

广发基金管理有限公司

关于旗下部分 ETF 调整现金替代相关内容并相应修订招募说明书的公告

为更好地满足投资者的投资需求，广发基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据旗下广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金（交易代码：159755，场内简称：电池 ETF）、广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：159907，场内简称：2000ETF）、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：512580，场内简称：环保 ETF，扩位简称：环保 ETF）标的指数成份股的定期调整，修订上述基金招募说明书中涉及申购赎回现金替代的相关内容。

主要修订如下：

广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书主要修订对照表		
章节	原文条款内容	修改后条款内容
重要提示	<p>1、本基金于 2016 年 7 月 5 日经中国证监会证监许可[2016]1509 号文注册。</p> <p>3、本基金的标的指数为中证环保产业指数。 (1) 样本空间 指数样本空间由同时满足以下条件的非 ST、*ST 沪深 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成： 1) 科创板证券：<u>上市时间超过一年。</u> 2) 其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。</p> <p>4、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而</p>	<p>1、本基金于 2016 年 7 月 5 日经中国证监会证监许可[2016]1509 号文注册。</p> <p>3、本基金的标的指数为中证环保产业指数。 (1) 样本空间 指数样本空间由同时满足以下条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证组成： 1) <u>非 ST、*ST 证券；</u> 2) <u>科创板证券和北交所证券：上市时间分别超过一年和两年；</u> 3) 其他证券：上市时间超过一个季度，除非该证券自上市以来日均总市值排在前 30 位。</p> <p>4、本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社</p>

	<p>形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式基金，特定风险还包括：基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险等等。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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证环保产业指数的表现，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。其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、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、成份券停牌的风险等。</p>	<p>会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险。同时由于本基金是交易型开放式基金，特定风险还包括：基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考 IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险等等。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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证环保产业指数的表现，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。其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、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、成份券停牌的风险、<u>投资北交所股票的风险</u>等。</p>
<p>第十部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>七、申购、赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 (1) 现金替代分为 4 种类型： 退补现金替代适用于<u>深圳</u>证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。 (4) 退补现金替代 ①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证环保产业指数<u>深圳</u>证券交易所上市的成份股； 实时申报的原则为：基金管理人在深圳证券交易所连续竞价期间，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向深圳证</p>	<p>七、申购、赎回清单的内容与格式 3、现金替代相关内容 (1) 现金替代分为 4 种类型： 退补现金替代适用于<u>非上海</u>证券交易所上市的成份股，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。 (4) 退补现金替代 ①适用情形：退补现金替代的证券目前仅适用于中证环保产业指数<u>非上海</u>证券交易所上市的成份股； 实时申报的原则为：基金管理人在深圳/<u>北京</u>证券交易所连续竞价期间，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向</p>

	<p>券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>特例情况：若自 T 日起，深圳证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>	<p>深圳/北京证券交易所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>特例情况：若自 T 日起，深圳/北京证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>
<p>第十九部分 风险揭示</p>	<p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>9、其他风险</p>	<p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>9、投资北交所股票的风险</p> <p><u>本基金标的指数成份股可能包含北京证券交易所股票。北京证券交易所在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所股票，可能面临的风险包括但不限于：</u></p> <p><u>（1）中小企业经营风险</u></p> <p><u>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。</u></p> <p><u>（2）股价大幅波动风险</u></p> <p><u>北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为</u></p>

		<p>30%)，可能导致较大的股票价格波动。</p> <p><u>(3) 企业退市风险</u> 根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</p> <p><u>(4) 流动性风险</u> 北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</p> <p><u>(5) 监管规则变化的风险</u> 北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。</p> <p><u>10、其他风险</u></p>
--	--	--

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书主要修订对照表		
章节	原文条款内容	修改后条款内容
重要提示	<p>.....</p> <p>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。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、</p>	<p>.....</p> <p>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。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资人在投资本基金前，需充分了解本基金的产品特性，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、</p>

	<p>经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，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。同时由于本基金是交易型开放式指数基金，特定风险还包括：标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、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、成份股停牌的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、基金份额赎回对价的变现风险、投资特定品种（包括股指期货、股票期权、资产支持证券等）的特有风险、参与转融通证券出借业务的风险等等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。</p> <p>.....</p>	<p>经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，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。同时由于本基金是交易型开放式指数基金，特定风险还包括：标的指数的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、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、成份股停牌的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV 决策和 IOPV 计算错误的风险、基金份额赎回对价的变现风险、投资特定品种（包括股指期货、股票期权、资产支持证券等）的特有风险、参与转融通证券出借业务的风险、<u>投资北交所股票的风险</u>等等。本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。</p> <p>.....</p>
<p>第九部分 基金份额的申购与赎回</p>	<p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p> <p>T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。</p> <p>.....</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>A. 现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。</p> <p>对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。</p> <p>对于沪市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p>	<p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p> <p>T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。</p> <p>.....</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>A. 现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。</p> <p>对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。</p> <p>对于非深市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p>

<p>禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。</p> <p>当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>当可以现金替代适用于<u>上交所</u>上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。</p> <p>B. 可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为： 深市成份证券和沪市成份证券。</p> <p>【1】对于深市成份证券</p> <p>【2】对于<u>沪市</u>成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<u>沪市</u>成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的<u>沪市</u>成份证券全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>沪市</u>成份证券，替代金额的计算公式为： 申购替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1+现金替代溢价比例） 赎回替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1-现金替代折价比例）</p> <p>其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如</p>	<p>禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。</p> <p>当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>当可以现金替代适用于<u>非深交所</u>上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。</p> <p>B. 可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为： 深市成份证券和<u>非深市</u>成份证券。</p> <p>【1】对于深市成份证券</p> <p>【2】对于<u>非深市</u>成份证券</p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<u>非深市</u>成份证券。登记结构机构对设置可以现金替代的<u>非深市</u>成份证券全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>非深市</u>成份证券，替代金额的计算公式为： 申购替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1+现金替代溢价比例） 赎回替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1-现金替代折价比例）</p> <p>其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如</p>
---	--

	<p>果上海证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海证券交易所通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在上交所连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上交所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>	<p>果上海/北京证券交易所参考价格确定原则发生变化，以上海/北京证券交易所通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在上交所/北交所连续竞价期间，根据收到的深交所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向上交所/北交所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，上海/北京证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>
<p>第十七部分 风险揭示</p>	<p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>7、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p>(21) 指数编制机构停止服务的风险</p> <p>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，本</p>	<p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>7、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p>(21) 指数编制机构停止服务的风险</p> <p>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，本</p>

	<p>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。</p> <p>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并实施前，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。</p>	<p>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。</p> <p>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并实施前，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。</p> <p><u>(22) 投资北交所股票的风险</u></p> <p><u>本基金标的指数成份股可能包含北京证券交易所股票。北京证券交易所在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所股票，可能面临的风险包括但不限于：</u></p> <p><u>1) 中小企业经营风险</u></p> <p><u>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。</u></p> <p><u>2) 股价大幅波动风险</u></p> <p><u>北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u></p> <p><u>3) 企业退市风险</u></p> <p><u>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金</u></p>
--	---	--

	<p>(22) 本基金《基金合同》生效后，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 5000 万元人民币的情形，基金合同将自动终止。</p>	<p>可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</p> <p>4) 流动性风险</p> <p>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</p> <p>5) 监管规则变化的风险</p> <p>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。(新增)</p> <p>(23) 本基金《基金合同》生效后，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 5000 万元人民币的情形，基金合同将自动终止。</p>
--	---	--

广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书主要修订对照表		
章节	原文条款内容	修改后条款内容
重要提示	<p>.....</p> <p>3、本基金的标的指数为国证新能源车电池指数。</p> <p>(1) 指数样本空间</p> <p><u>在深圳证券交易所、上海证券交易所上市交易且满足下列条件的所有 A 股：</u></p> <p>1) 非 ST、*ST 股票；</p> <p>2) 上市时间超过六个月；</p> <p>3) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；</p> <p>4) 公司最近一年经营无异常、无重大亏损；</p>	<p>.....</p> <p>3、本基金的标的指数为国证新能源车电池指数。</p> <p>(1) 指数样本空间</p> <p><u>满足下列条件的 A 股和红筹企业发行的存托凭证：</u></p> <p>1) 非 ST、*ST 股票；</p> <p>2) <u>科创板证券、北交所证券上市时间超过 1 年；其他证券上市时间超过六个月；</u></p> <p>3) 公司最近一年无重大违规、财务报告无重大问题；</p> <p>4) 公司最近一年经营无异常、无</p>

<p>5) 考察期内股价无异常波动;</p> <p>6) 公司业务领域属于涉及新能源车电池(正极材料、负极材料、电解液、隔膜等)、新能源车电池管理系统及新能源车充电桩等。</p> <p>.....</p> <p>4、本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,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,本基金的特定风险等等。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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数国证新能源车电池指数的表现,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。</p> <p>本基金是指数基金,其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、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、成份股停牌的风险等。</p> <p>本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。</p> <p>本基金为交易型开放式指数证券投资基金(ETF),在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海两个证券交易所,本基金的申购、赎回模式与组合证券仅在深圳或上海证券交易所上市的ETF产品有所差异。如采用“场外实物申购赎回”模式,投资人的申购、赎回申请在T+1日确认,申购所得ETF份额及赎回所得组</p>	<p>重大亏损;</p> <p>5) 考察期内股价无异常波动;</p> <p>6) 公司业务领域属于涉及新能源车电池(正极材料、负极材料、电解液、隔膜等)、新能源车电池管理系统及新能源车充电桩等。</p> <p>.....</p> <p>4、本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,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,本基金的特定风险等等。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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数国证新能源车电池指数的表现,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。</p> <p>本基金是指数基金,其特定风险包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险、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、成份股停牌的风险、<u>投资北交所股票的风险</u>等。</p> <p>本基金的特定风险详见招募说明书“风险揭示”章节等。</p> <p>本基金为交易型开放式指数证券投资基金(ETF),在深圳证券交易所上市。由于本基金的标的指数组合证券横跨深圳及上海两个证券交易所(亦有可能横跨深圳、上海和北京三个证券交易所),本基金的申购、赎回模式与组合证券仅在深圳或上海或北京证券交易所上市的ETF产品有所差异。如采用“场</p>
---	---

	<p>合证券在 T+2 日可用；如采用“场内申购赎回”模式，投资人的申购、赎回申请在 T 日确认，申购所得 ETF 份额、赎回所得组合证券及现金替代在 T 日可用。</p> <p>.....</p>	<p>外实物申购赎回”模式，投资人的申购、赎回申请在 T+1 日确认，申购所得 ETF 份额及赎回所得组合证券在 T+2 日可用；如采用“场内申购赎回”模式，投资人的申购、赎回申请在 T 日确认，申购所得 ETF 份额、赎回所得组合证券及现金替代在 T 日可用。</p> <p>.....</p>
<p>第九部分 基金份额 的申购与 赎回</p>	<p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>本基金的基金份额申购与赎回包括“场内申购赎回”模式和“场外实物申购赎回”模式 2 种模式，将采用不同的申购赎回清单。</p> <p>（一）场内申购赎回模式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p> <p>T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。</p> <p>.....</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>A. 现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。</p> <p>对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。</p> <p>对于沪市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。</p> <p>当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，可以现金替代是指在</p>	<p>七、申购、赎回清单的内容与格式</p> <p>本基金的基金份额申购与赎回包括“场内申购赎回”模式和“场外实物申购赎回”模式 2 种模式，将采用不同的申购赎回清单。</p> <p>（一）场内申购赎回模式</p> <p>1、申购赎回清单的内容</p> <p>T 日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的申赎现金、组合证券内各成份证券数据、现金替代、T 日预估现金差额、T-1 日现金差额、基金份额净值及其他相关内容。</p> <p>.....</p> <p>4、现金替代相关内容</p> <p>现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。</p> <p>A. 现金替代分为 3 种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。</p> <p>对于深市成份证券，现金替代的类型可以设为：“禁止”、“允许”和“必须”。</p> <p>对于非深市成份证券，可以设为：“允许”和“必须”。</p> <p>禁止现金替代适用于深交所上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>可以现金替代适用于所有成份股。</p> <p>当可以现金替代适用于深交所上市的成份股时，可以现金替代是指在</p>

<p>申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>当可以现金替代适用于<u>上交所</u>上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。</p> <p>B. 可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：<u>深市成份证券</u>和<u>沪市成份证券</u>。</p> <p>【1】对于<u>深市成份证券</u></p> <p>【2】对于<u>沪市成份证券</u></p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<u>沪市成份证券</u>。登记结构机构对设置可以现金替代的<u>沪市成份证券</u>全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>沪市成份证券</u>，替代金额的计算公式为：</p> <p>申购替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1+现金替代溢价比例）</p> <p>赎回替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1-现金替代折价比例）</p> <p>其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果上海<u>证券交易所</u>参考价格确定原则发生变化，以上海<u>证券交易所</u>通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>上交所</u>连续竞价期间，根据收到的<u>深交所</u>申购赎回确认记录，在技术系</p>	<p>申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。</p> <p>当可以现金替代适用于<u>非深交所</u>上市的成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>必须现金替代适用于所有成份股，是指在申购赎回基金份额时，该成份证券必须使用固定现金作为替代。</p> <p>B. 可以现金替代</p> <p>可以现金替代的组合证券分为：<u>深市成份证券</u>和<u>非深市成份证券</u>。</p> <p>【1】对于<u>深市成份证券</u></p> <p>【2】对于<u>非深市成份证券</u></p> <p>①适用情形：投资者申购和赎回时的<u>非深市成份证券</u>。登记结构机构对设置可以现金替代的<u>非深市成份证券</u>全部用现金替代。</p> <p>②替代金额：对于可以现金替代的<u>非深市成份证券</u>，替代金额的计算公式为：</p> <p>申购替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1+现金替代溢价比例）</p> <p>赎回替代金额=替代证券数量×该证券开盘参考价格×（1-现金替代折价比例）</p> <p>其中，“该证券开盘参考价格”为该证券经除权调整的 T-1 日收盘价。如果上海/<u>北京</u><u>证券交易所</u>参考价格确定原则发生变化，以上海/<u>北京</u><u>证券交易所</u>通知规定的参考价格为准。</p> <p>.....</p> <p>③替代金额的处理程序</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>上交所</u>/<u>北交所</u>连续竞价期间，根据收到的<u>深交所</u>申购赎回确认记录，在</p>
---	---

	<p>统允许的情况下实时向上交所申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，上海证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> <p>.....</p>	<p>技术系统允许的情况下实时向上交所/<u>北交所</u>申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，上海/<u>北京</u>证券交易所正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p> <p>.....</p>
<p>第十九部分 风险揭示</p>	<p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>6、本基金特有的风险</p> <p>.....</p>	<p>一、投资于本基金的主要风险</p> <p>.....</p> <p>6、本基金特有的风险</p> <p>.....</p> <p>7、<u>投资北交所股票的风险</u></p> <p><u>本基金标的指数成份股可能包含北京证券交易所股票。北京证券交易所在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所股票，可能面临的风险包括但不限于：</u></p> <p><u>（1）中小企业经营风险</u></p> <p><u>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。</u></p> <p><u>（2）股价大幅波动风险</u></p> <p><u>北京证券交易所在证券发行、交</u></p>

	<p><u>易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u></p> <p><u>（3）企业退市风险</u> <u>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</u></p> <p><u>（4）流动性风险</u> <u>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</u></p> <p><u>（5）监管规则变化的风险</u> <u>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。（新增，以下序号依次修改）</u></p> <p><u>7、转融通证券出借业务风险</u> <u>（1）流动性风险</u> <u>基金面临大额赎回时，可能因证券出借无法及时变现来支付赎回款项的风险。</u> <u>（2）信用风险</u> <u>可能因交易对手方（证券借入方）违约，无法及时归还证券而无法支付相应权益补偿及借券费用的风险。</u> <u>（3）市场风险</u></p>	<p><u>易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u></p> <p><u>（3）企业退市风险</u> <u>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</u></p> <p><u>（4）流动性风险</u> <u>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</u></p> <p><u>（5）监管规则变化的风险</u> <u>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。（新增，以下序号依次修改）</u></p> <p><u>8、转融通证券出借业务风险</u> <u>（1）流动性风险</u> <u>基金面临大额赎回时，可能因证券出借无法及时变现来支付赎回款项的风险。</u> <u>（2）信用风险</u> <u>可能因交易对手方（证券借入方）违约，无法及时归还证券而无法支付相应权益补偿及借券费用的风险。</u> <u>（3）市场风险</u></p>
--	---	---

	证券出借后，可能面临出借期间无法及时处置证券的风险。	证券出借后，可能面临出借期间无法及时处置证券的风险。
--	-------------------------------------	-------------------------------------

上述修改事项对原基金份额持有人的利益无实质性不利影响，无需召开基金份额持有人大会，本次调整于 2024 年 6 月 17 日生效。本公司将按规定在相应更新的招募说明书中对上述内容进行修改。投资者欲了解上述基金详细信息，请仔细阅读上述基金的基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等法律文件。

投资者可通过以下途径咨询有关详情：

客户服务电话：95105828 或 020-83936999

公司网站：www.gffunds.com.cn

风险提示：基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险等级进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在投资者作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负责。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2024年6月19日