

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告自2017年10月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发多元新兴股票
基金代码	003745
交易代码	003745
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2017年4月25日
报告期末基金份额总额	20,173,369.59份
投资目标	在严格控制风险和保持资产流动性的基础上，通过前瞻性的研究布局，本基金力图把握多模式驱动下新兴产业的投资机会，力求实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金在宏观分析的基础上，结合政策面、市场面、资金面，并积极跟踪行业及个股趋势，根据对宏观经济和各类资产市场表现及景气度，对股票、债券和现金等大类资产配置比例进行动态配置和调整。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证金融指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，属于较高风险和较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 2017年10月1日-2017年12月31日
1.本期已实现收益	7,080,046.16
2.本期利润	-5,611.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.00001
4.期末基金资产净值	228,046,833.38
5.期末基金份额净值	1.0902

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。

3.2基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	0.57%	1.09%	3.91%	0.64%	-3.34%	0.45%

3.2.2 自基金合同生效以来至基金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

广发多元新兴股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年4月25日至2017年12月31日)



注：(1)本基金合同生效日期为2017年4月25日，至披露时点本基金成立未满一年。

(2)本基金建仓期为基金合同生效后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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理时间	证券从业年限	说明
吴兴武	本基金的基金经理，广发发动混合型证券投资基金的基金经理，广发核心精选混合型证券投资基金的基金经理	2017-04-25	9年	吴兴武先生，管理学硕士，持有中国证券投资基金从业证书，曾任华泰证券基金事业部研究员，广发基金管理有限公司研究发展部、权益投资一部研究员，现任广发发动混合型证券投资基金基金经理(自2015年2月17日起任职)，广发核心精选混合型证券投资基金基金经理(自2015年2月17日起任职)，广发多元新兴股票型证券投资基金基金经理(自2017年4月25日起任职)。

注：1、“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发多元新兴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。本报告期本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人的行为。基金的投资管理符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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，金融工程与风险管理风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制，稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易行为。

4.3.2 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。如果出现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 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季国内宏观经济延续了积极稳定的态势，但是受到阶段性波动的影响，周板块出现一定回调，市场的主线仍然是家电、食品饮料等消费龙头。

本基金的核心持仓结构没有发生重大的变化，依然是白酒、电子、等行业。目前来看，白酒没有大的风险，但是需要适当降低收益预期。

此外，本基金在季末加仓了地产、航空等周期性行业。本基金对地产行业整体不悲观，而且更看重龙头企业中提升的逻辑逐步兑现，航空伴随着淡季不淡的现象发生，预示着可能出现长期向上提升。

4.5 报告期内基金的投资表现

本报告期内，本基金净值增长率为0.57%，同期业绩比较基准收益率为3.91%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	196,941,802.95	85.03
	其中：股票	196,941,802.95	85.03
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
3	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	14,276,672.92	6.16
8	其他各项资产	20,405,732.28	8.81
9	合计	231,624,208.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	163,412,585.50	71.66
D	电力、热力、燃气及生产供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,545,540.94	2.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,120,752.55	1.81
J	金融业	13,594,282.76	5.96
K	房地产业	9,252,498.00	4.06
L	租赁和商业服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	407,865	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	14,309,363.68	6.16
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	196,941,802.95	86.36

5.2.2 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。

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300156	神州环保	898,003	21,226,790.92	9.31
2	000820	神州高铁	754,700	20,248,691.00	8.86
3	002572	索菲亚	407,865	15,008,542.40	6.58
4	000858	五粮液	179,136	14,309,363.68	6.27
5	603228	豪威电子	210,100	11,297,077.00	4.95
6	600779	水井坊	240,700	11,284,765.00	4.94
7	002384	金铂集团	338,995	9,590,877.70	4.21
8	600702	冠帽零售	164,100	8,590,106.00	3.77
9	601601	中国太保	164,263	8,803,773.46	2.98
10	600809	山西汾酒	119,300	6,798,907.00	2.98

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 报告期末本基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

5.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	152,310.95
2	应收证券清算款	108,058.74
3	应收股利	-
4	应收利息	4,108.23
5	应收申购款	20,141,254.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,405,732.28

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	期末公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300156	神州环保	21,229,790.92	9.31	重大诉讼影响
2	000820	神州高铁	20,248,691.00	8.86	重大诉讼影响

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期初基金份额总额	235,254,567.29
本报告基金总申购份额	101,941,396.83
减：本报告基金总赎回份额	128,106,565.53
本报告基金总申购份额	-
本报告期末基金份额总额	209,179,398.59

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期初报告人持有的本基金份额	0.00
本报告期间买入/卖出报告人持有的本基金份额	18,437,355.95
报告期末报告人持有的本基金份额	18,437,355.95
报告期末报告人持有的本基金份额占基金份额比例(%)	8.81

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易金额(元)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2017-12-29	18,437,355.95	20,000,000.00	-
合计			18,437,355.95	20,000,000.00	-

注：申购费1000元。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

(一)中国证监会注册广发多元新兴股票型证券投资基金募集的文件

(二)(广发)多元新兴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)多元新兴股票型证券投资基金托管协议

(五)法律意见书

8.2 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

8.3 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，也可通过本机构网站打印；

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

广发基金管理有限公司
二〇一八年一月二十日

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：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一八年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2018年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告自2017年10月1日起至2017年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发多因子混合
基金代码	002943
交易代码	002943
基金运作方式	契约开放式
基金合同生效日	2016年12月30日
报告期末基金份额总额	82,909,514.54份

本基金以企业本身价值为基础，通过深入研究企业基本面，精选出具有清晰商业模式、优良经营业绩、稳健财务状况、股价大幅低于内在价值的股票，在充分分散投资的基础上，追求基金资产的长期收益。

本基金通过以下三个环节精选个股：基本面因素、管理因素、价格因素。

业绩比较基准：中证800指数收益率×65%+中债金融债指数收益率×35%

风险收益特征：本基金是混合型基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金，属于中高风险收益特征的基金。

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2017年10月1日-2017年12月31日)
1.本期已实现收益	-2,739,947.21
2.本期利润	-2,086,090.01
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0214
4.期末基金资产净值	90,903,881.89
5.期末基金份额净值	1.0964

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率基准②	业绩比较基准收益差③	①-③	②-③
过去3个月	-1.92%	0.20%	1.13%	0.50%	-3.05%
过去6个月	-1.92%	0.20%	1.13%	0.50%	-3.05%

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

广发多因子灵活配置混合型证券投资基金历史业绩走势图
(2016年12月30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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金基金经理时间	证券从业年限	说明
张东一	本基金基金经理	2017-01-13	10年	张东一女士，理学硕士，持有中国证券投资基金从业资格，曾任广发基金管理有限公司研究员、基金助理、基金经理。2017年1月13日任本基金基金经理。2017年1月13日