

广发沪港深新起点股票型证券投资基金

2017 年年度报告

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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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。

本报告期自 2017 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.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§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.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
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.....	16
§6 审计报告	16
6.1 审计意见.....	16
6.2 形成审计意见的基础.....	16
6.3 其他信息.....	17
6.4 管理层对财务报表的责任.....	17
6.5 注册会计师的责任.....	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	23

§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	60
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
8.12 投资组合报告附注.....	61
§9 基金份额持有人信息	61
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	61
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	62
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.....	62
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	62
11.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
11.4 基金投资策略的改变.....	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	63
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.....	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	63
11.8 其他重大事件.....	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息	66
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	66
§13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录.....	66
13.2 存放地点.....	67
13.3 查阅方式.....	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发沪港深新起点股票型证券投资基金
基金简称	广发沪港深新起点股票
基金主代码	002121
交易代码	002121
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 11 月 2 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,465,526,497.21 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于境内市场和香港市场的股票，在深入研究的基础上，精选质地优良的股票进行投资，在严格控制风险的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金股票投资比例占基金资产的比例不低于 80%。在基金合同以及法律法规所允许的范围内，本基金将根据对宏观经济环境、所投资主要市场的估值水平、证券市场走势等进行综合分析，合理地进行股票、债券及现金类资产的配置。

业绩比较基准	45%×沪深 300 指数收益率+45%×恒生指数收益率+10%×中证全债指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金将投资于港股通标的股票，需承担汇率风险及境外市场风险。

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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	段西军	方琦
	联系电话	020-83936666	0755-22160168
	电子邮箱	dxj@gffunds.com.cn	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		95105828,020-83936999	95511-3
传真		020-89899158	0755-82080387
注册地址		广东省珠海市横琴新区宝中路 3号4004-56室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047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	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047号
邮政编码		510308	518001
法定代表人		孙树明	谢永林

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	2017 年	2016 年 11 月 2 日(基金合同生效日)至 2016 年 12 月 31 日
本期已实现收益	127,880,457.27	-19,618,152.05
本期利润	367,278,152.20	-29,874,757.11
加权平均基金份额本期利润	0.4657	-0.0356
本期加权平均净值利润率	37.34%	-3.59%
本期基金份额净值增长率	49.79%	-3.00%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末
期末可供分配利润	179,080,380.24	-29,874,458.05
期末可供分配基金份额利润	0.1222	-0.0299
期末基金资产净值	2,129,095,150.32	969,406,018.93
期末基金份额净值	1.453	0.970
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末
基金份额累计净值增长率	45.30%	-3.00%

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	10.66%	1.46%	6.07%	0.66%	4.59%	0.80%
过去六个月	23.55%	1.24%	11.71%	0.59%	11.84%	0.65%
过去一年	49.79%	1.03%	25.96%	0.52%	23.83%	0.51%
自基金合同生效起至今	45.30%	0.97%	21.91%	0.54%	23.39%	0.43%

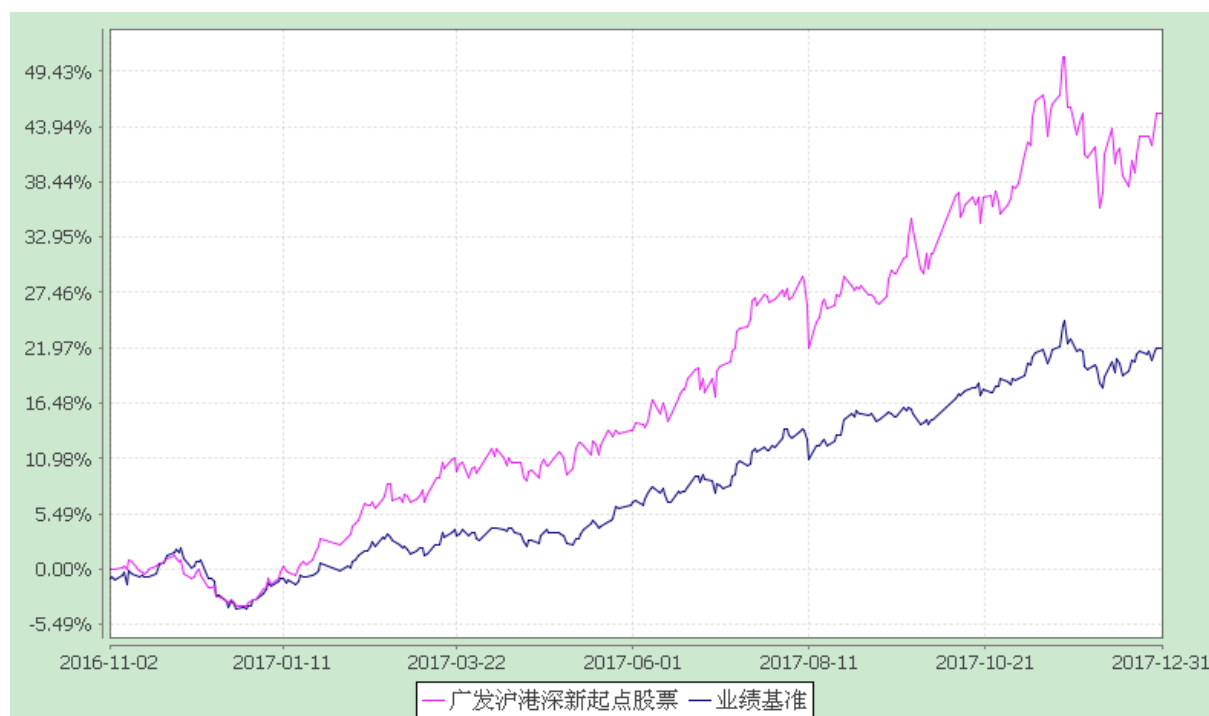
注：（1）业绩比较基准： $45\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 45\% \times \text{恒生指数收益率} + 10\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

（2）业绩比较基准是根据基金合同关于资产配置比例的规定构建的。

3.2.2 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

广发沪港深新起点股票型证券投资基金

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
(2016 年 11 月 2 日至 2017 年 12 月 31 日)

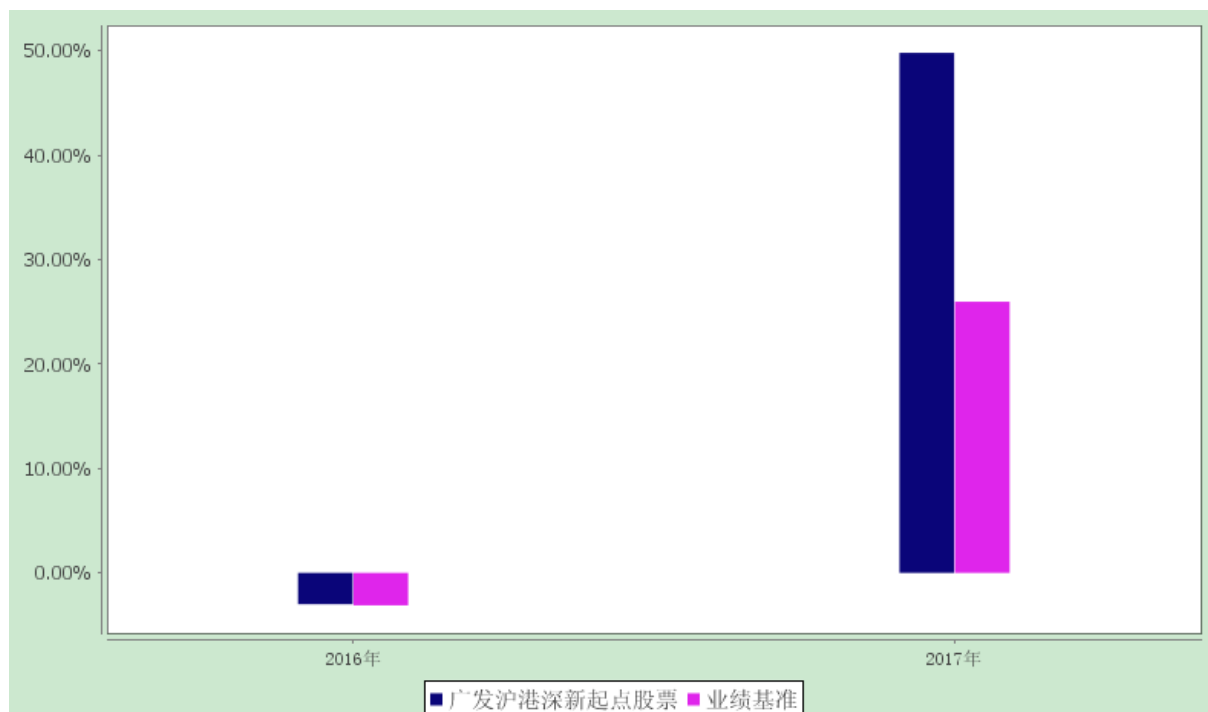


注：本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

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

广发沪港深新起点股票型证券投资基金

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（2016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

本基金自合同生效日（2016年11月2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		
李耀柱	本基金的基金经理；广发纳指 100ETF 基金的基金经理；广发美国房地产指数 (QDII) 基金的基金经理；广发纳斯达克 100 指数 (QDII) 基金的基金经理；广发全球农业指数 (QDII) 基金的基金经理；广发全球医疗保健 (QDII) 基金的基金经理；广发生物科技指数 (QDII) 基金的基金经理；广发道琼斯石油指数 (QDII-LOF) 基金的基金经	2016-11-09	-	8 年	李耀柱先生，理学硕士，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中央交易部股票交易员、国际业务部研究员、基金经理助理、广发亚太中高收益债券型证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日至 2017 年 11 月 9 日）。现任广发基金管理有限公司国际业务部总经理助理、广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（自 2015 年 12 月 17 日起任职）、广发标普全球农业指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日起任职）、广发纳斯达克 100 指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日起任职）、广发美国房地产指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日起任职）、广发全球医疗保健指数证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日起任职）、广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金基金经理（自 2016 年 8 月 23 日起任职）、广发沪港深新起点股票型证券投资基金基

	理；广发港股通恒生综合中型股指数基金的基金经理；广发海外多元配置（QDII）基金的基金经理；国际业务部总经理助理				金经理（自 2016 年 11 月 9 日起任职）、广发道琼斯美国石油开发与生产指数证券投资基金（QDII-LOF）基金经理（自 2017 年 3 月 10 日起任职）、广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2017 年 9 月 21 日任职)、广发海外多元配置证券投资基金（QDII）基金经理（自 2018 年 2 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、《广发沪港深新起点股票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

一月汽车、保险、零售和原材料等板块发力，港股全线上涨。由于美元回落，人民币贬值预期减缓，港股在 1 月全线反弹。买盘主要来自于非大陆的海外资金。随着美元回落，人民币汇率稳定，资金回流新兴市场，港股作为低配的市场受到市场的追捧。我们在一月整体加大了仓位，配置上主要以优质成长股和利润有明显改善的周期股为主。

二月整体降低仓位，调整了结构，降低了原油板块的比例，增加了可选消费。二月份港股表现十分强势，上游原材料的公司在春节后大幅上涨，主要反映的是中国的信贷数据超预期和市场对中国开工数据超预期的期望。由于这个月没法证伪开工数据，所以市场在信贷数据出来后表现得对市场有充分的信心，行情也由上游原材料行业扩展到中游，金融等周期性行业。但是到了月末，市场重新担心美联储 3 月加息，市场短期见顶。

三月份总体我们还是进行结构调整。月初我们憧憬年报行情会进一步推升港股，我们在月初整体保持高仓位，到了月中，我们发现公用事业等公司的业绩持续超出市场预期，同时我们看到了银行股等金融股的 AH 折价已经收窄到个位数，所以我们进行结构调整，降低了金融股的比例，增加

了公用事业股的配置比例。

四月港股走势先抑后扬，上旬受到地缘政治局势紧张影响，以及复活节假日因素，市场观望气息浓厚，指数呈现震荡走势，复活节假日后，受内地金融监管趋严导致 A 股连日下跌拖累，港股节后跟随下跌，在月底法国大选第一轮结果尘埃落定且利于风险偏好，全球市场普涨，同时 A 股也逐渐企稳，港股调头上涨。当月，增加公用事业等防御类标的，并在第二周增加配置信息科技、高股息外资银行等个股，在月底增加配置保险、医药类个股。

五月港股表现强劲，并没有受到 A 股 5 月以来连续下跌的影响，另一方面南下资金依旧踊跃，港股板块轮动明显，在金融股、内房股、内险股、以腾讯为代表的权重股等轮番推动下，恒生指数再创 2015 年中以来新高。第一周在法国大选之前，我们担心市场风险，保持谨慎不加仓；第二周，我们增加香港本地金融股配置，小幅提高仓位；第三周，对突然回调的燃气和科技板块进行减仓，回避市场风险；第四周，小幅增加仓位，增加原材料、金融股配置，降低周期股持仓。

六月 A 股企稳回升，但外围市场则波动增加，前期表现强势的市场和板块均出现回调，港股市场受外围影响，本月呈现震荡走势。第一周增加了非银板块仓位，增加指数期货空头对冲仓位，同时成功做了一笔事件套利（敏华）；第二周增加了香港本地金融股、有色等板块；第三周增加了香港通讯设备板块；第四周增加了家电等消费类个股。

七月恒生指数走势强劲，恒生指数上涨 6.05%，恒生国企指数上涨 4.46%，恒指创出 2015 年 6 月以来新高。当月市场行情主要受到中报利好推动，金融地产、资讯科技和周期类板块表现良好，推动大市走强。外围美联储鸽派言论降低了市场对九月加息的预期，市场风险偏好上升。港股通资金持续流入，资金面情况良好。本基金增加了保险板块的比例，减少了公用事业和汽车经销商公司的占比。

八月港股整体上涨，在月中受到朝鲜半岛局势影响有所回调，随后在外围风险因素缓解后，港股继续中报业绩行情，在金融地产、原材料等板块强势带动下，截止至 8 月底，恒生指数涨幅超过 27%，在全球股票市场中涨幅第一。但八月底开始，资金风格出现变化，前期涨幅较大的大盘股受到获利回吐压力影响回调，资金转向涨幅不显著的中小型股票，并且资金轮动的速度加快。本基金增加银行保险等板块持仓。

九月港股高位震荡，银行保险板块表现疲弱，但是香港内地房地产板块大幅上涨。同时，香港的中小型公司的交易活跃，中型的公司表现特别优异，快速追赶大型的公司。但是到月底，房地产调控政策变严影响港股的整体气氛，部分中小市值的股票快速回落，港股出现了小幅调整。本基金增加短期跌幅过大的手机零部件板块和豪华汽车的比例。

十月份假期期间，在内地宣布定向降准，以及外资积极买入的推动下，港股表现超预期强劲，

但经历月初上涨后,港股大部分时间都处于高位盘整的态势,在恒生指数经历年初以来涨幅接近 30% 的成绩下,当前阶段资金较为敏感,在遇到一些利空因素时候,部分资金会选择获利了结,因而导致大盘的震荡走势。

十一月港股表现分化。月初港股市场焦点集中在三季度业绩披露上,伴随着 A 股连续向好,恒生指数稳步上涨,到月中,A 股掉头向下,港股在突破 29000 点后有所调整,但随着下半月美股走势强劲,港股市场交易气氛逐渐活跃,成交量显著增加,港股通资金流入也明显上升,恒生指数时隔 10 年再次突破 3 万点关口,然而该突破并没能持续,由于 A 股市场连续下跌,主力板块内资银行、保险纷纷下跌,月底美国科技股回调,带动港股科技板块集体调整,恒生指数月底持续承压,收窄了月中以来的涨幅。

十二月初港股出现获利回吐,板块上前期涨幅较大的 TMT,保险等板块都出现较大的回调,获利情绪严重。但是由于港股的基本面没有改变,恒生指数在月中就出现见底的信号。等美联储议息会结束后,港股重新回到上涨的趋势中,并以靠近全年最高点的位置结束全年的行情。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为 49.79%,同期业绩比较基准收益率为 25.96%。

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 2018 年,我们认为中国的权益类资产特别是港股仍然有不错的机会。一方面,我们认为 2018 年中国的经济在全球复苏的一个背景下面仍然是十分强劲的,所以中国的权益类资产会表现得不错。另外一方面,中国的权益类资产在全球的权益类资产中仍然是性价比很高资产。所以今年中国权益类资产仍然十分有吸引力。港股在中国权益类资产中估值是最低的,未来香港市场随着新的上市政策落地,更多优质科技企业会在香港上市,香港将是中国未来非常有活力的资产之一,我们仍然十分看好港股市场。不过,今年市场的波动率会比 2017 年大非常多,结构性的机会会更加明显。本基金未来会集中配置到估值低,同时有竞争优势、有增长的龙头个股之中。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展情况,坚持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,继续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。公司合规稽核部门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、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。

4.8 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，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，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发沪港深新起点股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由广发基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

德师报(审)字(18)第 P01434 号

广发沪港深新起点股票型证券投资基金持有人：

6.1 审计意见

我们审计了广发沪港深新起点股票型证券投资基金（以下简称“广发沪港深新起点股票”）的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度及 2016 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附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，公允反映了广发沪港深新起点股票 2017 年 12 月 31 日及 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度及 2016 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于广发沪港深新起点股票，并履行了职业道德方面的其他责任。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 其他信息

广发沪港深新起点股票的基金管理人广发基金管理有限公司管理层对其他信息负责。其他信息包括广发沪港深新起点股票年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层对财务报表的责任

基金管理人管理层负责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，使其实现公允反映，并设计、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导致的重大错报。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估广发沪港深新起点股票的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算广发沪港深新起点股票、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督广发沪港深新起点股票的财务报告过程。

6.5 注册会计师的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，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。

(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对广发沪港深新起点股票持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致广发沪港深新起点股票不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) 中国注册会计师
洪锐明 江丽雅
中国·上海
2018 年 3 月 23 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：广发沪港深新起点股票型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	307,040,250.70	102,273,840.18
结算备付金		59,982,521.21	3,454,545.45
存出保证金		3,109,911.07	-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,924,460,608.85	352,496,585.94

其中：股票投资		1,924,460,608.85	352,496,585.94
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	-	500,000,000.00
应收证券清算款		-	13,223,040.72
应收利息	7.4.7.5	48,032.62	434,792.51
应收股利		323,015.14	93,789.86
应收申购款		65,042,360.93	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,360,006,700.52	971,976,594.66
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		221,173,953.40	-
应付赎回款		5,829,889.45	-
应付管理人报酬		2,221,845.16	1,244,717.77
应付托管费		370,307.55	207,452.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	981,054.64	1,068,404.99
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	334,500.00	50,000.01
负债合计		230,911,550.20	2,570,575.73
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	1,465,526,497.21	999,280,476.98
未分配利润	7.4.7.10	663,568,653.11	-29,874,458.05
所有者权益合计		2,129,095,150.32	969,406,018.93
负债和所有者权益总计		2,360,006,700.52	971,976,594.66

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.453 元，基金份额总额 1,465,526,497.21 份。

7.2 利润表

会计主体：广发沪港深新起点股票型证券投资基金

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	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 11 月 2 日（基 金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日
一、收入		392,034,848.35	-24,580,090.19
1.利息收入		1,474,657.59	941,285.43
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,053,404.48	382,295.01
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		421,253.11	558,990.42
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		146,619,801.94	-15,264,802.42
其中：股票投资收益	7.4.7.12	135,218,082.78	-15,406,043.25
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	-17.33	-
股利收益	7.4.7.15	11,401,736.49	141,240.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	239,397,694.93	-10,256,605.06
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	4,542,693.89	31.86
减：二、费用		24,756,696.15	5,294,666.92
1. 管理人报酬		14,594,395.82	2,005,626.82
2. 托管费		2,432,399.28	334,271.11
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	7,363,901.05	2,904,368.98
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	366,000.00	50,400.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		367,278,152.20	-29,874,757.11
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		367,278,152.20	-29,874,757.11

注：本基金合同生效日为 2016 年 11 月 2 日，上年度可比期间不完整。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发沪港深新起点股票型证券投资基金

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）	999,280,476.98	-29,874,458.05	969,406,018.93
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	367,278,152.20	367,278,152.20
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）	466,246,020.23	326,164,958.96	792,410,979.19
其中：1.基金申购款	1,206,149,881.98	416,171,261.09	1,622,321,143.07
2.基金赎回款	-739,903,861.75	-90,006,302.13	-829,910,163.88
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）	1,465,526,497.21	663,568,653.11	2,129,095,150.32
项目	上年度可比期间		
	2016 年 11 月 2 日（基金合同生效日）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）	499,290,272.94	-	499,290,272.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-29,874,757.11	-29,874,757.11
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）	499,990,204.04	299.06	499,990,503.10
其中：1.基金申购款	499,999,000.00	-	499,999,000.00

2.基金赎回款	-8,795.96	299.06	-8,496.90
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）	999,280,476.98	-29,874,458.05	969,406,018.93

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

广发沪港深新起点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[2015]2157 号《关于准予广发沪港深新起点股票型证券投资基金注册的批复》和机构部函[2016]2484 号《关于广发沪港深新起点股票型证券投资基金延期募集备案的回函》的核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发沪港深新起点股票型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2016 年 10 月 28 日向社会公开发行募集并于 2016 年 11 月 2 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2016 年 10 月 28 日至 2016 年 10 月 28 日，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 499,290,272.94 元，有效认购户数为 215 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 9,985.59 元，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。上述资金业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，包括境内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券以及经法律法规或中国证监会允许投资的其他债券类金融工具）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基

金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金业绩比较基准为： $45\% \times \text{沪深 300 指数收益率} + 45\% \times \text{恒生指数收益率} + 10\% \times \text{中证全债指数收益率}$ 。

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 日及 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度及 2016 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。可比期间为 2016 年 11 月 2 日（基金合同生效日）至 2016 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

1. 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产包括股票投资、债券投资、资产支持证券和衍生工具投资等，其中股票投资、债券投资和资产支持证券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。

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），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认权证投资收益。卖出权证的成本按移动加权平均法结转。

(4) 期货投资

期货投资于相关合同签署日以公允价值进行初始计量，并以公允价值进行后续计量，公允价值变动计入当期损益。因期货交易每日无负债结算确认的相关金融资产和金融负债，与相关的期货暂收暂付款之间按抵销后的净额在资产负债表内列示。

(5) 资产支持证券

买入资产支持证券于交易日按资产支持证券的公允价值入账，相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含资产支持证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)。

卖出资产支持证券于交易日确认资产支持证券投资收益。卖出资产支持证券按移动加权平均法结转成本。

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。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；对于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股票公司公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，按照中国证监会或中国证券投资基金业协会的有关规定确定公允价值。

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。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和市价折扣法等。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

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。

对于长期停牌的股票，若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% 以上的，经基金管理人估值委员会同意，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。

非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期股票等流通受限股票，考虑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，采用市价折扣法确定公允价值。

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。

（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。

(4) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提。

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) 资产支持证券投资收益于交易日按卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本与应收利息（若有）后的差额确认。

(4) 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。

(5) 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×1.50%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×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 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 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；
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. 本基金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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，折算后记账本位币金额与原记账本位币金额的差额作为公允价值变动处理，直接计入当期损益。

7.4.4.13 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

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[2014]81号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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、对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，由 H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税；基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国证券登记结算有限责任公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。

5、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。

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、基金通过沪港通买卖联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	307,040,250.70	102,273,840.18
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	307,040,250.70	102,273,840.18

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,695,319,518.98	1,924,460,608.85	229,141,089.87

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		1,695,319,518.98	1,924,460,608.85	229,141,089.87
项目		上年度末		
		2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		362,753,191.00	352,496,585.94	-10,256,605.06
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		362,753,191.00	352,496,585.94	-10,256,605.06

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

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日

	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售金融资产	-	-
银行间买入返售金融资产	-	-
合计	-	-
项目	上年度末	
	2016 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所买入返售金融资产	500,000,000.00	-
银行间买入返售金融资产	-	-
合计	500,000,000.00	-

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	33,123.06	18,344.13
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	736.98	428.82
应收结算备付金利息	14,172.58	2,183.84
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	413,835.72
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	48,032.62	434,792.51

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	上年度末

	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	981,054.64	1,068,404.99
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	981,054.64	1,068,404.99

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	334,500.00	50,000.01
合计	334,500.00	50,000.01

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	999,280,476.98	999,280,476.98
本期申购	1,206,149,881.98	1,206,149,881.98
本期赎回（以“-”号填列）	-739,903,861.75	-739,903,861.75
本期末	1,465,526,497.21	1,465,526,497.21

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

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	-21,678,726.95	-8,195,731.10	-29,874,458.05
本期利润	127,880,457.27	239,397,694.93	367,278,152.20
本期基金份额交易产生的	72,878,649.92	253,286,309.04	326,164,958.96

变动数			
其中：基金申购款	87,623,155.04	328,548,106.05	416,171,261.09
基金赎回款	-14,744,505.12	-75,261,797.01	-90,006,302.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	179,080,380.24	484,488,272.87	663,568,653.11

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 11 月 2 日（基金合同 生效日）至 2016 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	807,600.18	286,621.88
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	45,517.96	24,773.88
结算备付金利息收入	200,286.34	70,899.25
其他	-	-
合计	1,053,404.48	382,295.01

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 11 月 2 日（基金合同 生效日）至 2016 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,287,815,185.77	594,690,923.08
减：卖出股票成本总额	2,152,597,102.99	610,096,966.33
买卖股票差价收入	135,218,082.78	-15,406,043.25

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

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同生效日） 至2016年12月31日
可供股权投资收益	-17.33	-

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同生效日） 至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,401,736.49	141,240.83
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,401,736.49	141,240.83

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同生效日） 至2016年12月31日
1.交易性金融资产	239,397,694.93	-10,256,605.06
——股票投资	239,397,694.93	-10,256,605.06
——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	239,397,694.93	-10,256,605.06

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同生效日）至 2016年12月31日
基金赎回费收入	4,028,322.89	-
新股手续费返还收入	-	-
基金转换费收入	514,370.33	31.86
配债手续费返还收入	-	-
基金认购利息收入	-	-
其他	0.67	-
合计	4,542,693.89	31.86

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同生效日） 至2016年12月31日
交易所市场交易费用	7,363,901.05	2,904,368.98
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
期货交易费用	-	-
合计	7,363,901.05	2,904,368.98

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同生效日） 至2016年12月31日
审计费用	60,000.00	-

信息披露费	300,000.00	50,000.01
账户维护费	6,000.00	-
其他	-	400.00
合计	366,000.00	50,400.01

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
平安银行股份有限公司	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。

7.4.10 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

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。

7.4.10.1.2 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

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可比期间末无应付关联方佣金余额。

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 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同 生效日）至2016年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	14,594,395.82	2,005,626.82
其中：支付销售机构的客户维护费	227,205.93	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同 生效日）至2016年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,432,399.28	334,271.11

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。托管费的计算方法如下：

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

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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，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 2017年1月1日至2017年12月31 日	上年度可比期间 2016年11月2日(基金合同生效 日)至2016年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期内申购/买入总份额	76,847,620.98	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	76,847,620.98	-
报告期末持有的基金份额占基 金总份额比例	5.24%	-

注：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。

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。

7.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份

		总份额的比 例		额的比例
广发证券股份有 限公司	21,245,750.71	1.45%	-	-

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 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年11月2日（基金合同生效日） 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
平安银行股份有限公司	307,040,250.70	807,600.18	102,273,840.18	286,621.88

注：本基金的银行存款由基金托管人平安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

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2017 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

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证券。

7.4.12.2 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 价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
60052	长园集	2017-12	重大事	15.79	2018-0	17.30	20.00	307.41	315.80	-

5	团	-25	项停牌		1-10					
603986	兆易创新	2017-11-01	重大事项停牌	163.12	2018-03-02	150.00	13,100.00	1,701,456.18	2,136,872.00	
03886	康健国际医疗	2017-11-27	重大事项停牌	0.58	-	-	48,000.00	29,633.52	27,685.34	

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 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 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合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，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。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总裁负责。

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、合规稽核部、金融工程与风险管理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，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，从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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

7.4.13.4 市场风险

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，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 2017 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	307,040,250.70	-	-	-	307,040,250.70
结算备付金	59,982,521.21	-	-	-	59,982,521.21
存出保证金	3,109,911.07	-	-	-	3,109,911.07
交易性金融资产	-	-	-	1,924,460,608.85	1,924,460,608.85
应收利息	-	-	-	48,032.62	48,032.62
应收股利	-	-	-	323,015.14	323,015.14
应收申购款	-	-	-	65,042,360.93	65,042,360.93
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	370,132,682.98	-	-	1,989,874,017.54	2,360,006,700.52
负债					
应付证券清算款	-	-	-	221,173,953.40	221,173,953.40
应付赎回款	-	-	-	5,829,889.45	5,829,889.45
应付管理人报酬	-	-	-	2,221,845.16	2,221,845.16
应付托管费	-	-	-	370,307.55	370,307.55
应付交易费用	-	-	-	981,054.64	981,054.64
其他负债	-	-	-	334,500.00	334,500.00
负债总计	-	-	-	230,911,550.20	230,911,550.20
利率敏感度缺口	370,132,682.98	-	-	1,758,962,467.34	2,129,095,150.32
上年度末 2016 年 12 月 31 日					

资产					
银行存款	102,273,840.18	-	-	-	102,273,840.18
结算备付金	3,454,545.45	-	-	-	3,454,545.45
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	352,496,585.94	352,496,585.94
买入返售金融资产	500,000,000.00	-	-	-	500,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	13,223,040.72	13,223,040.72
应收利息	-	-	-	434,792.51	434,792.51
应收股利	-	-	-	93,789.86	93,789.86
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	605,728,385.63	-	-	366,248,209.03	971,976,594.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,244,717.77	1,244,717.77
应付托管费	-	-	-	207,452.96	207,452.96
应付交易费用	-	-	-	1,068,404.99	1,068,404.99
其他负债	-	-	-	50,000.01	50,000.01
负债总计	-	-	-	2,570,575.73	2,570,575.73
利率敏感度缺口	605,728,385.63	-	-	363,677,633.30	969,406,018.93

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

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	1,494,449,569.27	1,494,449,569.27
应收股利	-	317,583.14	317,583.14
资产合计	-	1,494,767,152.41	1,494,767,152.41
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	1,494,767,152.41	1,494,767,152.41
项目	上年度末 2016年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	352,496,585.94	352,496,585.94
应收股利	-	77,157.86	77,157.86
资产合计	-	352,573,743.80	352,573,743.80
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞	-	352,573,743.80	352,573,743.80

口净额			
-----	--	--	--

7.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

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	上年度末
		2017 年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
	所有外币相对人民币升值 5%	74,738,357.62	-
	所有外币相对人民币贬值 5%	-74,738,357.62	-

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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	1,924,460,608.85	90.39	352,496,585.94	36.36
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	1,924,460,608.85	90.39	352,496,585.94	36.36

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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	167,115,975.03	76,090,179.45
业绩比较基准下降 5%	-167,115,975.03	-76,090,179.45	

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 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 1,922,295,735.71 元，属于第二层级的余额为 2,164,873.14 元，无属于第三层级的金额（2016 年 12 月 31 日：属于第一层级的余额为 350,129,001.34 元，属于第二层级的余额为 2,367,584.60 元，无属于第三层级的金额）。

(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。

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

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	1,924,460,608.85	81.54
	其中：股票	1,924,460,608.85	81.54

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	367,022,771.91	15.55
8	其他各项资产	68,523,319.76	2.90
9	合计	2,360,006,700.52	100.00

注：权益投资中通过港股通机制投资的港股公允价值为 1,494,449,569.27 元，占基金总资产比例 63.32%。

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	6,716.00	0.00
C	制造业	221,998,273.12	10.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	100,392.60	0.00
E	建筑业	23,866,262.00	1.12
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	167,820,603.86	7.88

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	16,218,792.00	0.76
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	430,011,039.58	20.20

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
电信业务	344,144.14	0.02
房地产	152,710,409.28	7.17
非日常生活消费品	146,787,154.37	6.89
工业	105,605,539.16	4.96
公用事业	35,047,550.21	1.65
金融	386,057,070.63	18.13
能源	418,172.34	0.02
日常消费品	24,195,519.44	1.14
信息技术	453,014,619.36	21.28
医疗保健	186,749,441.03	8.77
原材料	3,519,949.31	0.17
合计	1,494,449,569.27	70.19

注：（1）以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

（2）由于四舍五入的原因市值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

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	00700	腾讯控股	535,600	181,771,638.78	8.54
2	03968	招商银行	6,700,500	174,191,565.10	8.18
3	000002	万科A	1,199,900	37,268,894.00	1.75
3	02202	万科企业	4,653,700	121,370,320.25	5.70

4	01336	新华保险	2,849,000	127,172,505.31	5.97
5	600048	保利地产	7,657,103	108,348,007.45	5.09
6	000546	金圆股份	5,687,108	101,514,877.80	4.77
7	00285	比亚迪电子	6,873,500	97,790,578.10	4.59
8	01177	中国生物制药	6,461,000	74,855,289.11	3.52
9	02601	中国太保	2,331,600	73,185,241.24	3.44
10	01093	石药集团	5,244,000	69,171,819.99	3.25
11	01055	中国南方航空股份	7,990,000	53,898,891.67	2.53
12	00763	中兴通讯	2,012,400	49,372,138.09	2.32
13	01728	正通汽车	7,300,000	48,267,951.13	2.27
14	00868	信义玻璃	5,510,000	46,887,696.54	2.20
15	600031	三一重工	4,711,089	42,729,577.23	2.01
16	00855	中国水务	5,802,000	34,289,145.23	1.61
17	002045	国光电器	1,950,257	32,803,322.74	1.54
18	00981	中芯国际	2,859,700	32,318,908.70	1.52
19	02208	金风科技	2,603,200	28,897,823.31	1.36
20	02007	碧桂园	2,022,000	25,184,129.30	1.18
21	02018	瑞声科技	208,500	24,295,640.56	1.14
22	01513	丽珠医药	470,300	24,256,026.78	1.14
23	002081	金螳螂	1,557,850	23,866,262.00	1.12
24	02313	申洲国际	350,000	21,767,096.40	1.02
25	02382	舜宇光学科技	243,000	20,292,300.39	0.95
26	00522	ASM PACIFIC	221,500	20,163,277.68	0.95
27	00753	中国国航	2,316,000	18,352,972.47	0.86
28	002430	杭氧股份	1,190,489	16,631,131.33	0.78
29	002044	美年健康	741,600	16,218,792.00	0.76
30	00175	吉利汽车	630,000	14,271,491.43	0.67
31	01112	合生元	275,000	11,930,525.47	0.56
32	000671	阳光城	1,442,800	11,354,836.00	0.53
33	00291	华润啤酒	454,000	10,645,063.08	0.50
34	02196	复星医药	253,500	10,626,944.73	0.50
35	06869	长飞光纤光缆	310,000	9,302,842.39	0.44
36	601155	新城控股	310,100	9,085,930.00	0.43
37	600176	中国巨石	547,864	8,924,704.56	0.42
38	01347	华虹半导体	610,000	8,454,226.55	0.40
39	00425	敏实集团	206,000	8,119,110.24	0.38
40	002409	雅克科技	269,500	7,705,005.00	0.36
41	01548	金斯瑞生物科技	392,000	6,546,980.87	0.31
42	00005	汇丰控股	81,200	5,426,677.57	0.25
43	000786	北新建材	233,100	5,244,750.00	0.25
44	00148	建滔化工	118,500	4,185,087.90	0.20
45	00881	中升控股	261,000	3,892,197.58	0.18
46	00011	恒生银行	23,000	3,729,830.42	0.18

47	00268	金蝶国际	882,000	3,243,999.53	0.15
48	01997	九龙仓置业	58,000	2,521,104.56	0.12
49	603986	兆易创新	13,100	2,136,872.00	0.10
50	00336	华宝国际	433,000	1,860,418.01	0.09
51	002244	滨江集团	221,700	1,762,515.00	0.08
52	300110	华仁药业	107,148	1,481,856.84	0.07
53	002876	三利谱	24,100	1,442,385.00	0.07
54	00004	九龙仓集团	58,000	1,309,035.06	0.06
55	300461	田中精机	21,400	1,234,352.00	0.06
56	00152	深圳国际	94,500	1,175,423.21	0.06
57	01044	恒安国际	14,500	1,051,470.29	0.05
58	00027	银河娱乐	16,000	838,584.91	0.04
59	01918	融创中国	19,000	513,792.08	0.02
60	00914	安徽海螺水泥股份	12,500	383,996.16	0.02
60	600585	海螺水泥	81	2,375.73	0.00
61	03888	金山软件	17,000	369,472.22	0.02
62	01099	国药控股	12,400	350,346.60	0.02
63	01211	比亚迪股份	6,000	341,552.83	0.02
64	01766	中国中车	46,000	321,457.55	0.02
65	02238	广汽集团	20,000	309,621.06	0.01
66	06030	中信证券	21,500	289,709.69	0.01
67	00586	海螺创业	18,500	279,904.46	0.01
68	00200	新濠国际发展	14,000	269,163.02	0.01
69	01339	中国人民保险集团	78,000	251,023.77	0.01
70	02333	长城汽车	32,500	243,145.32	0.01
71	03898	中车时代电气	5,500	233,783.13	0.01
72	00489	东风集团股份	28,000	221,415.84	0.01
73	06886	华泰证券	16,800	218,513.56	0.01
74	00867	康哲药业	14,000	213,223.92	0.01
75	00014	希慎兴业	6,000	207,890.82	0.01
76	00390	中国中铁	42,000	202,925.51	0.01
77	01357	美图公司	22,000	200,083.42	0.01
78	01816	中广核电力	111,000	196,706.34	0.01
79	01888	建滔积层板	19,000	193,446.29	0.01
80	02689	玖龙纸业	18,000	188,380.68	0.01
81	00902	华能国际电力股份	44,000	180,222.20	0.01
82	02600	中国铝业	38,000	177,564.00	0.01
83	00696	中国民航信息网络	9,000	176,418.81	0.01
84	06881	中国银河	36,500	175,741.72	0.01
85	00008	电讯盈科	45,000	170,776.41	0.01

86	01530	三生制药	13,000	166,697.17	0.01
87	03323	中国建材	28,000	163,604.31	0.01
88	03377	远洋集团	36,000	162,199.98	0.01
89	03800	保利协鑫能源	138,000	161,497.81	0.01
90	02777	富力地产	10,800	159,070.33	0.01
91	03383	雅居乐集团	16,000	158,622.28	0.01
92	01186	中国铁建	20,500	155,253.56	0.01
93	00303	VTECH HOLDINGS	1,800	154,074.93	0.01
94	00916	龙源电力	33,000	153,372.77	0.01
95	02899	紫金矿业	60,000	147,956.07	0.01
96	03606	福耀玻璃	5,200	143,224.82	0.01
97	02338	潍柴动力	20,000	143,107.79	0.01
98	01316	耐世特	9,000	140,081.80	0.01
99	03360	远东宏信	25,000	139,387.99	0.01
100	00694	北京首都机场股份	14,000	137,858.28	0.01
101	01171	兖州煤业股份	18,000	137,523.91	0.01
102	01882	海天国际	7,000	137,507.20	0.01
103	00168	青岛啤酒股份	4,000	134,748.69	0.01
104	00338	上海石油化工股份	36,000	133,912.78	0.01
105	00884	旭辉控股集团	34,000	133,862.63	0.01
106	00345	VITASOY INTL	8,000	133,745.60	0.01
107	00316	东方海国际	2,000	126,055.23	0.01
108	00358	江西铜业股份	12,000	124,383.41	0.01
109	01898	中煤能源	42,000	123,932.02	0.01
110	02607	上海医药	6,800	120,220.58	0.01
111	03618	重庆农村商业银行	26,000	119,969.80	0.01
112	00177	江苏宁沪高速公路	12,000	119,367.95	0.01
113	00165	中国光大控股	8,000	116,893.65	0.01
114	00968	信义光能	46,000	116,124.62	0.01
115	02314	理文造纸	15,000	115,857.13	0.01
116	00142	第一太平	26,000	115,188.40	0.01
117	02883	中海油田服务	18,000	114,502.95	0.01
118	03396	联想控股	3,800	114,034.84	0.01
119	00590	六福集团	4,000	112,179.12	0.01
120	01813	合景泰富	14,500	110,661.95	0.01
121	00179	德昌电机控股	4,000	109,504.21	0.01
122	01199	中远海运港口	16,000	108,735.17	0.01
122	03908	中金公司	8,000	108,735.17	0.01
123	00460	四环医药	45,000	105,700.82	0.00

124	00552	中国通信服务	24,000	105,124.04	0.00
125	01958	北京汽车	12,000	102,114.77	0.00
126	00958	华能新能源	46,000	101,897.43	0.00
127	00576	浙江沪杭甬	14,000	100,526.54	0.00
128	600025	华能水电	18,942	100,392.60	0.00
129	00493	国美电器	127,000	99,790.94	0.00
130	01999	敏华控股	15,600	96,888.66	0.00
131	01066	威高股份	20,000	95,126.56	0.00
132	03380	龙光地产	14,000	94,558.14	0.00
133	00363	上海实业控股	5,000	93,621.92	0.00
134	01788	国泰君安国际	45,000	92,159.08	0.00
135	00817	中国金茂	32,000	92,016.97	0.00
136	02186	绿叶制药	17,500	90,257.38	0.00
137	02611	国泰君安	6,200	90,177.97	0.00
138	01508	中国再保险	59,000	87,787.27	0.00
139	06099	招商证券	8,600	87,128.57	0.00
140	00604	深圳控股	32,000	86,667.15	0.00
141	01313	华润水泥控股	20,000	85,931.55	0.00
142	01919	中远海控	25,500	85,902.29	0.00
143	00123	越秀地产	70,000	85,430.00	0.00
143	06818	中国光大银行	28,000	85,430.00	0.00
144	002050	三花智控	4,620	84,730.80	0.00
145	00410	S O H O 中国	22,000	84,042.39	0.00
146	01308	海丰国际	13,000	83,891.93	0.00
147	00806	惠理集团	12,000	83,256.64	0.00
148	00665	海通国际	22,000	82,019.49	0.00
149	02386	中石化炼化工程	13,000	80,414.54	0.00
150	00511	电视广播	3,400	79,862.84	0.00
151	01208	五矿资源	24,000	77,839.94	0.00
152	03969	中国通号	15,000	76,736.54	0.00
153	02588	中银航空租赁	2,200	76,594.43	0.00
154	00670	中国东方航空股份	16,000	75,833.76	0.00
155	02727	上海电气	28,000	75,365.65	0.00
156	02357	中航科工	21,000	73,025.10	0.00
157	00341	大家乐集团	4,000	71,721.08	0.00
158	00119	保利置业集团	21,000	71,445.23	0.00
159	00220	统一企业中国	13,000	71,069.07	0.00
160	00570	中国中药	20,000	69,547.71	0.00
161	01382	互太纺织	10,000	68,962.58	0.00
162	00272	瑞安房地产	38,000	68,611.49	0.00
162	00606	中国粮油控股	24,000	68,611.49	0.00
163	01668	华南城	40,000	68,544.62	0.00
164	00041	鹰君	2,000	68,461.03	0.00

165	00440	大新金融	1,600	66,939.67	0.00
166	00698	通达集团	40,000	66,872.80	0.00
167	02038	富智康集团	33,000	65,652.37	0.00
168	00330	思捷环球	18,400	64,291.51	0.00
169	02356	大新银行集团	4,400	62,378.95	0.00
170	01333	中国忠旺	16,800	60,105.27	0.00
171	01458	周黑鸭	8,500	58,262.93	0.00
172	00658	中国高速传动	5,000	56,423.93	0.00
172	00680	南海控股	250,000	56,423.93	0.00
173	00751	创维数码	20,000	56,173.15	0.00
174	03900	绿城中国	6,500	54,660.15	0.00
175	01515	华润凤凰医疗	6,500	53,573.47	0.00
176	00308	香港中旅	22,000	53,514.96	0.00
177	01083	港华燃气	10,000	52,495.15	0.00
178	03808	中国重汽	7,000	51,492.06	0.00
179	00173	嘉华国际	14,000	49,970.70	0.00
180	02128	中国联塑	11,000	46,526.75	0.00
181	00636	嘉里物流	5,000	46,309.41	0.00
182	00737	合和公路基建	11,000	45,791.15	0.00
183	00439	光启科学	22,000	45,607.25	0.00
184	00732	信利国际	16,000	45,206.01	0.00
185	00934	中石化冠德	10,000	42,213.46	0.00
186	01928	金沙中国有限公司	1,200	40,474.76	0.00
187	03698	徽商银行	11,000	39,354.64	0.00
188	00215	和记电讯香港	14,000	36,746.60	0.00
189	01363	中滔环保	30,000	36,362.09	0.00
190	00242	信德集团	14,000	35,693.36	0.00
191	00699	神州租车	6,000	34,355.90	0.00
192	00787	利标品牌	64,000	34,238.87	0.00
193	02039	中集集团	2,700	34,080.05	0.00
194	00996	嘉年华国际	90,000	33,478.20	0.00
195	03899	中集安瑞科	6,000	32,951.57	0.00
196	603685	晨丰科技	932	32,769.12	0.00
197	01117	现代牧业	25,000	31,555.60	0.00
198	00315	数码通电讯	4,000	31,497.09	0.00
199	00861	神州控股	7,000	31,070.77	0.00
200	00506	中国食品	8,000	30,560.87	0.00
201	00178	莎莎国际	12,000	30,193.07	0.00
202	03886	康健国际医疗	48,000	27,685.34	0.00
203	00777	网龙	1,500	27,208.87	0.00
204	03331	维达国际	2,000	26,214.14	0.00
205	01282	中国金洋	48,000	26,080.39	0.00
206	01970	IMAX CHINA	1,300	25,428.38	0.00

207	01293	宝信汽车	7,000	22,878.86	0.00
208	00931	中国天然气	20,000	21,399.30	0.00
209	00400	科通芯城	6,000	20,814.16	0.00
210	00317	中船防务	2,000	20,362.77	0.00
211	01680	澳门励骏	20,000	19,560.29	0.00
212	02380	中国电力	11,333	19,420.40	0.00
213	02199	维珍妮	3,000	19,309.52	0.00
214	00939	建设银行	3,000	18,055.66	0.00
215	00003	香港中华煤气	1,400	17,928.60	0.00
216	000333	美的集团	317	17,571.31	0.00
217	02329	国瑞置业	9,000	17,529.03	0.00
218	01432	中国圣牧	13,000	13,692.21	0.00
219	300450	先导智能	200	11,394.00	0.00
220	01315	允升国际	40,000	10,198.10	0.00
221	000968	蓝焰控股	400	6,716.00	0.00
222	00012	恒基地产	100	4,304.94	0.00
223	000537	广宇发展	33	421.41	0.00
224	600525	长园集团	20	315.80	0.00
225	002138	顺络电子	17	281.86	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	03968	招商银行	186,806,086.31	19.27
2	02202	万科企业	124,475,307.67	12.84
3	01336	新华保险	124,002,547.01	12.79
4	00700	腾讯控股	112,405,701.17	11.60
5	600048	保利地产	106,663,775.59	11.00
6	00285	比亚迪电子	101,881,197.86	10.51
7	02318	中国平安	98,672,930.40	10.18
8	000546	金圆股份	96,417,662.91	9.95
9	02601	中国太保	75,755,399.47	7.81
10	000333	美的集团	68,787,459.26	7.10
11	01055	中国南方航空股份	64,620,349.61	6.67
12	01728	正通汽车	59,947,607.32	6.18
13	01093	石药集团	57,852,471.02	5.97
14	00868	信义玻璃	54,797,925.25	5.65
15	01177	中国生物制药	54,776,940.37	5.65

16	00388	香港交易所	53,686,392.00	5.54
17	01398	工商银行	52,311,967.24	5.40
18	600019	宝钢股份	51,849,298.07	5.35
19	600585	海螺水泥	51,802,539.94	5.34
20	00763	中兴通讯	51,405,996.90	5.30
21	002430	杭氧股份	50,156,261.75	5.17
22	01114	BRILLIANCE CHI	49,640,609.17	5.12
23	02600	中国铝业	46,711,461.24	4.82
24	02688	新奥能源	43,785,334.80	4.52
25	00027	银河娱乐	43,617,414.99	4.50
26	600031	三一重工	42,029,779.61	4.34
27	002045	国光电器	38,642,597.79	3.99
28	002081	金螳螂	38,457,449.50	3.97
29	02208	金风科技	38,333,305.78	3.95
30	03993	洛阳钼业	37,266,522.58	3.84
31	600499	科达洁能	36,871,355.82	3.80
32	00981	中芯国际	36,571,304.46	3.77
33	00005	汇丰控股	36,399,721.13	3.75
34	000002	万科A	35,995,263.27	3.71
35	00371	北控水务集团	33,780,711.48	3.48
36	300476	胜宏科技	33,763,537.92	3.48
37	002415	海康威视	31,897,975.15	3.29
38	002050	三花智控	31,475,788.55	3.25
39	300408	三环集团	30,440,230.40	3.14
40	00855	中国水务	30,101,370.71	3.11
41	00522	ASM PACIFIC	29,663,531.83	3.06
42	000725	京东方A	28,987,965.00	2.99
43	00857	中国石油股份	28,062,282.17	2.89
44	01193	华润燃气	27,636,073.06	2.85
45	002138	顺络电子	27,511,397.82	2.84
46	01919	中远海控	26,955,851.26	2.78
47	02382	舜宇光学科技	26,628,394.36	2.75
48	02018	瑞声科技	26,452,734.29	2.73
49	03898	中车时代电气	24,761,679.04	2.55
50	02238	广汽集团	24,670,853.99	2.54
51	00753	中国国航	24,216,380.84	2.50
52	01513	丽珠医药	23,070,241.01	2.38
53	00384	中国燃气	21,911,917.59	2.26
54	02007	碧桂园	21,802,875.80	2.25
55	00220	统一企业中国	20,875,643.70	2.15
56	02313	申洲国际	20,159,354.45	2.08
57	01044	恒安国际	19,652,518.26	2.03
58	002230	科大讯飞	19,495,593.86	2.01

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	02318	中国平安	145,467,198.82	15.01
2	00285	比亚迪电子	71,537,733.29	7.38
3	000333	美的集团	66,886,731.30	6.90
4	02600	中国铝业	64,492,482.85	6.65
5	03898	中车时代电气	62,476,246.79	6.44
6	600585	海螺水泥	57,137,024.58	5.89
7	00027	银河娱乐	56,263,951.22	5.80
8	01398	工商银行	53,207,435.45	5.49
9	00388	香港交易所	51,783,912.69	5.34
10	03993	洛阳钼业	48,808,350.18	5.03
11	01114	BRILLIANCE CHI	48,287,485.33	4.98
12	600019	宝钢股份	47,942,801.12	4.95
13	02688	新奥能源	45,043,481.52	4.65
14	00005	汇丰控股	37,947,945.43	3.91
15	002415	海康威视	37,795,153.46	3.90
16	000725	京东方 A	34,959,443.00	3.61
17	00857	中国石油股份	34,384,753.55	3.55
18	300476	胜宏科技	33,409,588.49	3.45
19	00371	北控水务集团	32,904,949.23	3.39
20	02238	广汽集团	32,732,528.05	3.38
21	600499	科达洁能	32,706,852.59	3.37
22	00700	腾讯控股	32,086,327.35	3.31
23	00386	中国石油化工股份	31,279,418.64	3.23
24	002050	三花智控	31,009,667.93	3.20
25	300408	三环集团	29,612,080.67	3.05
26	01919	中远海控	27,453,223.15	2.83
27	002430	杭氧股份	27,003,566.73	2.79
28	002138	顺络电子	26,699,881.94	2.75
29	00384	中国燃气	26,362,233.50	2.72

30	01193	华润燃气	25,789,001.45	2.66
31	01928	金沙中国有限公司	25,724,431.67	2.65
32	01728	正通汽车	22,916,724.24	2.36
33	00763	中兴通讯	22,209,343.62	2.29
34	00220	统一企业中国	22,191,516.52	2.29
35	03968	招商银行	22,149,893.55	2.28
36	600048	保利地产	21,000,320.77	2.17
37	002230	科大讯飞	20,392,572.10	2.10
38	01044	恒安国际	19,658,819.76	2.03

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	3,485,163,430.97
卖出股票的收入（成交）总额	2,287,815,185.77

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	3,109,911.07
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	323,015.14
4	应收利息	48,032.62
5	应收申购款	65,042,360.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,523,319.76

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
30,129	48,641.72	1,176,508,388.08	80.28%	289,018,109.13	19.72%

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	562,979.40	0.0384%

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	10~50
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(2016年11月2日)基金份额总额	499,290,272.94
本报告期期初基金份额总额	999,280,476.98
本报告期基金总申购份额	1,206,149,881.98
减：本报告期基金总赎回份额	739,903,861.75
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,465,526,497.21

§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

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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	
国金证券	2	571,008,139.00	9.90%	429,533.50	22.70%	新增 2 个
中金公司	1	4,094,660,429.51	70.98%	1,183,012.57	62.53%	新增 1 个
华鑫证券	2	1,102,707,495.07	19.12%	279,507.63	14.77%	新增 2 个

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金公司	-	-	1,666,300,000.00	100.00%	-	-

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增加大河财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-12-29
2	广发基金管理有限公司关于调整同花顺部分基金产品销售起点的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-12-29
3	广发基金管理有限公司关于广发沪港深新起点股票型证券投资基金 2018 年交易市场休市日暂停申购赎回的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-12-28
4	广发基金管理有限公司关于增加华林证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-12-18
5	广发基金管理有限公司关于增加凤凰金信为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-11-29
6	广发基金管理有限公司关于增加伯嘉基金为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-11-29
7	广发基金管理有限公司关于增加万家财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-11-24
8	广发基金管理有限公司关于增加天风证券为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-11-24
9	广发基金管理有限公司关于增加金石基金为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-11-20
10	广发基金管理有限公司关于增加洪泰财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-11-20
11	广发基金管理有限公司关于增加四川天府银	《中国证券报》、《证券	2017-11-08

	行为旗下部分基金销售机构的公告	时报》、《上海证券报》	
12	广发基金管理有限公司关于增加懒猫金融为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-10-17
13	广发基金管理有限公司关于增加金斧子为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-10-17
14	广发基金管理有限公司关于增加通华财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-09-29
15	广发基金管理有限公司关于广发沪港深新起点股票型证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-09-26
16	广发基金管理有限公司关于增加中民财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-09-25
17	广发基金管理有限公司关于增加华夏财富为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-09-25
18	广发基金管理有限公司关于旗下部分基金面向养老金客户实施特定申购费率的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-09-19
19	广发基金管理有限公司关于广发沪港深新起点股票型证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-08-24
20	广发基金管理有限公司关于增加中国银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-08-21
21	广发基金管理有限公司关于增加交通银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-08-21
22	广发基金管理有限公司关于增加恒泰证券为广发沪港深新起点股票型证券投资基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-08-17
23	广发基金管理有限公司关于增加平安银行为广发沪港深新起点股票型证券投资基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-08-11
24	广发基金管理有限公司关于增加工商银行广发沪港深新起点股票型证券投资基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-08-09
25	广发基金管理有限公司关于增加招商银行为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-08-04
26	广发基金管理有限公司关于增加中信期货为旗下部分基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-07-27
27	广发基金管理有限公司关于增加上海证券为广发沪港深新起点股票型证券投资基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-07-27
28	广发基金管理有限公司关于增加广发沪港深新起点股票型证券投资基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-07-21
29	广发基金管理有限公司关于增加广发沪港深新起点股票型证券投资基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-07-20
30	广发基金管理有限公司关于广发沪港深新起	《中国证券报》、《证券	2017-06-30

	点股票型证券投资基金修改基金合同、新增风险揭示内容的公告	时报》、《上海证券报》	
31	广发基金管理有限公司关于增加兴业证券为广发沪港深新起点股票型证券投资基金销售机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-06-23
32	广发基金管理有限公司关于增加广发沪港深新起点股票基金代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-06-15
33	广发基金管理有限公司关于广发沪港深新起点股票型证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-05-24
34	广发基金管理有限公司关于增加蚂蚁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》	2017-05-18
35	关于广发沪港深新起点股票型证券投资基金恢复申购业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-04-19
36	关于广发沪港深新起点股票型证券投资基金暂停赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-03-30
37	关于广发沪港深新起点股票型证券投资基金暂停赎回业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》	2017-01-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170101-20171231	999,257,985.00	0.00	413,223,140.50	586,034,844.50	39.99%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；极端情况下基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

(一) 中国证监会批准广发沪港深新起点股票型证券投资基金募集的文件

- (二)《广发沪港深新起点股票型证券投资基金基金合同》
- (三)《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》
- (四)《广发沪港深新起点股票型证券投资基金托管协议》
- (五)法律意见书
- (六)基金管理人业务资格批件、营业执照
- (七)基金托管人业务资格批件、营业执照

13.2 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

13.3 查阅方式

1.书面查阅：查阅时间为每工作日 8:30-11:30，13:30-17:00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2.网站查阅：基金管理人网址：<http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司
二〇一八年三月二十七日