

# 广发中证军工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：中国工商银行股份有限公司

时间：二〇一七年九月

## 【重要提示】

本基金于 2016 年 6 月 27 日经中国证监会证监许可[2016]1440 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军工指数的表现，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。

投资者申购的基金份额当日可卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；即在目前结算规则下，T 日申购的基金份额当日可卖出，T 日申购当日未卖出的基金份额，T+1 日不得卖出和赎回，T+1 日交收成功后 T+2 日可卖出和赎回。因此为投资者办理申购业务的代理机构若发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购当日未卖出的基金份额，投资者的利益可能受到影响。

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军工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军工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 2017 年 8 月 30 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 6 月 30 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：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

孙树明先生：董事长，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，中国证券业协会第六届理事会兼职副会长，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，上海证券交易所第三届理事会理事，上海证券交易所第一届上市咨询委员会委员，广东金融学会副会长，广东省预算腐败工作专家咨询委员会财政金融运行规范组成员，中证机构间报价系统股份有限公司副董事长。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。

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。

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总裁，兼任南京烽火星空通信发展有限公司董事。曾任烽火通信科技股份有限公司财务部总经理助理、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，现任深圳香江控股股份有限公司董事长，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，全国妇联常委，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，广东省女企业家协会会长，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。曾任深圳市前海香江金融控股集团有限公司法定代表人、董事长。

许冬瑾女士：董事，硕士，副主任药师，现任康美药业股份有限公司副董事长、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。

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、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，高级经济师，现任宁波大学法学院教授、学术委员会主任，兼任绍兴银行独立董事，海尔施生物医药股份有限公司独立董事。曾任复旦大学教授、法律系副主任、法学院副院长。

姚海鑫先生：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会常务理事、辽宁省生产力学会副理事长、东北制药（集团）股份有限公司独立董事、沈阳化工股份有限公司独立董事和中兴-沈阳商业大厦（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

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。

匡丽军女士：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：监事，硕士，现任广发基金管理有限公司产品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，瑞元资本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。

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。

易阳方先生：副总经理，硕士。兼任广发基金管理有限公司投资总监，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、广发鑫享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、总经理助理，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。

段西军先生：督察长，博士。曾在广东省佛山市财贸学校、广发证券股份有限公司、中国证监会广东监管局工作。

邱春杨先生：副总经理，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。

魏恒江先生：副总经理，硕士，高级工程师。兼任广东证券期货业协会副会长及发展委员会委员。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。

张敬晗女士：副总经理，硕士，兼任广发国际资产管理有限公司副董事长。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。

#### 4、基金经理

刘杰,男, 中国籍, 工学学士, 13 年基金业从业经历, 持有中国证券投资基金业从业证书, 2004 年 7 月至 2010 年 11 月在广发基金管理有限公司信息技术部工作, 2010 年 11 月至 2014 年 3 月任广发基金管理有限公司数量投资部数量投资研究员, 2014 年 4 月 1 日至 2016 年 1 月 17 日任广发沪深 300 指数基金的基金经理, 2014 年 4 月 1 日起任广发中证 500ETF 以及广发中证 500ETF 联接(LOF)基金的基金经理, 2015 年 8 月 20 日起任广发沪深 300ETF 基金的基金经理, 2016 年 1 月 18 日起任广发沪深 300ETF 联接基金的基金经理, 2016 年 1 月 25 日起任广发中小板 300ETF 及联接基金、广发养老指数和广发环保指数基金的基金经理, 2016 年 1 月 28 日起任数量投资部总经理助理, 2016 年 8 月 30 日起任广发中证军工 ETF 基金的基金经理, 2016 年 9 月 26 日起任广发中证军工 ETF 联接基金的基金经理, 2017 年 1 月 25 日起任广发中证环保 ETF 基金的基金经理, 2017 年 4 月 25 日起任广发创业板 ETF 基金的基金经理, 2017 年 5 月 25 日起任广发创业板 ETF 联接基金的基金经理, 2017 年 8 月 4 日起任广发量化稳健混合基金的基金经理。

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分管的副总经理易阳方先生、权益投资一部负责人李巍先生和研究发展部负责人孙迪先生等成员组成, 易阳方先生担任投委会主席。基金管理人固定收益投委会由固定收益投资总监张芊女士、固定收益部副总经理谢军先生、温秀娟女士、代宇女士和固定收益部研究负责人韩晟先生等成员组成, 张芊女士担任投委会主席。

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、基金托管人基本情况

名称: 中国工商银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 易会满

成立时间: 1984 年 1 月 1 日

注册资本: 人民币 35,640,625.71 万元

电话: 010-66105799

联系人: 郭明

### 二、基金托管部门及主要人员情况

截至 2017 年 6 月末, 中国工商银行资产托管部共有员工 218 人, 平均年龄 30 岁, 95%以上员工拥有大学本科以上学历, 高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

### 三、证券投资基金托管情况

作为中国大陆托管服务的先行者, 中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来, 秉承诚实信用、勤勉尽责的宗旨, 依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队, 严格履行资产托管人职责, 为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务, 展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、基本养老保险、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系, 同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务, 可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2017 年 6 月, 中国工商银行共托管证券投资基金 745 只。自 2003 年以来, 本行连续十四年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权

威财经媒体评选的 54 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

### 第三部分相关服务机构

#### 一、基金份额发售机构

##### 1、发售协调人

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、41、42、43 楼

法定代表人：孙树明

联系人：黄岚

客户服务电话：95575

开放式基金业务传真：020-87555305

网址：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

##### 2、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 1 号保利国际广场南塔 17 楼

直销中心电话：020-89899073

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：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴东路 166 号 905-10 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](http://www.gffunds.com.cn)

本公司网址：[www.gffunds.com.cn](http://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。

#### 3、网下现金和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：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

法人代表：刘汝军

联络人：孙恺

联系电话：010-83561149

客服电话：400-698-9898

传真：010-83561094

网址：www.xsdzq.cn

(3) 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：95321

公司网站：www.cindasc.com

(4) 名称：中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

联系人：田薇

电话：010-66568430

传真：010-66568990

客服电话：4008-888-888 或拨打各城市营业网点咨询电话。

公司网站：www.chinastock.com.cn

(5) 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：北京市朝阳区门内大街 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

(6) 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：张智河

联系人：吴忠超

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

客服电话：95548

公司网站：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

（7）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

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：010-60833722

传真：010-60833739

客服电话：95548

公司网站：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

（8）名称：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路1508号

办公地址：上海市静安区新闻路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：95525

公司网站：[www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

（9）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：95521

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

（10）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](http://www.hfzq.com.cn)

客服电话：96326（福建省外请先拨0591）

（11）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](http://www.swhysc.com)

（12）名称：兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系人：谢高得

电话：021-38565785

传真：021-38565955

客户服务热线：95562

公司网站：[www.xyq.com.cn](http://www.xyq.com.cn)

（13）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](http://www.essence.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：周杨

电话：0755-82130833

传真：0755-82133952

客服电话：95536

公司网站：[www.guosen.com.cn](http://www.guosen.com.cn)

（15）名称：平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层；

办公地址：深圳市福田区中心区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层；

法定代表人：谢永林

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：[www.pingan.com](http://www.pingan.com)

（16）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](http://www.tfzq.com)

(17) 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 3845 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](http://www.newone.com.cn)

(18) 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](http://www.china-invs.cn)

(19) 名称：方正证券股份有限公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦 22—24 层

法定代表人：雷杰

联系人：彭博

电话：0731-85832343

传真：0731-85832214

客服电话：95571

公司网站：[www.foundersc.com](http://www.foundersc.com)

(20) 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：天津市南开区滨水西道 8 号

法定代表人：王春峰

联系人：蔡霆

联系电话：022-28451991

传真：022-28451892

客服电话：400-6515-988

公司网站：[www.ewww.com.cn](http://www.ewww.com.cn)

(21) 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](http://www.dwzq.com.cn)

(22) 名称：华宝证券有限责任公司

注册地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

办公地址：上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 27 层

法定代表人：陈林

联系人：宋歌

电话：021-50122086

传真：021-50122200

客服电话：4008209898

公司网站：[www.cnhbstock.com](http://www.cnhbstock.com)

(23) 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

(24) 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：吴阳

电话：0531-68889155

传真：0531-68889752

客服电话：95538

公司网站：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(25) 名称：湘财证券有限责任公司

注册地址：长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地址：湖南省长沙市天心区湘府中路 198 号标志商务中心 11 楼

法定代表人：林俊波

联系人：钟康莺

电话：021-68634518

传真：021-68865680

开放式基金客服电话：400-888-1551

公司网站：[www.xcsc.com](http://www.xcsc.com)

(26) 名称：长城证券股份有限公司

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](http://www.cgws.com)

(27) 名称：中国国际金融股份有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

办公地址：北京市建国门外大街 1 号国贸大厦 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：李剑阁

联系电话：010-65051166

业务传真：010-65051166

公司网址：[www.cicc.com.cn](http://www.cicc.com.cn)

#### 4、网上现金发售代理机构

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

#### 5、申购赎回代办券商

(1) 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](http://www.dwzq.com.cn)

(2) 名称：中国民族证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人：赵大建

联系人：李微

联系电话：010-59355941

客服电话：40088-95618

公司网站：[www.e5618.com](http://www.e5618.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

### 1、场内份额

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：010-59378856

传真：010-59378907

### 2、场外份额

名称：广发基金管理有限公司

住所：广东省珠海市横琴新区宝中路 3 号 4004-56 室

法定代表人：孙树明

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

电话：020-89188970

传真：020-89899175

联系人：李尔华

### 三、出具法律意见书的律师事务所

名称：北京市盈科（广州）律师事务所

住所：广州市广州大道中 289 号南方传媒大厦 B 座 15-18 层

负责人：牟晋军

电话：020-66857288

传真：020-66857289

经办律师：刘智、陈琛

联系人：牟晋军

### 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：洪锐明、江丽雅

### 第四部分基金的名称

广发中证军工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、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（即中证军工指数）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。

## 第九部分业绩比较基准

本基金的标的指数为中证军工指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。

中证军工指数是中证指数有限公司编制，以 2004 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点，旨在反映沪深两市军工行业上市公司的整体表现，为投资人投资军工行业提供投资标的。

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、基金的标的指数许可使用费；
- 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、基金收益分配中发生的费用；
- 8、基金的证券交易费用；
- 9、基金的银行汇划费用；
- 10、基金上市初费及年费、场内份额的注册登记费用、IOPV 计算与发布费用；
- 11、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 12、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 0.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.5\% \times \text{当年天数}$$

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送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，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送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 3、基金的指数许可使用费

本基金按照基金管理人与标的指数许可方所签订的指数使用许可协议中所规定的指数许可使用费计提方法支付指数许可使用费。

本基金的指数许可使用费按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提。指数许可使用费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.03\% \times \text{当年天数}$$

H 为每日应付的指数许可使用费

E 为前一日基金资产净值

指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 5 万元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

指数许可使用费自基金合同生效之日起每日计提，逐日累计，按季支付。指数许可使用费的支付由基金管

理人向基金托管人发送划付指令，经基金托管人复核后于下一个季度开始后 10 个工作日内从基金财产中一次性支付。

如果指数使用许可协议约定的指数许可使用费的计算方法、费率和支付方式等发生调整，本基金将采用调整后的方法或费率计算指数许可使用费。基金管理人将在招募说明书更新或其他公告中披露基金最新适用的方法。

上述一、基金费用的种类中第 4—12 项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### 三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### 四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致并履行适当程序后，可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费等相关费率。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前 2 个工作日在至少一种指定媒介上公告。

## 第十二部分基金投资组合报告

本基金管理人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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 9 月 26 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 2017 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 315,915,299.97 95.57

其中：股票 315,915,299.97 95.57

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 14,421,307.43 4.36

7 其他资产 217,829.95 0.07

8 合计 330,554,437.35 100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中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

##### （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 --

B 采矿业 --

C 制造业 297,323,406.92 90.44

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 3,120,650.51 0.95

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 13,081,028.25 3.98

J 金融业 --

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 2,391,684.00 0.73

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 --

合计 315,916,769.68 96.10

##### （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	601989	中国重工	5,339,888	33,160,704.48	10.09
2	000768	中航飞机	862,600	15,906,344.00	4.84
3	600893	航发动力	582,313	15,897,144.90	4.84
4	002465	海格通信	1,077,400	11,571,276.00	3.52
5	600118	中国卫星	367,808	10,239,774.72	3.11
6	600150	中国船舶	428,600	9,802,082.00	2.98
7	600879	航天电子	1,008,718	8,866,631.22	2.70
8	600435	北方导航	550,847	7,882,620.57	2.40
9	002179	中航光电	245,662	7,662,197.78	2.33
10	600038	中直股份	146,438	6,702,467.26	2.04

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) 本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

(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) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1	存出保证金	64,146.41
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,451.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	151,232.48
8	其他	-
9	合计	217,829.95

(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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	601989	中国重工	33,160,704.48	10.09	重大事项停牌

### 第十三部分基金的业绩

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 2017 年 6 月 30 日。

1、本基金本报告期单位基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差
2016.8.30-2016.12.31	-3.65%	0.74%	-5.56%	0.96%
2017.1.1-2017.6.30	-10.62%	1.29%	-12.85%	1.35%
自基金合同生效起至今	-13.88%	1.10%	-17.70%	1.20%

注：业绩比较基准：中证军工指数收益率。

2、自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年8月30日至2017年6月30日)

注：1、本基金合同生效日期为2016年8月30日，至披露时点本基金成立未满一年。

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。

#### 第十四部分对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对原广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书的内容进行了更新,主要更新的内容如下:

- 1、在第三部分基金管理人部分,更新了基金管理人的相关内容。
- 2、在第四部分基金托管人部分,更新了基金托管人的人员变动、业务经营情况及内控制度的信息。
- 3、在第五部分相关服务机构部分,变更了经办注册会计师的信息。
- 4、在第十一部分基金的投资部分,更新了截至2017年6月30日的基金投资组合报告。
- 5、在第十二部分基金的业绩部分,更新了截至2017年6月30日的基金业绩。

广发基金管理有限公司

二〇一七年九月二十九日