

广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（广发纳指100ETF联接（QDII）人民币F）基金产品资料概要更新

编制日期：2024年8月7日
送出日期：2024年8月12日

本概要提供本基金的重要信息，是招募说明书的一部分。
作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|---------|---------------------------|----------------|---|
| 基金简称 | 广发纳指 100ETF 联接（QDII） | 基金代码 | 270042 |
| 下属基金简称 | 广发纳指 100ETF 联接（QDII）人民币 F | 下属基金代码 | 021778 |
| 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 |
| 境外投资顾问 | - | 境外托管人 | 中国银行股份有限公司 Bank of China New York Branch |
| 基金合同生效日 | 2012-08-15 | | |
| 基金类型 | 股票型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 普通开放式 | 开放频率 | 每个开放日 |
| 基金经理 | 刘杰 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022-04-01 |
| | | 证券从业日期 | 2004-07-02 |

其他

本基金基金合同生效后的存续期间，基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万元的，基金管理人应当及时报告中国证监会；连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当向中国证监会说明原因及报送解决方案。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。

未来若出现标的指数不符合要求（因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外）、指数编制机构退出等情形，基金管理人应当自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。

本基金由广发纳斯达克 100 指数证券投资基金转型而来。

注：本基金自 2024 年 8 月 14 日起增设 F 类人民币份额，广发纳斯达克 100 指数证券投资基金自 2015 年 1 月 16 日起增设 A 类美元现汇份额，自 2018 年 10 月 25 日起增设 C 类人民币份额、C 类美元现汇份额。

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金主要通过投资于目标ETF，力求实现对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于目标ETF（广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金）、美国证券市场中的纳斯达克100指数成份股、备选成份股、以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金（ETF）、新股（一级市场初次发行或增发）等，其中，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括在证券市场挂牌交易的普通股、优先股、存托凭证、公募基金、结构性投资产品、金融衍生产品、银行存款、短期政府债券等以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的标的指数为纳斯达克100指数（NASDAQ-100 Index）。 如法律法规或监管机构以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。如法律法规或中国证监会变更投资品种比例限制的，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，不需经基金份额持有人大会审议。 |
| 主要投资策略 | 本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。在正常情况下，力争将本基金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控制在0.5%以内，年跟踪误差控制在5%以内。 具体包括：1、资产配置策略；2、目标ETF投资策略；3、股票投资策略；4、固定收益类投资策略；5、衍生品投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 人民币计价的纳斯达克100总收益指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为ETF联接基金，目标ETF为股票型基金，本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标ETF跟踪标的指数表现，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。 |

注：详见《广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表

无

区域配置图表

无

(三) 自基金合同生效以来基金每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

无

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

以下费用在认购/申购/赎回基金过程中收取：

| 费用类型 | 份额(S)或金额(M) /持有期限(N) | 收费方式/费率 | 备注 |
|----------|-------------------------|---------|---------------------|
| 申购费(前收费) | - | - | 本基金F类 份额无申购 费 |
| 赎回费 | N < 7日 | 1.50% | |
| | N ≥ 7日 | 0.00% | |

(二) 基金运作相关费用

以下费用将从基金资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | 收费方 |
|-------|---|------------|
| 管理费 | 0.80% | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费 | 0.25% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.18% | 销售机构 |
| 审计费用 | 72,000.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 《基金合同》生效后与基金相关的律师费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、基金相关账户的开户及维护费用等费用，以及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。费用类别详见本基金《基金合同》及《招募说明书》或其更新。 | |

注：1、本基金交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从基金资产扣除。

本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费和托管费。

2、审计费用、信息披露费为基金整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以基金定期报告披露为准(金额单位为人民币元)。

四、风险揭示与重要提示

(一) 风险揭示

本基金不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买基金时应认真阅读本基金的《招募说明书》等销售文件。

1、本基金特有的风险

(1) 标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资者心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。

(2) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于基金投资过程中的证券交易成本、基金管理费和托管费的存在以及其它因素，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(3) 成份股权重较大的风险

根据本基金标的指数编制方案，存在个别成份股权重较大、集中度较高的情况，可能使基金面临较大波动风险或流动性风险。

(4) 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

(5) 指数成份股发生负面事件面临退市时的应对风险

根据法律法规的要求，在指数基金运作过程中，当指数成份券发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。存在因基金管理人对负面事件及其影响，以及对指数编制机构的相应反应的判断不够准确而未能及时调整相关成份股或者过早调整相关成份股，进而增大本基金的跟踪误差，甚至不排除给基金资产带来损失的风险。

(6) 标的指数变更的风险

尽管可能性很小，若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

(7) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在6个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，本基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

(8) 投资于目标ETF的风险

本基金为ETF联接基金，投资于目标ETF的比例不低于本基金资产净值的90%，投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。同时，目标ETF面临的诸如管理风险与操作风险、目标ETF份额二级市场交易价格折溢价的风险等，可能直接或间接成为本基金的风险。

(9) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金为广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金的联接基金，主要通过投资于广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争将日均跟踪偏离度控制在0.5%以内，年化跟踪误差控制在5%以内，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

(10) 本基金为目标ETF的联接基金，但不能保证本基金的表现与目标ETF的表现完全一致，产生差异的原因主要包括：1) 现金投资比例要求，目标ETF没有现金投资比例的要求，可以将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现；而本基金作为普通的开放式基金，需保留不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；2) 目标ETF采取按照最小申购、赎回单位和申购、赎回清单要求进行申赎的方式，申购赎回对基金净值影响较小；而本基金采取按照未知价法进行申赎的方式，大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击。

(11) 本基金开通了外币申购和赎回业务，在方便投资者的同时，可能也增加了相关业务处理的复杂性，从而带来相应的风险，增加投资者的支出和基金运作成本。

2、境外投资风险

证券市场价格会因为国际政治环境、宏观和微观经济因素、国家政策、投资人风险收益偏好和市场流动程度等各种因素的变化而波动，将对本基金资产产生潜在风险，这种风险主要包括：海外市场风险、汇率风险、政治风险、法律和政府管制风险、会计核算风险、税务风险。

3、开放式基金的共有风险

(1) 流动性风险；(2) 管理风险；(3) 大额赎回风险；(4) 金融模型风险；(5) 衍生

品投资风险；(6) 证券借贷、正回购 / 逆回购风险；(7) 信用风险；(8) 本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险等。

4、其他风险

(二) 重要提示

中国证监会对本基金募集的核准,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,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金投资者自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和基金合同的当事人。

基金产品资料概要信息发生重大变更的,基金管理人将在三个工作日内更新,其他信息发生变更的,基金管理人每年更新一次。因此,本文件内容相比基金的实际情况可能存在一定的滞后,如需及时、准确获取基金的相关信息,敬请同时关注基金管理人发布的相关临时公告及定期报告等。

如投资者对基金合同有争议的,争议解决处理方式详见基金合同“争议的处理和适用的法律”部分或相关章节。

五、其他资料查询方式

以下资料详见广发基金官方网站 [www.gffunds.com.cn] [客服电话: 95105828 或 020-83936999]

- (1) 《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 基金合同》
- (2) 《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII) 托管协议》
- (3) 《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)招募说明书》
- (4) 定期报告,包括基金季度报告、中期报告和年度报告
- (5) 基金份额净值
- (6) 基金销售机构及联系方式
- (7) 其他重要资料