广发中证环保产业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:二〇二〇年六月

【重要提示】

本基金于2016年7月5日经中国证监会证监许可[2016]1509号文注册。

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。同时由于本基金是交易型开放式基金,特定风险还包括:基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险等等。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环保产业指数的表现,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。投资者投资本基金时需具有上海证券账户,但需注意,使用上海证券交易所基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资者需要使用中证环保产业指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户;如投资者需要使用中证环保产业指数成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购,则还应开立深圳证券交易所A股账户。

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。

投资者应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自主做出投资决策,自行承担投资风险。本基金约定的基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

本基金本次更新招募说明书对申购赎回清单的相关信息进行更新,相关信息更新截止日为2020年6月2日。除非另有说明,本招募说明书其他所载内容截止日为2020年1月7日,有关财务数据截止日为2019年9月30日,净值表现截止日为2019年6月30日(本报告中财务数据未经审计)。

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、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60.593%、15.763%、15.763%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,现任广发证券股份有限公司党委书记、董事长、执行董事,兼任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、第一届上市咨询委员会委员、第一届科创板股票公开发行自律委员会委员,深圳证券交易所第二届监事会监事,中国上市公司协会第二届理事会兼职副会长、财务总监专业委员会主任委员,中国注册会计师协会道德准则委员会委员,中国资产评估协会常务理事,中国证券博物馆第一届理事会理事,广东金融学会副会长,广东省金融发展研究会常务副会长,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,河北涿州市人民政府副市长(挂职),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、亚洲金融合作协会理事等职务。

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,现任广发证券股份有限公司执行董事、副总经理、财务总监,兼任证通股份有限公司监事,中国证券业协会财务会计委员会委员,广东省党外知识分子联谊会国企分会理事。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会主席。

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董事、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。

匡丽军女士:董事,硕士,现任广州科技金融创新投资控股有限公司副总经理、工会主席。曾任广州科技房地产开发公司办公室主任,广州市科达实业发展公司办公室主任,广州科技风险投资有限公司办公室主任、董事会秘书。

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,绍兴银行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、中兴-沈阳商业大厦(集团)股份有限公司独立董事、东软医疗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等。

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。

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。

孔伟英女士:职工监事,学士,经济师。现任广发基金管理有限公司人力资源部总经理。曾任职于广发证券股份有限公司。

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副董事长。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。

张敏晗女士:副总经理,硕士,兼任广发国际资产管理有限公司董事。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。

张芊女士: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、广发集丰债券型证券投资基金基金经理、广发汇优66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、广发汇利一年定期开放债券型发起式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

霍华明先生,理学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司注册登记部核算专员、数量投资部数据分析员、ETF基金助理兼研究员。现任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2017年4月20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2017年4月20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2017年4月20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2017年4月20日起任职)、广发中证基建工程指数型发起式证券投资基金基金经理(自2018年2月1日起任职)、广发中证京津冀协同发展主题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2018年4月19日起任职)、广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2018年4月19日起任职)、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2019年11月14日起任职)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自2019年11月14日起任职)、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2019年11月14日起任职)、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2019年11月14日起任职)、广发中证军工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2019年11月14日起任职)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自2019年11月14日起任职)、广发中证环保产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2019年11月14日起任职)。

历任基金经理:刘杰,任职时间为2017年1月25日至2019年11月14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总经理助理王海涛先生、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,王海涛先生担任权益公募投委会主席。

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任贰佰肆拾壹元整

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:许俊

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9月30日,中国银行已托管721只证券投资基金,其中境内基金681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。

第三部分相关服务机构

一、基金份额销售机构

1、二级市场交易代办证券公司

投资者在上海证券交易所各会员单位营业部均可参与基金二级市场。

2、申购、赎回代办证券公司(以下排序不分先后)

(1) 公司名称: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:北京东城区朝内大街2号凯恒中心B座16层

法定代表人:王常青

联系人:刘芸

电话:010-85156310

传真:010-65182261

客服电话:95587/4008-888-108

公司网站:www.csc108.com

(2)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

法人:王连志

联系人:陈剑虹

联系电话:0755-82825551

传真:0755-82558355

客服电话:95517

网址:http://www. essence. com. cn/

(3)公司名称: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:李颖

电话:0755-82130833

传真:0755-82133952

客服电话:95536

公司网站:www.guosen.com.cn

(4)公司名称:广州证券股份有限公司

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:胡伏云

联系人:林洁茹

电话:020-88836999

传真:020-88836654

客服电话:95396

公司网站:www.gzs.com.cn

(5)公司名称:申万宏源西部证券有限公司

注册地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

办公地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2005室

法定代表人:韩志谦

联系人:王怀春

联系电话:0991-2307105

客户服务电话:400-800-0562

传真:010-88085195

网址:www.hysec.com

(6)公司名称:国泰君安证券股份有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区商城路618号

办公地址:上海市静安区南京西路768号国泰君安大厦

法人:杨德红

联系人:钟伟镇

联系电话:021-38676666

传真:021-38670666

客服电话:95521 / 4008888666

网址:www.gtja.com

(7)公司名称:申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市徐汇区长乐路989号45层

办公地址:上海市徐汇区长乐路989号40层

法人:杨玉成

联系人:余敏

联系电话:02133388252

传真:02133388224

客服电话:95523

网址:www.swhysc.com

(8)公司名称: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

法人:闫峻

联系人:龚俊涛

联系电话:021-22169999

客服电话:95525

网址:www.ebscn.com

(9)公司名称:中信证券股份有限公司

注册地址:广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场二期北座

办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法人:张佑君

联系人:王一通

联系电话:010-60838888

传真:010-60836029

客服电话:95548

网址:www.cs.ecitic.com

(10)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:上海市浦东新区长柳路36号

法人:杨华辉

联系人:乔琳雪

联系电话:021-38565547

客服电话:95562

网址:www.xyzq.com.cn

(11)公司名称:天风证券股份有限公司

注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼

办公地址:湖北省武汉市江汉区唐家墩路32号国资大厦B座

法人代表:余磊

联系人:翟璟

联系电话:027-87618882

客服电话:4008005000

传真:027-87618863

公司网址:www.tfzq.com

(12)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

(13)公司名称:新时代证券股份有限公司

注册地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

办公地址:北京市海淀区北三环西路99号院1号楼15层1501

法人:叶顺德

联系人:田芳芳

联系电话:010-83561000

传真:010-83561001

客服电话:95399

网址:www.xsdzq.cn

(14)公司名称:中信证券(山东)有限责任公司

注册地址:山东省青岛市崂山深圳路222号1号楼2001

办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场20层(266061)

法定代表人:姜晓林

联系人:吴忠超

电话:0532-85022326

传真:0532-85022605

客服电话:95548

公司网站:http://sd.citics.com/

(15)公司名称:万联证券股份有限公司

注册地址:广州市天河区珠江东路11号高德置地广场F栋18、19层

办公地址:广州市天河区珠江东路13号高德置地广场E栋12层

法定代表人:罗钦城

开放式基金咨询电话:95322

联系人:甘蕾

联系电话:020-38286026

公司网站:www.wlzq.cn

(16)公司名称:财通证券股份有限公司

注册地址:杭州市解放路111号

法定代表人:沈继宁

联系人:陶志华

电话:0571-87789160

传真:0571-87818329

客服电话:95336(浙江),40086-96336(全国)

公司网站:www.ctsec.com

(17)公司名称:第一创业证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

办公地址:深圳市福田区福华一路115号投行大厦20楼

法人:刘学民

联系人:王叔胤

联系电话:0755-23838712

传真:0755-23838999-8712

客服电话:95358

网址:www.firstcapital.com.cn

(18)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: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

(19)公司名称:广发证券股份有限公司

注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

联系地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人:孙树明

联系人:黄岚

客服电话:95575、020-95575或致电各地营业网点

公司网站:www.gf.com.cn

(20)公司名称: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

(21)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层

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

(22)公司名称:东兴证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)

办公地址:北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12、15层(详细地址)

法定代表人:魏庆华

联系人:汤漫川

联系电话:010-66555316

业务传真:010-66555246

客服热线:95309

公司网址:www.dxzq.net.cn

(23)公司名称:东吴证券股份有限公司

住所:苏州工业园区翠园路181号商旅大厦18-21层

法定代表人:范力

联系人:方晓丹

电话:0512-62938521

传真:0512-65588021

客服电话:95330

公司网站:www.dwzq.com.cn

(24)公司名称: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

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

(25)公司名称: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:王虹

电话:021-20655183

传真:021-20655196

客服电话:95547

公司网站:www.hfzq.com.cn

(26)公司名称:华融证券股份有限公司

注册地址:北京市西城区金融大街8号

办公地址:北京市朝阳区朝阳门外大街18号中国人保寿险大厦12层

法定代表人:祝献忠

联系人:李慧灵

电话:010-85556100

传真:010-85556153

客服电话:95390

公司网站:www.hrsec.com.cn

(27)公司名称:华鑫证券有限责任公司

注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元

办公地址:上海市徐汇区宛平南路8号

法定代表人:俞洋

联系人:杨莉娟

联系电话:021-54967202

业务传真:021-54967293

客服热线:021-32109999;029-68918888;4001099918

(28)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5033号平安金融中心61层-64层

办公地址:深圳市福田区益田路5033号平安金融中心61层-64层

法定代表人:何之江

全国免费业务咨询电话:95511-8

开放式基金业务传真:0755-82400862

全国统一总机:95511-8

网址:stock.pingan.com

(29)公司名称:上海证券有限责任公司

注册地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼

办公地址:上海市黄浦区四川中路213号7楼

法定代表人:李俊杰

联系人:邵珍珍

联系电话:021-53686262

业务传真:021-53686277

客服热线:4008918918

公司网址:www.962518.com

(30)公司名称:湘财证券股份有限公司

注册地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

办公地址:湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法人:孙永祥

联系人:江恩前

联系电话:021-38784580

传真:021-68865680

客服电话:95351

网址:www.xcsc.com

(31)公司名称: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

法人:张志刚

联系人:付婷

联系电话:01063081000

传真:01063080978

客服电话:95321

网址:www.cindasc.com

(32)公司名称:中国银河证券股份有限公司

办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

注册地址:北京市西城区金融大街35号2-6层

法定代表人:陈共炎

联系人:辛国政

联系电话:010-83574507

传真:010-83574807

客服电话:4008-888-888或95551

公司网址:www.chinastock.com.cn

(33)公司名称:长江证券股份有限公司

地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人:胡运钊

客服电话:955679或4008888999

联系人:李良

电话:07-65799999

传真:027-85481900

客服网站:www.95579.com

(34)公司名称: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:许曼华

电话:021-20315290

传真:021-20315125

客服电话:95538

公司网站:www.zts.com.cn

(35)公司名称:中国中金财富证券有限公司

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:高涛

联系人:万玉琳

电话:0755-82026907

传真:0755-82026539

开放式基金咨询电话:95532、400-600-8008

公司网站:www.china-invs.cn

(36)公司名称:大同证券有限责任公司

注册地址:山西省大同市城区迎宾街15号桐城中央21层

办公地址:山西省太原市小店区长治路世贸中心12层

法人:董祥

联系人:薛津

联系电话:03514130322

传真:03517219891

客服电话:4007121212

网址:http://www.dtsbc.com.cn

(37)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江中路二段36号华远华中心45号楼3701-3717

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:施华

联系人:程博怡

联系电话:010-56437060

传真:010-56437030

客服电话:95571

网址:www.foundersc.com

(38)公司名称: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:956080

公司网站:www.gszq.com

(39)公司名称:国联证券股份有限公司

办公地址:无锡市金融一街8号国联大厦

法人:姚志勇

联系人:祁昊

联系电话:0510-82831662

客服电话:95570

网址:www.glsc.com.cn

3、基金管理人可根据有关法律法规,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

住所、办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:周明

联系人:崔巍

电话:010-50938888

传真:010-59378907

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:赵雅、马婧

第四部分基金的名称

广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金

第五部分基金类型

股票型、指数型证券投资基金

第六部分基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

第七部分基金的投资方向

本基金主要投资于标的指数(即中证环保产业指数)的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货、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,但须符合中国证监会相关规定。

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。

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90%且不低于非现金基金资产的80%,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。

第八部分基金的投资策略

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90%且不低于非现金基金资产的80%。

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的绝对值小于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。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。

第九部分基金的业绩比较基准

本基金的标的指数为中证环保产业指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。

中证环保产业指数是中证指数有限公司根据联合国环境与经济综合核算体系对于环保产业的界定方法,将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题,采用等权重加权方式编制而成。该指数以2011年12月30日为基日,基点为1000点,旨在反映上海和深圳市场环保产业公司表现的指数,为投资人投资环保产业提供投资标的。

如果指数编制单位变更或停止指数的编制、发布或授权,或标的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标的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),在不违反有关法律法规和《基金合同》约定并对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,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。

第十部分基金的风险收益特征

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。

第十一部分基金投资组合报告

基金管理人的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,并对其内容的真实性、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2020年1月10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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,618,254,636.09	94.11
	其中:股票	1,618,254,636.09	94.11
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	101,140,236.28	5.88
7	其他资产	199,471.47	0.01
8	合计	1,719,594,343.84	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的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

2.1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	86,923.03	0.01
B	采矿业	315,315.00	0.02
C	制造业	1,078,852,762.28	63.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	261,788,050.12	15.37
E	建筑业	46,119,246.67	2.71
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	42,050.60	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,726,238.34	1.16
J	金融业	366,506.78	0.02
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	15,814,465.24	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	194,835,558.07	11.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	307,519.96	0.02
	合计	1,618,254,636.09	95.04

2.2 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	300618	寒锐钴业	374,628	23,489,175.60	1.38
2	002531	天顺风能	3,356,000	23,424,880.00	1.38
3	603806	福斯特	501,561	22,770,869.40	1.34
4	002129	中环股份	1,878,500	22,748,635.00	1.34
5	002080	中材科技	2,139,417	22,292,725.14	1.31
6	002384	东山精密	1,130,233	22,265,590.10	1.31
7	600703	三安光电	1,564,569	22,029,131.52	1.29
8	601012	隆基股份	810,997	21,272,451.31	1.25
9	300207	欣旺达	1,400,749	21,221,347.35	1.25
10	300316	晶盛机电	1,402,181	20,878,475.09	1