广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要

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
时间：二〇一八年十一月

【重要提示】

本基金于2016年1月19日经中国证监会证监许可[2016]80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。

基金管理人依照恪尽职守，诚实信用，谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为境外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；衍生品风险，包括衍生品市场风险和衍生品模型风险；由于基金投资人在买入赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险；本基金的特定风险等。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为境外投资证券市场波动等因素产生波动，在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自己的风险承受能力，从而取基金投资收益，并承担相应的投资风险。本基金投资中出现的风险主要分为四类：一是本基金特有风险；二是与指数相关的风险，包括指数的授权、编制、拟销风险，金融模型风险和跟踪误差风险；三是境外投资风险；四是开放式基金投资的一般风险，包括流动性风险、信用风险、利率风险等。

投资者可使用人民币或美元购买本基金的认购/申购申请，其中使用人民币认购/申购的份额将被确认为人民币份额，使用美元认购/申购的份额将被确认为美元份额。

投资者认购、投资人买入购或申购/基金时应认真阅读本基金《招募说明书》与《基金合同》，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购或申购/基金的意思、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要采取组合投资。

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2018年9月30日，有关财务数据截止日为2018年6月30日（财务数据未经审计）。

第一部分	基金的名称
广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金	
第二部分	基金的类型
股票型证券投资基金、QDII	

第二部分 基金的投资范围

本基金主要投资于纳斯达克生物科技指数成份股、紧密跟踪纳斯达克生物科技指数的投资标的的指数基金（包括 ETF）等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的股票（可投资“沪股通及深股通”范围内的股票）；与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构认可的证券交易所上市交易的权证、期货、期权等金融衍生产品；经中国证监会、证券投资基金业协会等证券监管机构核准的证券基金；与固定收益、股权、货币、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；法律合约、互换及其他中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期货等金融衍生产品；银行存款、短期债券等货币市场工具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（但法律允许中国证监会相关规定，则基本法律法规或监管机构以允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围）。

基金的投资组合比例为：本基金对纳斯达克生物科技指数成份股、各选成份股及以纳斯达克生物科技指数为标的的指数基金（包括 ETF）的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

第五部分 基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金为被动管理的指数型基金，在正常情况下，力争将本基金净值跟长期内的日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在5%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取尽量跟踪被动跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金对纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股及以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括 ETF）的投资比例不低于基金资产净值的90%。现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

（二）股票投资策略

1.股票组合构建方法

本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式跟踪指数投资。股票在投资组合中时权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复合标的指数的业绩表现。但若出现股为特殊的情况（例如成分股流动性不足、成份股投资受限、成分股长期停牌、成分股发生变更、成份股权重由于自由流通发生变化、成分股公司行为等），或变基金规模的投资受限，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整，力争降低跟踪误差。

若部分成分股出现流动性不佳或停牌等原因而无法投资买进，则基金管理人可以选择采用合理方法进行替代，如选择相关性较高的股票或投资组合，对替代性股票的选择一般原则合考虑基金投资标的指数的权重可能带来影响等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整，力争降低跟踪误差。

2.股票组合调整

根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3.其他调整

对于标的指数成份股，若因其出现停牌限制，存在严重的流动性困难，或者财务风险较大，或者面临重大的不利的司法诉讼，或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。

（三）固定收益类投资策略

本基金在主要以跟踪跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。

（四）衍生品投资策略

为了使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，本基金可投资于该中国证监会允许的各种金融衍生产品，如与标的指数或标的指数成份股相关的期货、期权、权证以及其他衍生工具。本基金在金融衍生品投资策略，对外汇风险管理、利率风险管理、流动性风险管理、信用风险管理、交叉风险和某些特殊情况下的流动性风险，以及利用金融衍生产品的杠杆作用，达到对标的指数的有效跟踪，同时降低总体股票调整带来的交易成本。

第六部分 基金的比较基准

本基金的标的指数为纳斯达克生物科技指数（NASDAQ Biotechnology Index）。

本基金的业绩比较基准为：95%×人民币计价的纳斯达克生物科技指数收益率×人民币汇率（税后）+5%×人民币活期存款收益率（税后）。

如预期指数编制单位变更或停止纳斯达克生物科技指数的编制及发布或指数、或纳斯达克生物科技指数其他指数替代、或由于指数编制方法原理发生变更导致基金管理人认为纳斯达克生物科技指数不适合作为标的指数，或证券市场发生剧烈波动、或证券市场有重大变化等情形时，本基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称。其中，若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更，则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会，并按中国证监会备案且在指定媒体公告。若变更标的指数对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后，报中国证监会备案并及时公告。

第七部分 基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金，具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为被动管理的指数型基金，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。

第八部分 基金的投资组合报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金基金合同规定，于2018年11月7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。

本投资组合报告所载数据截至2018年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	319,109,397.99	90.29
	其中：普通股	305,145,966.18	86.34
	存托凭证	13,963,431.81	3.95
	优先股	–	–
	房地产信托	–	–
2	基金投资	11,029,863.14	3.12
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
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	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	21,980,422.41	6.22
8	其他资产	1,295,280.65	0.37
9	合计	353,414,964.19	100.00

2.报告期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	319,109,397.99	92.01
合计	319,109,397.99	92.01

注：1.国家（地区）系按照股票及存托凭证所在的证券交易所确定。
2.上述国别比图包括法律地为英国、开曼、开曼群岛、法国、比利时、西班牙、洛西岛在美国上市的ADR。
3.报告期末按行业分类的权益投资及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
公用事业	–	–
能源	–	–
信息技术	–	–
日常消费品	–	–
非日常生活消费品	–	–
房地产	–	–
原材料	–	–
通信服务	–	–
工业	–	–
金融	–	–
医疗保健	319,109,397.99	92.01
合计	319,109,397.99	92.01

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。
4.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及存托凭证投资明细

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	BIOGEN INC	百健	BIIB US	纳斯达克证券交易所	美国	11,282.00	27,429,789.89	7.91
2	AMGEN INC	–	AMGN US	纳斯达克证券交易所	美国	18,464.00	26,329,467.69	7.59
3	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	49,209.00	26,137,017.46	7.54
4	CELGENE CORP	新基医药	CELG US	纳斯达克证券交易所	美国	38,967.00	23,988,849.26	6.92
5	ILLUMINA INC	Illumina公司	ILMN US	纳斯达克证券交易所	美国	7,903.00	19,955,700.54	5.75
6	REGENERON PHARMACEUTICALS	再生元制药股份有限公司	REGN US	纳斯达克证券交易所	美国	5,521.00	15,345,464.74	4.42
7	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Vertex制药股份有限公司	VRTX US	纳斯达克证券交易所	美国	10,767.00	14,275,933.09	4.12
8	ALEXION PHARMACEUTICALS INC	Alexion制药公司	ALXN US	纳斯达克证券交易所	美国	12,228.00	11,693,362.39	3.37
9	MYLAN NV	迈兰公司	MYL US	纳斯达克证券交易所	美国	28,333.00	7,133,646.47	2.06
10	BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	BioMarin 制药股份有限公司	BMRN US	纳斯达克证券交易所	美国	9,713.00	6,479,309.42	1.87

注：以权所用证券代码的纳斯达克证券市场代码。
5.报告期末按债券品种等级分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。
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明细
本基金本报告期末未持有债券。
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
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
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金融衍生品投资明细
本基金本报告期末未持有金融衍生品。
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十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	PROSHARES ULTRA NASD BIOTECH	ETF基金	契约式开放式基金	Proshares Trust	11,029,863.14	3.18

10.投资组合报告附注
(1) 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。
(2) 报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选投资库。
(3) 其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	–
2	应收证券清算款	–
3	应收股利	5,279.79
4	应收利息	2,268.60
5	应收申购款	1,287,732.26
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,295,280.65

(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) 期末前数投资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。

第九部分 基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守，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，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2018年6月30日。

1. 本基金各报告期末位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率①	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
2015.03.30-2015.12.31	1.10%	1.77%	1.57%	1.74%	-0.47%	0.03%
2016.01.01-2016.12.31	-17.21%	1.86%	-15.40%	1.81%	-1.81%	0.05%
2017.01.01-2017.12.31	13.26%	1.10%	12.85%	1.02%	0.41%	0.08%
2018.01.01-2018.06.30	3.48%	1.41%	4.51%	1.38%	-1.03%	0.03%
自基金合同生效至2018.06.30	-1.90%	1.57%	1.22%	1.52%	-3.12%	0.05%

注：1.本基金的业绩比较基准为：95%×人民币计价的纳斯达克生物科技指数收益率×5%×人民币活期存款收益率（税后）。
2.业绩比较基准是根据基金合同关于投资组合比例的规定和测算。
2. 本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图

第十部分 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华路6号105室—49948（集中办公区）
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：孙柏明
5.设立时间：2003年8月5日
6.电话：020-83936000
全国统一客服热线：95105828
7.联系人：邱春艳
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”），持有2家股权投资机构，深圳市前海百汇金融投资集团有限公司，国美控股股份有限公司和广州科技金融创新投资控股有限公司，分别持有基金管理人51.136%、15.762%、15.762%、9.8246%和7.2891%股权。

二、主要人员情况

1.董事会成员

孙柏明先生：董事长，博士，高级经济师。兼任广发证券股份有限公司董事长、执行董事、党委书记，中证机构间报价系统股份有限公司副董事长，中国证券业协会第六届理事会副理事长，上海证券交易所第四届理事会理事，深圳证券交易所第二届董事会监事，中国上市公司协会第二届理事会副理事长、非洲金融合作协会理事，中国注册会计师协会道德准则委员会委员，广东省第六届委员会，广东省预防腐败工作专家咨询委员会财政金融组行规员机组成员，中证机构间报价系统股份有限公司副董事长。曾任职于广东省证券公司，先后担任广发证券股份有限公司总经理办公室主任、总经理助理，中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长，中国银河证券有限公司监事会监事，中国证监会证券部主任、主任等职务。

林传辉先生：董事长，学士，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，中国基金业协会副会长兼证券业专业委员会委员，资产管理业务专业委员会委员，深圳证券交易所第四届上诉复核委员会委员。曾任广发证券股份有限公司投资银行部常务副总经理，海富资本管理有限公司总经理、董事长。

孙颖医女士：董事，硕士，现任广发证券执行董事、副总经理，财务总监，兼任广发控股（香港）有限公司董事，证通股份有限公司监事长，曾任广东广发证券股份有限公司财务总监、副总经理，广发证券股份有限公司证券投资总部总经理，广发证券股份有限公司证券投资管理部总经理。广发基金管理有限公司财务总监、副总经理，广发证券股份有限公司证券投资管理部总经理。

文剑先生：董事，硕士，高级会计师，现任煤炭通信科技股份有限公司总裁，兼任南京煤大星空通信发展有限公司董事，曾任煤炭通信科技股份有限公司财务部经理助理、财务部总经理、董事会秘书、财务总监、副总裁。

翟英卿女士：董事，硕士，现任深圳市门联股份有限公司董事长，南方香江集团董事长、总经理，香江集团董事长、总经理，香江集团有限公司董事长、董事长兼总裁、广东省安全应急协会会长、全国民营企业协会副会长、广东省安全应急协会会主席，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，深圳光明安村横岭股份有限公司董事，曾任深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事长、总经理，曾任深圳市前海香江金融投资有限公司董事、总经理，曾任深圳市前海香江金融投资有限公司董事、总经理、财务总监、副总裁。

谷冬强先生：董事，硕士，副主任药师，现任康美药业股份有限公司董事长、常务副总经理，兼任世界中联中药协会副会长兼秘书长、全国中药企业家委员会副会长、国家中医药管理局对外交流合作专家咨询委员会委员、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、全国药品食品标准化技术委员会委员、广东省中药学会第六届理事会理事、广东省中药标准化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专业技术专家、基金管理人职业操守委员会副主任委员。广东省中药标准化技术委员会副主任委员等。

罗海平先生：独立董事，博士，现任中信联合证券股份有限公司董事副总经理，集团机关党委书记，兼任信联资产管理有限公司董事，曾任中国人民保险公司阿姆克分公司经理，副北京分公司副际保险部党组书记、总经理，汉口分公司党委书记、总经理，太平保险有限公司市场部总经理，副北京分公司党委书记、总经理，助理总经理，副总经理兼董事会秘书，阳光财产保险股份有限公司总裁，法人代表、董事长、党委书记。

董茂云先生：独立董事，博士，现任宁波大学法学院教授，学术委员会主任，兼任南京独生物医药股份有限公司独立董事，复旦大学兼职教授，浙江合创律师事务所兼职律师，曾任复旦大学教授、法律系副主任、法学院副院长。

姚海鑫先生：独立董事，博士，教授，博士生导师，现任江广大学法学院院长，辽宁大学非学院博士生导师，兼任中国会计教授资格委员，东北财经高校财务与会计教师联合会常务理事，辽宁省生产力学会副理事长，东北财经（集团）股份有限公司独立董事，沈阳化工股份有限公司独立董事和叶兴一庆国商业大厦（集团）股份有限公司独立董事。曾任辽宁大学工商管理学院副院长、主任教授、博士生导师、辽宁省人民政府特聘专家、辽宁省政府法律顾问、辽宁省人民政府特聘专家、辽宁省人民政府特聘专家、辽宁省人民政府特聘专家