

广发标普全球农业指数证券投资基金招募说明书 更新 摘要

[2016年第1号]

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
时间:二〇一六年一月

【重要提示】

本基金于2011年5月11日经中国证监会证监许可[2011]667号文核准。本基金合同于2011年6月28日生效。

本基金说明书由基金管理人负责招募说明书的内部真实、准确、完整。

本基金说明书由基金管理人对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益做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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

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。

基金管理人根据有关法律法规的规定,充分了解本基金投资的市场情况,基金净值会因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性质,并承担基金投资所涉及的各类风险,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、基金资产投资于境外证券市场所涉及的国家风险、基金资产投资于境外证券市场的流动性风险、基金资产投资于境外证券市场的操作风险、汇率变动等所产生的风险等。

本基金投资于境外证券市场的,基金净值会因为境外证券市场的波动,汇率变动等产生波动。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等,全面认识本基金产品的投资收益与风险,充分考察能投资人自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作理性判断。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应的风险,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作理性判断。

本基金根据本基金合同和本基金招募说明书,并经中国证监会核准,基金合同约定基金当事人之间的权利、义务的法律文件。基金投资人自取得基金份额之日起,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的合法权益,即成为基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金所持有的权利和义务,应详细阅读本基金合同。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2015年12月27日,有关财务数据和净值表现截止日为2015年6月30日(财务数据未经审计)。

一、基金的名称

广发标普全球农业指数证券投资基金

二、基金的类型

契约型开放式

三、基金的投资目标

本基金采用被动投资策略,通过严格的资产配置和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率为行业基准指数成份股、备选成份股、现金或者到期日在一年以内(即为本基金的货币市场基金)占基金资产净值的95%。基金成立后还可投资于全球农业指数成份股的其他金融工具。

如法律法规或监管部门今后允许本基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,但须在招募说明书中列明投资品种的比例限制,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,不经基金管理人持有人大会审议。

五、基金的投资策略

本基金以追求稳定的指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。

本基金将不高于5%的基金资产投资于标普全球农业指数成份股、备选成份股,现金或者到期日在一年以内(即为本基金的货币市场基金)不低于基金资产净值的5%。

(一) 资产配置策略

本基金将追求指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。

本基金将不高于5%的基金资产投资于标普全球农业指数成份股、备选成份股,现金或者到期日在一年以内(即为本基金的货币市场基金)不低于基金资产净值的5%。

(二) 指数投资策略

1、基金组合构建原则

本基金主要采用完全复制法来跟踪标普全球农业指数,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合。

2、股票组合构建方法

本基金主要采用完全复制法,即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,并根据标的指数的构成及其权重的变动定期进行相应调整。

当个别成份股发生股息、送股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的构成可能带来影响时,基金管理人对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。

如因受股票停牌、股票股利或其他一些影响指数构成的市场因素的限制,基金管理人无法依指数权重购买成份股,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对投资组合进行适当调整,以获得更接近的指数的收益率。

3、股票组合调整

(1) 定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的标普全球农业指数对成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

(2) 不定期调整

1) 与指数相关的调整:

当个别成份股发生股息、送股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的构成可能带来影响时,基金管理人对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。

2) 其他调整:

基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对投资组合进行适当调整,以获得更接近的指数的收益率。

4、基金组合调整

本基金基于对股票投资组合跟踪误差与流动性管理的需要,可投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略,且以跟踪全球农业指数为投资标的的指数型公募基金(包括 ETF)。

(三) 固定收益类投资策略

本基金将主要通过降低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,构建本基金债券投资市场的投资组合。

(四) 衍生品投资策略

本基金可投资于中国证监会允许的各类型金融产品,如与标的指数相关的指数型公募基金(包括 ETF)。

本基金将主要通过降低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,达到对标的指数的有效跟踪,同时降低组合的频繁调整带来的跟踪误差。

5、其他投资

对于部分指数成份股,若因其存在停牌限制,存在严重的流动性困难,或者财务风险较大,或者面临重大的司法诉讼,或者有充分的理由认为其已被市场操纵等情形时,本基金可以不投资该成份股,而用备选成份股、现金或者现金替代,也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益相关性较高的其它股票代替。

6、基金投资决策

本基金基于对股票投资组合跟踪误差与流动性管理的需要,可投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略,且以跟踪全球农业指数为投资标的的指数型公募基金(包括 ETF)。

(三) 固定收益类投资策略

本基金将主要通过降低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,构建本基金债券投资市场的投资组合。

(四) 衍生品投资策略

本基金可投资于中国证监会允许的各类型金融产品,如与标的指数相关的指数型公募基金(包括 ETF)。

本基金将主要通过降低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,达到对标的指数的有效跟踪,同时降低组合的频繁调整带来的跟踪误差。

7、基金投资决策

本基金基于对股票投资组合跟踪误差与流动性管理的需要,可投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略,且以跟踪全球农业指数为投资标的的指数型公募基金(包括 ETF)。

(三) 固定收益类投资策略

本基金将主要通过降低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,构建本基金债券投资市场的投资组合。

(四) 衍生品投资策略

本基金可投资于中国证监会允许的各类型金融产品,如与标的指数相关的指数型公募基金(包括 ETF)。

本基金将主要通过降低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,达到对标的指数的有效跟踪,同时降低组合的频繁调整带来的跟踪误差。

八、基金的投资组合报告

本基金的资产配置情况,详见本招募说明书“基金的投资”部分。

本基金的行业配置情况,详见本招募说明书“基金的投资”部分。

本基金的前十名股票、债券、资产支持证券、衍生品投资的资产总额占基金资产净值的比例,详见本招募说明书“基金的投资”部分。

本基金的前十名股票、债券、资产支持证券、衍生品