

广发上证AAA科技创新公司债交易型开放式指数证券 投资基金基金产品资料概要

编制日期：2025年7月2日
送出日期：2025年7月3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	广发上证 AAA 科技创新公司债 ETF	基金代码	511120
基金管理人	广发基金管理有限公司	基金托管人	国金证券股份有限公司
基金合同生效日	-	上市交易所及上市日期	上海证券交易所（暂未上市）
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	-
		证券从业日期	2013-06-27
其他	《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 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并 6 个月内召集基金份额持有人大会。 法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。 未来若出现标的指数不符合要求（因成份券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，基金合同终止。		
场内简称	科创债基		
扩位简称	科创债 ETF 广发		

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。
------	---

投资范围	本基金主要投资于标的指数（上证AAA科技创新公司债指数）成份券、备选成份券。本基金还可投资于其他债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、政府支持债券、政府支持机构债券、可分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购、信用衍生品、国债期货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的相关规定）。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，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。 在建仓完成后，本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份券和备选成份券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国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。 如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人在履行适当程序后，对本基金的投资比例做出相应调整。
主要投资策略	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，以实现对标的有效跟踪。 在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%，年化跟踪误差不超过2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过了上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪误差进一步扩大。 本基金投资国债期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，力争提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。 本基金若投资信用衍生品，将按照风险管理的原则，以风险对冲为目的，并遵守证券交易所或银行间市场的相关规定。管理人将结合根据所持标的债券等固定收益品种的投资策略，合理评估信用衍生品的价格和流动性，确定投资金额、期限、风险敞口等。管理人将加强交易对手方、创设机构的风险管理，合理分散交易对手方、创设机构的集中度，对交易对手方、创设机构的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理。 未来，随着市场的发展和基金管理运作的需要，基金管理人可以在不改变投资目标的前提下，遵循法律法规的规定，相应调整或更新投资策略，并在履行适当程序后在招募说明书更新中披露。
业绩比较基准	上证AAA科技创新公司债指数同期收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金，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。 本基金为指数型基金，主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

注：详见《广发上证AAA科技创新公司债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

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
认购费	$S < 50 \text{ 万份}$	0.30%	
	$50 \text{ 万份} \leq S < 100 \text{ 万份}$	0.15%	
	$S \geq 100 \text{ 万份}$	500 元/笔	

注：1、基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用，基金管理人办理网下债券认购时可不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下债券认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金；

2、场内交易费用以证券公司实际收取为准；

3、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0.50%的标准收取佣金。

(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
审计费用	—	会计师事务所
信息披露费	—	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： 本基金交易证券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、本基金特有风险

(1) 标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险

(2) 标的指数波动的风险

- (3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险
- (4) 标的指数变更的风险
- (5) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险
- (6) 参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险
- (7) 退市风险
- (8) 投资者申购失败的风险
- (9) 投资者赎回失败的风险
- (10) 申购和赎回限额的风险
- (11) 基金份额赎回对价的变现风险
- (12) 第三方机构服务的风险
- (13) 投资国债期货的风险
- (14) 成份券违约的风险
- (15) 成份券停牌的风险
- (16) 本基金可能投资信用衍生品, 信用衍生品的投资可能面临流动性风险、偿付风险以及价格波动风险。
- (17) 本基金主要投资于科技创新公司债券, 可能面临因政府政策变化、行业景气度变化等影响因素所带来的风险。

2、开放式基金的共有风险

(1) 市场风险; (2) 管理风险; (3) 职业道德风险; (4) 合规性风险; (5) 流动性风险; (6) 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。

3、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) 《广发上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (2) 《广发上证 AAA 科技创新公司债交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (3) 《广发上证 AAA 科技创新公司债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