

广发上海清算所0-4年央企80债券指数证券投资基金 (广发央企80债券指数C) 基金产品资料概要更新

编制日期：2024年6月19日

送出日期：2024年6月24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 | 广发央企80债券指数 | 基金代码 | 008482 |
| 下属基金简称 | 广发央企80债券指数C | 下属基金代码 | 008483 |
| 基金管理人 | 广发基金管理有限公司 | 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 基金合同生效日 | 2020-04-29 | | |
| 基金类型 | 债券型 | 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 | 洪志 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2022-07-11 |
| | | 证券从业日期 | 2013-06-27 |
| 其他 | 《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，基金管理人应在定期报告中予以披露；连续五十个工作日出现前述情形的，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。 | | |

注：本基金自2024年1月3日起增设D类份额。

二、基金投资与净值表现

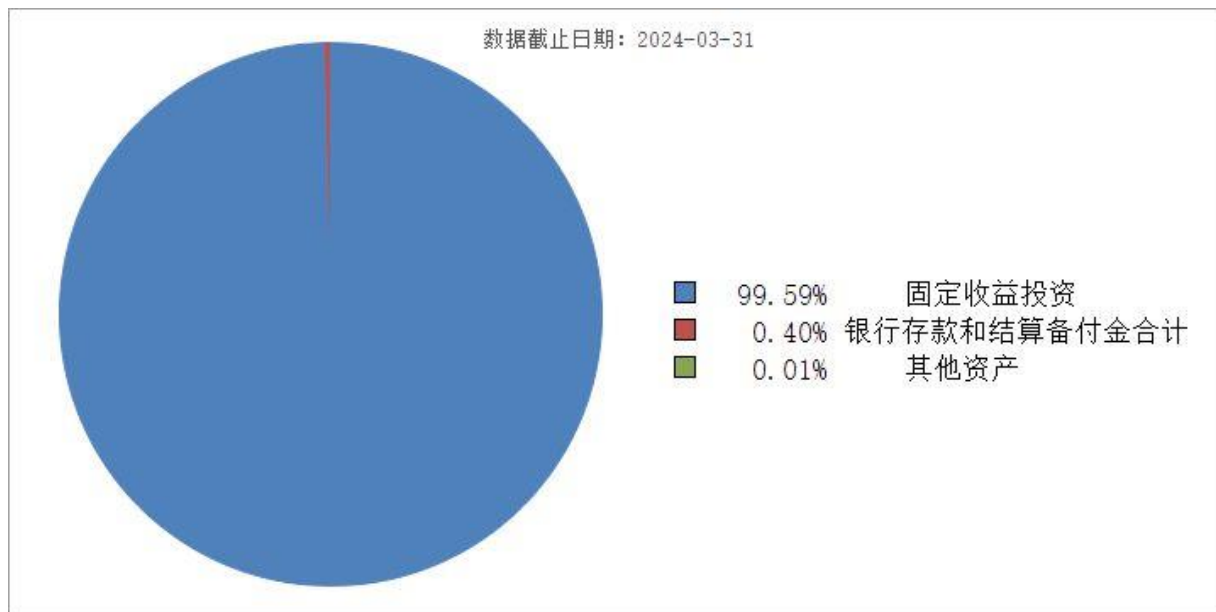
(一) 投资目标与投资策略

| | |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。在正常市场情况下，本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.50%，将年化跟踪误差控制在2%以内。 |
| 投资范围 | 本基金主要投资于标的指数（上海清算所0-4年央企80债券指数）成份券及备选成份券，为更好实现投资目标，还可以投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的债券（含国债、央行票据、金融债、地方政府债、企业债、公司债、短期融资券、超级短期融资券、中期票据、资产支持证券、次级债、可转债、可分离交易可转债、可交换债）、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具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。 |

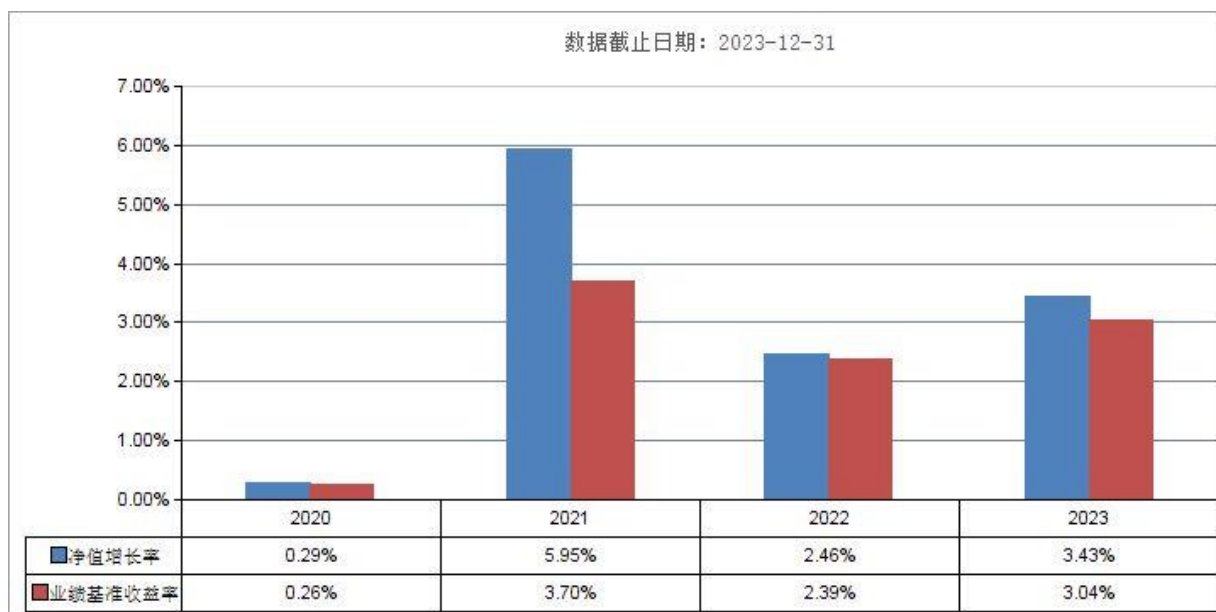
| | |
|--------|--|
| | <p>本基金为债券指数基金，本基金不投资于标的指数成份券发行主体之外的主体发行的信用债券。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，其中标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的80%；本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>上海清算所0-4年央企80债券指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金为债券型指数基金，其预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。</p> |

注：详见《广发上海清算所0-4年央企80债券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



(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、本基金份额成立当年（2020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

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 C 类 份额无申购 费 |
| 赎回费 | $N < 7$ 日 | 1.50% | |
| | $7 \text{ 日} \leq N < 30$ 日 | 0.10% | |
| | $N \geq 30$ 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 | 0.15% | 基金管理人、销售机构 |
| 托管费 | 0.05% | 基金托管人 |
| 销售服务费 | 0.10% | 销售机构 |
| 审计费用 | 51,000.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 规定披露报刊 |
| 指数许可使用费 | 年费率 0.01%，具体收费方式详见《招募说明书》 或其更新。 | 指数编制公司 |

| | | |
|------|---|--------|
| 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。
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）。

（三）基金运作综合费用测算

若投资者认购/申购本基金份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

| |
|--------------|
| 基金运作综合费率（年化） |
| 0.32% |

注：基金管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为基金现行费率，其他运作费用以最近一次基金年报披露的相关数据为基准测算。

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）指数化投资相关的风险：包括标的指数下跌的风险、标的指数计算出错的风险及标的指数变更的风险。

（2）基金跟踪偏离风险：基金在跟踪标的指数时由于各种原因导致基金的业绩表现与标的指数表现之间可能产生差异。

（3）本基金面临特定情形下提前终止风险：本基金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 5,000 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。

（4）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、市场风险：证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险。

3、证券投资基金所共有的管理风险、职业道德风险、合规性风险、流动性风险、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) 《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金基金合同》
- (2) 《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券指数证券投资基金托管协议》
- (3) 《广发上海清算所 0-4 年央企 80 债券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