

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招募说明书(更新)摘要

2016年1号

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
时间:二零一六年三月

【重要提示】
本基金于2015年5月27日经中国证监会证监许可[2015]1033号文准予募集注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资者有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人及基金管理人实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险等。

本基金为“广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金”(以下简称“广发中证全指主要消费ETF”)的联接基金,风险和收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要投资于“广发中证全指主要消费ETF,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金与“广发中证全指主要消费ETF”在投资策略、投资方式和业绩表现等方面存在着联系和区别。本基金对“广发中证全指主要消费ETF”的投资比例不低于本基金资产净值的90%,投资标的单一且过份集中有可能给本基金带来风险。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

投资者有风险,投资人拟认购(或申购)基金时应认真阅读本基金《招募说明书》与《基金合同》,全面了解本基金产品的风险收益特征,充分考虑投资自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资要承担相应风险。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2016年2月18日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年12月31日。

第一部分 基金管理人

一、概况
1.名称:广发基金管理有限公司
2.住所:广东省珠海市横琴新区宝中三路3号4004-56室
3.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
4.法定代表人:王志伟
5.成立时间:2003年8月5日
6.电话:020-83936666
全国统一客服热线:95105828
7.联系人:殷雪军
8.注册资本:1.2688亿元人民币
9.股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”),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风险投资有限公司,分别持有本基金管理人51.135%、15.763%、15.763%、9.458%和7.881%的股权。

二、主要人员情况

1.董事会成员
王志伟:董事长,男,经济学硕士,高级经济师。兼任中国基金业协会公司治理专业委员会委员,广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员,广东金融学会常务理事,江西财经大学客座教授。历任广东省第十届政协常委,广发证券董事长兼党委书记,广东发展银行党组成员兼副行长,广东发展银行行长助理,广东发展银行信托投资公司董事长,广东发展银行人事教育部经理,广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

林传辉:副董事长,男,大学本科学历,现任广发基金管理有限公司总经理,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,资产管理业务专业委员会,深圳证券交易所第三届上市复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司总部北京业务部总经理,投资银行总部副经理兼投资银行上海业务部副经理兼投资银行财务部副经理。

孙晓晓:董事,女,硕士,现任广发证券副总裁、财务总监,兼任广发控股(香港)有限公司董事,证信股份有限公司监事,监事长。曾任广东广发证券分公司投资银行部经理,广发证券广东分公司财务部经理,财务部副经理,投资自营部副经理,广发基金管理有限公司财务总监、副总经理。

支欣:董事,男,管理学硕士,高级经济师,现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书,兼任武汉烽火信息技术有限责任公司、南京烽火烽火光电通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火激光光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏证信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都大唐线缆有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司等公司董事;兼任武汉烽火网络科技有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、滕仓烽火光纤材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。曾任烽火通信科技股份有限公司证券部总经理助理、财务部总经理助理、财务部经理。

崔美卿:董事,女,工商管理硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人,香江集团有限公司总裁,深圳市金鹰实业股份有限公司董事长,深圳香江控股股份有限公司董事长,兼任全国政协常委、全国妇联常委、中国产业发展促进会副会长、广东省工商联副主席、广东省女企业家协会会长、深圳市政协常委,香江社会救助基金会主席,深圳市深商控股集团股份有限公司董事,广东南粤银行董事,深圳龙岗国安村镇银行董事,广发证券股份有限公司监事。

许冬瑾:董事,女,工商管理硕士,主管药师,现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理,兼任中国中药协会中药饮片专业委员会专家、全国中药标准化技术委员会委员、全国制药装备标准化技术委员会中药炮制机械分技术委员会副主任委员、国家中医药行业特有工种职业技能鉴定工作中药炮制与配置工艺专家委员会委员副主任委员、广东省中药炮制技术委员会副主任委员等。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂文:独立董事,男,经济学博士,教授,博士生导师,现任复旦大学教授,兼任宁波大学特聘教授,上海四联东法律师事务所兼职律师,绍兴银行独立董事,海尔生物制药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学法律系副主任、复旦大学法学院副院长。

姚海鑫:独立董事,男,经济学博士、教授,博士生导师,本人现任辽宁大学新华国际商学院教授,兼任东北制药(集团)股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院院长、工商管理硕士(MBA)教育中心主任、计财处处长、学科建设处处长、发展规划处处长、新华国际商学院党总支书记。

罗海平:独立董事,男,经济学博士,现任中保联合保险控股股份有限公司常务副总裁,兼任中保联合财产保险股份有限公司总裁(法人代表),曾任中国人民保险分公司荆州分公司经理,中国人民保险分公司湖北省分公司业务处长,中国人民保险分公司湖北、中国国民保险总公司、太平保险分公司汉口分公司总经理,太平保险湖北分公司总经理,太平保险分公司总经理助理,太平保险集团总公司,民安保险(中国)有限公司副总裁,阳光财产保险股份有限公司总裁,阳光保险集团执行委员会委员。

2.监事会成员

余利平:监事会主席,女,经济学博士,兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券成都营业部总经理,广发证券基金部副总经理,嘉实基金管理有限公司副总经理,董事长。

匡丽军:监事,女,工商管理硕士,高级涉外秘书,现任广州科技风险投资有限公司工会主席、副总经理。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任,广州屈臣氏公司行政主管,广州市科达实业股份公司办公室主任,总经理,广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

吴晓辉:监事,男,工学硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分工工会主席。曾任广发证券电脑中心员工、副经理,经理。

3.总经理及其他高级管理人员

林传辉:总经理,男,大学本科学历,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,瑞元资本管理有限公司董事长、总经理,中国基金业协会创新与战略发展专业委员会委员,资产管理业务专业委员会委员,深圳证券交易所第三届上市复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司总部北京业务部总经理,投资银行总部副经理兼投资银行上海业务部副经理,投资银行总部副经理兼投资银行上海业务部副经理。

朱平:副总经理,男,硕士,经济师,中国证券监督管理委员会第六届创业板发行审核委员会兼职委员。曾任上海荣臣集团市场部经理,广发证券投资银行华南业务部副经理,基金科汇基金管理部,易方达基金管理有限公司投资部研究负责人,广发基金管理有限公司总经理助理。

易阳方:副总经理,男,经济学硕士,经济师。兼任广发基金管理有限公司业务总监,广发聚丰股票型证券投资基金基金经理,广发聚祥灵活配置混合型证券投资基金基金经理,广发国际资产管理有限公司董事,瑞元资本管理有限公司董事。曾任广发证券投资银行总部北京业务部总经理,投资银行总部副经理兼投资银行上海业务部副经理,投资银行总部副经理。

殷雪军:督察长,男,博士,曾在广东省佛山市财贸学校“广发证券股份有限公司”中国证券投资基金业协会广东监管局工作。

邱春辉:副总经理,男,经济学博士,瑞元资本管理有限公司董事。曾任原南方证券资产管理部产品设计人员,广发基金管理有限公司机构管理部副总经理、金融工部部副总经理,产品总监、金融工部部总经理。

4.基金经理

陆志明,男,中国籍,经济学硕士,15年证券和基金从业经历,持有中国证券投资基金从业证书,1999年6月至2001年6月在大鹏证券有限公司任研究员,2001年5月至2010年8月在深圳证券信息有限公司任部门总监,2010年8月9日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理,2011年6月3日起任“广发中小板300ETF基金

的基金经理,2011年6月9日起任“广发中小板300ETF联接基金”的基金经理,2012年6月7日起任“广发深证100指数分级基金的基金经理,2014年6月3日起任“广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理,2014年10月30日起任“广发百100指数基金的基金经理,2014年12月1日起任“广发中证中医药卫生ETF基金的基金经理,2015年1月8日起任“广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理,2015年1月29日起任“广发中证全指信息技术ETF联接基金的基金经理,2015年3月23日起任“广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理,2015年4月23日起任“广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理,2015年5月6日起任“广发能源互联网ETF基金的基金经理,2015年6月25日起任“广发中证全指医药ETF和广发中证全指原材料ETF基金的基金经理,2015年7月1日起任“广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理,2015年7月9日起任“广发能源联接和广发金融地产联接基金的基金经理,2015年7月23日起任“广发医疗健康分级基金的基金经理,2015年8月18日起任“广发原材料联接和广发主要消费联接基金的基金经理。

5.本基金投资决策集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:

主席:公司总经理林传辉;成员:公司副总经理朱平,公司副总经理易阳方,权益投资一部总经理刘晓龙,研究发展部总经理孙迪,固定收益部总经理张平。

6.上述人员之间均不存在近亲属关系。

第二部分 基金托管人

(一)基金托管人基本情况
名称:中国银行股份有限公司(简称“中国银行”)
住所及办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
首次注册日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24号
托管部门信息披露联系人:王为民
电话:(010)66594942
中国银行客服电话:95566

(二)基金托管部门及主要人员情况
中国银行托管业务部设立于1998年,现有员工110余人,大部分员工具有丰富的银行、证券、基金、信托从业经验,且具备海外工作、学习或培训经历,60%以上的员工具有硕士以上学位或高级职称。为给客户提供专业化的托管服务,中国银行已在境内、外分行开展托管业务。

作为国内首批开展证券投资基金托管业务的商业银行,中国银行拥有证券投资基金(基金—一对多)、一对一对、社保基金、保险资金、QDII、RQDII、ODI、境外三类货币、券商资产管理计划、信托计划、企业年金、银行理财产品、股权基金、私募基金、资金托管等门类齐全、产品丰富的托管业务体系。在国内,中国银行首家开展绩效评估、风险分析等增值服务,为各类客户提供个性化的托管增值服务,是国内领先的大型中资托管银行。

(三)证券投资基金托管情况
截至2015年12月31日,中国银行已托管418只证券投资基金,其中境内基金390只,QDII基金28只,覆盖A股股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构
1.直销机构
本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务:

(1)广州分公司
地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场东塔楼4楼
直销中心电话:020-89890773 020-8989042
传真:020-8989069 020-8989070

(2)北京分公司
地址:北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层
电话:010-68083368
传真:010-68083078

(3)上海分公司
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路168号中国保险大厦2908室
电话:021-68885310
传真:021-68885200

(4)网上交易
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。
本公司网上交易系统网址:www.gffunds.com.cn
本公司网址:www.gffunds.com.cn
客服电话:95105828(免长途费)或020-83936999
客服传真:020-34281105

(5)投资人也可通过本公司客户服务热线电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2.代销机构

(1)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
客服电话:95566
传真:010-66594946
公司网站:www.boc.cn

(2)名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5.18.19.36.38、39.41.42.43.44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:020-87565888
传真:020-87567985
客服电话:95575或致电各地营业网点
公司网站:www.gf.com.cn

(3)名称:北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址:北京市朝阳区西四环北路1号1号楼1603
办公地址:北京市朝阳区西四环北路1号1号楼特康中心A座16层
法定代表人:董浩
联系人:于婷婷
电话:13811217674
客服电话:010-56409010
公司网站:www.jimufund.com

(4)名称:北京微动利投资管理有限公司
注册地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心C341
法定代表人:梁洪军
联系人:李长军
电话:13621232313
传真:010-68854009
客服电话:4008-196-666
公司网站:www.buyforyou.com.cn

(5)名称:上海浦东东方资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁宇琦
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
公司网站:www.lufunds.com

(6)名称:合衡期货有限责任公司
注册地址:合肥市芜湖路258号
办公地址:合肥市芜湖路258号
法定代表人:吴国光
联系人:蔡芳
联系电话:0651-62862801
业务传真:0651-62862801
客服电话:4008878707
公司网站:www.hsqh.net

(7)名称:宁波银行股份有限公司
住所:宁波市鄞州区南汇南路700号
法定代表人:陆华裕
联系人:陈华
联系方式:0574-89068340
传真:0574-87005204
客服电话:96528,上海、北京地区962528
公司网站:www.nbcb.com.cn

(8)名称:北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区华严北里2号院1号楼6层
办公地址:北京市朝阳区华严北里2号院1号楼6层
法定代表人:闫振杰
联系人:翟飞飞
联系电话:010-52703550-6006
业务传真:010-62203555
客服电话:4008886661
公司网站:www.myfund.com

(9)名称:上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-446-788
公司网站:www.66zichan.com

(10)名称:深圳济财财富管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新技术产业园七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:马力佳

电话:0755-8399907-815
传真:0411-8399926
客服电话:0755-8399907
公司网站:www.jinjiangw.com

(11)名称:江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵中路669号
办公地址:江苏省常州市延陵中路668号
法人代表:王志刚
联系人:练统刚
联系电话:0519-89955001
客服电话:0519-96005
传真:0519-89955001
网址:www.jnbank.com

(12)名称:珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
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12楼1201-1203室
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏娟
电话:020-89629019
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
公司网站:www.yingmi.com

(13)名称:上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号9层
办公地址:上海市徐汇区虹梅路1801号凯利国际大厦7-9层
法定代表人:冯鹤冲
联系人:陈云卉
电话:021-33232899-5611
传真:021-33232837
客服电话:400-820-2819
公司网站:https://tty.chinapay.com

(14)名称:上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10楼12楼
法定代表人:沈继伟
联系人:张裕
联系电话:15901816661
客服热线:4000767266
公司网站:www.lidfund.com.cn

(15)名称:开源证券股份有限公司
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
联系人:黄芳、袁伟涛
电话:029-6337256
传真:029-61877060
客服电话:400-860-8866
公司网站:www.kysec.cn

(16)名称:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市基金390号,ODII基金28号,覆盖A股股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

二、基金份额发售机构
1.直销机构
本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务:

(1)广州分公司
地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场东塔楼4楼
直销中心电话:020-89890773 020-8989042
传真:020-8989069 020-8989070

(2)北京分公司
地址:北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层
电话:010-68083368
传真:010-68083078

(3)上海分公司
地址:上海市浦东新区陆家嘴东路168号中国保险大厦2908室
电话:021-68885310
传真:021-68885200

(4)网上交易
投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。
本公司网上交易系统网址:www.gffunds.com.cn
本公司网址:www.gffunds.com.cn
客服电话:95105828(免长途费)或020-83936999
客服传真:020-34281105

(5)投资人也可通过本公司客户服务热线电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2.代销机构

(1)中国银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:田国立
客服电话:95566
传真:010-66594946
公司网站:www.boc.cn

(2)名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
办公地址:广东省广州天河北路大都会广场5.18.19.36.38、39.41.42.43.44楼
法定代表人:孙树明
联系人:黄岚
电话:020-87565888
传真:020-87567985
客服电话:95575或致电各地营业网点
公司网站:www.gf.com.cn

(3)名称:北京乐融多源投资咨询有限公司
注册地址:北京市朝阳区西四环北路1号1号楼1603
办公地址:北京市朝阳区西四环北路1号1号楼特康中心A座16层
法定代表人:董浩
联系人:于婷婷
电话:13811217674
客服电话:010-56409010
公司网站:www.jimufund.com

(4)名称:北京微动利投资管理有限公司
注册地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心341
办公地址:北京市石景山区古城西路113号景山财富中心C341
法定代表人:梁洪军
联系人:李长军
电话:13621232313
传真:010-68854009
客服电话:4008-196-666
公司网站:www.buyforyou.com.cn

(5)名称:上海浦东东方资产管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
联系人:宁宇琦
电话:021-20665952
传真:021-22066653
客服电话:4008219031
公司网站:www.lufunds.com

(6)名称:合衡期货有限责任公司
注册地址:合肥市芜湖路258号
办公地址:合肥市芜湖路258号
法定代表人:吴国光
联系人:蔡芳
联系电话:0651-62862801
业务传真:0651-62862801
客服电话:4008878707
公司网站:www.hsqh.net

(7)名称:宁波银行股份有限公司
住所:宁波市鄞州区南汇南路700号
法定代表人:陆华裕
联系人:陈华
联系方式:0574-89068340
传真:0574-87005204
客服电话:96528,上海、北京地区962528
公司网站:www.nbcb.com.cn

(8)名称:北京展恒基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区华严北里2号院1号楼6层
办公地址:北京市朝阳区华严北里2号院1号楼6层
法定代表人:闫振杰
联系人:翟飞飞
联系电话:010-52703550-6006
业务传真:010-62203555
客服电话:4008886661
公司网站:www.myfund.com

(9)名称:上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8号楼3层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:4000-446-788
公司网站:www.66zichan.com

(10)名称:深圳济财财富管理有限公司
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新技术产业园七道惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
联系人:马力佳

电话:0755-8399907-815
传真:0411-8399926
客服电话:0755-8399907
公司网站:www.jinjiangw.com

(11)名称:江苏江南农村商业银行股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵中路669号
办公地址:江苏省常州市延陵中路668号
法人代表:王志刚
联系人:练统刚
联系电话:0519-89955001
客服电话:0519-96005
传真:0519-89955001
网址:www.jnbank.com

(12)名称:珠海盈米财富管理有限公司
注册地址:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
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12楼1201-1203室
法定代表人:肖雯
联系人:黄敏娟
电话:020-89629019
传真:020-89629011
客服电话:020-89629066
公司网站:www.yingmi.com

(13)名称:上海汇付金融服务有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路100号9层
办公地址:上海市徐汇区虹梅路1801号凯利国际大厦7-9层
法定代表人:冯鹤冲
联系人:陈云卉
电话:021-33232899-5611
传真:021-33232837
客服电话:400-820-2819
公司网站:https://tty.chinapay.com

(14)名称:上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路5475号1033室
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号10楼12楼
法定代表人:沈继伟
联系人:张裕
联系电话:15901816661
客服热线:4000767266
公司网站:www.lidfund.com.cn

(15)名称:开源证券股份有限公司
注册地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
办公地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层
法定代表人:李刚
联系人:黄芳、袁伟涛
电话:029-6337256
传真:029-61877060
客服电话:400-860-8866
公司网站:www.kysec.cn

(16)名称:中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京市基金390号,ODII基金28号,覆盖A股股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,满足了不同客户多元化的投资理财需求,基金托管规模位居同业前列。

第四部分 基金的投资

一、投资目标
本基金为ETF联接基金,主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内,年化跟踪误差控制在4%以内。

(一)资产配置策略
本基金主要投资于目标ETF,标的指数成份股及备选成份股,其中投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的保证金后,保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人可在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

二、目标ETF投资策略

1.投资组合的方式
本基金在综合考虑风险、风险、效率、成本等因素的基础上,决定采用申购的方式二级市场交易的方式投资于目标ETF的买卖。本基金还可适度参与目标ETF基金份额交易和申购、赎回之间的套利,以增强基金收益。当目标ETF申购、赎回交易模式进行了变更或调整,本基金也将作相应的变更或调整,无须召开基金份额持有人大会。

2.投资组合的调整
本基金将根据开放申购和赎回情况,决定投资目标ETF的时间和方式。

(1)当申购时,本基金将根据申购规模及仓位情况,决定股票组合的构建,目标ETF申购或买入等。

(2)当赎回时,本基金将根据申购赎回规模及仓位情况,决定目标ETF的赎回或卖出等。

(三)股票投资组合策略
1.股票组合构建原则
根据标的指数,结合研究报告和基金组合的构建情况,采用被动式指数化投资的方法构建股票组合。

2.股票组合构建方法
本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备

造成成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法,根据标的指数的构成权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对股票组合管理进行适当调整和变更,以更紧密的跟踪标的指数。

3.股票组合的调整

(1)定期调整
本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

(2)不定期调整
基金经理跟踪标的指数变动,基金组合跟踪偏离度情况,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

(四)债券投资策略

本基金将通过自上而下的宏观分析,结合对金融货币政策和利率趋势的判断确定债券投资组合的债券类别配置,并根据对个券对价格的比较,进行个券选择和配置。债券投资的主要目的是保证基金资产的流动性,有效利用基金资产。

(五)股指期货的投资策略
本基金在股指期货投资中主要遵循有效管理投资策略,根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要采用流动性好、交易活跃、期货合约,通过对现货和期货市场运行趋势的研究,结合股指期货定价模型寻求其合理估值水平,与现货资产进行匹配,通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。

本基金运用股指期货的情形主要包括:对冲系统性风险;对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;对冲因其他原因导致无法有效跟踪标的指数的风险;利用金融衍生品的杠杆作用,降低股票和目标ETF仓位频繁调整的交易成本,达到有效跟踪对标的指数的目的。

(六)权证投资策略
权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于提高基金资产的投资效率,控制基金投资组合风险水平,更好地实现本基金的投资目标。

若未来法律法规或监管部门有新规定,本基金将按最新规定执行。

(七)资产支持证券投资策略
资产支持证券主要包括资产抵押贷款支持证券(ABS)、住房抵押贷款支持证券(MBS)等证券品种。本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析,并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型,评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。