

广发纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新

编制日期：2021年8月21日
送出日期：2021年8月25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 | 基金代码 | 159941 |
| 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 中国银行纽约分行 |
| 境外投资顾问 | - | 境外托管人 | BANK OF CHINA NEW YORK BRANCH |
| 基金合同生效日 | 2015-06-10 | 上市交易所及上市日期 | 深圳证券交易所 2015-07-13 |
| 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 | 2018-08-06 |
| | | 证券从业日期 | 2004-07-02 |
| 其他 | 本基金基金合同生效后，连续二十个工作日出现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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续六十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报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。法律法规或监管部门另有规定的，按其规定办理。 | | |
| 扩位简称 | 纳指 ETF | | |

二、基金投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

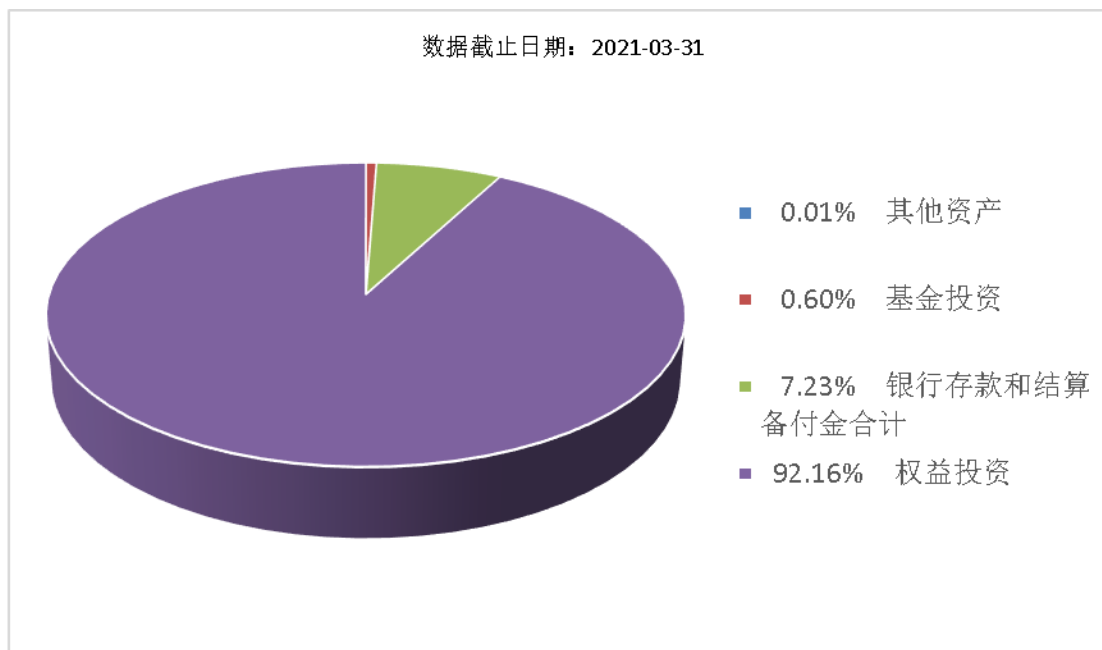
| | |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 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。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股、境外交易的跟踪同一标的指数的公募基金（包括ETF）、依法发行或上市的其他股票、固定收益类资产、银行存款、货币市场工具、股指期货等金融衍生品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。本基金的标的指数为纳斯达克100指数（Nasdaq-100 Index）。 在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股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%。 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。 |
| 主要投资策略 | 本基金力求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年跟踪误差不超过2%。具体包括：1、权益类投资策略；2、固定收益投资策略；3、衍生品投资策略。 |

| | |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------|
| 业绩比较基准 | 汇率调整后的纳斯达克100指数 (Nasdaq-100 Index) 收益率 |
| 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。 |

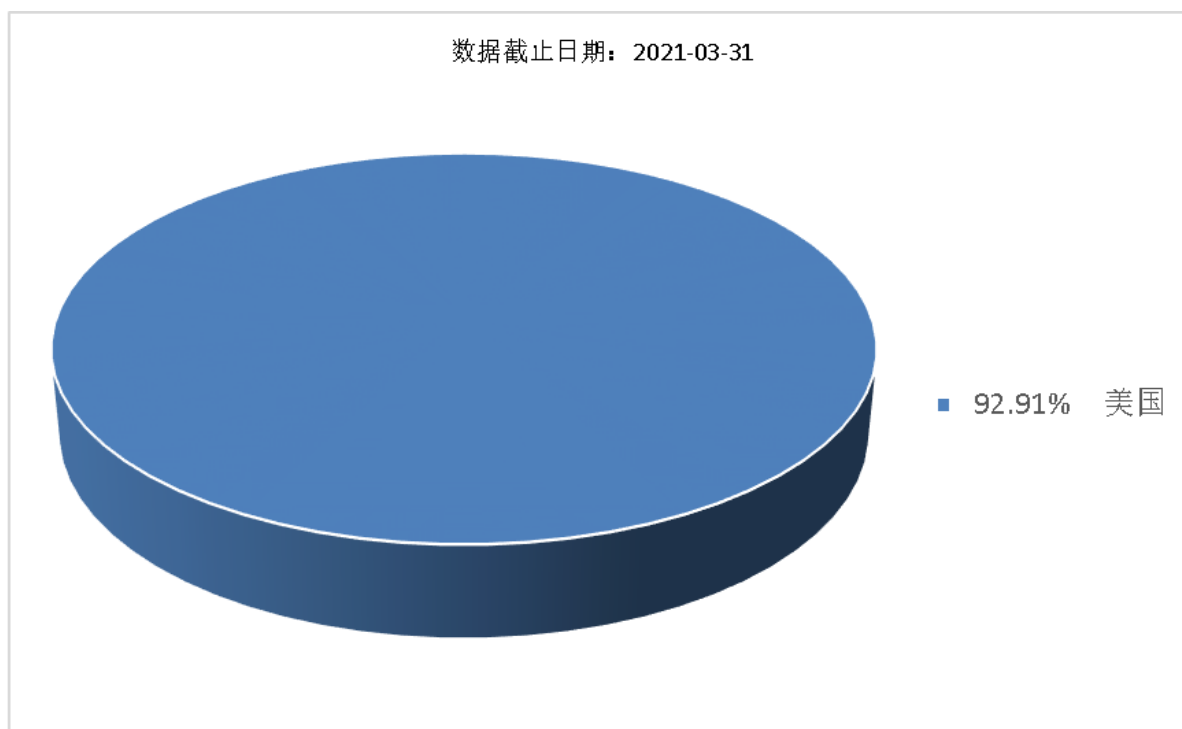
注：详见《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

(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



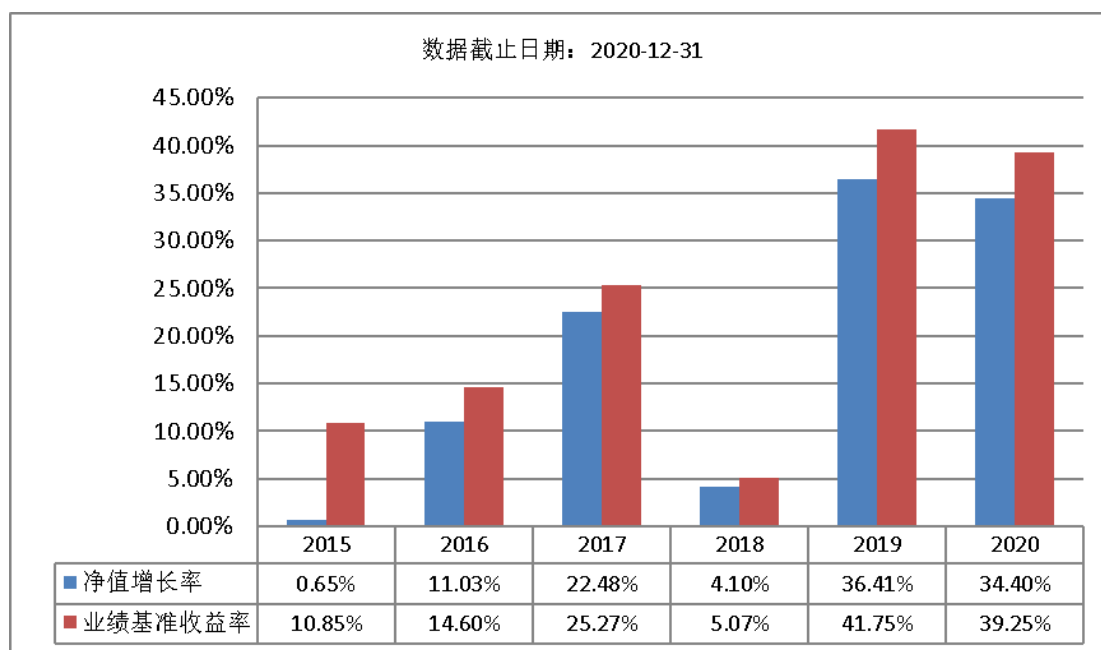
区域配置图表



注：1、区域配置图数据取自定期报告的“报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布”。

2、各国家（地区）投资分布比重为占基金资产净值比例。

(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



注：1、本基金成立当年按实际存续期计算，未按自然年度折算。

2、基金的过往业绩不代表未来表现。

三、投资本基金涉及的费用

(一) 基金销售相关费用

1、场内交易费用以证券公司实际收取为准；

2、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、登记结算机构等收取的相关费用。

(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 |
|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 管理费 | 0.80% |
| 托管费 | 0.25% |
| 其他费用 | 本基金费用包括基金指数许可使用费，指数许可使用费的费率、收取下限、具体计算方法及支付方式等内容请参见招募说明书。 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、律师费、诉讼费、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等费用，和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。 |

注： 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。

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) 标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险：标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

(2) 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。

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险：由于标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；由于标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；标的指数成份股派发现金红利将导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度；由于成份股停牌、摘牌或流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；由于基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费和托管费的存在，使基金投资组合与标的指数产生跟踪偏离度与跟踪误差；在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度；其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

(4) 标的指数变更的风险：尽管可能性很小，但根据基金合同规定，如出现变更标的指数的情形，本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资政策将会改变，投资组合将随之调整，基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致，投资人须承担此项调整带来的风险与成本。

(5) 基金管理人代理申赎投资人买券卖券的风险：因涉及境外市场股票的买卖，在投资人申购、赎回本基金时，本基金组合证券中全部或部分证券需以一定数量的现金进行现金替代，并由基金管理人按照招募说明书的规定代理申赎投资人进行相关证券买卖，投资人需承受买入证券的结算成本和卖出证券的结算金额的不确定性（含汇率波动风险）。

(6) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险：尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内，但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响，存在不同于基金份额净值的情形，即存在价格折溢价的风险。

(7) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险：基金管理人或者基金管理人委托中证指数有限公司计算基金份额参考净值（IOPV），并由深圳证券交易所交易时间发布，供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，IOPV 计算可能出现错误，投资人若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资人自行承担后果。

(8) 退市风险：因本基金不再符合证券交易所上市条件被终止上市，或被基金份额持有人大会决议提前终止上市，导致基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

(9) 投资人申购失败的风险：如果投资人申购时未能提供符合要求的申购对价，或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资人的申购申请，则投资人的申购申请失败。此外，如果基金可用的外汇额度不足，申购赎回代理券商应付资金不足或出现违约，投资人的申购申请也可能失败。

(10) 投资人赎回失败的风险：在投资人提交赎回申请时，如本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，可能导致出现赎回失败的情形。另外，基金管理人可能根据成份股市值规模变化等因素调整最小申购赎回单位，由此可能导致投资人按原最小申购赎回单位申购并持有的基金份额，可能无法按照新的最小申购赎回单位全部赎回，而只能在二级市场卖出全部或部分基金份额。

(11) 第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理，存在以下风险：1) 受多种因素影响，申购赎回代理券商代理申购、赎回业务可能受到限制、暂停或终止，从而影响投资人申购、赎回。2) 登记结算机构可能调整结算制度，从而对投资人基金份额、资金等的结算方式发生变化，制度调整可能给投资人带来理解偏差的风险。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。3) 证券交易所、期货交易所、证券与期货登记结算机构、申购赎回代理券商、基金托管人及其他代理机构可能违约，导致基金或投资人利益受损的风险。

(12) 本基金的特定风险还包括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、成份券停牌或违约的风险等。

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) 管理风险；(2) 职业道德风险；(3) 合规性风险；(4) 流动性风险等。

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) 《广发纳斯达克 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (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