

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

注:上表的股票投资项含可替代款估值增值,而下表的合计项不含可替代款估值增值。

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

A	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	—	—
B	医药	22,381,208.00	76.03
C	制造业	4,339,432.64	14.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储和邮政业	1,038,276.76	3.39
G	金融业	—	—
H	信息技术业	—	—
I	房地产业	—	—
J	公共事业	—	—
K	综合	489,377.84	1.59
L	合计	28,231,228.24	97.29

(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有持有港股通投资股票。

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	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	307,100	2,365,108.00	10.18
2	600000	中信证券	171,084	2,076,262.62	9.17
3	600027	华鲁恒升	428,247	2,050,280.03	9.11
4	600036	招商银行	286,339	2,047,050.00	9.07
5	600066	广汽集团	201,188	168,172.14	0.74
6	600063	兴业银行	18,300	153,740.08	0.67
7	600021	招商局港口	185,180	152,103.21	0.67
8	600022	招商局港口	87,348	102,044.88	0.45
9	600027	华鲁恒升	523,200	776,248.00	0.34
10	600030	中信证券	63,587	676,202.08	0.29

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有持有债券。

5.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未有持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未有持有资产支持证券。

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有持有贵金属。

8.报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未有持有权证。

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有股指期货投资。

(2)本基金本报告期末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有国债期货。

(2)本基金本报告期末未进行国债期货交易。

11.投资组合报告附注

(1)报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

(2)本报告期内,本基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

(3)其他各项资产构成

序号	项目	金额(元)
1	应收利息	198.00
2	应收股利	—
3	应收申购款	182.27
4	其他应收款	—
5	其他流动资产	—
6	其他长期资产	—
7	其他资产	—
8	合计	3,880.27

(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有处于转股期的可转换债券。

(5)报告期末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。

第十二部分基金的投资

本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。

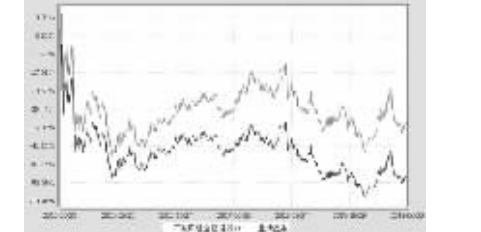
投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。基金业绩数据截至2019年6月30日。

1.本基金本报告期单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

期间	净值增长率	净值增长率与业绩比较基准收益率的差额	业绩比较基准收益率	1—差	2—差
2015.6.26—2019.6.30	-20.71%	-2.08%	-18.63%	2.07%	0.07%
2015.11—2019.1	-12.01%	-1.02%	-10.99%	1.02%	-0.01%
2015.11—2019.3	-12.01%	-0.88%	-10.77%	1.22%	0.01%
2015.11—2019.11	-12.01%	-0.36%	-1.00%	-0.36%	-0.02%
2015.11—2019.12	-14.71%	-1.51%	-13.61%	1.09%	-0.01%
自基金合同生效以来	-34.60%	1.50%	-41.61%	5.76%	0.00%

2.自基金合同生效以来至本报告期末基金资产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

广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月25日至2019年6月30日)



第十三部分基金的费用

一、基金费用的种类

1.基金管理人的管理费;

2.基金托管人的托管费;

3.基金的指数许可使用费;

4.《基金合同》生效与基金相关的信息披露费;

5.《基金合同》生效与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;

6.基金份额持有人大会费用;

7.基金的证券交易费用;

8.基金的银行汇划费用;

9.基金上市费及年费

10.证券账户开户费用和银行账户管理费;

11.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1.基金管理人的管理费

E=基金的管理费按前一日基金资产净值0.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×0.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付划给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

2.基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×0.10%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前5个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

3.基金的指数许可使用费

本基金指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.03%的年费率计提。指数许可使用费计算方法如下:

H=E×0.03%÷当年天数

H为每日应计提的指数许可使用费

E为前一日的基金资产净值

(1)就每个计费季度而言,如当季度基金日均资产净值大于5000万元(不含),的,当期指数许可使用费下限为人民币1万元。

(2)就每个计费季度而言,如当季度基金日均资产净值小于5000万元(含)的,不设指数许可使用费下限。

指数许可使用费自基金合同生效之日起开始计算,逐日累计,按季支付。指数许可使用费由基金管理人向基金托管人发送划款指令,经基金托管人复核后于下一个季度开始后10个工作日内从基金财产中一次性支付。

上述“一、基金费用”中第4—10项费用,根据相关法律法规相应协议约定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

三、列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1.基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;

2.基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;

3.《基金合同》生效前的相关费用;

4.其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

第十四部分对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金基金

的投资管理活动,对原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的内容进行了更新,主要内容如下:

1.在“重要提示”项下,更新了本招募说明书(更新)所载内容截止日。

2.在“第十六部分 基金费用与税收”项下,更新了指费使用许可费的相关内容。

客服电话:4008-888-988/05651

公司网站:www.chinastock.com.cn

(16)公司名称:华泰证券股份有限公司

注册地址:济南市市中区经二路86号

办公地址:济南市经二路86号证券大厦

法定代表人:李伟

联系人:许曼华

电话:021-20315290

传真:021-20315125

客服电话:95538

公司网站:www.zts.com.cn

(17)公司名称:中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:山东省青岛市市南区深圳路222号1号楼2001

办公地址:青岛市市南区深圳路222号青岛国际金融中心20层(266061)

法定代表人:姜晓林

联系人:吴志超

电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

客服电话:95548

公司网站:http://sd.citic.com/

(18)公司名称:中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界荣超商务中心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

联系人:张佑君

联系人:王一通

联系电话:010-60838888

传真:010-60838629

客服电话:95548

网址:www.csccit.com.cn

(19)公司名称:华泰证券股份有限公司

办公地址:南京市江东中路228号

法定代表人:张伟

电话:020-224042103

传真:0755-82492362

联系人:陈婉蓉

客服电话:95567

公司网站:www.htsc.com.cn

(20)公司名称:兴业证券股份有限公司

注册地址:福州市湖东路268号

办公地址:上海市浦东新区长杨路36号

法人:杨华辉

联系人:乔琳琳

联系电话:021-38565547

客服电话:95562

网址:www.xyzq.com.cn

(21)公司名称:平安证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路6033号平安金融中心61层-64层

办公地址:深圳市福田区益田路6033号平安金融中心61层-64层

法定代表人:何之江

全国免费业务咨询热线:95511-8

开放式基金业务传真:0755-82440862

全国统一总机:95511-8

网址:stock.pingan.com

(22)公司名称:东海证券股份有限公司

注册地址:江苏省常州延陵西路23号投资广场18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:陈耀庭

电话:021-20333333

传真:021-50498825

联系人:王一彦

客服电话:95531;400-8888-588

网址:www.longone.com.cn

(3)公司名称:方正证券股份有限公司

注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路192号广电中心4

5号楼701-717

办公地址:北京市朝阳区北四环中路盘古大观A座40层

法人:陈华

联系人:程博怡

联系电话:010-56437060

传真:010-56437030

客服电话:95571

网址:www.fundsecurities.com

(4)公司名称:广发证券股份有限公司

办公地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

联系人:陈博怡

电话:020-27181333

传真:020-37181389

经办律师:刘智、杨桦

联系人:刘智

四、审计基金资产的会计师事务所

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:赵娜

电话:020-23812888

传真:020-23812618

经办注册会计师:赵娜、马皓

第四部分基金的投资

广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金

第五部分基金的投资

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

第七部分基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数即中证全指能源指数的成份股、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投资品种)、新股、债券、资产支持证券、货币市场工具及中国证监会允许本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,本基金投资于成份股和备选成份股,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及基金合同约定的方式进行。

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。

待基金参与融资融券和转融通业务的相关规定颁布后,基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风格的前提下,在控制风险的前提下,参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务,以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项将按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行,无需召开基金份额持有人大会审议。

第八部分基金的投资策略

本基金主要采取完全复制法,跟踪标的指数的成份股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%。

一般情况下,本基金将根据标的指数的成份股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、流动性等因素选择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。

在正常情况下一,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%,年跟踪误差不超过2%。

本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,但不对基金的业绩表现作出任何承诺。本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,但不对基金的业绩表现作出任何承诺。

本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,但不对基金的业绩表现作出任何承诺。

本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,但不对基金的业绩表现作出任何承诺。

传真:0755-82133352

客服电话:95536

公司网站:www.guosen.com.cn

(18)公司名称: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36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36层、28层A02单元

法人:王连志

联系人:陈婉蓉

电话:0755-82225551

传真:0755-82568355

客服电话:95517

网址:http://www.esence.com.cn/

(19)公司名称: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

(20)公司名称:中信证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界荣超商务中心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

联系人:张佑君

联系人:王一通

联系电话:010-60838888

传真:010-60838629