

广发基金管理有限公司

关于旗下部分基金标的指数纳入北京证券交易所股票并修订招募说明书的公告

根据中证指数有限公司相关指数成份股的定期调整情况，广发基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下部分基金标的指数纳入北京证券交易所股票。根据相关法律法规、基金合同等有关规定，本公司决定对旗下部分基金的招募说明书进行修订。现将具体情况公告如下：

一、涉及基金名单

| 基金主代码 | 基金名称 | 场内简称 |
|--------|------------------------------------|--------------|
| 004854 | 广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金 | - |
| 021397 | 广发中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金 | - |
| 159512 | 广发中证全指汽车交易型开放式指数证券投资基金 | 汽车 ETF |
| 159527 | 广发中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金 | 云计算 50ETF |

二、招募说明书的修订

根据相关指数成份股的定期调整情况，本公司将更新上述基金招募说明书相关内容，此次修订的非 ETF 基金主要涉及更新标的指数的相关内容，ETF 基金主要涉及调整申购赎回现金替代的相关内容，并针对上述基金补充标的指数成份股调整后基金投资北京证券交易所股票的投资风险揭示，主要修订内容详见附件。上述修订内容自 2025 年 6 月 16 日起生效。投资者欲全面了解具体修订详情，请查阅更新的招募说明书。

三、其他需要提示的事项

1. 上述修改事项对原基金份额持有人的利益无实质性不利影响，无需召开基

金份额持有人大会。投资者欲了解上述基金详细信息，请仔细阅读上述基金的基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等法律文件。

2. 投资者可以致电本公司的客户服务电话（95105828 或 020-83936999）、登录本公司网站（www.gffunds.com.cn）咨询相关信息。

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、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。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。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。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2025年6月14日

附件：《招募说明书主要修订内容前后对照表》

一、《广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金更新的招募说明书》主要修订对照表

| 章节 | 原文条款内容 | 修改后条款内容 |
|---------------|--|--|
| 重要提示 | <p>.....</p> <p>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。</p> <p>3、本基金的标的指数为中证全指汽车指数。中证全指汽车指数<u>选取中证全指样本股中的汽车行业股票组成，以反映该行业股票的整体表现。</u></p> <p style="padding-left: 2em;">(1) 指数样本空间</p> <p style="padding-left: 2em;"><u>指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、*ST 沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成：</u></p> <p style="padding-left: 4em;">1) <u>科创板证券：上市时间超过一年。</u></p> <p style="padding-left: 4em;">2) <u>其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。</u></p> <p style="padding-left: 2em;">(2) 选择方法</p> <p style="padding-left: 4em;">1) <u>将样本空间证券按中证行业分类方法分类；</u></p> <p style="padding-left: 4em;">2) <u>如果行业内证券数量少于或等于 50 只，则全部证券作为相应全指行业指数的样本；</u></p> <p style="padding-left: 4em;">3) <u>如果行业内证券数量多于 50 只，则分别按照证券的日均成交金额、日均总市值由高到低排名，剔除成交金额排名后 10%、以及累积总市值占比达到 98%以后的证券，并且保持剔除后证券数量不少于 50 只；行业内剩余证券作为相应行业指数的样本。</u></p> <p style="padding-left: 2em;">有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：http://www.csindex.com.cn</p> <p>.....</p> | <p>.....</p> <p>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。</p> <p>3、本基金的标的指数为中证全指汽车指数。中证全指汽车指数<u>从中证全指指数中选取与汽车主题相对应的上市公司证券作为指数样本，以反映该主题上市公司证券</u>的整体表现。</p> <p style="padding-left: 2em;">(1) 指数样本空间</p> <p style="padding-left: 2em;"><u>同中证全指指数的样本空间。</u></p> <p style="padding-left: 2em;">(2) 选择方法</p> <p style="padding-left: 4em;"><u>1)对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，选取主营业务涉及整车制造、零部件制造和其他与汽车主题相关的上市公司证券作为待选样本；</u></p> <p style="padding-left: 4em;"><u>2)在上述待选样本中，优先按照过去一年日均总市值从高到低纳入整车制造企业；若样本不足 50 只，再按照过去一年日均总市值由高到低纳入汽车零部件企业，直到补齐 50 只样本。</u></p> <p style="padding-left: 2em;">有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：http://www.csindex.com.cn</p> <p>.....</p> |
| 第十七部分 风险揭示 | <p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>9、投资存托凭证的风险</p> | <p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>9、投资存托凭证的风险</p> |

| | |
|--|--|
| <p>本基金投资存托凭证，可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。除价格波动风险外，本基金还将面临存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。</p> <p><u>10、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</u></p> <p>.....</p> | <p>本基金投资存托凭证，可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。除价格波动风险外，本基金还将面临存托凭证发行机制相关的风险，包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人的股东在法律地位、享有权利等方面存在差异可能引发的风险；存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。</p> <p><u>10、投资北交所股票的风险</u></p> <p><u>本基金标的指数成份股可能包含北京证券交易所股票。北京证券交易所在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所股票，可能面临的风险包括但不限于：</u></p> <p><u>①中小企业经营风险</u></p> <p><u>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。</u></p> <p><u>②股价大幅波动风险</u></p> <p><u>北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u></p> <p><u>③企业退市风险</u></p> <p><u>根据北京证券交易所退市制度，上市</u></p> |
|--|--|

| | | |
|--|--|--|
| | | <p><u>企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</u></p> <p><u>④流动性风险</u> 北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</p> <p><u>⑤监管规则变化的风险</u> 北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。</p> <p>11、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</p> |
|--|--|--|

二、《广发中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金更新的招募说明书》主要修订对照表

| 章节 | 原文条款内容 | 修改后条款内容 |
|------|---|---|
| 重要提示 | <p>.....</p> <p>本基金为指数基金，其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数成份股行业集中风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、成份股权重较大的风险、成份股停牌的风险、指数成份股发生负面事件面临退市时的应对风险、指数编制机构停止服务的风险、标的指数值计算出错的风险、投资于目标 ETF 的风</p> | <p>.....</p> <p>本基金为指数基金，其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数成份股行业集中风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、成份股权重较大的风险、成份股停牌的风险、指数成份股发生负面事件面临退市时的应对风险、指数编制机构停止服务的风险、标的指数值计算出错的风险、</p> |

| | | |
|-------------------|--|---|
| | <p>险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险、由目标 ETF 的联接基金变更为直接投资目标 ETF 标的指数成份股的指数基金的风险等。除此之外，本基金还面临投资特定品种（包括股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、存托凭证、参与转融通证券出借业务等）的特有风险。</p> <p>.....</p> <p>3、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证云计算与大数据主题指数（指数代码：930851）。中证云计算与大数据主题指数从沪深市场中选取 50 只业务涉及提供云计算服务、大数据服务以及上述服务相关硬件设备的上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场云计算与大数据主题上市公司证券的整体表现。</p> <p>.....</p> | <p>投资于目标 ETF 的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险、由目标 ETF 的联接基金变更为直接投资目标 ETF 标的指数成份股的指数基金的风险等。除此之外，本基金还面临投资特定品种（包括股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、存托凭证、参与转融通证券出借业务、北交所股票等）的特有风险。</p> <p>.....</p> <p>3、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证云计算与大数据主题指数（指数代码：930851）。中证云计算与大数据主题指数选取 50 只业务涉及提供云计算服务、大数据服务以及上述服务相关硬件设备的上市公司证券作为指数样本，以反映云计算与大数据主题上市公司证券的整体表现。</p> <p>.....</p> |
| <p>第十八部份 风险揭示</p> | <p>.....</p> <p>7、本基金特有风险</p> <p>.....</p> <p>（8）投资股票期权的风险</p> <p>本基金投资股票期权可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、股票期权价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。</p> <p>（9）本基金基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于 2 亿元人民币，基金合同自动终止。投资者将面临触及上述事件导致基金合同终止的风险。</p> <p>.....</p> | <p>.....</p> <p>7、本基金特有风险</p> <p>.....</p> <p>（8）投资股票期权的风险</p> <p>本基金投资股票期权可能给本基金带来额外风险，包括杠杆风险、股票期权价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等，由此可能增加本基金净值的波动性。</p> <p>（9）投资北交所股票的风险</p> <p>本基金标的指数成份股可能包含北京证券交易所股票。北京证券交易所在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所股票，可能面临的风险包括但不限于：</p> <p>①中小企业经营风险</p> <p>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小</p> |

| | | |
|--|--|--|
| | | <p>企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。</p> <p>②股价大幅波动风险 北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</p> <p>③企业退市风险 根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>④流动性风险 北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</p> <p>⑤监管规则变化的风险 北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。（新增）</p> <p>（10）本基金基金合同生效满三年之日，若基金资产净值低于 2 亿元人民币，基金合同自动终止。投资者将面临触及上述事件导致基金合同终止的风险。</p> <p>.....</p> |
|--|--|--|

三、《广发中证全指汽车交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书》

主要修订对照表

| 章节 | 原文条款内容 | 修改后条款内容 |
|-------------------------------|--|---|
| <p>重要提示</p> | <p>.....</p> <p>同时，由于本基金是交易型开放式指数基金，特定风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数成份股行业集中风险、成份股权重较大的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、标的指数数值计算出错的风险、成份股停牌的风险、指数成份股发生负面事件面临退市时的应对风险、指数编制机构停止服务的风险、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、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置风险、沪市成份证券申赎处理规则带来的风险、申购赎回的代理买卖风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、第三方机构服务的风险、参与转融通证券出借业务的风险等。除此之外，本基金还面临投资特定品种（包括股指期货、期权、资产支持证券、存托凭证等）的特有风险。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。</p> <p>.....</p> | <p>.....</p> <p>同时，由于本基金是交易型开放式指数基金，特定风险包括：标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、标的指数成份股行业集中风险、成份股权重较大的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数变更的风险、标的指数数值计算出错的风险、成份股停牌的风险、指数成份股发生负面事件面临退市时的应对风险、指数编制机构停止服务的风险、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、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、申购赎回清单差错风险、申购赎回清单标识设置风险、沪市成份证券申赎处理规则带来的风险、申购赎回的代理买卖风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、第三方机构服务的风险、参与转融通证券出借业务的风险等。除此之外，本基金还面临投资特定品种（包括股指期货、期权、资产支持证券、存托凭证、北交所股票等）的特有风险。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。</p> <p>.....</p> |
| <p>第十部分 基金份额的申购与赎回</p> | <p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p> <p>T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。</p> <p>.....</p> <p>4、现金替代相关内容</p> | <p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p> <p>T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。</p> <p>.....</p> <p>4、现金替代相关内容</p> |

| | | |
|--|---|--|
| | <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>A. 现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。</p> <p>对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。</p> <p>对于沪市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。</p> <p>当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>当可以现金替代适用于上交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。</p> <p>B. 可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和沪市成份证券。</p> <p>【1】对于深市成份证券</p> <p>【2】对于沪市成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的沪市成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的沪市成份证券全部用</p> | <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>A. 现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。</p> <p>对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。</p> <p>对于非深市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。</p> <p>当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>当可以现金替代适用于非深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。</p> <p>B. 可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和非深市成份证券。</p> <p>【1】对于深市成份证券</p> <p>【2】对于非深市成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的非深市成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的非深市成份证券全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的非深市成份证券，替代金额的计算公式为：</p> |
|--|---|--|

| | | |
|-----------------------|--|--|
| | <p>现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>沪市</u>成份证券，替代金额的计算公式为：</p> <p>申购替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1+现金替代溢价比例）</p> <p>赎回替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1-现金替代折价比例）</p> <p>其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果<u>上海证券交易所</u>参考价格确定原则发生变化，以<u>上海证券交易所</u>通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>上交所</u>连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>上交所</u>申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，<u>上海</u>证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> | <p>申购替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1+现金替代溢价比例）</p> <p>赎回替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1-现金替代折价比例）</p> <p>其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果<u>该证券上市所在交易所</u>参考价格确定原则发生变化，以<u>该证券交易所</u>通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>该证券上市所在交易所</u>连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>该交易所</u>申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，<u>该证券上市所在</u>证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> |
| <p>第十九部分 风险揭示</p> | <p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>7、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p>(14) <u>沪市</u>成份证券申赎处理规则带来的风险</p> <p>对“可以现金替代”的<u>沪市</u>成份证</p> | <p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>7、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p>(14) <u>非深市</u>成份证券申赎处理规则带来的风险</p> <p>对“可以现金替代”的<u>非深市</u>成份证</p> |

| | |
|---|--|
| <p>券的处理，由于采取基金管理人代买代卖模式，可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性。这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场价格的折溢价水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则，投资者的利益可能受到影响。</p> <p>.....</p> <p>(17) 本基金投资特定品种的特有风险</p> <p>.....</p> | <p>券的处理，由于采取基金管理人代买代卖模式，可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性。这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场价格的折溢价水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则，投资者的利益可能受到影响。</p> <p>.....</p> <p>(17) 本基金投资特定品种的特有风险</p> <p>.....</p> <p>5) 投资北交所股票的风险</p> <p><u>本基金标的指数成份股可能包含北京证券交易所股票。北京证券交易所在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所股票，可能面临的风险包括但不限于：</u></p> <p>①中小企业经营风险</p> <p><u>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。</u></p> <p>②股价大幅波动风险</p> <p><u>北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u></p> <p>③企业退市风险</p> <p><u>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能</u></p> |
|---|--|

| | | |
|--|--|--|
| | | <p><u>退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</u></p> <p>④流动性风险 <u>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</u></p> <p>⑤监管规则变化的风险 <u>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。</u></p> <p>.....</p> |
|--|--|--|

四、《广发中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书》主要修订对照表

| 章节 | 原文条款内容 | 修改后条款内容 |
|------|--|---|
| 重要提示 | <p>.....</p> <p>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，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。同时由于本基金是交</p> | <p>.....</p> <p>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，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。同时由于本基金是交易型开放式指数</p> |

| | | |
|---|--|---|
| | <p>易型开放式指数基金，特定风险还包括：标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、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、基金份额赎回对价的变现风险、投资特定品种（包括股指期货、股票期权、资产支持证券、存托凭证等）的特有风险、参与转融通证券出借业务的风险等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。</p> <p>……</p> | <p>基金，特定风险还包括：标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、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、基金份额赎回对价的变现风险、投资特定品种（包括股指期货、股票期权、资产支持证券、存托凭证、北交所股票等）的特有风险、参与转融通证券出借业务的风险等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。……</p> |
| <p>第十部分 基金份额 的申购与 赎回</p> | <p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p> <p>T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。</p> <p>……</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>A. 现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。</p> <p>对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。</p> <p>对于沪市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。</p> <p>当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或</p> | <p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p> <p>T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。</p> <p>……</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>A. 现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。</p> <p>对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。</p> <p>对于非深市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。</p> <p>当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该</p> |

| | |
|--|---|
| <p>部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>当可以现金替代适用于<u>上交所</u>上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。</p> <p>B.可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和<u>沪市</u>成份证券。</p> <p>【1】对于深市成份证券</p> <p>【2】对于<u>沪市</u>成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<u>沪市</u>成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的<u>沪市</u>成份证券全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>沪市</u>成份证券，替代金额的计算公式为： $\text{申购替代金额} = \text{替代证券数量} \times \text{该证券开盘参考价格} \times (1 + \text{现金替代溢价比例})$ $\text{赎回替代金额} = \text{替代证券数量} \times \text{该证券开盘参考价格} \times (1 - \text{现金替代折价比例})$ 其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果<u>上海证券交易所</u>参考价格确定原则发生变化，以上<u>上海证券交易所</u>通知规定的参考价格为准。 </p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>上交所</u>连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>上交所</u>申报被替代证券的交易指令。 </p> <p>特例情况：若自 T 日起，<u>上海证券交易所</u>正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申</p> | <p>成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>当可以现金替代适用于<u>非深交所</u>上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。</p> <p>B.可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：深市成份证券和<u>非深市</u>成份证券。</p> <p>【1】对于深市成份证券</p> <p>【2】对于<u>非深市</u>成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<u>非深市</u>成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的<u>非深市</u>成份证券全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>非深市</u>成份证券，替代金额的计算公式为： $\text{申购替代金额} = \text{替代证券数量} \times \text{该证券开盘参考价格} \times (1 + \text{现金替代溢价比例})$ $\text{赎回替代金额} = \text{替代证券数量} \times \text{该证券开盘参考价格} \times (1 - \text{现金替代折价比例})$ 其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果<u>该证券上市所在交易所</u>参考价格确定原则发生变化，以<u>该交易所</u>通知规定的参考价格为准。 </p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>该证券上市所在交易所</u>连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>该交易所</u>申报被替代证券的交易指令。 </p> <p>特例情况：若自 T 日起，<u>该证券上市所在交易所</u>正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最</p> |
|--|---|

| | | |
|---------------------------|---|--|
| | <p>购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> <p>.....</p> | <p>近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> <p>.....</p> |
| <p>第十一部分 基金的投资</p> | <p>四、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证云计算与大数据主题指数（指数代码：930851）。中证云计算与大数据主题指数从<u>沪深市场</u>中选取 50 只业务涉及提供云计算服务、大数据服务以及上述服务相关硬件设备的上市公司证券作为指数样本，以反映<u>沪深市场</u>云计算与大数据主题上市公司证券的整体表现。</p> <p>.....</p> | <p>四、标的指数</p> <p>本基金的标的指数为中证云计算与大数据主题指数（指数代码：930851）。中证云计算与大数据主题指数选取 50 只业务涉及提供云计算服务、大数据服务以及上述服务相关硬件设备的上市公司证券作为指数样本，以反映云计算与大数据主题上市公司证券的整体表现。</p> <p>.....</p> |
| <p>第十九部分 风险提示</p> | <p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>7、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p>（21）<u>沪市</u>成份证券申赎处理规则带来的风险</p> <p>对“可以现金替代”的<u>沪市</u>成份证券的处理，由于采取基金管理人代买代卖模式，可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性。这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场价格的折溢价水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则，投资者的利益可能受到影响。</p> <p>.....</p> <p>（25）本基金投资特定品种的特有风险</p> <p>.....</p> | <p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>7、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p>（21）<u>非深市</u>成份证券申赎处理规则带来的风险</p> <p>对“可以现金替代”的<u>非深市</u>成份证券的处理，由于采取基金管理人代买代卖模式，可能给投资者申购和赎回带来价格的不确定性。这种价格的不确定性可能影响本基金二级市场价格的折溢价水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格和基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则，投资者的利益可能受到影响。</p> <p>.....</p> <p>（25）本基金投资特定品种的特有风险</p> <p>.....</p> <p>5) 投资北交所股票的风险</p> |

| | | |
|--|--|---|
| | | <p><u>本基金标的指数成份股可能包含北京证券交易所股票。北京证券交易所在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所股票，可能面临的风险包括但不限于：</u></p> <p><u>①中小企业经营风险</u></p> <p><u>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。</u></p> <p><u>②股价大幅波动风险</u></p> <p><u>北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u></p> <p><u>③企业退市风险</u></p> <p><u>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</u></p> <p><u>④流动性风险</u></p> <p><u>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</u></p> <p><u>⑤监管规则变化的风险</u></p> <p><u>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能</u></p> |
|--|--|---|

| | | |
|--|--|--|
| | | <p>根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。</p> <p>.....</p> |
|--|--|--|