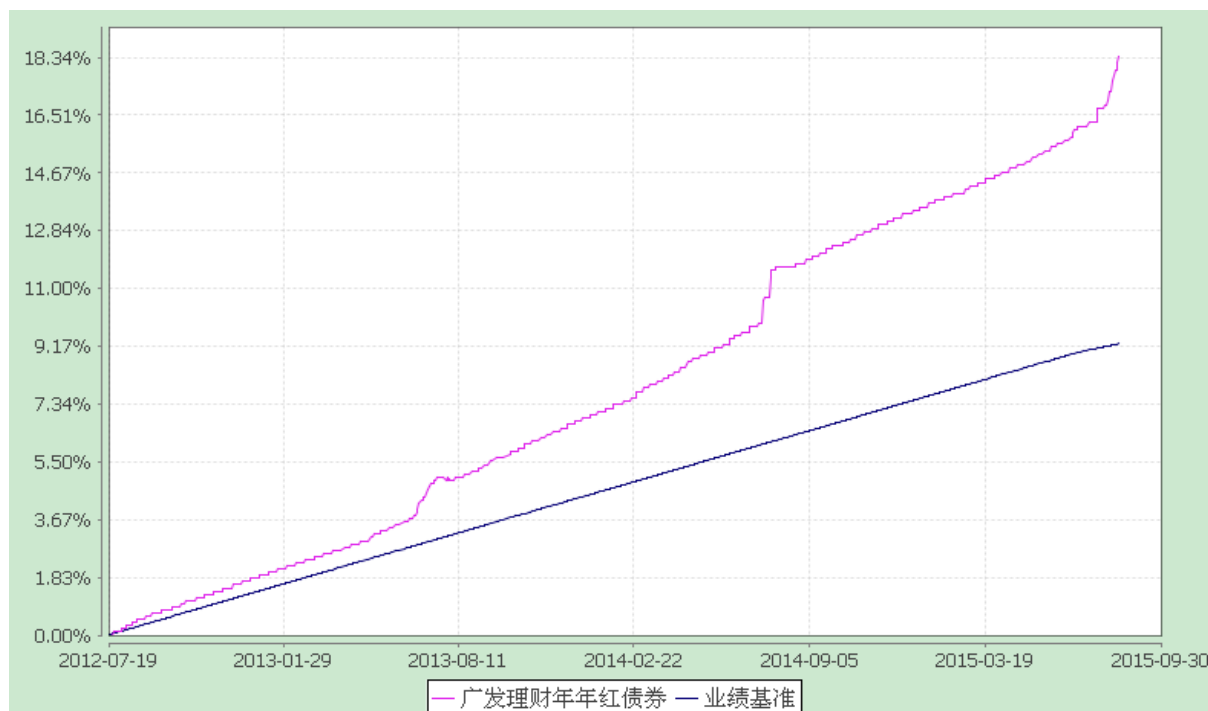
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-	-	-	-	-	-
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	10.70%	0.07%	4.93%	0.00%	5.77%	0.07%
自基金合同生效起至今	18.39%	0.05%	9.35%	0.00%	9.04%	0.05%

注：在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日的银行一年期定期存款利率（税后）。

#### 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

广发理财年年红债券型证券投资基金  
 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  
 (2012 年 7 月 19 日至 2016 年 12 月 31 日)

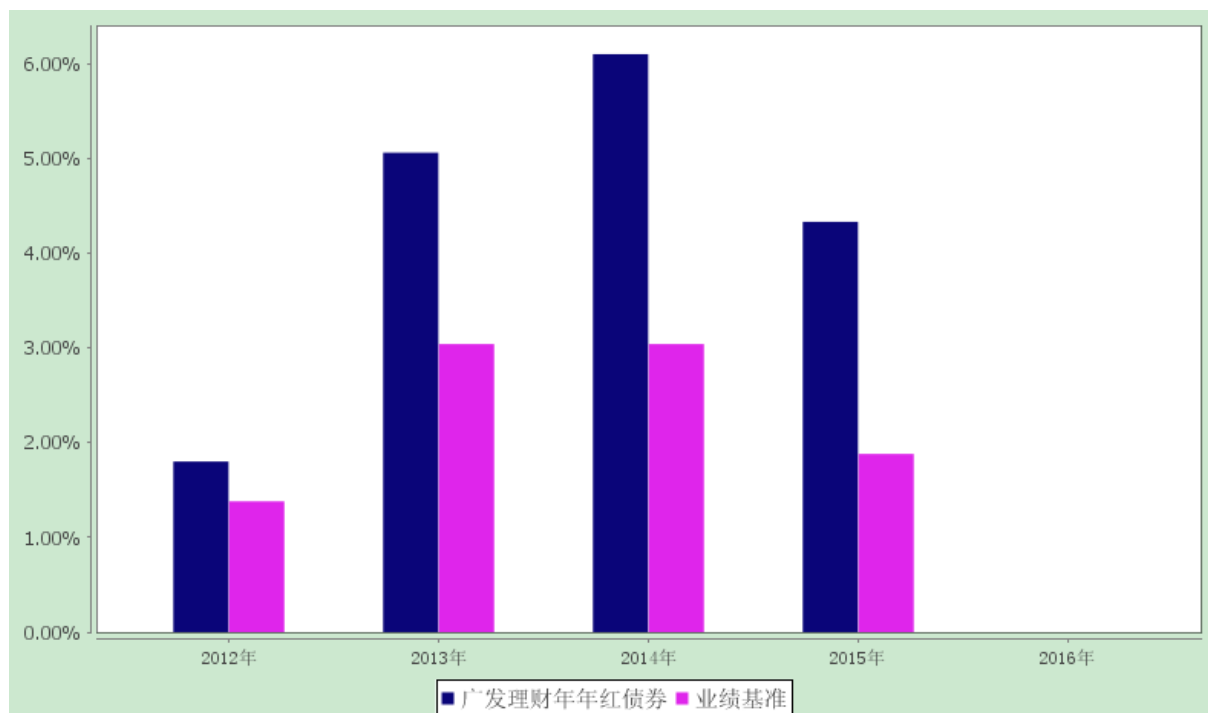


注：根据基金合同的规定及本基金暂停运作的安排，本基金第三个封闭期到期后暂停进入开放期、不接受申购，本基金所有份额已于该封闭期的最后 1 日日终，即 2015 年 8 月 14 日将全部基金份额自动赎回，详见基金管理人于 2015 年 8 月 13 日发布的《关于广发理财年年红债券型证券投资基金第三期运作期到期后暂停下一运作期运作、不接受申购等安排的公告》。

### 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

广发理财年年红债券型证券投资基金

自基金合同生效以来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(2012年)以及2015年(因暂停运作)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、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		
谭昌杰	本基金的基金经理；广发天天红货币基金的基金经理；广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理；广发聚安混合基金的基金经理；广发聚宝混合基金的基金经理；广发聚康混合基金的基金经理；广发稳安保本混合基金的基金经理；广发安泽纯债债券基金的基金经理；广发鑫源混合基金的基金经理	2012-07-19	-	8 年	男，中国籍，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书，2008 年 7 月至 2012 年 7 月在广发基金管理有限公司固定收益部任研究员，2012 年 7 月 19 日起任广发理财年年红债券基金的基金经理，2012 年 9 月 20 日至 2015 年 5 月 26 日任广发双债添利债券基金的基金经理，2013 年 10 月 22 日起任广发天天红发起式货币市场基金的基金经理，2014 年 1 月 10 日至 2015 年 7 月 23 日任广发钱袋子货币市场基金的基金经理，2014 年 1 月 27 日至 2015 年 5 月 26 日任广发集鑫债券型证券投资基金，2014 年 1 月 27 日至 2015 年 7 月 23 日任广发天天利货币市场基金的基金经理，2014 年 9 月 29 日至 2015 年 4 月 29 日任广发季季利债券基金的基金经理，2015 年 1 月 29 日起任广发趋势优选灵活配置混合基金的基金经理，2015 年 3 月 25 日起任广发聚安混合基金的基金经理，2015 年 4 月 9 日起任广发聚宝混合基金的基金经理，2015 年 6 月 1 日起任广发聚康混合基金的基金经理，2016 年 2 月 4 日起任广发稳安保本混合基金的基金经理，2016 年 6 月 17 日至 2016 年 11 月 17 日任广发安泽回报混合基金的基金经理，2016 年 11 月 2 日起任广发鑫源混合基金的基金经理，2016 年 11 月 18 日起任广发安泽纯债债券基金的基金经理。

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、《广发理财年年红债券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

本报告期内，传统工业指标数据表现一般，宏观调查数据显示经济持续回暖。经过市场化出清以及政府层面的强力去产能，养殖、钢铁、煤炭等行业的利润水平显著回升。在具体去化过程中，民企受到的冲击更大，国企整体的盈利能力得以加强，期间爆发了多起信用违约风险，但更大部分的信用事件得以保全。房地产价格的全国性普涨是年度主题，部分地区的上涨幅度超过 50%，一方面促成了居民资产负债表的调整，也带动了整条房地产生产链企业的盈利好转。房价的大涨促使中央层面于国庆期间出台一系列专项调控措施。虽然货币政策的转向在 3 季度已经有所端倪，但房地产调控是个触发因素。资金面在国庆节后逐步收紧，11 月份开始，资金利率的攀升愈演愈烈。年底的国海事件和中央经济会议确定的降杠杆、去泡沫的政策方向，带动债券收益率快速上行，大部分公募债券基金为此基本侵蚀了全年的收益。

本基金在本运作期内暂停运作。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金暂停运作，没有收益。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017 年国内外的变动较大。从国内来看，预计货币政策全年都会中性偏紧，尤其在上半年从紧的幅度会更大一些。下半年的不确定性因素更多，我们将主要关注国内的通胀走势和房地产情况以及美联储的加息情况。目前来看，全年的经济不会差，债券市场在上半年整体都处于调整期，下半年的不确定因素较多，在当前的时点很难说下半年的债市走势。

本基金已经暂停运作，后续等待重启时机。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的副总经理、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、监察稽核部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。监察稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上

所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关债券品种的估值数据。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

### **§5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对广发理财年年红债券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，广发理财年年红债券型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发理财年年红债券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，广发理财年年红债券型证券投资基金未进行利润分配。

#### **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理财年年红债券型证券投资基金 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**

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(17)第 P00491 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：广发理财年年红债券型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	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	3,651.34	79,793.13
结算备付金	-	-
存出保证金	-	797.50
交易性金融资产	-	-
其中：股票投资	-	-
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	3.90	17.90
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
<b>资产总计</b>	<b>3,655.24</b>	<b>80,608.53</b>
	本期末	上年度末
负债和所有者权益	2016 年 12 月 31 日	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	-	-
应付管理人报酬	-	-
应付托管费	-	-
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	-	-
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	157,620.36	157,182.00
<b>负债合计</b>	<b>157,620.36</b>	<b>157,182.00</b>
<b>所有者权益：</b>	-	-
实收基金	-	-
未分配利润	-153,965.12	-76,573.47
<b>所有者权益合计</b>	<b>-153,965.12</b>	<b>-76,573.47</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>3,655.24</b>	<b>80,608.53</b>

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 0.000 元，基金份额总额 0 份。

## 7.2 利润表

会计主体：广发理财年年红债券型证券投资基金

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	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	<b>342.71</b>	<b>5,729,141.66</b>
1.利息收入	342.71	3,849,358.45
其中：存款利息收入	342.71	32,281.10
债券利息收入	-	3,790,731.38
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	26,345.97
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-	1,848,204.73
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	1,848,204.73
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）	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	-	31,578.48
<b>减：二、费用</b>	<b>77,734.36</b>	<b>1,397,280.04</b>
1. 管理人报酬	-	173,303.53
2. 托管费	-	51,349.22
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	-	-
5. 利息支出	-	960,573.45
其中：卖出回购金融资产支出	-	960,573.45
6. 其他费用	77,734.36	212,053.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>-77,391.65</b>	<b>4,331,861.62</b>
减：所得税费用	-	-



四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-77,391.65	4,331,861.62
-------------------	------------	--------------

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发理财年年红债券型证券投资基金

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）	-	-76,573.47	-76,573.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-77,391.65	-77,391.65
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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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）	-	-153,965.12	-153,965.12
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	89,697,602.81	12,103,743.51	101,801,346.32

金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,331,861.62	4,331,861.62
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)	-89,697,602.81	-16,512,178.60	-106,209,781.41
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-89,697,602.81	-16,512,178.60	-106,209,781.41
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)	-	-76,573.47	-76,573.47

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

广发理财年年红债券型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2012]841 号文《关于核准广发理财年年红债券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》、《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《广发理财年年红债券型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起, 于 2012 年 7 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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期为 2012 年 7 月 16 日至 2012 年 7 月 16 日止, 本基金为契约型开放式基金, 以定期开放方式运作, 存续期限不定, 募集资金总额为人民币 543,111,437.13 元, 有效认购户数为 3,326

户。其中，认购款项在基金验资确认日之前产生的利息共计人民币 15.31 元，折合基金份额 15.31 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。本基金募集资金经天健会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

根据基金合同规定，每个开放期的最后一日（份额折算日），本基金将进行份额折算，即基金管理人根据基金合同的约定，在基金份额持有人持有的基金份额所代表的资产净值总额保持不变的前提下，对本基金所有份额进行折算，将本基金所有份额的基金份额净值调整为 1.000 元，并将基金份额数按折算比例相应调整。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行的债券、货币市场工具、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金主要投资于固定收益类金融工具，具体包括企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、短期融资券、高收益债券、中期票据、资产支持证券、债券回购及银行存款等。本基金不从二级市场买入股票或权证，也不参与一级市场新股申购或股票增发。本基金不投资可转换债券，但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。本基金将采用买入并持有策略，主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具。本基金业绩比较基准为该封闭期起始日的银行一年期定期存款利率（税后）。

根据基金合同的约定及结合市场环境及产品需求分析，经与基金托管人协商一致，并向中国证监会备案，本基金管理人决定本基金第三个封闭期到期后暂停进入开放期、不接受申购。本基金所有份额将在该封闭期的最后 1 日日终，即 2015 年 8 月 14 日全部基金份额自动赎回，赎回款项在该日后的 3 个工作日内从本基金托管账户划出。本基金暂停运作以后，本基金管理人将根据实际情况，决定下一开放期和封闭期的安排，在报中国证监会备案后，进行下一开放期的申购。下一封闭期的运作将依据基金合同的规定正常运作。截至资产负债表日，本基金仍暂停运作。

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 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

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 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 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。

6. 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，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 7.4.7 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。

#### 7.4.8 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

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股票交易。

###### 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 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	15,256,810.42	100.00%

#### 7.4.8.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	165,078,000.00	100.00%

#### 7.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度末无应付关联方佣金余额。

#### 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 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	-	173,303.53
其中：支付销售机构的客户维护费	-	76,925.12

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至封闭期末，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封闭期结束后的 3 个工作日之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。

在开放期，本基金不计提管理费。

#### 7.4.8.2.2 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	-	51,349.22

注：基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

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，逐日累计至封闭期末，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封闭期结束后的 3 个工作日之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。

在开放期，本基金不计提托管费。

#### 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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 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 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	
	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	3,651.34	342.30	79,793.13	11,411.13

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。

**7.4.8.6 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（2016 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**

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证券。

**7.4.9.2 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的股票。

**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 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。

**7.4.9.3.2 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。

**7.4.10 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 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有以公允价值计量的金融工具(2015 年 12 月 31 日：未持有以公允价值计量的金融工具)。

(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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

6	银行存款和结算备付金合计	3,651.34	99.89
7	其他各项资产	3.90	0.11
8	合计	3,655.24	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

本基金本报告期末未持有股票。

### 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前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 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

本基金本报告期内未持有股票。

### 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

本基金本报告期内未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

## 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在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	3.90
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3.90

#### 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(2012年7月19日)基金份额总额	543,111,437.13
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	-

### §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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	5	-	-	-	-	-

北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财富里昂	1	-	-	-	-	-
财富证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	0	-	-	-	-	减少 1 个
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
东方证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	6	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	7	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	4	-	-	-	-	-
国信证券	4	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
宏源证券	3	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	4	-	-	-	-	新增 1 个
华福证券	2	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	6	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
民族证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	3	-	-	-	-	-
世纪证券	1	-	-	-	-	-

首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
万和证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
万联证券	4	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
兴业证券	4	-	-	-	-	-
银河证券	3	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	新增 2 个
中泰证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
中天证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	4	-	-	-	-	-
中信证券	4	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-

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

二〇一七年三月二十八日