广发中证全指可选消费交易型开放式指数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:中国银行股份有限公司
时间:二〇一九年十月

【重要提示】

本基金于2013年9月29日经中国证监会证监许可[2013]1265号文核准。根据当时生效的法律法规,本基金合同于2014年6月3日生效。

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核准,但中国证监会对本基金募集的核准,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。

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,投资人在投资本基金前,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,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等。本基金为股票型基金,风险与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,主要采用完全复制法跟踪标的指数中证全指可选消费指数的表现,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。

本基金为交易型开放式指数证券投资基金(ETF),已在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海两个证券交易所,本基金的申购、赎回模式与组合证券仅在深圳或上海证券交易所上市的ETF产品有所差异。如采用组合证券的“场外实物申购、赎回”,投资人的申购、赎回申请在T+1日确认,申购所得ETF份额及赎回所得组合证券在T+2日可用;如采用组合证券的“场内部分实物、部分现金”申购、赎回模式,投资人的申购、赎回申请在T日确认,申购所得ETF份额、赎回所得组合证券及现金替代在T日可用。如投资人需要通过申购赎回代理券商参与本基金的申购、赎回,则应同时持有并使用深圳A股账户与上海A股账户,且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有,同时用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管证券公司和上海A股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理券商。投资人认购或申购基金份额时应认真阅读本招募说明书。

基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

本基金本次更新的招募说明书主要根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则(2019年修订)》的规定对相关信息进行更新,相关信息更新截止日为2019年10月16日。除非另有说明,本招募说明书其他所载内容截止日为2019年6月3日,有关财务数据截止日为2019年3月31日,净值表现截止日为2018年12月31日。(财务数据未经审计)。

一、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-49848(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:孙树明
5、设立时间:2003年8月5日
6、电话:020-83936666
全国统一客服热线:95105828
7、联系人:邱春杨
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金融创新投资控股有限公司,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

孙树明先生: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兼职副会长,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监事会监事,中国上市公司协会第三届理事会兼职副会长,亚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,广东金融学会副会长,广东省预防腐败工作专家咨询委员会财政金融运行规范组成员。曾任财政部条法司副处长、处长,中国经济开发信托投资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,中国证监会会计部副主任、主任等职务。

林传辉先生:副董事长,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,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,瑞元资本管理有限公司总经理、董事长。

孙晓燕女士: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。曾任广东广发证券公司投资银行部经理、广发证券有限责任公司财务部经理、财务部副总经理、广发证券股份有限公司投资自营部副总经理,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财务部总经理,证通股份有限公司监事长。

戈俊先生:董事,硕士,高级会计师,现任烽火通信科技股份有限公司总裁。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、财务部总经理、董事会秘书、财务总监、副总裁。

翟美卿女士:董事,硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司董事长、总经理,深圳香江控股股份有限公司董事长、总经理,南方香江集团董事长、总经理,香江集团有限公司总裁、深圳市金海马实业股份有限公司董事长。兼任全国政协委员,中国女企业家协会副会长,广东省妇联副主席,广东省工商联副主席,广东省女企业家协会会长,香江社会救助基金会主席,深圳市侨商国际联合会会长,深圳市深商控股集团股份有限公司董事,香港各界文化促进会主席。

许冬瑾女士:董事,硕士,副主任药师,现任康美药业股份有限公司副董事长、常务副总经理,兼任世界中联中药饮片质量专业委员会副会长、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专业专家委员会副主任委员,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,现任中华联合保险集团股份有限公司常务副总经理、首席风险官、集团机关党委书记,兼任保监会行业风险评估专家。曾任中国人民保险公司荆襄支公司经理、湖北省分公司国际保险部党组书记、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、湖北分公司党委书记、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,阳光保险集团执行委员会委员,中华联合财产保险股份有限公司总经理、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,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,海尔施生物医药股份有限公司独立董事。

姚海鑫先生:独立董事,博士,现任辽宁大学新华国际商学院教授、辽宁大学商学院博士生导师,兼任中国会计学会理事、东北地区高校财务与会计教师联合会常务理事、辽宁省会计与珠算心算学会会长、沈阳化工股份有限公司独立董事和中兴-沈阳商业大厦(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、工商管理硕士(MBA)教育中心副主任、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、东北制药(集团)股份有限公司独立董事。

2、监事会成员

符兵先生:监事会主席,硕士,经济师。曾任广东物资集团公司计划处副科长,广东发展银行广州分行世贸支行行长、总行资金部处长,广发基金管理有限公司广州分公司总经理、市场拓展部副总经理、市场拓展部总经理、营销服务部总经理、营销总监、市场总监。

匡丽军女士:股东监事,硕士,高级涉外秘书,现任广州科技金融创新投资控股有限公司工会主席、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,广州市科达实业发展公司办公室主任、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。

吴晓辉先生:职工监事,硕士,现任广发基金管理有限公司信息技术部总经理,兼任广发基金分工会主席。曾任广发证券电脑中心副经理、经理。

张成柱先生:职工监事,学士,现任广发基金管理有限公司中央交易部交易员。曾任广州新太科技股份有限公司工程师,广发证券股份有限公司工程师,广发基金管理有限公司信息技术部工程师。

刘敏女士:职工监事,硕士,现任广发基金管理有限公司营销管理部副总经理。曾任广发基金管理有限公司市场拓展部总经理助理,营销服务部总经理助理,产品营销管理部总经理助理。

3、总经理及其他高级管理人员

林传辉先生:总经理,学士,兼任广发国际资产管理有限公司董事长,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,瑞元资本管理有限公司总经理、董事长。

易阳方先生:常务副总经理,硕士。兼任广发基金管理有限公司投资总监,广发创新驱动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。曾任广发证券投资自营部副经理,中国证券监督管理委员会发行审核委员会发行审核委员,广发基金管理有限公司投资管理部总经理、公司总经理助理、副总经理,广发聚富开放式证券投资基金基金经理、广发制造业精选混合型证券投资基金基金经理、广发鑫享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发稳裕保本混合型证券投资基金基金经理、广发聚丰混合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、广发鑫益灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发转型升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发聚惠灵活配置混合型证券投资基金基金经理,瑞元资本管理有限公司董事。

朱平先生:副总经理,硕士,经济师。曾任上海荣臣集团市场部经理、广发证券投资银行部华南业务部副总经理,基金科汇基金经理,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,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。

邱春杨先生:督察长,博士。曾任广发基金管理有限公司机构理财部副总经理、金融工程部副总经理、金融工程部总经理、产品总监、副总经理,广发沪深300指数证券投资基金基金经理、广发中证500指数证券投资基金基金经理,瑞元资本管理有限公司董事。

魏恒江先生:副总经理,硕士,高级工程师。曾在水利部、广发证券股份有限公司工作,历任广发基金管理有限公司上海分公司总经理、综合管理部总经理、总经理助理。

张敬晗女士:副总经理,硕士,兼任广发国际资产管理有限公司副董事长。曾任中国农业科学院助理研究员,中国证监会培训中心、监察局科员,基金监管部副处长及处长,私募基金监管部处长。

张苹女士:副总经理,硕士。兼任广发基金管理有限公司固定收益投资总监、广发纯债债券型证券投资基金基金经理、广发聚鑫债券型证券投资基金基金经理、广发鑫裕灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发集裕债券型证券投资基金基金经理。曾在施耐德电气公司、中国银河证券、中国人保资产管理公司、工银瑞信基金管理有限公司和长盛基金管理有限公司工作,历任广发基金管理有限公司固定收益部总经理,广发聚盛灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发安宏回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金基金经理、广发集安债券型证券投资基金基金经理、广发集鑫债券型证券投资基金基金经理、广发集丰债券型证券投资基金基金经理、广发集源债券型证券投资基金基金经理。

王凡先生:副总经理,博士。曾在财政部、全国社保基金理事会、易方达基金管理有限公司工作。

窦刚先生:首席信息官,硕士。曾在广发证券股份有限公司工作,历任广发基金管理有限公司中央交易部总经理、运营总监、公司总经理助理。

4、基金经理

陆志明先生,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员,深圳证券信息有限公司部门总监,广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2011年6月3日至2016年7月28日)、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自2011年6月9日至2016年7月28日)、广发深证100指数分级证券投资基金基金经理(自2012年5月7日至2016年7月28日)、广发中证百度百发策略100指数型证券投资基金基金经理(自2014年10月30日至2016年7月28日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自2015年7月23日至2016年7月28日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年7月9日至2018年10月9日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年8月18日至2018年12月20日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年8月18日至2018年12月20日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年7月1日至2019年4月2日)。现任广发基金管理有限公司量化投资部副总经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年6月3日起任职)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2014年12月1日起任职)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年1月8日起任职)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年1月29日起任职)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年3月23日起任职)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年4月15日起任职)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年5月6日起任职)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日起任职)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2015年6月25日起任职)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2015年7月9日起任职)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2017年6月13日起任职)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自2017年6月13日起任职)。

历任基金经理:季峰,任职时间为2014年10月21日至2016年5月26日。

5、基金投资采取集体决策制度。基金管理人权益公募投委会由副总经理朱平先生、总经理助理陈少平女士、价值投资部总经理傅友兴先生、成长投资部总经理刘格菘先生和策略投资部副总经理李巍先生等成员组成,朱平先生担任投委会主席。基金管理人固定收益投委会由副总经理张芊女士、债券投资部总经理谢军先生、现金投资部总经理温秀娟女士、债券投资部副总经理代宇女士和固定收益研究部总经理助理毛炳华先生等成员组成,张芊女士担任投委会主席。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

一、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
首次注册登记日期:1983年10月31日
注册资本:人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整
法定代表人:刘连舸
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:王永民
传真:(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,且具有海外工作、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)、社保基金、保险资金、QFII、RQFII、QDII、境外三类机构、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2019年6月30日,中国银行已托管716只证券投资基金,其中境内基金676只,QDII基金40只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型、FOF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。

三、相关服务机构

一、申购赎回代理券商

(1)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:020-87555888
传真:020-87557985
客服电话:95575或致电各地营业网点
公司网站:www.gf.com.cn

(2)名称:华泰证券股份有限公司
住所:南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:0755-82492193
传真:0755-82492962
联系人:庞晓芸
客服电话:95597
公司网站:www.htsc.com.cn

(3)名称:上海证券有限责任公司
注册地址:上海市黄浦区西藏中路336号
办公地址:上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人:龚德雄
联系人:张瑾
联系电话:021-53519888
业务传真:021-63608830
客服热线:4008918918、021-962518
公司网址:www.962518.com

(4)名称:兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
联系人:谢高得
电话:021-38565785
传真:021-38565955
客户服务热线:95562
公司网站:www.xyzq.com.cn

(5)名称:广州证券有限责任公司
注册地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
办公地址:广州市天河区珠江新城珠江西路5号广州国际金融中心19、20楼
法定代表人:刘东
联系人:林洁茹
电话:020-88836999
传真:020-88836654
客服电话:020-961303
公司网站:www.gzs.com.cn

(6)名称:国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦六楼
法定代表人:何如
联系人:齐晓燕
电话:0755-82130833
传真:0755-82133952
客服电话:95536
公司网站:www.guosen.com.cn

(7)名称:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘晨
电话:021-22169999
传真:021-22169134
客服电话:4008888788,10108998,95525
公司网站:www.ebscn.com

(8)名称:东海证券股份有限公司
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18-19楼
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦
法定代表人:朱科敏
客服电话:95531;4008888588
联系人:梁旭
电话:0519-88157761
传真:0519-88157761
公司网站:www.longone.com.cnn

(9)名称:中国中投证券有限责任公司
注册地址: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
联系人:刘毅
电话:0755-82023442
传真:0755-82026539
开放式基金咨询电话:400-600-8008
公司网站:www.china-invs.cn

(10)名称:平安证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼
法定代表人:杨宇翔
联系人:郑舒丽
电话:0755-22626319
开放式基金业务传真:0755-82400862
全国免费业务咨询电话:95511—8
公司网站:www.pingan.com

(11)名称:安信证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人:牛冠兴
电话:0755-82825551
传真:0755-82558355
统一客服电话:4008001001
公司网站:www.essence.com.cn

(12)名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
电话:010-63081000
传真:010-63080978
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com

(13)名称:中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
联系人:权唐
电话:400-8888-108
传真:010-65182261
客服电话:400-8888-108
公司网站:www.csc108.com

(14)名称:招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层
法定代表人:宫少林
联系人:林生迎
电话:0755-82943666
传真:0755-82943636
客服电话:95565、4008888111
公司网站:www.newone.com.cn

(15)名称:中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
联系人:田薇
电话:010-66568430
传真:010-66568990
客服电话:4008-888-888或拨打各城市营业网点咨询电话。
公司网站:www.chinastock.com.cn

(16)名称:德邦证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址:上海市福山路500号城建大厦26楼
法定代表人:姚文平
联系人:罗芳
电话:021-68761616
传真:021-68767981
客服电话:400-8888-128
公司网站:www.tebon.com.cn

(17)名称:华福证券有限责任公司
注册地址:福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址:福州市五四路157号新天地大厦7至10层
法定代表人:黄金琳
联系人:张腾
电话:0591-87383623
传真:0591-87383610
公司网站:www.hfzq.com.cn
客服电话:96326(福建省外请先拨0591)

(18)名称:国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
办公地址:上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦29楼
法定代表人:万建华
联系人:吴倩
电话:021-38676666
传真:021-38670666
客服电话:400-8888-666
公司网站:www.gtja.com

(19)名称:海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
联系人:金芸、李笑鸣
电话:021-23219000
传真:021-23219100
客户服务热线:95553或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:www.htsec.com

(20)名称:中泰证券股份有限公司
注册地址:济南市市中区经七路86号
办公地址:济南市经七路86号证券大厦
法定代表人:李玮
联系人:吴阳
电话:0531-68889155
传真:0531-68889752
客服电话:95538
公司网站:www.zts.com.cn

(21)名称:国盛证券有限责任公司
注册地址:南昌市北京西路88号(江信国际金融大厦)
办公地址:南昌市北京西路88号(江信国际金融大厦)
法定代表人:徐丽峰
联系人:周欣玲
电话:0791-86281305
传真:0791-86282293
客服电话: 4008-222-111
公司网站:www.gsstock.com

(22)名称:东北证券股份有限公司
注册地址:长春市生态大街6666号
办公地址:长春市生态大街6666号
法定代表人:李福春
联系人:安岩岩
联系电话:0431-85096517
客服热线:95360
公司网站:www.nesc.cn

(23)名称:方正证券股份有限公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层
法定代表人:雷杰
联系人:彭博
电话:0731-85832343
传真:0731-85832214
客服电话:95571
公司网站:www.foundersc.com

(24)名称:中天证券股份有限公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23甲
办公地址:沈阳市和平区南五马路121号 万丽城晶座4楼 中天证券 经纪事业部
法定代表人:马功勋
联系人 李泓灏
联系电话:024-2328 0806
客服电话:(024)95346
公司网站:www.iztzq.com

基金管理人可根据有关法律、法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

二、登记结算机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:010-50938888
传真:010-59378907
联系人:崔巍

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:广东广信君达律师事务所
住所:广东省广州市天河区珠江新城珠江东路6号广州周大福金融中心(广州东塔)29层、10 层
负责人:王晓华
电话:020-37181333
传真:020-37181388
经办律师:刘智、杨琳
联系人:刘智

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
法人代表: 毛鞍宁
联系人:赵雅
电话:020-28812888
传真:020-28812618
经办注册会计师:赵雅、马婧

四、基金的名称

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数即中证全指可选消费指数的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、新股、债券、权证、股指期货、货币市场工具及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的相关规定。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%,权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构以后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。

八、基金的投资策略

一、投资策略

本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。

一般情形下, 本基金将根据标的指数成份股的构成及其权重构建股票资产投资组合,但在标的指数成份股发生调整、配股、增发、分红等公司行为导致成份股的构成及权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整时,基金管理人将对投资组合进行优化,以更紧密的跟踪标的指数。本基金将根据市场情况,结合经验判断,综合考虑相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中其他成份股或备选成份股进行替代,以期在规定的风险承受限度之内,尽量缩小跟踪误差。

在正常情况下,本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.2%,年化跟踪误差不超过2%。

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品,如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具,包括融资融券等。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,力争提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差,而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。

二、投资组合管理

1、投资组合构建

本基金投资组合的构建主要分为三步:确定目标组合、制定建仓策略、组合调整。

(1)确定目标组合:基金管理人主要采用完全复制标的指数成份股的构成及权重的方法确定目标组合;

(2)制定建仓策略:基金经理根据对标的指数成份股的流动性和交易成本等因素的分析,制定合理的建仓策略;

(3)组合调整:基金经理在规定的时间内,采用适当的方法和措施对组合进行调整,直至达到紧密跟踪标的指数的要求。

2、投资组合的日常管理

(1)标的指数成份股公司行为信息的跟踪与分析:跟踪标的指数成份股公司行为信息以及成份股公司其他重大信息,包括但不限于成份股发生配股、增发、分红、停牌、复牌等,分析这些信息对指数的影响,并进行相应的组合调整分析,为投资决策提供依据。

(2)标的指数的跟踪与分析:跟踪标的指数的调整等变化,确定标的指数变化是否与预期一致,分析是否存在差异及差异产生的原因,为投资决策提供依据。

(3)每日申购赎回情况的跟踪与分析:跟踪基金申购和赎回情况,分析其对投资组合的影响。

(4)组合持有证券、现金头寸及流动性分析:基金经理跟踪分析实际组合与目标组合的差异及其原因,并对拟调整的成份股进行流动性分析。

(5)组合调整:找出将实际组合调整为目标组合的最优方案,确定组合交易计划;如发生标的指数成份股调整、成份股公司发生并购重组等重大事项,基金经理召集会议,决定基金的操作策略;调整组合,达到目标组合的持仓结构。

(6) 每日申购赎回清单的制作: 基金经理以T-1日指数成份股的构成及其权重为基础,考虑T日将会发生的上市公司变动等情况,制作T日的申购赎回清单并公告。

3、投资组合的定期管理

(1)每月

每月末,根据基金合同中基金管理费、基金托管费等的支付要求,及时检查组合中的现金比例,进行支付现金的准备。

每月末,基金经理对投资操作、投资组合表现、跟踪误差等进行分析,分析最近投资组合与标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差情况,找出未能有效控制较大偏离的原因。

(2)每半年

根据标的指数的编制规则及调整公告,基金经理依据投资决策委员会的决策,在标的指数成份股调整生效前,分析并制定投资组合调整策略,尽量减少因成份股变动带来的跟踪偏离度和跟踪误差。

4、投资绩效评估

(1)每日对基金的跟踪偏离度进行分析;

(2)每月末对本基金的运行情况进行量化评估;

(3)每月末根据评估报告分析当月的投资操作、组合状况和跟踪误差等情况,重点分析基金的跟踪误差和跟踪偏离度的产生原因、现金控制情况、标的指数成份股调整前后的操作以及成份股未来可能发生的变化等。

在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度不超过0.2%,年化跟踪误差不超过2%。当跟踪偏离度和年化跟踪误差超过上述目标范围时,基金管理人将通过归因分析模型找出跟踪误差的来源,并采取合理措施避免跟踪偏离度和跟踪误差进一步扩大。

九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证全指可选消费指数。

如果指数编制单位变更或停止中证全指可选消费指数的编制、发布或授权,或中证全指可选消费指数由其他指数替代、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可选消费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、更适合投资的指数推出时,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,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。

十、风险收益特征

本基金为股票型基金,风险与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,主要采用完全复制法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。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年7月17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2019年3月31日,有关财务数据未经审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	291,095,297.12	98.88
	其中:股票	291,095,297.12	98.88
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	3,293,052.04	1.12
7	其他各项资产	2,051.96	0.00
8	合计	294,390,401.12	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而下表中合计项不含可退替代款估值增值。

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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	199,952,795.92	68.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	84,144.00	0.03
F	批发和零售业	25,543,091.73	8.69
G	交通运输、仓储和邮政业	373,606.35	0.13
H	住宿和餐饮业	2,216,453.66	0.75
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,926,268.53	4.40
J	金融业	134,343.00	0.05
K	房地产业	2,832,299.56	0.96
L	租赁和商务服务业	19,166,164.47	6.52
M	科学研究和技术服务业	852,214.83	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	2,159,795.62	0.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	642,316.40	0.22
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	24,211,803.05	8.24
S	综合	-	-
	合计	291,095,297.12	99.06

(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。

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	000651	格力电器	545,988	25,776,093.48	8.77
2	000333	美的集团	507,052	24,708,643.96	8.41
3	600104	上汽集团	397,634	10,366,318.38	3.53
4	601888	中国国旅	110,750	7,761,360.00	2.64
5	600690	青岛海尔	415,246	7,104,859.06	2.42
6	002594	比亚迪	103,119	5,515,835.31	1.88
7	002024	苏宁易购	422,243	5,299,149.65	1.80
8	002027	分众传媒	832,596	5,220,376.92	1.78
9	000100	TCL集团	1,230,055	4,994,023.30	1.70
10	600660	福耀玻璃	159,236	3,874,211.88	1.32

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、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

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名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。

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。

8、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9、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。

10、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。

11、投资组合报告附注

(1)根据公开市场信息,本基金投资