

广发沪深300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6月10日

送出日期：2021年6月16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	广发沪深 300ETF	基金代码	510360
基金管理人	广发基金管理有限公司	基金托管人	中国工商银行股份有限公司
基金合同生效日	2015-08-20	上市交易所及上市日期	上海证券交易所 2015-09-09
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	2015-08-20
		证券从业日期	2004-07-02
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。		
场内简称	广发 300		
扩位简称	沪深 300ETF 基金		

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（沪深300指数）的成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券、债券回购、资产支持证券、银行存款、货币市场工具、权证、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。 在建仓完成后，本基金股票资产的投资比例不低于基金资产的80%，其中投资于标的指数成份股、备选成份股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%。 本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资融券、转融通。
主要投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。正常

情况下，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%。

为更好地实现本基金的投资目标，本基金还将在条件允许的情况下投资于股指期货等金融衍生品，以期降低跟踪误差水平。

业绩比较基准

沪深300指数收益率

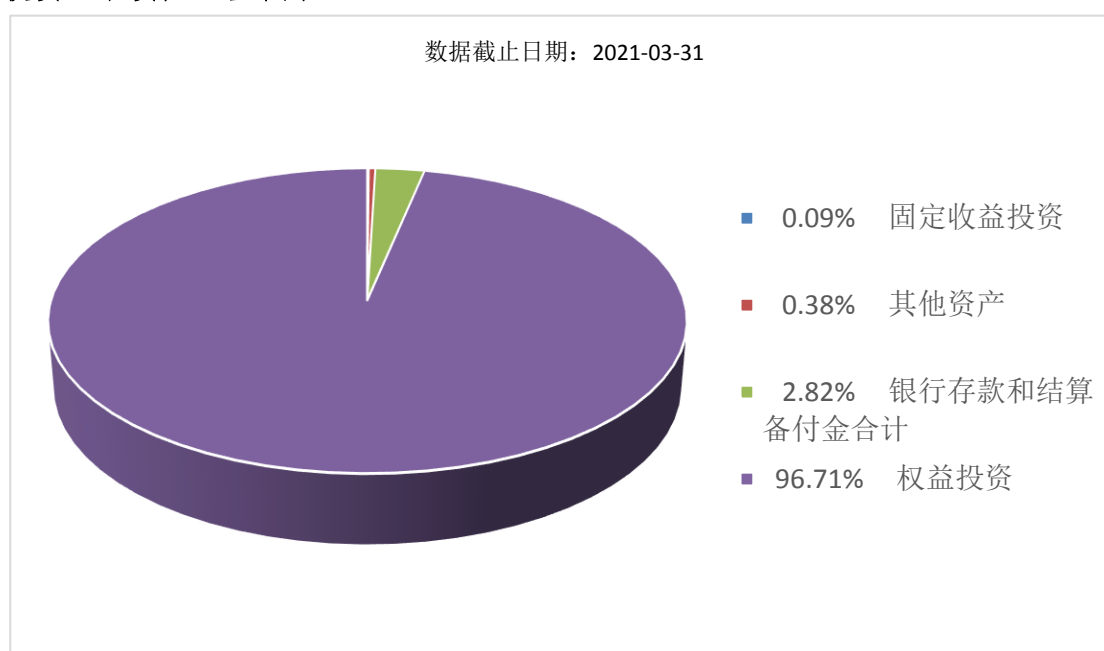
风险收益特征

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。

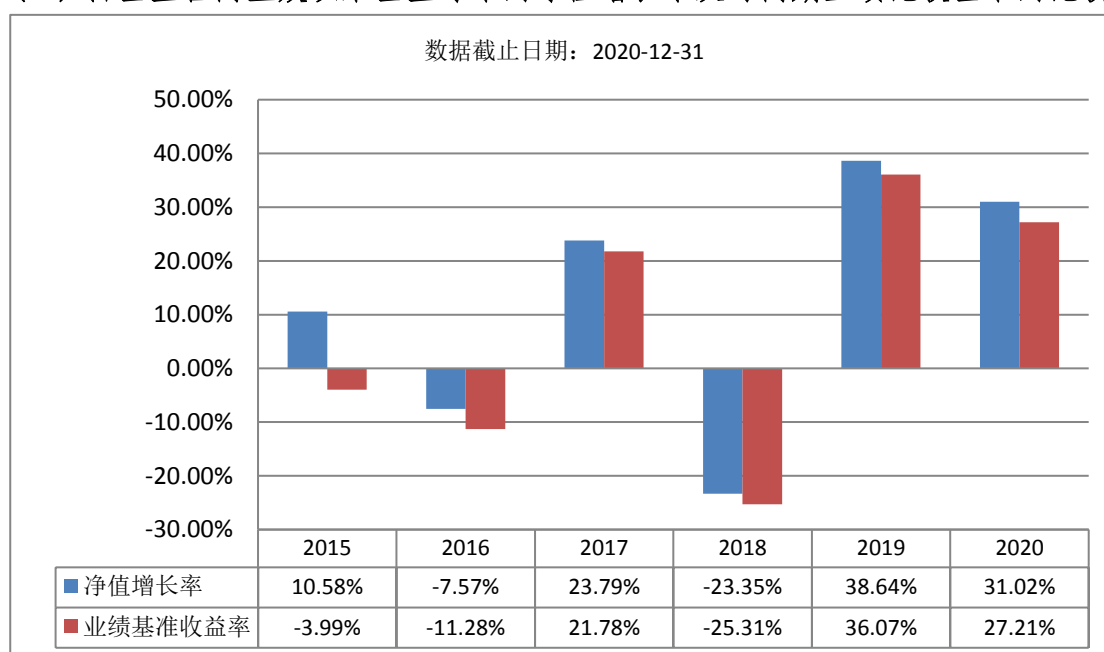
注：详见《广发沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及其更新文件中“基金的投资”。

(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



(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（2015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	0.50%
托管费	0.10%
其他费用	本基金费用包括基金指数许可使用费（年费率0.03%），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：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。

（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，投资者须承担此项调整带来的风险与成本。

（5）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。

（6）参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险：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，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

(7) 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。

(8) 投资者申购失败的风险：本基金的申购赎回清单中，可能仅允许对部分成份股使用现金替代，且设置了现金替代比例上限。因此，投资者在进行申购时，可能存在因个别成份股涨停、临时停牌等原因而无法买入申购所需的足够的成份股，导致申购失败的风险。因此为投资者办理申购业务的代理券商如发生交收违约，将导致投资者不能及时、足额获得申购基金份额，投资者的利益可能受到影响。

(9) 投资者赎回失败的风险：在投资者提交赎回申请时，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，由此可能导致投资者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。

(10) 退补现金替代方式的风险：本基金在申购赎回环节新增了“退补现金替代”方式，该方式不同于现有其他现金替代方式，可能给申购和赎回投资者带来价格的不确定性，从而间接影响本基金二级市场价格的折溢价水平。极端情况下，如果使用“退补现金替代”证券的权重增加，该方式带来的不确定性可能导致本基金的二级市场价格折溢价处于相对较高水平。基金管理人不对“时间优先、实时申报”原则的执行效率做出任何承诺和保证，现金替代退补款的计算以实际成交价格 and 基金招募说明书的约定为准。若因技术系统、通讯链路或其他原因导致基金管理人无法遵循“时间优先、实时申报”原则对“退补现金替代”的证券进行处理，投资者的利益可能受到影响。

(11) 基金份额赎回对价的变现风险：本基金赎回对价主要为组合证券，在组合证券变现过程中，由于市场变化、部分成份股流动性差等因素，导致投资者变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异，存在变现风险。

(12) 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，可能带来额外风险。如申购赎回代理券商因多种原因，导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止，由此影响对投资者申购赎回服务的风险；登记机构可能调整结算制度，如对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生变化，制度调整可能给投资者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；第三方机构可能违约，导致基金或投资者利益受损的风险。

(13) 本基金的特有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) 合规性风险；(5) 流动性风险等。

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) 《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(2) 《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

- (3) 《广发沪深 300 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