广发对冲套利定期开放混合型发起式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:中国工商银行股份有限公司
日期:二〇一八年三月

【重要提示】
本基金于2014年12月26日经中国证监会证监许可[2014]1406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,获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。
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,投资者在投资本基金前,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,由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险,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。
本基金以市场中性策略为主要投资策略,通过同时持建多头和空头的方式实现策略,因此除面临一般混合型基金风险外还包括本基金所特有的风险。首先,本基金的市场中性策略是否能实现剥离多头股票系统性风险具有不确定性;其次,本基金的主要投资工具股指期货还可能引发的基差风险、杠杆风险、对于方风险、盯市结算风险等;此外,在本基金的封闭运作期间,基金份额持有人还面临不确定性风险的风险。
本基金可投资中小企业私募债券,其发行人是非上市中小微企业,发行方式为面向特定对象的私募发行。当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约,或在交易过程发生交收违约,或价格因债务违约风险大幅下降等,可能造成基金资产损失。中小企业私募债券较传统企业债的信用风险及流动性风险更大,从而增加了本基金整体的债券投资风险。
投资者在进行投资决策前,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2018年2月6日,有关财务数据和净值表现截止日为2017年12月31日(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中路3号4004-56室
3.办公地址:广州市海珠区琶洲大道13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:段西军
8.注册资本:1,288亿元人民币
9.股权结构:广发证券股份有限公司(以下简称"广发证券")、维火通信科技股份有限公司、深圳市海善汇金融投股集团有限公司、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%、15.7673%、15.7673%、9.4842%和7.2811%的股权。
二、主要人员情况
1.董事会成员
孙树明先生:董事长,经济学博士,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,中证机构间股份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,中国上市公司协会第二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,广东省财政厅会计专家,广东省预防腐败工作专家咨询委员会财政金融运行模拟组成员,中证机构间场外系统股份有限公司董事长,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党委书记、总经理助理,中共中央金融工作委员会监事会主席,中国证券业协会监事会主席,中国银河证券有限公司监事会监事,中国证监会会计用副主任、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,瑞元资本管理有限公司董事长,中国基金业协会副会长,广东省企业家协会副会长,曾任广发证券股份有限公司党委书记、纪委书记、董事、常务副总裁、广东省证券业协会副会长、广东省证券业协会第六届理事会理事、中国证券业协会第四届证券投资基金专业委员会委员,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。
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、广发证券股份有限公司投资计划管理部总经理、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总监、兼任南京臻光显示器件制造有限公司董事。
戈敏先生:董事,硕士,现任深圳海汇控股股份有限公司董事长,南方海汇集团董事长、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、全国工商联常委,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,深圳市深商投资集团有限公司董事长,广东省人大代表,曾任上海证券报社长、总编辑、深圳市政府海外人才顾问、深圳证券交易所第四届理事会理事、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董事、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、全国医药技术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制剂机械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,现任中欧证券投资基金管理有限公司董事长、瑞元资本管理有限公司董事长,中国基金业协会副会长,中国证券业协会第六届理事会理事、证券业协会证券投资基金专业委员会委员,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党委书记、总经理,太平保险有限公司中国区总经理、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,副共保保险集团公司董事会秘书、中国保险资产保险股份有限公司总经理、董事长、党委书记。
詹茂元先生:独立董事,博士,现任宁波大学法学院教授,学术委员会主任,兼任海尔施生物医药股份有限公司独立董事,复旦大学兼职教授、曾任复旦大学教授,法律系副主任,法学院副院长。
魏海鹰先生:独立董事,博士,教授,博士生导师,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,兼任中国会计教授会理事,东北地区高校财务与会计教师联合常务理事,辽宁省生产力学会副理事长、东北财务(集团)股份有限公司独立董事、改革化工股份有限公司独立董事和中英一次百商业大厦(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、新华国际商学院副院长。
2.监事会成员
薛兵先生: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,市场机展部总经理,市场机展部总经理,资管业务部总经理,资管业务部总经理,营销总监、市场总监。
庄丽军女士: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,广州思巨民公司行政主管,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: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:监事,学士,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。
刘敏女士: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。
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、瑞元资本管理有限公司董事长,中国基金业协会副会长及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。
李平先生:副总经理,硕士,经济师,曾任上海证信集团总经理助理,广发证券股份有限公司广州证券营业部总经理,广发证券股份有限公司证券投资基金管理部总经理,广发证券股份有限公司证券投资基金管理部总经理,广发证券股份有限公司证券投资基金管理