广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金招募说明书【更新】摘要

【2015年第1号】

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:二〇一五年十一月

【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]1262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,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金融地产指数的表现,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),将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、赎回采用组合证券"场外实物申购、赎回"的模式办理,其申购、赎回流程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。通常情况下,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》。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年9月23日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日。

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中路3号4004-56室

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:王志伟

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:段西军

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

王志伟:董事长,男,经济学硕士,高级经济师。兼任中国基金业协会公司治理专业委员会委员,广东省第十届政协委员、广东省政府决策咨询顾问委员会企业家委员,广东金融学会常务理事,江西财经大学客座教授。历任广发证券董事长兼党委书记、广东发展银行党组成员兼副行长,广东发展银行行长助理,广东发展银行信托投资部总经理,广东发展银行人事教育部经理,广东省委办公厅政治处人事科科长等职务。

林传辉:副董事长,男,大学本科学历,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长、总经理,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,深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部副总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

孙晓燕:董事,女,硕士,现任广发证券副总裁、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,监事长。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、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。

戈俊:董事,男,管理学硕士,高级经济师,现任烽火通信科技股份有限公司副总裁、财务总监兼董事会秘书,兼任武汉烽火国际技术有限责任公司、南京烽火藤仓光通信有限公司、武汉烽火软件技术有限公司、烽火藤仓光纤科技有限公司、江苏烽火诚城科技有限公司、江苏征信有限公司、西安北方光通信有限责任公司、武汉烽火普天信息技术有限公司、武汉市烽视威科技有限公司、武汉光谷机电科技有限公司、成都大唐线缆有限公司、南京烽火星空通信发展有限公司等公司董事;兼任武汉烽火网络有限责任公司、武汉烽火信息集成技术有限公司、藤仓烽火光电材料科技有限公司、大唐软件股份有限公司等公司监事。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。

翟美卿:董事,女,工商管理硕士,现任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人,香江集团有限公司总裁。兼任全国政协委员、全国妇联常委、香江社会救助基金会主席,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,深圳龙岗国安村镇银行董事。

许冬瑾:董事,女,工商管理硕士,主管药师,现任康美药业股份有限公司副董事长、副总经理,兼任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。曾任广东省康美药业有限公司副总经理。

董茂云:独立董事,男,法学博士,教授,博士生导师,现任复旦大学教授,兼任宁波大学特聘教授,上海四维乐马律师事务所兼职律师,绍兴银行独立董事,海尔施生物医药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学法律系副主任,复旦大学法学院副院长。

姚海鑫:独立董事,男,经济学博士、教授、博士生导师,现任辽宁大学新华国际商学院教授,兼任东北制药(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。

罗海平:独立董事,男,经济学博士,现任中华联合财产保险股份有限公司董事长、总裁,兼任中华联合保险控股股份有限公司常务副总裁。曾任中国人民保险公司荆州市分公司经理、中国人民保险公司湖北省分公司业务处长、中国人民保险公司湖北省国际部总经理、中国人民保险公司汉口分公司总经理,太平保险湖北分公司总经理,太平保险公司总经理助理,太平保险公司副总经理兼纪委书记,民安保险(中国)有限公司副总裁,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。

2、监事会成员

余利平:监事会主席,女,经济学博士,兼任广发国际资产管理有限公司董事。曾任广发证券成都营业部总经理、广发证券基金部副总经理、嘉实基金管理有限公司副总经理、董事长。

匡丽军:监事,女,工商管理硕士,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:监事,男,工学硕士,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员工,副经理,经理。

3、总经理及其他高级管理人员

林传辉:总经理,男,大学本科学历,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长、总经理,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,深圳证券交易所第三届上诉复核委员会委员。曾任广发证券投资银行总部北京业务总部总经理、投资银行总部副总经理兼投资银行上海业务总部副总经理、投资银行部常务副总经理。

朱平:副总经理,男,硕士,经济师,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。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。

易阳方:副总经理,男,经济学硕士,经济师。兼任广发基金管理有限公司投资总监,广发聚丰股票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,广发国际资产管理有限公司董事、瑞元资本管理有限公司董事。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,广发基金管理有限公司总经理助理,广发制造业精选股票基金基金经理。

段西军:督察长,男,博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证券监督管理委员会广东监管局工作。

邱春杨:副总经理,男,经济学博士,瑞元资本管理有限公司董事。曾任原南方证券资产管理部产品设计人员,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、产品总监、金融工程部总经理。

4、基金经理

陆志明:男,中国籍,经济学硕士,持有基金业执业资格证书,1999年5月至2001年5月在大鹏证券有限公司任研究员,2001年5月至2010年8月在深圳证券信息有限公司任部门总监,2010年8月9日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理,2011年6月3日起任广发中小板300ETF基金的基金经理,2011年6月9日起任广发中小板300ETF联接基金的基金经理,2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金的基金经理,2014年6月3日起任广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理,2014年10月30日起任广发百发100指数基金的基金经理,2014年12月1日起任广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理,2015年1月8日起任广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理,2015年1月29日起任广发中证全指信息技术ETF联接基金的基金经理,2015年3月23日起任广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理,2015年4月15日起任广发可选消费联接基金的基金经理,2015年5月6日起任广发医药卫生联接基金的基金经理,2015年6月25日起任广发中证全指能源ETF和广发中证全指原材料ETF基金的基金经理,2015年7月1日起任广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理,2015年7月9日起任广发能源联接和广发金融地产联接基金的基金经理,2015年7月23日起任广发医疗指数分级基金的基金经理,2015年8月18日起任广发原材料联接和广发主要消费联接基金的基金经理。

5、本基金投资采取集体决策制度,投资决策委员会成员的姓名及职务如下:

主席:公司总经理林传辉;成员:公司副总经理朱平,公司副总经理易阳方,权益投资一部总经理刘晓龙,研究发展部副总经理孙迪,固定收益部总经理张芊。

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:人民币贰仟柒佰玖拾壹亿肆仟柒佰贰拾贰万叁仟壹佰玖拾伍元整

法定代表人:田国立

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2015年6月30日,中国银行已托管382只证券投资基金,其中境内基金356只,QDII基金26只,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型、指数型等多种类型的基金,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、基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构和网下股票发售直销机构

本公司通过在广州、北京、上海设立的分公司及本公司网上交易系统为投资者办理本基金的开户、认购等业务:

(1)广州分公司

地址:广州市海珠区琶洲大道东3号保利国际广场南塔17楼

直销中心电话:020-89899073 020-89899042

传真:020-89899069 020-89899070

(2)北京分公司

地址:北京市宣武区宣武门外大街甲1号环球财讯中心D座11层

电话:010-68083368

传真:010-68083078

(3)上海分公司

地址:上海市浦东新区陆家嘴东路166号中国保险大厦2908室

电话:021-68885310

传真:021-68885200

(4)网上交易

投资者可以通过本公司网上交易系统办理本基金的开户、认购等业务,具体交易细则请参阅本公司网站公告。

本公司网上交易系统网址:www.gffunds.com.cn

本公司网址: www.gffunds.com.cn

客服电话:95105828(免长途费)

客服传真:020-34281105

(5)投资人也可通过本公司客户服务电话进行本基金发售相关事宜的查询和投诉等。

2、网上现金发售代理机构

投资者可以到以下代销机构办理本基金的募集期的认购业务:爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财富证券、财富里昂、财通证券、长城证券、长江证券、诚浩证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、广州证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰长财、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰联合、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、开源证券、联讯证券、民生证券、民族证券、南京证券、平安证券、齐鲁证券、日信证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、天源证券、万和证券、万联证券、西部证券、西藏同信、西南证券、厦门证券、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金公司、中山证券、中投证券、中天证券、中信建投、中信浙江、中信万通、中信证券、中银证券、中邮证券、中原证券(排名不分先后)。

本基金募集期结束前获得基金代销资格的深交所会员可通过深交所网上系统办理本基金的网上现金认购业务。

3、网下股票发售代理机构

(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: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

(3)名称:国海证券股份有限公司

注册地址:广西桂林市辅星路13号

公司地址:广西南宁市滨湖路46号

法定代表人:张雅锋

联系人:牛孟宇

电话:0755-83709350

传真:0755-83704850

客服电话:95563

公司网站:www.ghzq.com.cn

(4)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

(5)名称:国联证券股份有限公司

注册地址:无锡市县前东街168号

办公地址:无锡市滨湖区太湖新城金融一街8号

法定代表人:雷建辉

联系人:沈刚

电话:0510-82831662

传真:0510-82830162

客服电话: 95570

公司网站:www.glsc.com.cn

(6)名称:长城证券有限责任公司

住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人:黄耀华

联系人:刘阳

电话:0755-83516289

传真:0755-83515567

客户服务热线:0755-33680000;400-6666-888

公司网站:www.cgws.com

(7)名称:万联证券有限责任公司

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11号高德置地广场F栋18、19层

法定代表人:张建军

开放式基金咨询电话:400-8888-133

开放式基金接收传真:020-22373718-1013

联系人:罗创斌

联系电话:020-37865070

公司网站:www.wlzq.com.cn

(8)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

(9)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

(10)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:吴永敏

联系人:方晓丹

电话:0512-65581136

传真:0512-65588021

公司网站:www.dwzq.com.cn

(11)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:上海市肇嘉浜路750号

法定代表人:洪家新

联系人 ::陈敏

联系电话:021-64316642

业务传真:021-54653529

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

公司网站:www.cfsc.com.cn

(12)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)

(13)名称:东莞证券股份有限公司

注册地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址:广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心30楼

法人代表:张运勇

联系人:乔芳

联系电话:0769-22100155

客服电话:0769-961130

传真:0769-22119426

公司网站:www.dgzq.com.cn

(14)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

(15)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

(16)名称:渤海证券股份有限公司

注册地址:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址:天津市南开区宾水西道8号

法定代表人:王春峰

联系人:蔡霆

电话:022-28451991

传真:022-28451892

客服电话:400-6515-988

公司网站:www.bhzq.com

(17)名称:江海证券有限公司

注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人:孙名扬

联系人:刘爽

电话:0451-85863719

传真:0451-82287211

客户服务热线:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn

(18)名称:华安证券有限责任公司

注册地址:安徽省合肥市长江中路357号

办公地址:安徽省合肥市阜南路166号润安大厦

法定代表人:李工

联络人:甘霖

电话:0551-5161666

传真:0551-5161600

客服电话:96518(安徽),4008096518(全国)

公司网站:www.hazq.com

(19)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:027-65799999

传真:027-85481900

客服网站:www.95579.com

(20)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

(21)名称:申万宏源证券有限公司

注册地址:上海市长乐路989号世纪商贸广场45层

办公地址:上海市长乐路989号世纪商贸广场40层

法定代表人:储晓明

联系人:曹晔

电话:021-33389888

传真:021-33388224

客服电话:95523或4008895523

电话委托:021-962505

网址:www.swhysc.com

(22)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:95532、400-600-8008

公司网站:www.china-invs.cn

(23)名称:国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市自由贸易试验区商城路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:杨德红

联系人:芮敏祺

电话:021-38676666

传真:021-38670666

客服电话:400-8888-666、95521

公司网站:www.gtja.com

基金管理人可根据有关法律法规要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述发售代理机构,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:金颖

联系人:任瑞新

电话:010-59378835

传真:010-59378907

三、出具法律意见书的律师事务所

名称:国浩律师(广州)事务所

住所: 广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼

负责人:程秉

电话:020-38799345

传真: 020-38799335

经办律师:黄贞、王志宏

联系人:程秉

四、审计基金资产的会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

办公地址:上海市延安东路222号外滩中心30楼

法人代表:卢伯卿

联系人:洪锐明

电话:021-61418888

传真:021-63350003

经办注册会计师:王明静、吴迪

第四部分 基金的名称

广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金

第五部分 基金的类型

股票型证券投资基金。

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全指金融地产指数的成份股、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。

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险收益特征并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、转融通等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决定。

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。

1、投资决策依据

有关法律、法规、基金合同以及标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、投资管理体制

本基金管理人实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会负责决定有关标的指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。基金经理决定日常标的指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策以及每日申购、赎回清单的编制等决策。

3、投资管理程序

研究、投资决策、组合构建、交易执行、绩效评估、组合监控与调整等流程的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究:数量投资部依托公司整体研究平台,整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果,开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、流动性分析、误差及其归因分析等工作,并撰写相关的研究报告,作为本基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会依据数量投资部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数,结合研究报告,基金经理主要以完全复制标的指数成份股权重的方法构建组合。在追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,提高投资效率、降低交易成本、控制投资风险。

(4)交易执行:交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)绩效评估:绩效评估与风险管理组定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关的绩效评估报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此总结和检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6)组合监控与调整:基金经理将跟踪标的指数的变动,结合成份股基本面情况、流动性状况以及组合投资绩效评估的结果等,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下,有权根据环境变化和实际需要对上述投资程序做出调整,并在基金招募说明书及其更新中予以公告。

第九部分 基金的业绩比较基准

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金融地产指数。

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。

第十一部分 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2015年10月31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2015年6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	154,353,018.17	98.20
	其中:股票	154,353,018.17	98.20
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	2,236,281.57	1.42
7	其他各项资产	589,104.61	0.37
8	合计	157,178,404.35	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

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	181,016.00	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	121,228,883.36	77.46
K	房地产业	31,651,473.81	20.22
L	租赁和商务服务业	270,774.00	0.17
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	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	1,020,871.00	0.65
	合计	154,353,018.17	98.63

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	601318	中国平安	160,193	13,126,214.42	8.39
2	600036	招商银行	541,099	10,129,373.28	6.47
3	600000	浦发银行	474,583	8,048,927.68	5.14
4	600016	民生银行	769,757	7,651,384.58	4.89
5	600030	中信证券	272,300	7,327,593.00	4.68
6	601166	兴业银行	362,956	6,260,991.00	4.00
7	600837	海通证券	264,000	5,755,200.00	3.68
8	000002	万 科A	331,240	4,809,604.80	3.07
9	601328	交通银行	550,700	4,537,768.00	2.90
10	601818	光大银行	687,900	3,687,144.00	2.36

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序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。

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序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,报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

(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股票库。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	535,387.34
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	640.23
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	53,077.04
8	其他	-
9	合计	589,104.61

(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) 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 基金的业绩

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2015年6月30日。

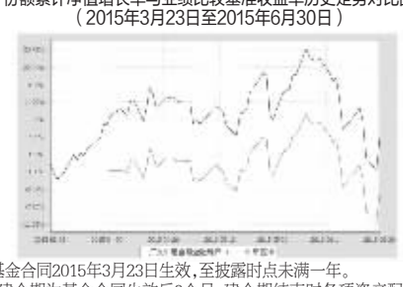
(一)净值增长率与同期业绩基准收益率比较表

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
自基金合同生效起至今	-4.61%	2.40%	7.26%	2.56%	-11.87%	-0.16%

注:业绩比较基准为中证全指金融地产指数。

(二)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

广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金
份额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3月23日至2015年6月30日)



注:1、本基金合同2015年3月23日生效,至披露时点未满一年。

2、本基金建仓期为基金合同生效后3个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

第十三部分 基金费用

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、基金的指数使用许可费;

4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

5、《基金合同》生效后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维护费;

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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的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