

广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）（广发恒生科技ETF联接（QDII）F）基金 产品资料概要更新

编制日期：2024年8月27日

送出日期：2024年9月2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	广发恒生科技 ETF 联接（QDII）	基金代码	012804
下属基金简称	广发恒生科技 ETF 联接（QDII）F	下属基金代码	022005
基金管理人	广发基金管理有限公司	基金托管人	中信银行股份有限公司
境外投资顾问	-	境外托管人	美国花旗银行有限公司 Citibank N.A.
基金合同生效日	2021-08-11		
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	霍华明	开始担任本基金 基金经理的日期	2023-03-08
		证券从业日期	2008-07-01

《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现上述情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

其他 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。

注：（1）本基金由广发恒生科技指数证券投资基金（QDII）于 2023 年 3 月 8 日转型而来。
（2）本基金自 2024 年 9 月 4 日起增设 F 类人民币份额。

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	<p>本基金主要投资于目标ETF（广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII））、标的指数（恒生科技指数）成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于境内外依法发行上市的其他股票（包括港股通标的和中国证监会依法发行上市的其他股票、存托凭证）、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括银行定期存款、协议存款、通知存款等）、股指期货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的相关规定）。其中，在投资香港市场时，本基金可通过合格境内机构投资者（QDII）境外投资额度或内地与香港股票市场交易互联互通机制进行投资。</p> <p>本基金可根据相关法律法规的规定参与转融通证券出借业务。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者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%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或对投资比例要求有变更的，基金管理人可依据届时有有效的法律法规并在履行适当程序后，适时合理地调整投资范围及投资比例。</p>
主要投资策略	<p>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。</p> <p>在正常市场情况下，本基金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0.35%以内，年化跟踪误差不超过4%。</p> <p>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、债券投资策略；5、股指期货的投资策略；6、资产支持证券投资策略。</p>
业绩比较基准	人民币计价的恒生科技指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>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，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。</p> <p>本基金投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有投资风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行T+0回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。</p>

注：详见《广发恒生科技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	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.10%	基金托管人
销售服务费	0.10%	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。	相关服务机构

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) 境外投资风险
 - 1) 境外市场风险
 - 2) 引入境外托管人的相关风险
 - 3) 汇率风险
 - 4) 政治风险
 - 5) 法律和政府管制风险
 - 6) 会计核算风险
 - 7) 税务风险
 - 8) 证券借贷、正回购 / 逆回购风险
 - 9) 境外证券投资额度限制引致的风险

(2) 通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港市场股票的风险

若本基金通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港市场股票,本基金还将面临以下特有风险,包括但不限于:

1) 港股通制度下对公司行为的处理规则带来的风险。本基金因所持香港证券市场股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况,所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券,只能通过港股通卖出,但不得买入;因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在联交所上市的,可以通过港股通卖出,但不得行权;因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券,可以享有相关权益,但不得通过港股通买入或卖出。本基金存在因上述规则,利益得不到最大化甚至受损的风险。

2) 交易失败及交易中断的风险。在内地与香港股票市场交易互联互通机制下,港股通交易存在每日额度限制,本基金可能面临每日额度不足而交易失败的风险。若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障,可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险。

3) 结算风险。香港结算机构可能因极端情况存在无法交付证券和资金的结算风险;另外港股通境内结算实施分级结算原则,本基金可能面临以下风险:因结算参与人未完成与中国结算的集中交收,导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置;结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金;结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误导致本基金权益受损;其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

(3) 指数投资相关的风险

- 1) 标的指数波动的风险
- 2) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险
- 3) 成份股权重较大的风险
- 4) 成份股停牌的风险
- 5) 标的指数变更的风险
- 6) 指数编制机构停止服务的风险
- 7) 跟踪误差控制未达约定目标的风险
- 8) 指数成份股发生负面事件面临退市时的应对风险
- 9) 投资于目标 ETF 的风险

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。

(4) 基金合同直接终止的风险

连续五十个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万

元人民币情形的，基金管理人应当终止基金合同，并按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。

(5) 衍生品投资风险

(6) 投资科创板股票的风险

2、市场风险

3、开放式基金风险

(1) 流动性风险；(2) 管理风险；(3) 大额赎回风险；(4) 操作风险；(5) 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。

4、其他风险

(二) 重要提示

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) 《广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）基金合同》
- (2) 《广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）托管协议》
- (3) 《广发恒生科技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