

易方达中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1. 易方达中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）根据2022年6月28日中国证券监督管理委员会《关于准予易方达中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》（证监许可【2022】1360号）进行募集。

2.本基金是交易型开放式、股票型指数证券投资基金。

3.本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为中国工商银行股份有限公司，本基金登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4. 本基金募集对象为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。

5.本基金自2022年7月4日至2022年7月6日进行发售。本基金的投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式（本基金暂不开通网下股票认购），其中网下现金认购的日期为2022年7月4日至2022年7月6日，网上现金认购的日期为2022年7月4日至2022年7月6日。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。本公司可根据认购的情况适当调整募集时间，但最长不超过法定募集期限，并予以公告。

6. 本基金的网上现金发售通过具有基金销售业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理；本基金网下现金发售通过基金管理人指定的销售机构（包括直销机构和发售代理机构）公开发售。

7. 投资者认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户。投资者应保证用于认购的资金来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他方面的障碍。投资者已提交的身份证件或身份证明文件已过有效期，请及时办理相关更新手续，以免影响认购。投资者在认购时还应遵守销售机构有关反洗钱的相关要求，配合提供必要的客户身份信息与资料。

8.本基金的认购费用或认购佣金不超过认购份额的0.8%。

9. 募集规模上限

本基金首次募集规模上限为 80亿元人民币（不包括募集期利息和认购费用，下同）。

在募集期结束后，认购累计有效申请份额总额超过80亿份（折合为金额80亿元人民币），基金管理人将采取全程比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分的认购款项将在募集期结束后退还给投资者，由此产生的损失由投资者自行承担。

认购申请确认比例的计算方法如下：

认购申请确认比例=80亿份/有效认购申请份额总额

投资者认购申请确认份额=提交的有效认购申请份额×认购申请确认比例

“有效认购申请份额总额”、“投资者认购申请确认份额” 都不包括募集期利息和认购费用。

当认购发生部分确认时，认购申请确认份额不受认购最低限额的限制，将按照认购申请确认比例对每笔有效认购申请份额进行部分确认处理，因对每笔认购明细处理的精度等原因，最终确认的累计有效认购份额（不包括募集期利息和认购费用）可能会略微超过80亿份。最终认购申请确认结果以本基金登记结算机构的记录为准。

10.网上现金认购单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上（含10万份）。在本基金首次募集规模上限内，投资者可以多次认购，单个投资者的累计认购不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定，下同。

11.网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。网下现金认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

12. 销售机构对认购申请的受理并不表示对该申请的成功确认，而仅代表销售机构确实接受了认购申请，申请的成功确认应以登记结算机构的确认登记为准。投资者可以在基金合同生效后到各销售机构查询最终成交确认情况和认购的份额。

13.本基金《基金合同》生效后，符合基金上市交易条件的，本基金基金份额可申请在上海证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

14.本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解“易方达中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金”的详细情况，请仔细阅读刊登在本公司官网（www.efunds.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站(http://eid.csrc.gov.cn/fund)上的《易方达中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

15. 本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站（www.efunds.com.cn），投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金募集相关事宜。

16.各发售代理机构办理认购业务的办理网点、办理日期和时间等事项参照各发售代理机构的具体规定。

17.在发售期间，除本公告所列的发售代理机构外，如增加其他发售代理机构，将在基金管理人网站公示。

18.对未开设销售网点的地方的投资者，请拨打本公司的客户服务电话（4008818088）及直销中心专线电话（020—85102506）咨询购买事宜。

19.基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

20.基金募集期结束后，基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单，报上海证券交易所，经上海证券交易所有关部门认可后，在基金管理人网站公示。基金上市后，指定交易未在申购赎回代理券商的投资者只能进行本基金的二级市场买卖，如投资者需进行本基金申购赎回交易，须指定交易或转指定交易到申购赎回代理券商。

21.风险提示

（1）本基金标的指数为中证上海环交所碳中和指数。

1）样本空间

中证全指指数的样本空间

2）可投资性筛选

过去一年日均成交金额排名位于样本空间前90%

3）选择方法

①对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券，在各中证一级行业内剔除中证ESG得分位于后10%的证券；

②从剩余证券中，选取深度低碳和高碳减排两大领域的上市公司证券作为待选样本；

深度低碳领域：清洁能源与储能、绿色交通、减碳和固碳技术等；高碳减排领域：火电、钢铁、建材、有色金属、化工、建筑等；

③基于碳中和行业减排模型，计算深度低碳领域碳中和贡献度W1和高碳减排领域碳中和贡献度W2，不同年份两大领域碳中和贡献度得分/中证指数有限公司网站发布的指数编制方案附表；

根据上述两大领域碳中和贡献度得分，分配指数深度低碳领域样本数量N1和高碳减排领域样本数量N2：

N1=round（100×W1）

N2=100—N1

在两大领域中，分别按向下取整原则平均分配各子领域样本数量，并做进一步调整使得两大领域获配样本数量维持N1与N2不变；

④对深度低碳领域的待选样本，在各子领域中分别按过去一年日均总市值由高到低排名选取对应数量样本；对高碳减排领域的待选样本，在各子领域中分别按上海证券交易所上市公司碳减排综合评分由高到低排名选取对应数量样本。合计选取100只证券作为指数样本。

4）指数计算

指数计算公式为：

报告期指数=（报告期样本的调整市值/除数）×1000

其中，调整市值=∑（证券价格×调整股本数×权重因子）。调整股本数的计算方法、除数修正方法参见计算与维护细则。权重因子介于0和1之间，以使单个样本权重不超过10%，深度低碳领域权重为W1，高碳减排领域权重为W2。

有关标的指数具体编制方案及成份股信息详见中证指数有限公司网站，网址：www.csindex.com.cn。

（2）本基金投资于中证上海环交所碳中和指数成份股及备选成份股的资产不低于非现金资产的80%且不低于基金资产净值的90%，其投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金投资于证券期货市场，基金净值会因为证券期货市场波动等因素产生波动，投资有风险，投资者在投资本基金前，请认真阅读

基金管理人:易方达基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

二零二二年六月

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+佣金比率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例：某投资人通过某发售代理机构以上网现金认购方式认购1,000份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.8%，该笔认购最后按照100%比例全部予以确认，则投资人需支付的认购佣金和需准备的认购金额计算如下：

认购佣金=1.00×1,000×0.8%=8.00元

认购金额=1.00×1,000×（1+0.8%）=1,008.00元

即投资人需准备1,008.00元资金，方可认购到1,000份本基金基金份额。

2.认购限额

网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额需为1,000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资者可以多次认购，单个投资者的累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3.认购申请

投资人在认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金。办理认购手续。网上现金认购申请提交后，投资者可以在当日交易时间内撤销指定的认购申请。

（十三）网下现金认购

1.认购金额和利息折算的份额的计算

（1）通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用和认购金额的计算公式为：

认购费用=认购价格×认购份额×认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+认购费率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

净认购份额=认购份额+认购金额产生的利息/认购价格

认购费用由基金管理人向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。

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，具体份额以基金管理人的记录为准。利息折算的份额保留至整数位，小数部分舍去，舍去部分计入基金财产。

例：某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购本基金800,000份，认购费率为0.5%，假定认购金额产生的利息为10元，该笔认购最后按照100%比例全部予以确认，则投资人需支付的认购费用和需准备的认购金额计算如下：

认购费用=1.00×800,000×0.5%=4,000元

认购金额=1.00×800,000×（1+0.5%）=804,000元

该投资人所得认购份额为：净认购份额=800,000+10/1.00=800,010份

即，若该投资人通过基金管理人网下现金认购本基金800,000份，则该投资人的认购金额为804,000元，假定该笔认购金额产生利息10元，则可得到800,010份基金份额。

（2）通过发售代理机构进行网下现金认购的投资者，认购佣金和认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的计算。

2.认购限额

网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1,000份或其整数倍；投资者通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在10万份以上（含10万份）。投资者可以多次认购，单个投资者的累计认购份额不设上限，但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

3.认购手续

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后如需撤销以销售机构的规定为准。

二、发售方式及相关规定

（一）本基金在发售期内面向个人和机构投资者同时发售。

（二）本公司直销网点接受单笔认购份额在10万份以上（含10万份）的投资人的网下现金认购本基金的申请。

（三）发售代理机构的代销网点接受投资人（不分机构和个人）单笔认购份额为1,000份或其整数倍的网上现金认购（最高不得超过99,999,000份）、网下现金认购本基金的申请。

（四）发售期内投资人可以多次认购本基金。

三、投资人开户

投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户（以下统称证券账户）。

1.如投资人需新开证券账户，则应注意：

1）如投资人需要参与网下现金或网上现金认购，应使用上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户；上海证券交易所证券投资基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要参与基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所A股账户。

2）开户当日无法办理指定交易，建议投资人在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

2.如投资人已开立证券账户，则应注意：

1）如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

2）当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购，建议投资人在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

四、本基金的认购程序

（一）网上现金认购的程序

1.业务办理时间：

基金发售日的上午9:30—11:30和下午1:00—3:00（周六、周日及法定节假日不受理）。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，我司将作出相应调整并及时公告。

2.认购手续：

1）开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户，办理指定交易在发售代理机构。利用上海证券交易所网上系统以现金进行认购。

2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

3）投资人可通过填写认购委托单、电话委托、磁卡委托、网上委托等方式申报认购委托，可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以上上海证券交易所和发售代理机构的相关规则为准。

（二）网下现金认购的程序

1.直销中心

1）本公司直销中心接受认购份额在10万份（含10万份）以上的个人、机构投资者的认购。

2）业务办理时间：基金发售日的9:00—16:00（周六、周日及法定节假日不受理）。

3）投资者在本公司直销中心办理基金认购手续时需提供的资料，参见本公司网站上公布的相关业务办理指南。

易方达中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告

易方达中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金基金合同全文和招募说明书全文于2022年6月29日在本公司网站（www.efunds.com.cn）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）披露，供投资者查阅。如有疑问可拨打本公司客服电话（4008818088）咨询。

本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

4）投资者应在提出认购申请当日下午17:00之前，将足额认购资金（含认购费用）汇入本公司在工商银行、中国银行等开立的直销专户：

a.户名：易方达基金管理有限公司直销专户

开户银行：中国工商银行广州市东城支行

账号：3602031419200088891

b.户名：易方达基金管理有限公司直销专户

开户银行：中国银行广东省分行

账号：665257735480

c.其他直销专户信息，请见本公司网站。

投资者若未按上述办法划付认购资金，造成认购无效的，易方达基金管理有限公司及直销专户的开户银行不承担任何责任。

5）注意事项：

（1）若投资人的认购资金在认购申请当日17:00之前未到本公司指定的直销资金专户，则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期（即有效申请日）以资金到账日为准。在本基金发行截止日的17:00之前，若投资者的认购资金未到达本公司指定账户，则投资者提交的认购申请将被认定为无效认购。

（2）投资人汇款时，应提示银行柜台人员务必准确完整地传递汇款信息，包括汇款人和用途栏内容。

2.发售代理机构

1）业务办理时间：

基金发售日上午9:30—11:30和下午1:00—3:00（周六、周日及法定节假日不受理）。

2）认购手续：

（1）开立上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户，办理指定交易或转指定交易。

（2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

（3）投资人填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以基金管理人或各发售代理机构的规定为准。

五、过户登记与退款

本基金权益由登记结算机构在发售结束后完成过户登记。

通过基金管理人进行的网下现金认购，在发售期内被确认无效的认购资金或认购费用，将于认购申请被确认无效之日起三个工作日内向投资者的结算账户划出，在发售结束后被确认无效的认购资金或认购费用，将于验资完成日起三个工作日内向投资者的结算账户划出。

六、基金的验资与基金合同生效

基金募集期限届满，本基金具备基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起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，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

本基金募集失败时，基金管理人应承担全部募集费用，将已募集资金加计银行同期活期存款利息在募集期结束后30日内退还给认购人。

七、本次发售当事人或中介机构

（一）基金管理人

名称：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区荣粤道188号6层

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40—43楼

法定代表人：刘晓艳

成立时间：2001年4月17日

客户服务电话：400 881 8088

传真：（020）38799488

联系人：李红枫

（二）基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：陈四清

注册资本：人民币35,640,625.7089万元

联系电话：010—66105799

联系人：郭明

（三）销售机构

1.网下现金发售直销机构：易方达基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市横琴新区荣粤道 188 号 6 层

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40—43 楼

法定代表人：刘晓艳

电话：020—85102506

传真：4008818099

联系人：梁美

网址：www.efunds.com.cn

直销机构网站信息：

本公司直销中心销售本基金，网点具体信息详见本公司网站。

2.网下现金发售代理机构

暂无。基金管理人可根据实际情况变更网下现金发售代理机构，并在基金管理人网站公示。

3.网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员单位办理，具体名单可在上海证券交易所网站查询。

（四）登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：于文强

联系人：郑宏莉

电话：（021）58872935

传真：（021）68870311

（五）律师事务所和经办律师

律师事务所：广东金桥百信律师事务所

地址：广州市珠江新城珠江东路16号高德置地冬广场G座24楼

负责人：聂卫国

电话：020—83338668

传真：020—83338088

经办律师：徐桐桐、李笑

联系人：徐桐桐

（六）会计师事务所和经办注册会计师

本基金的法定验资机构为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

会计师事务所：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

主要经营场所：北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01—12室

执行事务合伙人：Tony Mao 毛鞍宁

电话：010—58153000

传真：010—85188298

经办注册会计师：昌华、马婧

联系人：昌华

易方达基金管理有限公司
2022年6月29日

金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。请充分了解本基金的风险收益特征，审慎做出投资决定。

特此公告。

易方达基金管理有限公司
2022年6月29日