汇添富环保行业股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2020 年 5 月 21 日更新）

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
重要提示
汇添富环保行业股票型证券投资基金(基金简称:汇添富环保行业股票,基金代码:000696,以下简称"本基金")2014 年 5 月 26 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2014】526 号文准予注册募集。本基金基金合同于 2014 年 9 月 16 日正式生效。

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。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者根据所持有份额享受基金的收益,但同时也要承担相应的投资风险。投资者拟认购(或申购)基金时应认真阅读本招募说明书、基金产品资料概要、基金合同等信息披露文件,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、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,由于基金投资者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,等等。本基金也可投资中小企业私募债券,中小企业私募债是根据相关法律法规由非上市中小企业采用非公开方式发行的债券,由于不能公开交易,一般情况下,交易不活跃,潜在较大流动性风险,当发债主体信用质量恶化时,受市场流动性所限,本基金可能无法卖出所持有的中小企业私募债,由此可能给基金净值带来更大的负面影响和损失。

本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险、预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

本基金更新招募说明书"基金的投资"章节中有关"风险收益特征"的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述,代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构(包括基金管理人直销机构和其他销售机构)根据相关法律法规对本基金进行"销售适当性风险评价",不同的销售机构采用的评价方法也不同,因此销售机构的基金产品"风险等级评价"与"基金的投资"章节中"风险收益特征"的表述可能存在不同,投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

投资者应充分考虑自身的风险承受能力,并对于认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本基金单一投资者持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的 50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等情形导致被动达到或者超过 50%的除外。

本次招募说明书主要涉及基金经理信息的更新,更新所载内容截止日为 2020 年 5 月 21 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2019 年 12 月 31 日。

第一部分 基金管理人
(一) 基金管理人简况
名称:汇添富基金管理股份有限公司
上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 H686 室
办公地址:上海市富城路 99 号震旦国际大楼 20 楼
法定代表人:李文
成立时间:2005 年 2 月 3 日
批准设立机关:中国证券监督管理委员会
批准设立文号:证监基金字[2005]5 号
注册资本:人民币 132,724,224 元
联系人:李鹏
联系电话:021-28932888
股东名称及其出资比例:

股东名称	股权比例
东方证券股份有限公司	35.412%
上海菁聚金投资管理合伙企业(有限合伙)	24.656%
上海上报资产管理有限公司	19.966%
东航金控有限责任公司	19.966%
合计	100%

(二)主要人员情况
1、董事会成员
李文先生,2015 年 4 月 16 日担任董事长。国籍:中国,厦门大学会计学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事长,汇添富资产管理(香港)有限公司董事长。历任中国人民银行厦门市分行稽核处科长,中国人民银行杏林支行、国家外汇管理局杏林支局副行长、副局长,中国人民银行厦门市中心支行银行监管一处、二处副处长,东方证券有限责任公司资金财务管理总部副总经理,稽核总部总经理,东方证券股份有限公司资金财务管理总部总经理,汇添富基金管理股份有限公司督察长。

程峰先生,2016 年 11 月 20 日担任董事。国籍:中国,上海交通大学工商管理硕士。现任上海报业集团副总经理,上海上报资产管理有限公司董事长,上海文化产权交易所股份有限公司董事长,上海瑞力投资基金管理有限公司董事长。历任上海市对外经济贸易委员会团委副书记、书记,上海机械进出口(集团)有限公司副总裁,上海市对外经济贸易委员会技术进口处副处长,上海市对外经济贸易委员会科技发展与技术贸易处副处长、处长,上海国际集团有限公司办公室、信息中心主任,上海国际集团有限公司行政管理总部副总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委副书记、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长、总经理,上海国际集团金融服务有限公司党委书记、董事长,上海国有资产经营有限公司党委书记、董事长。

林福杰先生,2018 年 3 月 21 日担任董事。国籍:中国,上海交通大学工商管理硕士。现任东航金控有限责任公司总经理、党委副书记、东航集团财务有限责任公司董事长。曾任东航期货有限责任公司部门经理,东航集团财务有限责任公司副总经理,国泰人寿保险有限责任公司副总经理,东航金控有限责任公司党委书记、副总经理。

张晖先生,2015 年 4 月 16 日担任董事,总经理。国籍:中国,上海财经大学经济学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司总经理,汇添富资本管理有限公司董事长。历任申银万国证券研究所高级分析师,富国基金管理有限公司研究主管和基金经理,汇添富基金管理股份有限公司副总经理兼投资总监,曾担任中国证券监督管理委员会第十届和第十一届发行审核委员会委员。

林志军先生,2015 年 4 月 16 日担任独立董事。国籍:中国香港,厦门大学经济学博士,加拿大 Saskatchewan 大学工商管理学硕士。现任澳门科技大学副校长兼商学院院长、教授、博导。历任福建省科学技术委员计划统计处会计,五大国际会计师事务所 Touche Ross International (现为德勤) 加拿大多伦多分所审计员,厦门大学会计师事务所副主任会计师,厦门大学经济学院讲师、副教授,伊利诺大学(University of Illinois)国际会计教育与研究中心访问学者,美国斯坦福大学(Stanford University)经济系访问学者,加拿大 Lethbridge 大学管理学院会计学讲师、副教授 (tenured),香港大学商学院访问教授,香港浸会大学商学院会计与法律系教授,博导,系主任。

杨燕青女士,2011 年 12 月 19 日担任独立董事,国籍:中国,复旦大学经济学博士。现任《第一财经日报》副总编辑,第一财经研究院院长,国家金融与发展实验室特邀高级研究员,上海政协委员,《第一财经日报》创始编委之一,第一财经频道高端对话节目《经济学人》等栏目创始人和主持人,《波士堂》等栏目资深评论员。2002-2003 年期间受邀成为约翰-霍普金斯大学访问学者。

魏尚进(Shangjin Wei)先生,2020 年 1 月 9 日担任独立董事,国籍:美国,加州大学伯克利分校博士。现任复旦大学泛海国际金融学院访问教授、哥伦比亚大学终身讲席教授。曾任哈佛大学肯尼迪政府学院助理教授、副教授,世界银行顾问,国际货币基金组织工作贸易与投资处处长、研究局助理局长。2、监事会成员

任瑞良先生,2004 年 10 月 20 日担任监事,2015 年 6 月 30 日担任监事会主席。国籍:中国,大学学历,会计师、非执业注册会计师职称。现任上海报业集团上海上报资产管理有限公司副总经理。历任文汇新民联合报业集团财务中心财务主管,文汇新民联合报业集团文新投资公司财务主管、总经理助理、副总经理等。

王如富先生,2015 年 9 月 8 日担任监事。国籍:中国,硕士研究生,注册会计师。现任东方证券股份有限公司董事会秘书兼董事会办公室主任。历任申银万国证券计划统筹总部综合计划部专员、发展协调办公室专员,金信证券规划发展总部总经理助理、秘书处副主任(主持工作),东方证券研究所证券市场战略资深研究员、董事会办公室资深主管、主任助理、副主任。

毛海东先生,2015 年 6 月 30 日担任监事,国籍:中国,国际金融学硕士。现任东航金控有限责任公司总经理助理兼财富管理中心总经理。曾任职于东航期货有限责任公司,东航集团财务有限责任公司。

王静女士,2008 年 2 月 23 日担任职工监事,国籍:中国,中加商学院工商管理硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司互联网金融部总监。曾任职于中国东方航空集团公司宣传部,东航金控有限责任公司研究发展部。

林旋女士,2008 年 2 月 23 日担任职工监事,国籍:中国,华东政法学院法学硕士。现任汇添富基金管理股份有限公司董事会办公室副总监,汇添富资本管理有限公司监事。曾任职于东方证券股份有限公司办公室。

陈杰先生,2013 年 8 月 8 日担任职工监事,国籍:中国,北京大学理学博士。现任汇添富基金管理股份有限公司综合办公室副总监。曾任职于罗兰贝格管理咨询有限公司,泰科电子(上海)有限公司能源事业部。

3、高管人员
李文先生,董事长。(简历请参见上述董事会成员介绍)
张晖先生,2015 年 6 月 25 日担任总经理。(简历请参见上述董事会成员介绍)

雷继明先生,2012 年 3 月 7 日担任副总经理。国籍:中国,工商管理硕士。历任中国民族国际信托投资公司网上交易部副总经理,中国民族证券有限责任公司营业部总经理、经纪业务总监、总裁助理。2011 年 12 月加盟汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

娄焱女士,2013 年 1 月 7 日担任副总经理。国籍:中国,金融经济学硕士。曾在赛格国际信托投资股份有限公司、华夏证券股份有限公司、嘉实基金管理有限公司、招商基金管理有限公司、华夏基金管理有限公司以及富达基金北京与上海代表处工作,负责投资银行、证券投资研究,以及基金产品策划、机构理财等管理工作。2011 年 4 月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任公司副总经理。

袁建军先生,2015 年 8 月 5 日担任副总经理。国籍:中国,金融学硕士。历任华夏证券股份有限公司研究所行业二部副经理,汇添富基金管理股份有限公司基金经理、专户投资总监、总经理助理,并于 2014 年至 2015 年期间担任中国证券监督管理委员会第十六届主板发行审核委员会专职委员。2005 年 4 月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、投资决策委员会主席。

李骁先生,2017 年 3 月 3 日担任副总经理。国籍:中国,武汉大学金融学硕士。历任厦门建行计算机处副处长,厦门建行信用卡部副处长、处长,厦门建行信息技术部处长,建总行北京开发中心负责人,建总行信息技术管理部副总经理,建总行信息技术管理部副总经理兼北京研发中心主任,建总行信息技术管理部资深专员(副总经理级)。2016 年 9 月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司副总经理、首席技术官。

李鹏先生,2015 年 6 月 25 日担任督察长。国籍:中国,上海财经大学经济学博士,历任上海证监局主任科员、副处长,上海农商银行同业金融部副总经理,汇添富基金管理股份有限公司稽核监察总监。2015 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司,现任汇添富基金管理股份有限公司督察长。

4、基金经理
(1)现任基金经理
赵剑先生,国籍:中国,学历:清华大学工学硕士,10 年证券从业经验。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2007 年至 2009 年任职麦肯锡咨询(上海)有限公司。2009 年 9 月加入汇添富基金,历任行业分析师、高级行业分析师、投资经理。2020 年 5 月 20 日至今任汇添富环保行业股票基金的基金经理。
(2)历任基金经理
叶从飞先生,2014 年 9 月 16 日至 2019 年 1 月 18 日任汇添富环保行业股票型证券投资基金的基金经理。
赵鹏程先生,2019 年 1 月 18 日至 2020 年 5 月 20 日任汇添富环保行业股票型证券投资基金的基金经理。
5、投资决策委员会
主席:袁建军(副总经理)
成员:韩贤旺(首席经济学家)、王栩(总经理助理,权益投资总监)、陆文磊(总经理助理,固定收益投资总监)、劳杰男(研究总监)
6、上述人员之间不存在近亲属关系

第二部分 基金托管人
(一)基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
法定代表人:田国立
成立时间:2004 年 09 月 17 日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12 号
联系人:田 青
联系电话:(010)6759 5096

中国建设银行成立于 1954 年 10 月,是一家国内领先、国际知名的大型股份制商业银行,总部设在北京。本行于 2005 年 10 月在香港联合交易所挂牌上市(股票代码 939),于 2007 年 9 月在上海证券交易所挂牌上市(股票代码 601939)。

2018 年末,集团资产规模 23.22 万亿元,较上年增长 4.96%。2018 年度,集团实现净利润 2,556.26 亿元,较上年增长 4.93%;平均资产回报率和加权平均净资产收益率分别为 1.13%和 14.04%;不良贷款率 1.46%,保持稳中有降;资本充足率 17.19%,保持领先同业。

2018 年,本集团先后荣获新加坡《亚洲银行家》"2018 年中国最佳大型零售银行奖"、"2018 年中国全面风险管理成就奖";美国《环球金融》"全球贸易金融最具创新力银行"、《银行家》"2018 最佳金融创新奖"、《金融时报》"2018 年金龙奖一年度最佳普惠金融服务银行"等多项重要奖项。本集团同时获得英国《银行家》、香港《亚洲货币》杂志"2018 年中国最佳银行"称号,并在中国银行业协会 2018 年"陀螺"评价中排名全国性商业银行第一。

中国建设银行总行设资产托管业务部,下设综合与合规管理处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、养老金托管处、全球托管处、新兴业务处、运营管理处、托管应用系统支持处、跨境托管运营处、合规监督处等 11 个职能处室,在安徽合肥设有托管运营中心,在上海设有托管运营中心上海分中心,共有员工 300 余人。自 2007 年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。

(二)主要人员情况
蔡亚蓉,资产托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行总行资金计划部、信贷经营部、公司业务部以及中国建设银行重组改制办公室任职,并在总行公司业务部担任领导职务。长期从事公司业务,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

龚毅,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行北京市分行国际部、营业部并担任副行长,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲,资产托管业务部资深经理(专业技术一级),曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

郑绍平,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部、战略客户部,长期从事客户服务、信贷业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

原玎,资产托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行国际业务部,长期从事海外机构及海外业务管理、境内外汇业务管理、国外金融机构客户营销拓展等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。

(三)基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持"以客户为中心"的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、(R)QFII、(R)QDII、企业年金、存托业务等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2019 年二季度末,中国建设银行已托管 924 只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行先后 9 次获得《全球托管人》"中国最佳托管银行"、4 次获得《财资》"中国最佳次托管银行"、连续 5 年获得中债登"优秀资产托管机构"等奖项,并在 2016 年被《环球金融》评为中国市场唯一一家"最佳托管银行"、在 2017 年荣获《亚洲银行家》"最佳托管系统实施奖"。

第三部分 相关服务机构
(一)基金份额销售机构
1、直销机构
(1)汇添富基金管理股份有限公司直销中心
住所:上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 H686 室
办公地址:上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼
法定代表人:李文
电话:(021)28932893
传真:(021)50199035 或(021)50199036
联系人:陈卓膺
客户服务电话:400-888-9918(免长途话费)
网址:www.99fund.com
邮箱:guitai@htffund.com
(2)汇添富基金管理股份有限公司网上直销系统(trade.99fund.com)
2、代销机构
本基金的其他销售机构请详见基金管理人官网公示的销售机构信息表。基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售基金,并在基金管理人网站公示。
(二)登记机构
名称:汇添富基金管理股份有限公司
住所:上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区(东座)6 楼 H686 室
办公地址:上海市浦东新区樱花路 868 号建工大唐国际广场 A 座 7 楼
法定代表人:李文
电话:(021)28932888
传真:(021)28932876
联系人:韩从慧
(三)出具法律意见书的律师事务所
名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
办公地址:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人:俞卫锋
电话:(021)31358666
传真:(021)31358600
经办律师:黎明、孙睿
联系人:陈颖华
(四)审计基金财产的会计师事务所
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
办公地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
邮政编码:100738
执行事务合伙人:毛鞍宁
电话:010-58153000
传真:010-85188298
业务联系人:徐艳
经办会计师:徐艳、许培菁

第四部分 基金的名称
本基金名称:汇添富环保行业股票型证券投资基金
基金简称:汇添富环保行业股票
基金代码:000696

第五部分 基金的类型
本基金为契约型开放式股票型基金。

第六部分 基金的投资目标
本基金采用自下而上的策略,以基本面分析为立足点,主要投资于环保行业的优质上市公司,在科学严格管理风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。

第七部分 基金的投资方向
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、金融债、央行票据、公司债、企业债、地方政府债、可转换债券、可分离债券、短期融资券、中期票据、中小企业私募债券等)、债券回购、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款(含定期存款、协议存款、大额存单等)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)。

本基金将生产环保设备(含防大气污染设备、消除噪声设备、监测仪器设备、废水处理、废弃物管理和循环利用设备等)、提供环保服务(含控制大气污染、消除噪声、处理废弃物及处理废水等)、供应清洁生产技术和清洁产品(含清洁生产技术与设备,为能源节约与管理、能源转换及存储等活动提供生产设备和相应技术,新能源、清洁能源和可再生能源的开发及节能技术、设备,生态标志食品和绿色食品等)及供需结构因国家环保政策得到优化的上市公司定义为环保行业上市公司。

本基金的投资组合比例为:80%以上的基金资产投资于股票,其中投资于环保行业上市公司股票的资产不低于非现金基金资产的 80%;其余资产投资于债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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。其中,基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%;基金持有单只中小企业私募债,其市值不得超过基金资产净值的 10%;每个交易日日终在扣除股指期货交易保证金以后,基金保留的现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,本基金所指的现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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。

第八部分 基金的投资策略
一、投资策略
本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中,资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险;个股精选策略用于挖掘具有核心竞争优势和持续增长潜力且估值水平相对合理的环保行业优质上市公司,辅以严格的风险管理,以获得中长期的较高投资收益。投资策略的重点是个股精选策略。

1、资产配置策略
本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素(其中,基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据;政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财政政策;市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场 P/E 与历史平均水平的偏离程度等),结合全球宏观经济形势,研判国内经济的发展趋势,并在严格管理投资组合风险的前提下,确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款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的投资比例。

2、个股精选策略
本基金股票投资采用自下而上的个股精选策略,选择具有核心竞争优势和持续增长潜力且估值水平相对合理的环保行业优质上市公司的股票进行重点投资。

首先,按照本基金管理人投资管理制度要求和股票投资限制,针对沪深两市环保行业上市公司,剔除其中不符合投资要求的股票(包括但不限于法律法规或基金管理人内部制度明确禁止投资的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等)。

其次,在符合投资要求的股票中,本基金管理人主要采取定性分析结合定量分析的方法,通过扎实的案头研究和详尽紧密的实地调研,结合外部研究支持,分别从核心竞争优势和增长潜力等方面进行评估,挑选出环保行业优质上市公司股票。具体如下:

(1)核心竞争优势评估:根据环保行业自身的特点(包括但不限于环境污染成因复杂、治理思路三化【减量化、无害化、资源化】并重、国家环保政策力度不断加大、环保投入逐年增加、新技术应用比例较高、多采用 BOT【Build & Operate & Transfer】投资模式等),本基金管理人将从备选公司的研发能力、生产技术、终端产品或服务、销售渠道、融资能力及政府事务运作能力等方面进行综合评估,从中选择在技术、资源、政策等方面拥有核心竞争优势的环保行业上市公司。

(2)增长潜力评估:环保行业有其相对独特的盈利模式,例如上市公司通过开发环保新产品和环保新技术,以较低成本满足客户需求从而获得利润;或者利润来自于政府环保项目建设完成后特许经营期内收取的费用等。但是,业绩持续的增长性是企业永续的根本,也是优质公司的魅力所在。本基金管理人将分析备选公司的主营业务收入增长率和净利润增长率,同时考察主营业务利润率和净资产收益率,在研判增长质量的基础上,选择在较长期限内实现可持续增长的环保行业上市公司。

然后,针对筛选出的具有核心竞争优势和持续增长潜力的环保行业上市公司股票,本基金管理人主要采取定量分析的方法,考察市盈增长比率(PEG)、市盈率(P/E)、市净率(P/B)、企业价值/息税前利润(EV/EBIT)、企业价值/息税、折旧、摊销前利润(EV/EBITDA)、自由现金流贴现(DCF)等一系列估值指标,给出股票综合评级,从中选择估值水平相对合理的备选股票,组成本基金的股票库。

最后,基金经理按照本基金的投资决策程序,审慎精选,权衡风险收益特征后,根据二级市场波动情况构建股票组合并动态调整。

3、债券投资策略
本基金的债券投资综合考虑收益性、风险性和流动性,在深入分析宏观经济、货币政策以及市场结构的基础上,灵活运用各种消极和积极策略。

消极债券投资的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的收益。本基金主要通过利率免疫策略来进行消极债券投资。利率免疫策略就是构造一个恰当的债券组合,使得利率变动导致的价格波动风险与再投资风险相互抵消。这样无论市场利率如何变化,债券组合都能获得一个比较确定的收益率。

积极债券投资的目标是利用市场定价的无效率来获得低风险甚至是无风险的超额收益。本基金的积极债券投资主要基于对利率期限结构的研究。利率期限结构描述了债券市场的平均收益率水平以及不同期限债券之间的收益率差别,它决定于三个要素:货币市场利率、均衡真实利率和预期通货膨胀率。在深入分析利率期限结构的基础上,本基金将运用利率预期策略、收益率曲线追踪策略进行积极投资。

本基金也将从债券市场的结构变化中寻求积极投资的机会。由于国内债券市场仍处于发展阶段,交易制度、债券品种体系和投资者结构也在逐步完善,这些结构变化会产生低风险甚至无风险的套利机会。本基金将借助经济理论和金融分析方法,努力把握市场结构变化所带来的影响,并在此基础上寻求低风险甚至无风险的套利机会,主要通过跨市场套利策略和跨品种套利策略来完成套利投资。

4、中小企业私募债券投资策略
本基金将在严格控制信用风险的基础上,通过严密的投资决策流程、投资授权审批机制、集中交易制度等保障审慎投资于中小企业私募债券,并通过组合管理、分散化投资、合理谨慎地评估、预测和控制相关风险,实现投资收益的最大化。

本基金依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况,对其信用风险进行评估并作出及时反应。内部信用评级以深入的企业基本面分析为基础,结合定性和定量方法,注重对企业未来偿债能力的分析评估,对中小企业私募债券进行分类,以便准确地评估中小企业私募债券的信用风险程度,并及时跟踪其信用风险的变化。

本基金对中小企业私募债券的投资策略以持有到期为主,在综合考虑债券信用资质、债券收益率和期限的前提下,重点选择资质较好、收益率较好、期限匹配的中小企业私募债券进行投资。

基金投资中小企业私募债券,基金管理人将根据审慎原则,制定严格的投资决策流程、风险控制制度和信用风险、流动性风险处置预案,并经董事会批准,以防范信用风险、流动性风险等各种风险。

5、股指期货投资策略
本基金以套期保值为目的,参与股指期货交易。

本基金参与股指期货投资时机和数量的决策建立在对证券市场总体行情的判断和组合风险收益分析的基础上。基金管理人将根据宏观经济因素、政策及法规因素和资本市场因素,结合定性和定量方法,确定投资时机。基金管理人将结合股票投资的总体规模,以及中国证监会的相关限定和要求,确定参与股指期货交易的投资比例。

基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征,运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险,如大额申购赎回等;利用金融衍生品的杠杆作用,以达到降低投资组合的整体风险的目的。

基金管理人在进行股指期货投资前将建立股指期货投资决策小组,负责股指期货的投资管理的相关事项,同时针对股指期货投资管理制定投资决策流程和风险控制制度,并经基金管理人董事会批准后执行。

若相关法律法规发生变化时,基金管理人股指期货投资管理从其最新规定,以符合上述法律法规和监管要求的变化。

6、权证投资策略
本基金将权证看作是辅助性投资工具,其投资原则为优化基金资产的风险收益特征,有利于基金资产增值,有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上,综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素,对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

7、资产支持证券投资策略
本基金将分析资产支持证券的资产特征,估计违约率和提前偿付比率,并利用收益率曲线和期权定价模型,对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资,以降低流动性风险。

二、投资决策机制与流程
本基金实行投资决策团队制,强调团队合作,充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合,设立了投资研究部和金融工程部,策略分析师、行业分析师、金融工程分析师和基金经理分别立足本职工作,充分发挥主观能动性,渗透到投资研究的关键环节,群策群力,为基金份额持有人谋取持续稳健的较高投资回报。

本基金投资决策流程为:
1、策略分析师就宏观、政策、投资主题、市场环境提交策略报告并召开策略会议予以讨论;
2、行业分析师就行业发展趋势和行业组合的估值比较,召开会议讨论并确定行业评级;
3、基金经理在策略会议的基础之上提出资产配置的建议;
4、投资决策委员会审议基金经理提交的资产配置建议,确定资产配置比例的范围;
5、投资研究部提交备选股票库,在此基础上,基金经理、行业分析师决定本基金核心股票库名单;
6、基金经理在考虑资产配置的情况下,经过风险收益的权衡,决定投资组合方案;
7、投资总监审核投资组合方案后,交由基金经理实施;
8、集中交易室执行交易指令;
9、金融工程部进行全程风险评估和绩效分析。

第九部分 基金的业绩比较基准
本基金业绩比较基准:
中证环保产业指数收益率 @ 80% + 中证全债指数收益率 @ 20%

选择该业绩比较基准,是基于以下因素:
1、中证环保产业指数是中证指数公司编制并推出的反映沪深两市环保产业上市公司市场表现的指数,中证指数公司根据联合国环境与经济综合核算体系对于环保产业的界定方法,将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题,采用等权重加权方式进行了指数的编制;
2、中证环保产业指数编制合理、透明,有一定市场覆盖率,并且不易被操纵;
3、中证环保产业指数编制和发布有一定的历史,有较高的知名度和市场影响力;
4、中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数,也是中证指数公司编制并发布的首只债券类指数,该指数的样本由银行间市场和沪深交易所市场的国债、金融债券及企业债券组成;
5、基于本基金的投资范围和投资比例限制,选用上述业绩比较基准能够真实、客观地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化,或者指数编制单位停止计算编制上述指数或更改指数名称、或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金业绩比较基准的指数时,经与基金托管人协商一致,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

第十部分 基金的风险收益特征
本基金为股票型基金,属于证券投资基金中较高预期风险、较高预期收益的品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

第十一部分 基金的投资组合报告
基金管理人的董事会、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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§1 投资组合报告
1.1 期末基金资产组合情况
金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,417,123,901.12	86.59
	其中:股票	1,417,123,901.12	86.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,602,000.00	0.10
	其中:债券	1,602,000.00	0.10
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	204,967,233.53	12.52
8	其他各项资产	12,936,543.45	0.79
9	合计	1,636,629,678.10	100.00

1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合
金额单位:人民币元

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	27,219,727.80	1.67
C	制造业	968,517,620.52	59.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,666,241.74	2.43
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	97,012,647.17	5.95
J	金融业	86,457,203.45	5.31
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	81,259,500.00	4.99
N	水利、环境和公共设施管理业	92,423,204.94	5.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	24,567,755.50	1.51
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,417,123,901.12	86.96

1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本基金本报告期末未有港股通投资股票。
1.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细
金额单位:人民币元

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	300012	华测检测	5,450,000	81,259,500.00	4.99
2	000333	美的集团	1,370,024	79,803,898.00	4.90
3	002466	天齐锂业	2,600,000	78,468,000.00	4.82
4	600406	国电南瑞	3,500,000	74,130,000.00	4.55
5	600309	万华化学	1,100,000	61,787,000.00	3.79
6	601233	桐昆股份	4,050,000	60,709,500.00	3.73
7	603568	伟明环保	2,349,945	53,907,738.30	3.31
8	002050	三花智控	3,000,000	51,990,000.00	3.19
9	002484	江海股份	6,499,930	50,959,451.20	3.13
10	000786	北新建材	2,000,000	50,900,000.00	3.12
11	002001	新 和 成	2,000,000	46,520,000.00	2.85
12	603517	绝味食品	999,893	46,445,029.85	2.85
13	002032	苏 泊 尔	600,022	46,069,689.16	2.83
14	300285	国瓷材料	2,000,000	45,700,000.00	2.80
15	000703	恒逸石化	3,050,000	42,456,000.00	2.61
16	600900	长江电力	2,050,000	37,679,000.00	2.31
17	601166	兴业银行	1,900,000	37,620,000.00	2.31
18	002311	海大集团	1,000,000	36,000,000.00	2.21
19	600298	安琪酵母	899,943	27,601,251.81	1.69
20	000975	银泰黄金	1,999,980	27,219,727.80	1.67
21	601318	中国平安	300,000	25,638,000.00	1.57
22	600507	方大特钢	2,449,980	24,646,798.80	1.51
23	002044	美年健康	1,649,950	24,567,755.50	1.51
24	300207	欣旺达	1,200,000	23,424,000.00	1.44
25	601200	上海环境	2,099,930	23,309,223.00	1.43
26	002202	金风科技	1,800,000	21,510,000.00	1.32
27	688021	奥福环保	550,000	19,970,500.00	1.23
28	600426	华鲁恒升	1,000,000	19,870,000.00	1.22
29	300124	汇川技术	600,000	18,384,000.00	1.13
30	300750	宁德时代	160,000	17,024,000.00	1.04
31	300751	迈为股份	119,960	16,968,342.00	1.04
32	601615	明阳智能	1,300,000	15,990,000.00	0.98
33	688111	金山办公	100,059	15,882,647.17	0.97
34	300070	碧水源	1,999,956	15,199,665.60	0.93
35	603501	韦尔股份	100,000	14,340,000.00	0.88
36	688008	澜起科技	200,000	14,322,000.00	0.88
37	603786	科博达	250,000	13,037,500.00	0.80
38	601688	华泰证券	600,000	12,186,000.00	0.75
39	300438	鹏辉能源	350,000	9,380,000.00	0.58
40	601628	中国人寿	249,979	8,716,767.73	0.53
41	000822	山东海化	1,500,000	7,365,000.00	0.45
42	688023	安恒信息	50,000	7,000,000.00	0.43
43	300601	康泰生物	70,000	6,145,300.00	0.38
44	003816	中国广核	562,958	1,987,241.74	0.12
45	601916	浙商银行	294,278	1,371,345.44	0.08
46	601077	渝农商行	147,778	925,090.28	0.06
47	688011	新光光电	8,807	361,527.35	0.02
48	688181	八亿时空	4,306	189,377.88	0.01
49	688138	清溢光电	10,066	139,816.74	0.01
50	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.00
51	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.00
52	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	0.00

1.4 报告期内股票投资组合的重大变动
1.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002001	新 和 成	83,473,178.99	5.20
2	002714	牧原股份	76,374,415.34	4.75
3	000333	美的集团	74,944,296.20	4.67
4	600309	万华化学	67,380,216.94	4.19
5	002484	江海股份	66,557,942.05	4.14
6	601233	桐昆股份	65,146,619.45	4.06
7	000786	北新建材	55,132,650.97	3.43
8	002074	国轩高科	54,017,202.81	3.36
9	603568	伟明环保	52,256,893.80	3.25
10	000703	恒逸石化	52,232,853.65	3.25
11	600507	方大特钢	51,157,688.32	3.18
12	300750	宁德时代	50,718,962.36	3.16
13	600406	国电南瑞	50,549,368.40	3.15
14	300285	国瓷材料	45,500,136.60	2.83
15	601166	兴业银行	44,772,801.91	2.79
16	600104	上汽集团	44,642,726.53	2.78
17	002050	三花智控	44,012,171.16	2.74
18	603517	绝味食品	43,639,241.72	2.72
19	002032	苏 泊 尔	38,786,145.10	2.41
20	603605	珀莱雅	37,595,140.34	2.34
21	300450	先导智能	37,354,021.03	2.33
22	300037	新宙邦	36,954,605.35	2.30
23	300274	阳光电源	36,248,592.74	2.26
24	601012	隆基股份	34,985,606.29	2.18
25	002202	金风科技	34,881,814.91	2.17
26	002129	中环股份	34,833,323.12	2.17
27	300207	欣旺达	34,782,600.78	2.17
28	603305	旭升股份	33,173,963.35	2.07

注:本项"买入金额"按买入成交金额填列,不考虑相关交易费用。
1.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601222	林洋能源	176,422,877.15	10.98
2	002714	牧原股份	93,347,832.63	5.81
3	002001	新 和 成	89,708,535.28	5.58
4	300203	聚光科技	85,098,704.04	5.30
5	601088	中国神华	84,299,347.43	5.25
6	601688	华泰证券	83,105,727.39	5.17
7	002672	东江环保	79,777,859.98	4.97
8	601200	上海环境	71,929,380.47	4.48
9	000581	威孚高科	60,810,275.44	3.79
10	601800	中国交建	60,306,829.17	3.75
11	300416	苏试试验	60,041,364.23	3.74
12	600236	桂冠电力	57,251,274.90	3.56
13	600030	中信证券	56,212,333.67	3.50
14	600900	长江电力	55,180,546.31	3.43
15	600104	上汽集团	47,514,066.19	2.96
16	603605	珀莱雅	47,075,814.66	2.93
17	000488	晨鸣纸业	46,021,003.90	2.86
18	002074	国轩高科	45,988,520.19	2.86
19	601933	永辉超市	43,123,968.00	2.68
20	600028	中国石化	40,942,600.00	2.55
21	300037	新宙邦	40,336,381.68	2.51
22	601012	隆基股份	39,101,693.38	2.43
23	300274	阳光电源	37,858,724.95	2.36
24	300450	先导智能	35,174,487.16	2.19
25	600507	方大特钢	34,777,225.68	2.16
26	002258	利尔化学	33,495,827.70	2.09
27	000590	启迪古汉	32,459,440.62	2.02

注:本项"卖出金额"按卖出成交金额填列,不考虑相关交易费用。
1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额
单位: 人民币元

买入股票成本(成交)总额	2,285,584,217.80
卖出股票收入(成交)总额	2,591,513,761.60

注:本项"买入股票成本"和"卖出股票收入"均按买卖成交金额填列,不考虑相关交易费用。
1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,602,000.00	0.10
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,602,000.00	0.10

1.6 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
金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113029	明阳转债	16,020	1,602,000.00	0.10

1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。
1.8 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贵金属投资明细
注:本基金本报告期末未持有贵金属投资。
1.9 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
注:本基金本报告期末未持有权证。
1.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资股指期货。
1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
注:本基金本报告期内未投资国债期货。
1.12 投资组合报告附注
1.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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
报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
1.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库
本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
1.12.3 期末其他各项资产构成
单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	240,784.05
2	应收证券清算款	12,053,660.02
3	应收股利	-
4	应收利息	45,707.19
5	应收申购款	596,392.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,936,543.45

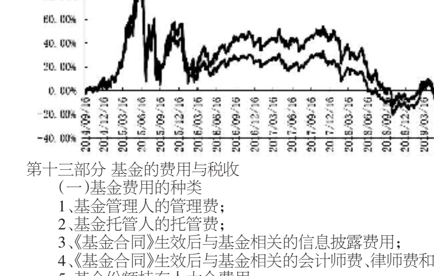
1.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。
1.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002466	天齐锂业	18,108,000.00	1.11	配股流通受限

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、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,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。
(一)本基金份额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(1)	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)
2014 年 9 月 16 日(基金合同生效日)至 2014 年 12 月 31 日	2.20%	1.37%	5.78%	1.25%	-3.58%	0.12%
2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日	51.08%	3.04%	34.87%	2.28%	16.21%	0.76%
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	-9.00%	1.80%	-13.00%	1.53%	4.00%	0.27%
2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	4.34%	0.97%	-0.71%	0.79%	5.05%	0.18%
2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	-36.70%	1.48%	-31.22%	1.12%	-5.48%	0.36%
2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	23.49%	1.05%	17.05%	1.20%	6.44%	-0.15%
2014 年 9 月 16 日(基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日	14.60%	1.81%	-0.79%	1.46%	15.39%	0.35%

(二)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图



第十三部分 基金的费用与税收
(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、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费;
5、基金份额持有人大会费用;
6、基金的证券、期货交易费用;
7、基金的银行汇划费用;
8、基金的证券/期货开户费用、银行账户维护费用;
9、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 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下:
H=E×1.50%÷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
基金管理费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径、从基金财产中一次性支付给基金管理人,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。
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 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:
H=E×0.25%÷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
基金托管费每日计提,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据,自动在次月月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径、从基金财产中一次性支付给基金托管人,基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延至最近可支付日。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。费用自动扣划后,基金管理人应进行核对,如发现数据不符,及时联系基金托管人协商解决。
上述"(一)基金费用的种类中第 3-9 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)基金税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第十四部分 对招募说明书更新部分的说明
(一)针对"重要提示"章节:增加了本次招募说明书更新的主要事项和更新截止时间。
(二)针对"基金管理人"章节:更新了基金管理人的相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司
2020 年 5 月 21 日

汇添富基金管理股份有限公司关于调整基金经理的公告

公告送出日期:2020 年 5 月 21 日

1 公告基本信息

基金名称	汇添富环保行业股票型证券投资基金
基金简称	汇添富环保行业股票
基金主代码	000696
基金管理人名称	汇添富基金管理股份有限公司
公告依据	《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等法律法规规定,以及汇添富基金管理股份有限公司总经理办公会会议决定。
基金经理变更类型	兼有增聘和解聘基金经理
新任基金经理姓名	赵剑
离任基金经理姓名	赵鹏程

2 新任基金经理的相关信息

新任基金经理姓名	赵剑
任职日期	2020 年 5 月 20 日
证券从业年限	10 年
证券投资管理从业年限	2 年
过往从业经历	赵剑先生,国籍:中国。学历:清华大学工学硕士。相关业务资格:证券投资基金从业资格。从业经历:2007 年至 2009 年任职麦肯锡咨询(上海)有限公司。2009 年 9 月加入汇添富基金,历任行业分析师、高级行业分析师、投资经理。
是否曾被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施	否
是否已取得基金从业资格	是
取得的其他相关从业资格	否
国籍	中国
学历、学位	研究生学历、硕士学位
是否已按规定在中国基金业协会注册/登记	是

3 离任基金经理的相关信息

离任基金经理姓名	赵鹏程
离任原因	公司内部工作调整
离任日期	2020 年 5 月 20 日
是否转任本公司其他工作岗位	是
是否已按规定在中国证券业协会办理变更手续	是

4 其他需要说明的事项
本公司已就上述事项在中国证券投资基金业协会完成相关手续。

汇添富基金管理股份有限公司
2020 年 5 月 21 日