广发基金管理有限公司

关于旗下部分沪市 ETF 调整交易结算模式并修订基金合同的公告

上海证券交易所（以下简称“上交所”）联合中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）对跨市场 ETF 的申赎结算模式进行了调整优化，并自 2020 年 1 月 20 日起施行《上海证券交易所交易型开放式指数基金业务实施细则（2020 年修订）》（以下简称“上交所 ETF 细则”）。

根据上交所 ETF 细则，广发基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“我司”）经与相关基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，决定于 2020 年 1 月 20 日起，调整旗下部分沪市 ETF 产品的交易结算模式，并对相关基金的基金合同进行修订。具体情况公告如下：

1、本次调整交易结算模式的沪市 ETF 包括：由中国工商银行托管的广发中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：510510，基金简称：广发 500）、广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：510360，基金简称：广发 300）、广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：512680，基金简称：军工基金）、广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：512780，基金简称：京津冀基）、广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：512910，基金简称：100ETF）、广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：512980，基金简称：传媒 ETF）、广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金（基金代码：515600，基金简称：央企创新），以及由中国银行托管的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，基金简称：环保 ETF）。

2、根据上交所 ETF 细则，本次相关基金合同的修订主要是对“基金份额的申购与赎回”章节中“申购和赎回的清算交收与登记”的相关内容进行调整。修订后的申购和赎回的清算交收与规则如下：

“投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替

代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。

投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。”

上述修订事项对原有基金份额持有人的利益无实质性不利影响，并已向证监会履行备案手续，无需召开基金份额持有人大会。修订后的《基金合同》自 2020 年 1 月 20 日起生效，并将于本公告同日登载于公司网站等中国证监会指定的互联网网站，具体修订内容详见附件的合同修订对照表。本公司将在届时更新相关基金招募说明书时一并更新相关内容。

本公告仅对本次基金合同修订的事项予以说明，最终解释权归本公司。投资者欲了解基金信息，请登录本公司网站（www.gffunds.com.cn）查询或拨打本公司客户服务电话 95105828（免费长途话费）或 020-83936999 进行咨询。

特此公告。

广发基金管理有限公司

2020 年 1 月 15 日

附件：《广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

修订对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》	文件修订
第八部分 基金份额的申购与赎回	3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上海证券交易所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交付。 ……	3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 ……	根据沪市 ETF 交易结算的调整，相应的修改相关内容。

《广发中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

修订对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》	文件修订
第七部分 基金份额的申购与赎回	2、申购和赎回申请的确认 基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资者应及时查询有关申请的确认情况。 投资者申购的基金份额当日可以卖出，当日未卖出的基金份额在份额交收成功之前不得卖出和赎回；投资者赎回获得的股票在当日可以卖出。 3、申购和赎回的清算交收与登记 …… 本基金的申购业务采用净额结算和逐笔全额结算相结合的方式，其中上海证券交易所上市的成份股的现金替代、申购当日卖出的基金份额及对应的深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，申购当日未卖出的基金份额及对应的深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用逐笔全额结算。 本基金的赎回业务采用净额结算和代收代付相结合的方式，其中	2、申购和赎回申请的确认 基金投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。投资者应及时查询有关申请的确认情况。 3、申购与赎回的清算交收与登记 ……	根据沪市ETF交易结算的调整，相应的修改相关内容。

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
	上海证券交易所上市的成份股的现金替代采用净额结算，深圳证券交易所上市的成份股的现金替代采用代收代付；本基金上述申购赎回业务涉及的现金差额和现金替代退补款采用代收代付。 投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与申购当日卖出基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收与申购当日未卖出基金份额的交收登记以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。 投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上海证券交易所上市的成份股现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交付。 ……	投资者 T 日申购成功后，登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 投资者 T 日赎回成功后，登记机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 ……	

《广发沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

修订对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》	文件修订
第八部分 基金份额的申购与赎回	3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上交所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上交所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深交所上市的成份股现金替代的交付。 ……	3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 ……	根据沪市 ETF 交易结算的调整，相应的修改相关内容。

《广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

修订对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》	文件修订
第八部分 基金份额的申购与赎回	3、申购和赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上海证券交易所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交付。 ……	3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的交收登记以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后办理上海证券交易所上市的成份股交收与基金份额的注销以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算；在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 ……	根据沪市 ETF 交易结算的调整，相应的修改相关内容。

《广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

修订对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》	文件修订
第八部分 基金份额的申购与赎回	四、场内申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上海证券交易所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交付。 ……	四、场内申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 ……	根据沪市 ETF 交易结算的调整，相应的修改相关内容。

《广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》修订对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》	文件修订
第八部分 基金份额的申购与赎回	四、场内申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上海证券交易所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的成	四、场内申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购	根据沪市 ETF 交易结算的调整，相应的修改相关内容。

	份股现金替代的交付。 ……	赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 ……	

《广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

修订对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》	文件修订
第八部分 基金份额的申购与赎回	四、申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上海证券交易所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的	四、申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果	根据沪市 ETF 交易结算的调整，相应的修改相关内容

	成份股现金替代的交付。 ……	发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 ……	

《广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

修订对照表

章节	原文条款 内容	修改后条款 内容	说明
全文	《中国证券登记结算有限责任公司关于上海证券交易所交易型开放式基金登记结算业务实施细则》	《中国证券登记结算有限责任公司关于交易所交易型开放式证券投资基金登记结算业务实施细则》	文件修订
第八部分 基金份额的申购与赎回	四、申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购当日卖出基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理申购当日未卖出基金份额与现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。现金替代交收失败的，该笔申购当日未卖出基金份额交收失败。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理上海证券交易所上市的成分股现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结	四、申购与赎回的程序 3、申购与赎回的清算交收与登记 …… 投资者 T 日申购成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理申购基金份额与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 投资者 T 日赎回成功后，登记结算机构在 T 日收市后为投资者办理基金份额的注销与上海证券交易所上市的成份股的交收以及现金替代的清算；在 T+1 日办理现金替代的交收以及现金差额的清算，在 T+2 日办理	根据沪市 ETF 交易结算的调整，相应的修改相关内容

	果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。基金管理人不迟于 T+3 日办理赎回的深圳证券交易所上市的成份股现金替代的交付。 ……	现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。 ……	