广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金更新的招募说明书摘要

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
时间：二〇一九年五月

【重要提示】

本基金于2015年1月19日经中国证监会证监许可[2015]10号文准予募集注册。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

本招募说明书经中国证监会注册，但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。

投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。

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。

基金投资于境外证券市场，基金净值会因为境外证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，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，衍生品风险，包括衍生品市场风险和衍生品模型风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为非投资证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，从而获取基金投资收益，并承担相应的投资风险。本基金投资中出现的风险主要分为四类：一是与基金特有风险；二是与指数相关的风险，包括指数的授权、编制、后续风险、金融模型风险和跟踪误差风险；三是境外投资风险；四是开放式基金投资的一般风险，包括流动性风险、信用风险、利率风险等。

投资者可使用人民币或美元现金本基金的认购/申购申请，其中使用人民币认购/申购的份额将被确认为人民币份额，使用美元认购/申购的份额将被确认为美元份额。

投资有风险，投资人在认购或申购基金时应认真阅读本招募说明书与《基金合同》，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年5月30日，有关财务数据截止日为2019年12月31日，净值表现截止日为2018年12月31日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金的名称

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

第二部分 基金的类型

股票型证券投资基金。QDII

第三部分 基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪纳斯达克生物科技指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化，为投资者提供一个投资美国纳斯达克生物科技市场的有效投资工具。

第四部分 基金的投资范围

本基金主要投资于纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股。以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证、房地产信托凭证（可简称"REITs"）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构推出并报经中国证监会批准、获权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；可作为、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；银行存款、短期政府债券等货币市场工具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（但请遵守中国证监会的相关规定）。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。

基金的投资组合比例为：本基金对纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股及以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

第五部分 基金的投资策略

（一）资产配置策略

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0.5%以内，年跟踪误差控制在5%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施调整投资组合，跟踪误差进一步扩大。

本基金对纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股及以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

（二）权益类投资策略

1.股票组合构建方法

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按照标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复合标的指数的业绩表现。但若出现较为特殊的情况（例如成分股流动性不足、成份券投资受限、成分股长期停牌、成分股发生变更、成份股权重由于日由商通发生变化、成分股公司行为等），或变基金规模而投资受限，或因基金的中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，力争降低跟踪误差。

而股分成分股出现流动性欠佳或停牌等原因无法按配置进行交易时，基金管理人可以选择采用合理方法寻求替代，如选择属性相近的股票或股票组合，对替代性股票的选择一般需综合考虑著选股票和被替代股票的行业所属、基本面、相关性等多个方面，以达到减少跟踪误差的目的。

此外，对于其他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，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。

2.股票组合调整

（1）定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的纳斯达克生物科技指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

1）与指数相关的调整

当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，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。

2）申购赎回调整

根据本基金的申购赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）其他调整

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，而用替选股，甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、近价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。

3.目标基金投资策略

本基金基于控制投资组合跟踪误差与流动性管理的需要，可投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）。

（三）固定收益类投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具投资组合。

（四）衍生品投资策略

为了使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，本基金可投资于纳中期证监会允许的各种金融衍生产品，如与标的指数成标的指数成份股有关的期货、期权、远期合约、互换等衍生品，以期在控制风险的前提下，提高投资组合的投资效率，从而更好地跟踪标的指数。个别证券特有的非系统性风险，衍生品风险，包括衍生品市场风险和衍生品模型风险，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金投资于境外证券市场，基金净值会因为非投资证券市场波动等因素产生波动。在投资本基金前，投资者应全面了解本基金的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，从而获取基金投资收益，并承担相应的投资风险。本基金投资中出现的风险主要分为四类：一是与基金特有风险；二是与指数相关的风险，包括指数的授权、编制、后续风险、金融模型风险和跟踪误差风险；三是境外投资风险；四是开放式基金投资的一般风险，包括流动性风险、信用风险、利率风险等。

投资者可使用人民币或美元现金本基金的认购/申购申请，其中使用人民币认购/申购的份额将被确认为人民币份额，使用美元认购/申购的份额将被确认为美元份额。

投资有风险，投资人在认购或申购基金时应认真阅读本招募说明书与《基金合同》，全面认识本基金产品的风险收益特征，充分考虑投资人自身的风险承受能力，并对于认购或申购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。基金管理人提醒投资人基金投资要承担相应风险。

基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成本基金业绩表现的保证。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为2018年12月31日，有关财务数据截止日为2019年12月31日，净值表现截止日为2018年12月31日（财务数据未经审计）。

第一部分 基金的名称

广发纳斯达克生物科技指数型发起式证券投资基金

第二部分 基金的类型

股票型证券投资基金。QDII

第三部分 基金的投资目标

本基金采用被动式指数化投资策略，紧密跟踪纳斯达克生物科技指数，力求实现对标的指数的跟踪偏离度和跟踪误差最小化，为投资者提供一个投资美国纳斯达克生物科技市场的有效投资工具。

第四部分 基金的投资范围

本基金主要投资于纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股。以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）等。本基金还可投资全球证券市场中具有良好流动性的其他金融工具，包括已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券市场挂牌交易的普通股、优先股、全球存托凭证和美国存托凭证（可简称"REITs"）；已与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录的国家或地区证券监管机构推出并报经中国证监会批准、获权、信用、商品指数、基金等标的物挂钩的结构性投资产品；可作为、互换及经中国证监会认可的境外交易所上市交易的权证、期权、期货等金融衍生产品；银行存款、短期政府债券等货币市场工具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（但请遵守中国证监会的相关规定）。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。

基金的投资组合比例为：本基金对纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股及以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人在与基金托管人协商一致并履行相关程序后，可相应调整本基金的投资比例规定，不需经基金份额持有人大会审议。

第五部分 基金的投资策略

（一）资产配置策略

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0.5%以内，年跟踪误差控制在5%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施调整投资组合，跟踪误差进一步扩大。

本基金对纳斯达克生物科技指数成份股、备选成份股及以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）的投资比例不低于基金资产净值的90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

（二）权益类投资策略

1.股票组合构建方法

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按照标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整，以复合标的指数的业绩表现。但若出现较为特殊的情况（例如成分股流动性不足、成份券投资受限、成分股长期停牌、成分股发生变更、成份股权重由于日由商通发生变化、成分股公司行为等），或变基金规模而投资受限，或因基金的中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，力争降低跟踪误差。

而股分成分股出现流动性欠佳或停牌等原因无法按配置进行交易时，基金管理人可以选择采用合理方法寻求替代，如选择属性相近的股票或股票组合，对替代性股票的选择一般需综合考虑著选股票和被替代股票的行业所属、基本面、相关性等多个方面，以达到减少跟踪误差的目的。

此外，对于其他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，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。

2.股票组合调整

（1）定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的纳斯达克生物科技指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

（2）不定期调整

1）与指数相关的调整

当标的指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，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。

2）申购赎回调整

根据本基金的申购赎回情况，对股票投资组合进行调整，从而有效跟踪标的指数。

3）其他调整

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，而用替选股，甚至现金来代替，也可以选择与其行业相近、近价特征类似或者收益率相关性较高的其它股票来代替。

3.目标基金投资策略

本基金基于控制投资组合跟踪误差与流动性管理的需要，可投资于与本基金有相近的投资目标、投资策略、且以纳斯达克生物科技指数为投资标的的指数基金（包括ETF）。

（三）固定收益类投资策略

本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，构建本基金债券和货币市场工具投资组合。

（四）衍生品投资策略

为了使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，本基金可投资于境中期证监会允许的各种金融衍生产品，如与标的指数或