

广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）（广发中证医疗ETF联接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	广发中证医疗ETF联接（LOF）	基金代码	502056
下属基金简称	广发中证医疗ETF联接C	下属基金代码	009881
基金管理人	广发基金管理有限公司	基金托管人	北京银行股份有限公司
基金合同生效日	2020-08-26		
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	霍华明	开始担任本基金基金经理的日期	2023-09-15
		证券从业日期	2008-07-01
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。法律法规或监管部门另有规定时，从其规定。		

注：（1）自2020年8月26日起，“广发中证医疗指数分级证券投资基金”正式转型并更名为“广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）”。自2020年8月31日起，广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）恢复场内交易业务。自2023年9月15日起，“广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）”正式转型并更名为“广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）”。

（2）广发中证医疗指数证券投资基金（LOF）自2020年8月26日起增设C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	本基金通过主要投资于目标ETF，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争将日均跟踪偏离度控制在0.35%以内，年跟踪误差控制在4%以内。
投资范围	本基金以目标ETF（广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金）基金份额、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）为主要投资对

象。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括创业板及其他依法发行上市的股票、存托凭证）、国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、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、同业存单、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）、股指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。

本基金可根据相关法律法规的规定参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：投资于目标ETF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股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

主要投资策略

本基金为ETF联接基金，主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪。本基金力争将本基金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控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内。具体投资策略包括：1、资产配置策略；2、目标ETF投资策略；3、股票投资策略；4、债券投资策略；5、可转债投资策略；6、资产支持证券投资策略；7、股指期货投资策略；8、其他投资策略。

业绩比较基准

中证医疗指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%

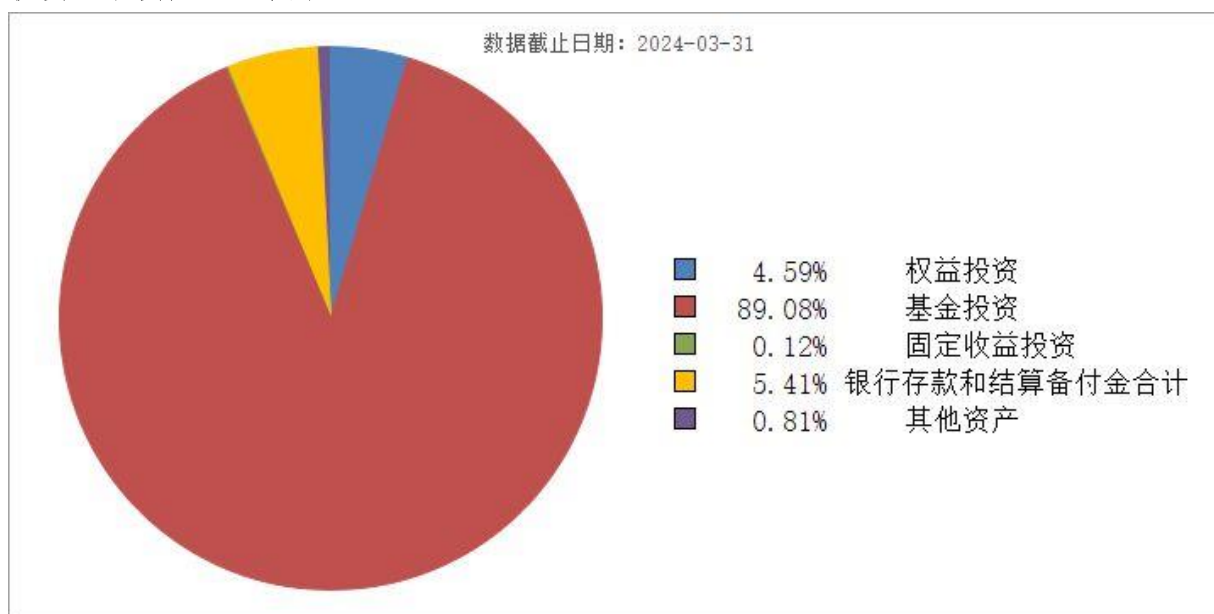
风险收益特征

本基金为ETF联接基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，以跟踪标的指数为投资目标，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《广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

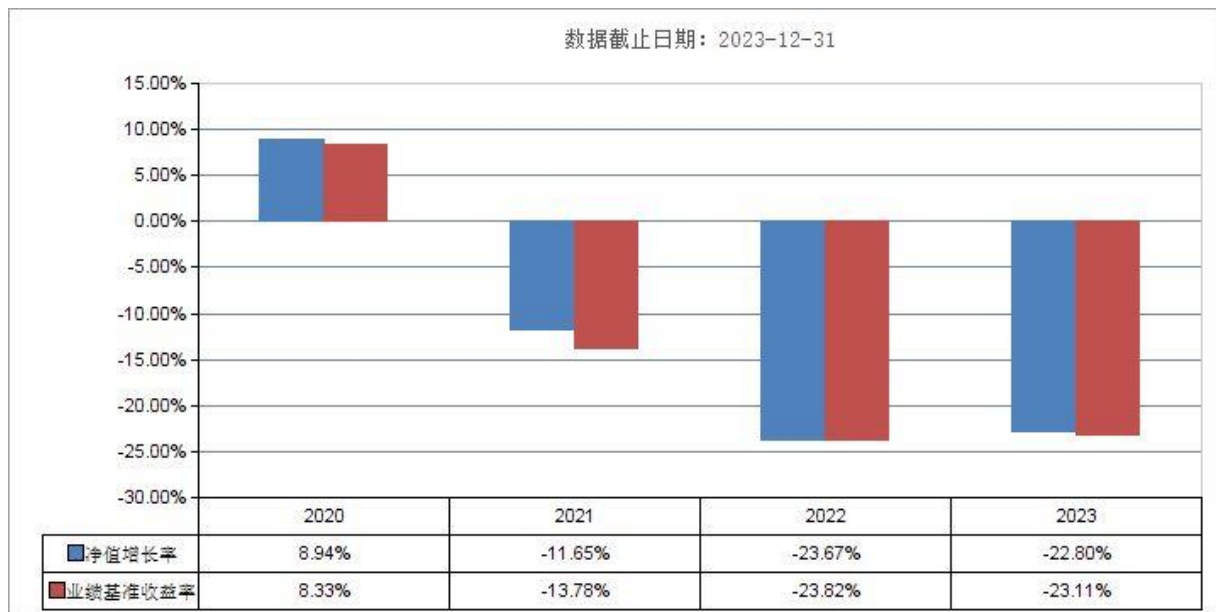
(二) 投资组合资产配置图表/区域配置图表

投资组合资产配置图表



(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%	
	N ≥ 7 日	-	

（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	0.50%	基金管理人、销售机构
托管费	0.15%	基金托管人
销售服务费	0.20%	销售机构
审计费用	72,000.00	会计师事务所
信息披露费	120,000.00	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	相关服务机构

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。

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。
本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费和托管费。
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）
0.87%

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）指数投资相关的风险

1) 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。

2) 基金收益率与业绩比较基准收益率偏离的风险，主要影响因素包括：

①目标 ETF 对指数的跟踪误差：本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪，目标 ETF 对指数的跟踪误差会影响本基金对业绩比较基准的跟踪误差；

②本基金发生申购赎回、管理费和托管费收取等其他导致基金跟踪误差的情形。

3) 标的指数成份股行业集中风险

本基金标的指数成份股主要集中于医疗主题上市公司，须承受因政府政策变化、行业景气度变化等影响带来的行业风险。

4) 成份股权重较大的风险

根据本基金标的指数编制方案，存在个别成份股权重较大、集中度较高的情况，可能使基金面临较大波动风险或流动性风险。

5) 成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时，基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

6) 指数成份股发生负面事件面临退市时的应对风险

根据法律法规的要求，在指数基金运作过程中，当指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。存在因基金管理人对负面事件及其影响，以及对指数编制机构的相应反应的判断不够准确而未能及时调整相关成份股或者过早调整相关成份股，进而增大本基金的跟踪误差，甚至不排除给基金资产带来损失的风险。

7) 标的指数变更的风险

尽管可能性较小，若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

8) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护,未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护,本基金将根据基金合同的约定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,如更换基金标的指数、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。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间,基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作,该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异,影响投资收益。

9) 标的指数值计算出错的风险

尽管指数编制机构将采取一切必要措施以确保指数的准确性,但不对此作任何保证,亦不因指数的任何错误对任何人负责。因此,如果标的指数值出现错误,投资人参考指数值进行投资决策,则可能导致损失。

(2) ETF 联接基金相关投资风险

1) 投资于目标 ETF 的风险

本基金为 ETF 联接基金,投资于目标 ETF 的比例不低于本基金资产净值的 90%,投资标的单一且过分集中有可能会给本基金带来风险。同时,目标 ETF 面临的诸如管理风险与操作风险、目标 ETF 份额二级市场交易价格折溢价的风险等,可能直接或间接成为本基金的风险。

2) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金为广发中证医疗 ETF 的联接基金,主要通过投资于广发中证医疗 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争将日均跟踪偏离度控制在 0.35% 以内,年化跟踪误差控制在 4% 以内,但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围,本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

3) 本基金为目标 ETF 的联接基金,但不能保证本基金的表现与目标 ETF 的表现完全一致,产生差异的原因主要包括:① 现金投资比例要求,目标 ETF 没有现金投资比例的要求,可以将全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现;而本基金作为普通的开放式基金,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,仍需将不低于基金资产净值 5% 的资产投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券;② 申购赎回的影响,目标 ETF 采取实物申赎的方式,申购赎回对基金净值影响较小;而本基金申赎采取现金方式,不仅大额申赎可能会对基金净值产生一定冲击,而且本基金为应对投资者以现金方式申赎而进行的证券交易需支付一定的手续费,该类费用将影响本基金相对于目标 ETF 的业绩表现。

4) 目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险

本基金属于联接基金,主要投资于目标 ETF,因此目标 ETF 面临的风险可能直接或间接成为本基金的风险,诸如目标 ETF 管理风险与操作风险、目标 ETF 份额二级市场交易价格折溢价的风险等。投资者应知悉并关注目标 ETF 招募说明书等文件中的风险揭示内容。

5) 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。

当目标 ETF 发生基金合同约定的特殊情况时,本基金可能由目标 ETF 的联接基金变更为直接投资目标 ETF 标的指数成份股及备选成份股的指数基金,投资者届时须承担变更基金类型所带来的风险。

(3) 基金运作的特有风险

投资者投资于本基金还将面临以下特有风险。

1) 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 A 类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 A 类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。

2) 本基金退市风险

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 A 类基金份额不能继续进行二级市场交易的风险。

3) 基金财产投资运营过程中的税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。基金财产投资的相关税收,由基金份额持有人承担,基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。

(4) 本基金可投资于股指期货、资产支持证券、存托凭证等特定品种,将面临投资上述品种所产生特定的风险,可能给基金净值带来不利影响或损失。

(5) 转融通证券出借业务风险,主要包括流动性风险、信用风险、市场风险

(6) 投资科创板股票的风险

(7) 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。投资者将面临触及上述事件导致基金合同终止的风险。

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) 流动性风险;(5) 合规性风险;(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等。

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) 《广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 基金合同》
- (2) 《广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 托管协议》
- (3) 《广发中证医疗交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (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