

广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金（LOF）（广发恒生中型股指数（LOF）E）基金产品资料概要更新

编制日期：2023年4月7日

送出日期：2023年4月12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 | 广发恒生中型股指数（LOF） | 基金代码 | 501303 |
| 下属基金简称 | 广发恒生中型股指数（LOF）E | 下属基金代码 | 018238 |
| 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 |
| 基金合同生效日 | 2017-09-21 | | |
| 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 |
| | 姚曦 | 开始担任本基金基金经理的日期 | 2021-11-17 |
| | | 证券从业日期 | 2015-07-29 |
| 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；连续六十个工作日出现前述情形的，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。 法律法规另有规定时，从其规定。 | | |

注：本基金自2023年4月12日起增设E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 | 本基金采用被动式指数化投资策略，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差的最小化。 |
| 投资范围 | 本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数（恒生综合中型股指数）成份股、备选成份股（含存托凭证）、依法发行上市的其他股票（包括港股通标的和中国证监会核准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、权证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）。 |

| | |
|--------|---|
| | <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。本基金通过港股通投资标的的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。</p> <p>基金的投资组合比例为：投资于港股通标的的股票资产的比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的的指数成份股及其备选成份股的比例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%。</p> |
| 主要投资策略 | <p>本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的的指数，以完全按照标的的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。在正常市场情况下，本基金力争控制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不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。具体策略包括：</p> <p>(1) 股票投资策略；(2) 债券投资策略；(3) 资产支持证券投资策略；(4) 融资及转融通投资策略；(5) 衍生品投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 人民币计价的恒生综合中型股指数收益率×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5% |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金资产投资于港股，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风险，包括港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。</p> |

注：详见《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)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 |
|----------|-------------------------|---------|-------------|
| 申购费(前收费) | - | - | 本基金E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 |
|------|----------|
| 管理费 | 0.50% |
| 托管费 | 0.10% |

| | |
|-------|---|
| 销售服务费 | 0.30% |
| 其他费用 | <p>本基金费用包括基金指数许可使用费（年费率 0.04%），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。</p> <p>《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。</p> |

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、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，主要影响因素可能包括标的指数调整成份股或变更编制方法，标的指数成份股发生配股、增发等行为，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，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，基金管理人的管理能力等。

（3）基金份额二级市场交易价格折溢价的风险：本基金在证券交易所的交易价格可能不同于基金份额净值，从而产生折价或者溢价的情况，虽然基金份额净值反映基金投资组合的资产状况，但是交易价格受到很多因素的影响，比如中国的经济情况、投资人的信心以及本基金的供需情况等。

（4）投资港股通股票存在的风险：包括港股交易失败风险（额度限制、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险）、汇率风险（港币相对于人民币的汇率变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产价值，从而导致基金资产面临潜在风险）、境外市场的风险（受到香港市场宏观经济运行、政策、港股市场机制等影响，如港股市场实行 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）。

（5）投资股指期货等金融衍生品的风险：投资于金融衍生品需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于衍生品通常具有杠杆作用，价格波动比标的资产更为剧烈，有时候需要承担比投资标的资产更高的风险。

（6）基金参与融资与转融通业务的风险：本基金可根据法律法规和基金合同的约定参与融资及转融通业务，可能面临杠杆投资风险和对手方交易风险等融资及转融通业务特有风险。

（7）基金投资流通受限证券的风险：基金投资有明确锁定期的非公开发行股票，按监管机构或行业协会有关规定确定公允价值，故本基金的净值可能由于估值方法的原因偏离所持有股票的收盘价所对应的净值，投资者在二级市场交易或受限申购赎回时，需考虑该估值方式对基金净值的影响。另外，本基金可能由于持有流通受限证券而面临流动性风险以及流通受限期间内证券价格大幅下跌的风险。

（8）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、投资科创板股票的风险

3、投资存托凭证的风险

4、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）流动性风险；（5）合规性风险等。

5、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) 《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- (2) 《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)托管协议》
- (3) 《广发港股通恒生综合中型股指数证券投资基金(LOF)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