

广发基金管理有限公司

关于广发中证 A500 指数型证券投资基金变更为广发中证
A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订
基金合同等法律文件的公告

广发基金管理有限公司（以下简称“本公司”）旗下的广发中证A500指数型证券投资基金（以下简称“本基金”）于2024年10月18日经中国证监会证监许可〔2024〕1442号文准予募集注册，《广发中证A500指数型证券投资基金基金合同》（以下简称《基金合同》）已于2024年11月5日生效。根据《基金合同》的约定：“若将来本基金管理人推出跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金（ETF），则基金管理人在履行适当程序后使本基金采取ETF联接基金模式并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会但须提前公告。”

本公司旗下的广发中证A500交易型开放式指数证券投资基金于2024年11月1日经中国证监会证监许可〔2024〕1523号文准予募集注册，于2024年11月11日成立运作，将于2024年11月18日起在上海证券交易所上市交易。为了更好地满足投资者投资需求，本公司经与基金托管人中国银行股份有限公司协商一致，决定将广发中证A500指数型证券投资基金变更为广发中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，并修订《基金合同》等法律文件。

现将相关事宜公告如下：

一、转型变更为联接基金

广发中证A500指数型证券投资基金变更为广发中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金后，本基金的登记机构将进行基金份额变更登记，即将“广发中证A500指数型证券投资基金A类基金份额”变更为“广发中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额”，将“广发中证A500指数型证券投资基金C类基金份额”变更为“广发中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额”。

本基金基金简称分别由“广发中证A500指数A”变更为“广发中证A500ETF

联接A”，“广发中证A500指数C”变更为“广发中证A500ETF联接C”，基金代码保持不变。

前述变更不影响各类基金份额净值的计算，各类基金份额的申购费率、赎回费率保持不变。

二、关于修改基金合同的说明

本公司经与基金托管人协商一致，对本基金基金合同、托管协议中涉及基金变更的相关内容进行修改（具体修改详见附件）。根据《基金合同》的规定，上述修改无需召开基金份额持有人大会。修订后的基金合同、托管协议及招募说明书等法律文件于公告当日在本公司网站上同时公布，并依照《公开募集证券投资基金管理信息披露管理办法》的有关规定在规定媒介上公告。

修订后的《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》自 2024 年 11 月 18 日起生效，原《广发中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》《广发中证 A500 指数型证券投资基金托管协议》《广发中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书》于当日失效。

三、其他需要提示的事项

1. 本公告仅对本基金本次基金合同修改的事项予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读本基金的基金合同、招募说明书（更新）和基金产品资料概要（更新）等法律文件。

2. 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

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11月15日

附件：广发中证 A500 指数型证券投资基金转型为广发中证 A500 交易型开放式

指数证券投资基金联接基金基金合同修订对照表

基金名称	广发中证 A500 指数型证券投资基金	广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
封面		(本基金由广发中证 A500 指数型证券投资基金转型而来) (新增)
一、前言	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。</p> <p>三、广发中证 A500 指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>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市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资策略，自行承担投资风险。</p>	<p>2、订立本基金合同的依据是《中华人民共和国民法典》(以下简称“《民法典》”)、《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《公开募集证券投资基金运作管理办法》(以下简称“《运作办法》”)、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》(以下简称“《销售办法》”)、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称“《信息披露办法》”)、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(以下简称“《流动性风险管理规定》”)、《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》、《公开募集证券投资基金运作指引第 2 号——基金中基金指引》(以下简称“《指数基金指引》”)和其他有关法律法规。</p> <p>三、<u>本基金由广发中证 A500 指数型证券投资基金转型而来。</u>广发中证 A500 指数型证券投资基金由基金管理人依照《基金法》、基金合同及其他有关规定募集，并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)注册。</p> <p>中国证监会对<u>广发中证 A500 指数型证券投资基金</u>募集的注册，并不表明其对本基金的价值和市场前景做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者应当认真阅读基金合同、基金招募说明书等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资策略，自行承担投资风险。</p>

	<p>七、本基金以有效跟踪<u>标的指数</u>，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化为投资目标，存在跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、标的指数成份股停牌等潜在风险，具体详见本基金招募说明书。</p>	<p>七、本基金以有效跟踪<u>业绩比较基准</u>，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化为投资目标，存在跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、标的指数成份股停牌等潜在风险，具体详见本基金招募说明书。</p>
二、释义	<p>基金或本基金：<u>指广发中证 A500 指数型证券投资基金</u></p> <p>30、基金合同生效日：<u>指基金募集达到法律法规规定及基金合同规定的条件，基金管理人向中国证监会办理基金备案手续完毕，并获得中国证监会书面确认的日期</u></p> <p>50、基金资产净值：<u>指基金资产总值及票据价值减去基金负债后的价值</u>（删除）</p>	<p>1、基金或本基金：<u>指广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金，本基金由广发中证 A500 指数型证券投资基金转型而来</u></p> <p>30、基金合同生效日：<u>指《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》生效日，原《广发中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》自本基金基金合同生效日起失效</u></p> <p>49、基金资产总值：<u>指基金拥有的目标 ETF 基金份额、各类有价证券及票据价值、银行存款本息、基金应收申购款及其他资产的价值总和</u></p> <p>54、目标 ETF：<u>指广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金</u></p> <p>55、ETF 联接基金：<u>指将绝大多数基金财产投资于目标 ETF，与目标 ETF 的投资目标类似，紧密跟踪业绩比较基准，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，简称“联接基金”</u>（新增，改序号）</p>
三、基金的基本情况	<p>四、基金的投资目标 <u>本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪中证 A500 指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</u></p> <p>六、基金的最低募集份额总额 <u>本基金的最低募集份额总额为 2 亿份，最低募集金额为 2 亿元人民币。</u></p>	<p>四、基金的投资目标 <u>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最小化。</u></p>

<p><u>七、基金份额面值和认购费用</u> <u>本基金基金份额发售面值为人民币</u> <u>1.00 元。</u> <u>本基金具体认购费率按招募说明书</u> <u>的规定执行。(删除, 改序号)</u></p>	<p><u>八、本基金与目标 ETF 的联系与区别</u> <u>本基金的目标 ETF 是广发中证 A500 交</u> <u>易型开放式指数证券投资基金 (简称</u> <u>广发中证 A500ETF)。</u> <u>本基金为广发中证 A500ETF 的联接基</u> <u>金, 二者既有联系也有区别:</u> <u>(1) 在投资方法方面, 目标 ETF 主要</u> <u>采用完全复制法, 直接投资于标的指</u> <u>数的成份股及备选成份股; 而本基金</u> <u>则采取间接的方法, 通过将绝大部分</u> <u>基金财产投资于目标 ETF, 实现对业绩</u> <u>比较基准的紧密跟踪。</u> <u>(2) 在交易方式方面, 投资者既可以</u> <u>像买卖股票一样在交易所市场买卖目</u> <u>标 ETF, 也可以按照最小申购、赎回单</u> <u>位和申购、赎回清单的要求, 申赎目</u> <u>标 ETF; 而本基金则像普通的开放式基</u> <u>金一样, 通过基金管理人及销售机构</u> <u>按“未知价”原则进行基金的申购与赎</u> <u>回。</u> <u>本基金与目标 ETF 业绩表现可能出现</u> <u>差异。可能引发差异的因素主要包括:</u> <u>(1) 法律法规对投资比例的要求。目</u> <u>标 ETF 作为一种特殊的基金品种, 可</u> <u>将全部或接近全部的基金资产投资于</u> <u>标的指数成份股及备选成份股; 而本</u> <u>基金作为普通的开放式基金, 每个交易日</u> <u>日终在扣除股指期货合约、股票</u> <u>期权合约、国债期货合约需缴纳的交</u> <u>易保证金后, 仍需保留不低于基金资</u> <u>产净值 5% 的现金或者到期日在一年</u> <u>以内的政府债券。</u> <u>(2) 申购赎回的影响。目标 ETF 采取</u> <u>按照最小申购、赎回单位和申购、赎</u> <u>回清单要求进行申赎的方式, 申购赎</u> <u>回对基金净值影响较小; 而本基金采</u> <u>取按照未知价法进行申赎的方式, 大</u> <u>额申赎可能会对基金净值产生一定冲</u></p>
---	---

		<u>击。(新增)</u>
四、基金份额的发售 <u>(章节标题 更改为“基 金的历史沿 革”)</u>	<p><u>第四部分 基金份额的发售</u></p> <p><u>一、基金份额的发售时间、发售方 式、发售对象</u></p> <p><u>1、发售时间</u> 自基金份额发售之日起最长不得超 过 3 个月，具体发售时间见基金份 额发售公告。</p> <p><u>2、发售方式</u> 通过各销售机构的基金销售网点公 开发售，各销售机构的具体名单见 基金份额发售公告以及基金管理人 官网公示的基金销售机构名录。 本基金认购采取全额缴款认购的方 式，基金投资者在募集期内可多次 认购，认购一旦被注册登记机构确 认，就不再接受撤销申请。</p> <p><u>基金销售机构对认购申请的受理并 不代表该申请一定生效，而仅代表 销售机构确实接收到认购申请。认 购的确认以注册登记机构的确认结 果为准。</u></p> <p><u>3、发售对象</u> 符合法律法规规定的可投资于证券 投资基金的个人投资者、机构投资 者、合格境外投资者以及法律法规 或中国证监会允许购买证券投资基金 的其他投资人。</p> <p><u>二、基金份额的认购</u></p> <p><u>1、认购费用</u> 本基金 A 类基金份额的认购费率由 基金管理人决定，并在招募说明书 中列示，基金认购费用不列入基金 财产，本基金 C 类基金份额不收取 认购费用。</p> <p><u>2、募集期利息的处理方式</u> 有效认购款项在募集期间产生的利 息将折算为基金份额归基金份额持 有人所有，其中利息转份额以登记 机构的记录为准。</p> <p><u>3、基金认购份额的计算</u> 基金认购份额具体的计算方法在招 募说明书中列示。</p>	<p><u>第四部分 基金的历史沿革</u></p> <p><u>广发中证 A500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金由广发中证 A500 指数型证券投资基金转型而来。</u> <u>广发中证 A500 指数型证券投资基金基 于 2024 年 10 月 18 日经中国证监会证 监许可[2024]1442 号文注册，基金管 理人为广发基金管理有限公司，基金 托管人为中国银行股份有限公司。广 发中证 A500 指数型证券投资基金自 2024 年 10 月 25 日至 2024 年 11 月 1 日进行发售，募集结束后基金管理人 向中国证监会办理备案手续。经中国 证监会书面确认，《广发中证 A500 指 数型证券投资基金基金合同》于 2024 年 11 月 5 日生效。</u> <u>根据《广发中证 A500 指数型证券投资 基金基金合同》的约定——“若将来 本基金管理人推出跟踪同一标的指 数的交易型开放式指数基金（ETF），则 基金管理人在履行适当程序后使本基 金采取 ETF 联接基金模式并相应修改 《基金合同》，届时无须召开基金份额 持有人大会但须提前公告”，基金管理 人经与基金托管人协商一致并履行公 告程序后，决定将广发中证 A500 指数 型证券投资基金转型为广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金，并据此修订《广发中证 A500 指数型证券投资基金基金合 同》。</u> <u>自 2024 年 11 月 18 日起，广发中证 A500 指数型证券投资基金正式转型 为广发中证 A500 交易型开放式指数 证券投资基金联接基金，《广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金基金合同》生效，原《广 发中证 A500 指数型证券投资基金基 金合同》同日失效。</u></p>

	<p><u>4、认购份额余额的处理方式</u> <u>认购份额的计算保留到小数点后 2 位，小数点 2 位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。</u></p> <p><u>三、基金份额认购金额的限制</u></p> <p><u>1、投资人认购时，需按销售机构规定的方式全额缴款。</u></p> <p><u>2、基金管理人可以对每个基金交易账户的单笔最低认购金额进行限制，具体限制请参看招募说明书或相关公告。</u></p> <p><u>3、基金管理人可以对募集期间的单个投资人的累计认购金额进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</u></p> <p><u>4、基金管理人可以对本基金的募集规模上限进行限制，具体限制和处理方法请参看招募说明书或相关公告。</u></p> <p><u>5、投资人在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。认购费用按每笔认购申请单独计算。</u></p> <p><u>6、基金募集期届满，如本基金单个投资人累计认购的基金份额数达到或者超过基金总份额的 50%，基金管理人可以于募集期结束后采取比例确认等方式对该投资人的认购申请进行限制。基金管理人接受某笔或者某些认购申请有可能导致投资者变相规避前述 50%比例要求的，基金管理人有权拒绝该等全部或者部分认购申请。投资人认购的基金份额数以基金合同生效后登记机构的确认为准。</u></p>	
<p>五、基金备案（章节标题更改为“基金的存续”）</p>	<p>第五部分 <u>基金备案</u></p> <p><u>一、基金备案的条件</u> <u>本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满</u></p>	<p>第五部分 <u>基金的存续</u></p>

	<p>或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售，并在 10 日内聘请法定验资机构验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会办理基金备案手续。</p> <p>基金募集达到基金备案条件的，自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；否则《基金合同》不生效。基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。</p> <p>二、基金合同不能生效时募集资金的处理方式</p> <p>如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：</p> <p>1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用。</p> <p>2、在基金募集期限届满后 30 日内返还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。</p> <p>3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。（删除）</p> <p>三、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模（改序号）</p>	<p>一、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模</p>
<p>六、基金份额的申购与赎回</p>	<p>二、申购和赎回的开放日及时间</p> <p>1、开放日及开放时间（删除）</p> <p>2、申购、赎回开始日及业务办理时间</p> <p>基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理申购，具体业务办理时间在申购开始公告中规</p>	

<p>定。</p> <p><u>基金管理人自基金合同生效之日起不超过 3 个月开始办理赎回，具体业务办理时间在赎回开始公告中规定。</u></p> <p><u>在确定申购开始与赎回开始时间后，基金管理人应在申购、赎回开放日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告申购与赎回的开始时间。</u> (删除)</p>	
<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p><u>7、基金管理人接受某笔或者某些申购申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50%，或者变相规避 50%集中度的情形时。</u> (删除)</p>	<p>七、拒绝或暂停申购的情形</p> <p><u>7、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致基金管理人无法计算当日基金资产净值。</u></p> <p><u>8、目标 ETF 暂停申购、暂停上市或二级市场交易停牌，基金管理人认为有必要暂停本基金申购的情形。</u> (新增)</p>
<p><u>8、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</u></p> <p><u>9、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</u> (改序号)</p>	<p><u>9、基金管理人、基金托管人、销售机构或登记机构的技术故障等异常情况导致基金销售系统、基金注册登记系统或基金会计系统无法正常运行。</u></p> <p><u>10、法律法规规定或中国证监会认定的其他情形。</u> (改序号)</p>
<p>发生上述第 1、2、3、4、6、8、9 项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p>	<p>发生上述除第 5 项以外的暂停申购情形之一且基金管理人决定拒绝或暂停接受投资者的申购申请时，基金管理人应当根据有关规定在规定媒介上刊登暂停申购公告。如果投资人的申购申请被拒绝，被拒绝的申购款项将退还给投资人。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理。</p> <p>八、暂停赎回或延缓支付赎回款项的情形</p> <p><u>7、目标 ETF 暂停基金资产估值，导致</u></p>

		<p><u>基金管理人无法计算当日基金资产净值。(新增)</u></p> <p><u>8、目标 ETF 暂停赎回、暂停上市或证券交易所场内交易停牌等有必要暂停本基金赎回的情形。(新增, 改序号)</u></p>
七、基金合同当事人及权利义务		<p>三、基金份额持有人</p> <p>1、根据《基金法》《运作办法》及其他有关规定,基金份额持有人的权利包括但不限于:</p> <p><u>(9) 按照目标 ETF 基金合同的约定出席或者委派代表出席目标 ETF 基金份额持有人大会并对目标 ETF 基金份额持有人大会审议事项行使表决权; (新增, 改序号)</u></p>
八、基金份额持有人大会		<p>本基金的基金份额持有人大会暂不设立日常机构。</p> <p><u>鉴于本基金是目标 ETF 的联接基金,本基金与目标 ETF 之间在基金份额持有人大会方面存在一定的联系,本基金的基金份额持有人可以凭所持有的本基金份额出席或者委派代表出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决,其持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为: 在目标 ETF 基金份额持有人大会的权益登记日,本基金持有目标 ETF 份额的总数乘以该基金份额持有人所持有的本基金份额占本基金总份额的比例。计算结果按照四舍五入的方法,保留到整数位。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人不应以本基金的名义代表本基金的全体基金份额持有人以目标 ETF 的基金份额持有人的身份行使表决权,但可接受本基金的特定基金份额持有人的委托以本基金的基金份额持有人代理人的身份出席目标 ETF 的基金份额持有人大会并参与表决。</u></p> <p><u>本基金的基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的,须先遵照本基金《基金合同》的约定召开本基金的基金份额持有人大会。本基金的基金份额持有人大会决定提议召开</u></p>

	<p>一、召开事由</p> <p>(8) 变更基金投资目标、范围或策略;</p>	<p><u>或召集目标 ETF 基金份额持有人大会的，由本基金基金管理人代表本基金的基金份额持有人提议召开或召集目标 ETF 基金份额持有人大会。(新增)</u></p> <p>一、召开事由</p> <p><u>(8) 变更基金投资目标、范围或策略，但由于目标 ETF 基金交易方式变更、终止上市、基金合同终止、与其他基金进行合并而变更基金投资目标、范围或策略的情况除外；</u></p>
十二、基金的投资	<p>一、投资目标</p> <p>本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪中证 A500 指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于标的指数（即中证 A500 指数）的成份股、备选成份股（含存托凭证）。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（包括科创板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、存托凭证）、银行存款、债券（包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权、国债期货等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单以及法律法规或中国证监会允许本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> <p>基金的投资组合比例为：本基金的股票资产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和备选成份股（均含存托凭证）</p>	<p>一、投资目标</p> <p>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最小化。</p> <p>二、投资范围</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。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（包括科创板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、存托凭证）、银行存款、债券（包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权、国债期货等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单以及法律法规或中国证监会允许本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）。本基金的目标 ETF 为广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金。</p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 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%</p>

<p>的比例不低于非现金基金资产的 80%</p> <p>三、投资策略</p> <p>本基金为被动管理的指数型基金，在正常情况下，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，年跟踪误差控制在 4% 以内。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数，以完全按照标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。股票在投资组合中的权重原则上将根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以拟合标的指数的业绩表现。</p> <p>对无法严格按照标的指数进行复制的情况，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，综合考虑标的指数样本中个股的自由流通市值规模、流动性、行业代表性、波动性与标的指数整体的相关性，通过抽样方式构建基金股票投资组合，优化确定投资组合中的个股权重，以获得更接近标的指数的收益率。</p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p>基金管理人将主要以标的指数成份股为基础，综合考虑跟踪效果、操作风险、投资可行性等因素构建投资组合，并根据基金资产规模、日常申购赎回情况、市场流动性以及股票市场交易特性等情况，对投资组合进行优化调整，以力争实现对标的指数的有效跟踪，实现对跟踪误差的有效控制。</p> <p>(二) 股票(含存托凭证)投资策略</p> <p>1、股票组合构建方法</p> <p>本基金主要采取完全复制法构建指数化投资组合，即，基金所构建的指数化投资组合将主要根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以拟合标的指数的业绩表现。</p>	<p>三、投资策略</p> <p>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。</p> <p>(一) 资产配置策略</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF、标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证)，其中投资于目标 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、股票期权合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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。</p> <p>本基金将根据市场的实际情况，适当调整基金资产在各类资产上的配置比例，以保证对标的指数的有效跟踪。</p> <p>(二) 目标 ETF 投资策略</p> <p>1、投资组合的投资方式</p> <p>本基金在综合考虑合规、风险、效率、成本等因素的基础上，决定采用申赎的方式或证券交易所场内交易的方式进行目标 ETF 的买卖。当目标 ETF 申购、赎回或交易模式进行了变更或调整，本基金也将作相应的变更或调整。</p> <p>2、投资组合的调整</p> <p>本基金将根据开放日申购和赎回情况，决定投资目标 ETF 的时间和方式。</p> <p>(1) 当净申购时，本基金将根据净申购规模及仓位情况，决定股票组合的构建、目标 ETF 的申购或买入等；</p> <p>(2) 当净赎回时，本基金将根据净赎回规模及仓位情况，决定目标 ETF 的赎回或卖出等。</p> <p>(三) 股票投资策略</p> <p>1、股票组合构建原则</p> <p>根据标的指数，结合研究判断和基金组合的构建情况，采用被动式指数化</p>
--	--

<p>现。但若出现较为特殊的情况（例如成份股流动性不足、成份股投资受限、成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股公司行为等），或受基金规模而投资受限，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响等其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合进行适当变通和调整，也可以采用抽样复制等方法构建本基金的指数化投资组合，以力争降低跟踪误差。此外，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对投资组合进行适当调整，以获得更接近标的指数的收益率。</p> <p>2、股票组合调整</p> <p>（1）定期调整</p> <p>本基金股票组合根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p>（2）不定期调整</p> <p>①与指数相关的调整</p> <p>当标的指数成份股发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时，本基金将根据指数公司发布的调整决定及其需调整的权重比例，进行相应调整。</p> <p>②申购赎回调整</p> <p>根据本基金的申购和赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。</p> <p>③其他调整</p> <p>对于标的指数成份股，若因其出现停牌限制、存在严重的流动性困难、或者财务风险较大、或者面临重大的不利的司法诉讼、或者有充分而合理的理由认为其被市场操纵等情形时，本基金可以不投资该成份股，而用备选股、甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、定价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。</p> <p>3、本基金在综合考虑预期收益、风</p>	<p>投资的方法构建股票组合。</p> <p>2、股票组合构建方法</p> <p>本基金将以追求跟踪误差最小化进行标的指数的成份股和备选成份股的投资。本基金采用被动式指数化投资的方法，根据标的指数成份股的构成及权重构建股票投资组合。如有因受成份股停牌、成份股流动性不足或其它一些影响指数复制的市场因素的限制，基金管理人可以根据市场情况，结合经验判断，对股票组合管理进行适当变通和调整，以更紧密的跟踪标的指数。</p> <p>3、股票组合的调整</p> <p>（1）定期调整</p> <p>本基金所构建的股票组合将根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。</p> <p>（2）不定期调整</p> <p>基金经理将跟踪标的指数变动，基金组合跟踪偏离度情况，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。</p> <p>本基金参与非标的指数成份股投资的，应当坚守产品定位，符合投资目标、投资策略、跟踪误差等要求，具有充分的投资依据，并履行基金管理人内部决策程序。</p> <p>4、本基金在综合考虑预期收益、风险、流动性等因素的基础上，合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪业绩比</p>
--	---

	<p>险、流动性等因素的基础上，合理参与存托凭证的投资，以更好地跟踪<u>标的指数</u>，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金的股票资产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和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>2、禁止行为</p> <p>(4) 买卖其他基金份额，但是中国证监会另有规定的除外；(删除，修改后序号)</p> <p>五、业绩比较基准</p> <p><u>采用该比较基准主要基于如下考虑：</u></p> <p><u>由于本基金为被动投资指数基金，跟踪标的为中证 A500 指数，因此本</u></p> <p><u>较基准</u>，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。</p> <p>四、投资限制</p> <p>1、组合限制</p> <p>(1) 本基金投资于目标 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%；</p> <p>(3) 本基金若参与股指期货交易，应当符合下列投资限制：</p> <p>在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指目标 ETF、股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票及目标 ETF 总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定；</p>
--	---

<p><u>基金采用上述业绩比较基准。(删除)</u></p> <p>六、风险收益特征</p> <p>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，<u>主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，(删除)</u>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>十、未来条件许可情况下的基金模式转换</p> <p>本基金管理人可在条件成熟时另行安排在证券交易所场内接受基金份额的申购赎回和上市交易，使本基金转型为<u>跟踪同一标的指数的(删除)</u>上市型开放式基金（LOF），其场内申购赎回、上市交易、注册登记、收益分配等场内业务规则遵循本基金上市交易的证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定，届时需履行适当程序并提前公告。</p> <p>若将来本基金管理人推出<u>跟踪同一标的指数的交易型开放式指数基金(ETF)</u>，则基金管理人在履行适当</p>	<p>六、风险收益特征</p> <p>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，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>七、目标 ETF 发生相关变更情形时的处理</p> <p><u>目标 ETF 出现下述情形之一的，本基金将由投资于目标 ETF 的联接基金变更为直接投资该标的指数的指数基金。相应地，基金合同中将删除关于目标 ETF 的表述部分，届时将由基金管理人另行公告。</u></p> <p><u>(1) 目标 ETF 交易方式发生重大变更致使本基金的投资策略难以实现；</u></p> <p><u>(2) 目标 ETF 终止上市；</u></p> <p><u>(3) 目标 ETF 基金合同终止；</u></p> <p><u>(4) 目标 ETF 的基金管理人发生变更。</u></p> <p>(新增，并修改后续序号)</p> <p>十一、未来条件许可情况下的基金模式转换 (改序号)</p> <p>本基金管理人可在条件成熟时另行安排在证券交易所场内接受基金份额的申购赎回和上市交易，使本基金转型为上市型开放式基金（LOF），其场内申购赎回、上市交易、注册登记、收益分配等场内业务规则遵循本基金上市交易的证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的有关规定，届时需履行适当程序并提前公告。</p>
--	--

	程序后使本基金采取 <u>ETF 联接基金模式</u> 并相应修改《基金合同》，届时无须召开基金份额持有人大会但须提前公告。（删除）	
十三、基金的财产		一、基金资产总值 基金资产总值是指购买的 <u>目标 ETF 基金份额</u> 、各类证券及票据价值、银行存款本息和基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和。
十四、基金资产估值	<p>二、估值对象 基金所拥有的股票、存托凭证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p><u>1、证券交易所上市的有价证券的估值</u>（改后续序号）</p> <p>十、特殊情形的处理 <u>1、基金管理人按估值方法的第 12 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</u></p>	<p>二、估值对象 基金所拥有的<u>目标 ETF 份额</u>、股票、存托凭证、股指期货合约、债券和银行存款本息、应收款项、其它投资等资产及负债。</p> <p><u>四、估值方法</u> <u>1、目标 ETF 份额的估值</u> <u>本基金投资的目标 ETF 份额以目标 ETF 估值日基金份额净值估值，若估值日为非交易所营业日，以该基金最近估值日的基金份额净值估值。（新增）</u> <u>2、证券交易所上市的有价证券（目标 ETF 除外）的估值</u> <u>七、暂停估值的情形</u> <u>4、基金所投资的目标 ETF 发生暂停估值、暂停公告基金份额净值的情形；</u> <u>（新增，改序号）</u> </p> <p>十、特殊情形的处理 <u>1、基金管理人按估值方法的第 13 项进行估值时，所造成的误差不作为基金资产估值错误处理；</u></p>
十五、基金费用与税收	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p><u>1、基金管理人的管理费</u> <u>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</u> $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ $H \text{ 为每日应计提的基金管理费}$ $E \text{ 为前一日的基金资产净值}$ </p>	<p>二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式</p> <p><u>1、基金管理人的管理费</u> <u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：</u></p>

	<p>$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值, 若为负数, 则 E 取 0</p> <p>2、基金托管人的托管费 <u>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:</u> $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值</p>	<p>2、基金托管人的托管费 <u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额 (若为负数, 则取 0) 的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下:</u> $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值, 若为负数, 则 E 取 0</p>
十八、基金的信息披露		<p>五、公开披露的基金信息 公开披露的基金信息包括: (七) 临时报告 <u>25、本基金变更目标 ETF: (新增, 改序号)</u></p>
二十二、基金合同的效力	<p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续, 并经中国证监会书面确认后生效。</p>	<p>1、《基金合同》经基金管理人、基金托管人双方盖章以及双方法定代表人或授权代表签字并在募集结束后经基金管理人向中国证监会办理基金备案手续, 并经中国证监会书面确认后生效。<u>本基金基金合同由《广发中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》修订而来, 自 2024 年 11 月 18 日起, 本基金基金合同生效, 原《广发中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》同日失效。</u></p>

广发中证 A500 指数型证券投资基金转型为广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议修订对照表

基金名称	广发中证 A500 指数型证券投资基金	广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
三、基金托管人对基金管理人的业务监督和核查	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金主要投资于标的指数（即中证 A500 指数）的成份股、备选成份股（含存托凭证）。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（包括科创板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、存托凭证）、银行存款、债券（包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权、国债期货等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单以及法律法规或中国证监会允许本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> <p>基金的投资组合比例为：本基金的股票资产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和备选成份股（均含存托凭证）的比例不低于非现金基金资产的 80%；</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督；</p> <p>(1) 本基金的股票资产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和备选成份股（均含存托凭证）的资产不低于非现金</p>	<p>(一) 基金托管人根据有关法律法规的规定对基金管理人的下列投资运作进行监督：</p> <p>1、对基金的投资范围、投资对象进行监督。</p> <p>本基金主要投资于目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）。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（包括科创板、创业板及其他国内依法发行上市的股票、存托凭证）、银行存款、债券（包括国债、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券以及其他中国证监会允许投资的债券）、债券回购、金融衍生工具（包括股指期货、股票期权、国债期货等）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单以及法律法规或中国证监会允许本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）。<u>本基金的目标 ETF 为广发中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金。</u></p> <p>基金的投资组合比例为：本基金投资于目标 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%；</p> <p>2、对基金投融资比例进行监督；</p> <p>(1) 本基金投资于目标 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%；</p>

	<p><u>基金资产的 80%;</u></p>	<p>(3) 本基金若参与股指期货交易，应当符合下列投资限制： 在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的 10%；在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约、国债期货合约价值与有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%，其中，有价证券指目标 ETF、股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；在任何交易日日终，持有的卖出股指期货合约价值不得超过基金持有的股票及目标 ETF总市值的 20%；在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的 20%；（新增）</p>
十一、基金费用	<p>(一) 基金管理人的管理费 <u>本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提</u>。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值</p> <p>(二) 基金托管人的托管费 <u>本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提</u>。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值</p>	<p>(一) 基金管理人的管理费 <u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费</u>。本基金管理费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下： $H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金管理费 E 为前一日的基金资产净值—前一日所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0</p> <p>(二) 基金托管人的托管费 <u>本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费</u>。本基金托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值后的余额（若为负数，则取 0）的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下： $H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应计提的基金托管费 E 为前一日的基金资产净值—前一日</p>

		<u>所持有目标 ETF 基金份额部分的基金资产净值，若为负数，则 E 取 0</u>
--	--	---