

广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书摘要

如果编制编制单位变更或停止中证全指能源指数的编制、发布或授权,或中证全指能源指数由其他机构操作,或由于指数编制方法的重大变更等事项导致本基金管理人认为中证全指能源指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资指数推出时,本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数,业绩比较基准和基金名称。其中,变更业绩比较基准和基金名称变更不涉及基金投资范围和投资策略无实质性影响(包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项),则无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应与基金托管人协商一致,报中国证监会备案并及公告。

本基金为复制型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制跟踪标的指数的表现,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。

广发基金管理有限公司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,并对本报告内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月1日复核了本报告中的财务指标、净值表和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合内所披露数据截至2018年8月31日,有关财务数据未经审计。

1. 报告期末基金资产净值情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	129,026,870.11	97.71
	其中:普通股	129,026,870.11	97.71
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	期货投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:应收款项类金融资产	-	-
7	其他资产	3,026,029.97	2.29
8	合计	132,052,813.11	100.00
9	负债	132,046,670.00	100.00

注:上表的股票投资组合含可退替代估值增值,而下表的数据不含可退替代估值增值。

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

行业名称	行业代码	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农林牧渔	-	-	-
B 非银	100,549,439.79	76.92	
C 制造业	18,421,097.66	13.91	
D 电力、热力、燃气及生产和供应业	2,526,891.00	2.13	
E 建筑业	-	-	
F 批发和零售业	5,188,259.64	3.92	
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-	
H 信息传输、软件和信息技术服务业	-	-	
I 医疗保健业	-	-	
J 金融业	-	-	
K 房地产业	-	-	
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 国防军工、管理和信息服务业	-	-	
P 其他	-	-	
Q 无法归类和未申报	-	-	
R 综合	2,419,413.00	1.83	
合计	129,026,870.11	97.70	

(2)报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

3. 报告期末未持仓的股票名称

4. 报告期末未持仓股票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组合

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	600028	中国石化	2,396,191	15,332,917.68	11.58
2	601887	中国中铁	1,749,947	13,309,566.00	10.09
3	601088	中国神华	582,400	12,145,040.00	9.17
4	600226	招商局港口	1,776,900	9,996,180.00	7.56
5	600917	山东墨龙	1,249,420	4,534,768.00	3.42
6	600296	广汇能源	1,154,885	4,400,123.36	3.32
7	600653	海油工程	699,689	4,076,676.40	3.08
8	601699	潞安环能	349,620	3,712,964.40	2.80
9	000963	山西路桥	461,100	3,616,004.00	2.73
10	002221	东华能源	243,892	2,897,243.92	2.18

5. 报告期末按品种分类的股票投资组合

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五名债券投资组合

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十名资产支持证券投资明细

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

9. 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

10. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

11. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1) 本基金报告期内未进行国债期货交易。

(2) 本基金报告期内未进行股指期货交易。

12. 投资组合报告附注

(1) 本基金报告期内未持有股票。

(2) 本基金报告期内未持有债券。

(3) 本基金报告期内未持有资产支持证券投资。

(4) 本基金报告期内未持有贵金属。

(5) 本基金报告期内未持有权证。

(6) 本基金报告期内未进行股指期货交易。

(7) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(8) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(9) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(10) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(11) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(12) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(13) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(14) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(15) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(16) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(17) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(18) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(19) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(20) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(21) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(22) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(23) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(24) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(25) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(26) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(27) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(28) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(29) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(30) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(31) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(32) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(33) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(34) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(35) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(36) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(37) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(38) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(39) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(40) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(41) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(42) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(43) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(44) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(45) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(46) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(47) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(48) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(49) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(50) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(51) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(52) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(53) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(54) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(55) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(56) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(57) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(58) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(59) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(60) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(61) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(62) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(63) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(64) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(65) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(66) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(67) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(68) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(69) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(70) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(71) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(72) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(73) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(74) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(75) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(76) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(77) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(78) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(79) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(80) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(81) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(82) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(83) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(84) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(85) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(86) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(87) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(88) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(89) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(90) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(91) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(92) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(93) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(94) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(95) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(96) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(97) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(98) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(99) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(100) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(101) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(102) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(103) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(104) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(105) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(106) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(107) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(108) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(109) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(110) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(111) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(112) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(113) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(114) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(115) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(116) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(117) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(118) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(119) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(120) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(121) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(122) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(123) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(124) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(125) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(126) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(127) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(128) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(129) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(130) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(131) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(132) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(133) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(134) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(135) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(136) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(137) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(138) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(139) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(140) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(141) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(142) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(143) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(144) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(145) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(146) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(147) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(148) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(149) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(150) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(151) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(152) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(153) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(154) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(155) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(156) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(157) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(158) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(159) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(160) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(161) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(162) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(163) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(164) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(165) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(166) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(167) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(168) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(169) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(170) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(171) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(172) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(173) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(174) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(175) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(176) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(177) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明