

广发中证环保产业指数型发起式证券投资基金

2017年度报告摘要

2790亿元。同时公司还管理着多个特定客户资产管理投资组合、社保基金投资和养老金投资。

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
报告送出日期：二〇一八年三月二十七日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人和基金托管人承诺本基金不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性承担个别及连带的法律责任。
本基金报告书经三分之二以上独立董事签字确认，并由基金管理人签章。
基金管理人和中国银行股份有限公司根据基金合同约定，于2018年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利率期限划分情况、财务会计报告、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。

基金管理人承诺就基金的经营情况、运作管理或运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人的过往业绩并不代表其未来表现。投资人应当在作出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书及其更新、风险揭示书，勤勉尽责地运用自己的判断力和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

基金管理人和基金托管人对本基金报告书及其摘要的内容，阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称 广发环保指数
基金代码 000964
基金运作方式 现行开放式
基金合同生效日 2016-01-26
报告期末基金资产净值 1306,399,117.21
基金份额净值 1.0000
不折不扣

下级基金份额的基金简称 广发环保指数A
广发环保指数C
下级基金份额的交易代码 000964
000965
基金合同终止日 不适用
报告期末下属分级基金的份额净值 1.297,174,943.96
149,323,273.69

2.2 基金产品说明
投资目标 追踪标的指数的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金主要投资于股票市场，通过投资于中证环保产业指数中的基本权重股票，以实现对指数的紧密跟踪。

业绩比较基准 本基金中证环保产业指数的收益率

风险特征 本基金为股票型基金，风险等级为中等风险，适合风险承受能力较强的投资者。

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险等级为中等风险，适合风险承受能力较强的投资者。

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

报告期天数 1,297,174,943.96
149,323,273.69

报告期天数 1,297,174,943.96
149,323,273.69

注：1.“任职日期”和“离任日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度执行办法

公司已建立科学合理的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过适当的执行行为对公平交易进行评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的授权制度，投资组合经理在被选投资项目、重仓股投资的权限必须得到核心股东、公司建立了严格的授权制度，投资组合经理在投资授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在投资过程中，中央对手方按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公司分配投资指令，原则上则遵循不同组合的同日向交易所（指数型基金除外），对于不同投资组合间同日向交易所，公司可以启用公平交易模式，确保交易的公平。

公司已建立完善与风险管理对非公开发行股票投资和购入公司名义进行的债券一级市场的购买方案及分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易的原则，由银行间同业拆借交易场和场外的第三方信息，将投资组合的交易对不同时间段内交价交易的价格差异情况进行分析，公司已建立完善的股票交易的内部控制制度，对不同投资组合间同日向交易所（指数型基金除外）的交易行为进行监控，从而保证在不同的窗口期内向交易所存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于零的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，上述公平交易制度严格执行，对过去一年该组合与公司其余各组合的同日、同方向的向交易所交易情况进行分析，未发现该组合与其他组合在不同的窗口期内向交易所存在足够的样本量且差价率均值显著不趋于零的情况，表明报告期内该组合未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

4.3.4 本基金所处的行业情况

4.3.5 本基金的行业情况

4.3.6 本基金的行业情况

4.3.7 本基金的行业情况

4.3.8 本基金的行业情况

4.3.9 本基金的行业情况

4.3.10 本基金的行业情况

4.3.11 本基金的行业情况

4.3.12 本基金的行业情况

4.3.13 本基金的行业情况

4.3.14 本基金的行业情况

4.3.15 本基金的行业情况

4.3.16 本基金的行业情况

4.3.17 本基金的行业情况

4.3.18 本基金的行业情况

4.3.19 本基金的行业情况

4.3.20 本基金的行业情况

4.3.21 本基金的行业情况

4.3.22 本基金的行业情况

4.3.23 本基金的行业情况

4.3.24 本基金的行业情况

4.3.25 本基金的行业情况

4.3.26 本基金的行业情况

4.3.27 本基金的行业情况

4.3.28 本基金的行业情况

4.3.29 本基金的行业情况

4.3.30 本基金的行业情况

4.3.31 本基金的行业情况

4.3.32 本基金的行业情况

4.3.33 本基金的行业情况

4.3.34 本基金的行业情况

4.3.35 本基金的行业情况

4.3.36 本基金的行业情况

4.3.37 本基金的行业情况

4.3.38 本基金的行业情况

4.3.39 本基金的行业情况

4.3.40 本基金的行业情况

4.3.41 本基金的行业情况

4.3.42 本基金的行业情况

4.3.43 本基金的行业情况

4.3.44 本基金的行业情况

4.3.45 本基金的行业情况

4.3.46 本基金的行业情况

4.3.47 本基金的行业情况

4.3.48 本基金的行业情况

4.3.49 本基金的行业情况

4.3.50 本基金的行业情况

4.3.51 本基金的行业情况

4.3.52 本基金的行业情况

4.3.53 本基金的行业情况

4.3.54 本基金的行业情况

4.3.55 本基金的行业情况

4.3.56 本基金的行业情况

4.3.57 本基金的行业情况

4.3.58 本基金的行业情况

4.3.59 本基金的行业情况

4.3.60 本基金的行业情况

4.3.61 本基金的行业情况

4.3.62 本基金的行业情况

4.3.63 本基金的行业情况

4.3.64 本基金的行业情况

4.3.65 本基金的行业情况

4.3.66 本基金的行业情况

4.3.67 本基金的行业情况

4.3.68 本基金的行业情况

4.3.69 本基金的行业情况

4.3.70 本基金的行业情况

4.3.71 本基金的行业情况

4.3.72 本基金的行业情况

4.3.73 本基金的行业情况

4.3.74 本基金的行业情况

4.3.75 本基金的行业情况

4.3.76 本基金的行业情况

4.3.77 本基金的行业情况

4.3.78 本基金的行业情况

4.3.79 本基金的行业情况

4.3.80 本基金的行业情况

4.3.81 本基金的行业情况

4.3.82 本基金的行业情况

4.3.83 本基金的行业情况

4.3.84 本基金的行业情况

4.3.85 本基金的行业情况

4.3.86 本基金的行业情况

4.3.87 本基金的行业情况

4.3.88 本基金的行业情况

4.3.89 本基金的行业情况

4.3.90 本基金的行业情况

4.3.91 本基金的行业情况

4.3.92 本基金的行业情况

4.3.93 本基金的行业情况

4.3.94 本基金的行业情况

4.3.95 本基金的行业情况

4.3.96 本基金的行业情况

4.3.97 本基金的行业情况

4.3.98 本基金的行业情况

4.3.99 本基金的行业情况

4.3.100 本基金的行业情况

4.3.101 本基金的行业情况

4.3.102 本基金的行业情况

4.3.103 本基金的行业情况

4.3.104 本基金的行业情况

4.3.105 本基金的行业情况

4.3.106 本基金的行业情况

4.3.107 本基金的行业情况

4.3.108 本基金的行业情况

4.3.109 本基金的行业情况

4.3.110 本基金的行业情况

4.3.111 本基金的行业情况

4.3.112 本基金的行业情况

4.3.113 本基金的行业情况

4.3.114 本基金的行业情况

4.3.115 本基金的行业情况

4.3.116 本基金的行业情况

4.3.117 本基金的行业情况

4.3.118 本基金的行业情况

4.3.119 本基金的行业情况

4.3.120 本基金的行业情况