

# 财通基金管理有限公司财通中证500指数增强型证券投资基金基金份额发售公告

## 【重要提示】

1、财通中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2023年5月10日中国证监会监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]1028号文进行募集。中国证监会对本基金的注册并不代表中国证监会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。

2、本基金为契约型开放式、股票型。

3、本基金的管理人为财通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本公司”),基金托管人为中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”),注册登记机构为财通基金管理有限公司。

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2023年6月26日至2023年7月14日,通过本公司的直销中心、网上交易平台及其他销售渠道公开发售,具体名单见本公告的附件。本公司可根据基金销售情况,依据法律法规和基金合同的规定适当延长或缩短基金募集期限,并及时公告。但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

各销售渠道的销售网点、业务办理日期和具体时间等事项以各销售机构在其各销售渠道市当地的公告为准。在募集期间,除本公司所列的代销机构外,如本基金增加其他代销机构的,本公司将及时登录于基金管理人网站。基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

投资人如有任何问题,可拨打本公司的客户服务电话400-820-9888(免长途话费)咨询购买事宜。

6、投资人欲购买本基金,需开立本公司注册登记机构提供的基金账户。投资者可在不同销售机构开户,但每个投资者只允许开立一个基金账户。若已经在本基金注册登记机构开立开放式基金账户的,则无需再次办理开户手续。募集期内本公司直销中心和指定的基金销售机构网点同时为投资者办理开户和认购手续。开户和认购申请可同时办理。若投资者在不同的销售机构处重复开立基金账户导致认购失败的,基金管理人和销售机构不承担认购失败责任。

7、本基金认购最低限额:投资者在本公司直销中心首次认购最低金额为50,000元人民币(含认购费),追加认购每笔最低金额1,000元人民币(含认购费);通过本公司网上交易平台办理本基金认购业务的不受直销中心最低认购金额的限制,最低认购金额为单笔1元(含认购费)。各销售渠道对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。投资人在募集期间内可多次认购基金份额,但认购申请一经销售机构受理,则不可以撤销。

8、投资人应保证用于认购的资金来源合法,投资人应有权自行支配,不存在任何法律上、合约上或其他方面的障碍。投资人已提交的身份证件或身份证明文件如已过有效期,请及时办理更新手续,以免影响认购。

9、销售机构对投资人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,申请的成功确认以基金注册登记机构的确认登记为准。投资人可以在基金合同生效后到认购网点查询认购成交确认情况。

10、本公司仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况,请详细阅读2023年6月14日发布本公司网站([www.ctfund.com](http://www.ctfund.com))等指定网站上的《财通中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)等文件,投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格并了解基金份额发售的相关事宜。本基金的基金合同及招募说明书揭示性公告和本公司将刊登在中国证券报。

11、基金管理人提示投资人充分了解投资基金的风险及收益特征,根据自身的风险承受能力,审慎选择适合自己的基金产品。基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人本基金投资的“买者自负”原则,在投资人做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。投资人投资于本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

## 12. 风险提示:

本基金为证券投资基金,证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此,宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业与个股业绩的变化,投资人风险收益偏好和市场流动度等因素影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩,从而产生市场风险,投资人对投资基金基金前,应全面了解本基金的产品特性、理性判断市场,并承担基金投资中出现的各种风险,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、本基金的特定风险等。本基金的一般风险及特别风险详见本基金招募说明书中“风险揭示”部分。

本基金是指数增强型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金,债券型基金与货币市场基金。基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资人根据所持有的基金份额享受基金收益,同时承担相应的投资风险。

本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股,跟踪中证500指数,其风险收益特征与标的指数所反映的市场的组合的风险收益特征相似。

本基金为指数基金,投资人投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险。

本基金努力将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.5%以内,年化跟踪误差控制在7.75%以内,但因标的指数编制规则或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围,本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。

未来可能出现的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素致使标的指数不符合要求的情形除外),指数编制机构退出等情况,基金管理人应当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,并在一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,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。

本基金的操作过程中,当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市,且指数编制机构暂未作出调整的,基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则,履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整,可能影响投资者的投资损益并给基金资产跟踪偏离度和跟踪误差带来不利影响。科创板上市企业均为科技创新型企业,其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似,基金难以通过分散投资降低投资风险,若股票价格同向波动,将引起基金资产价值波动。

本基金可投资股指期货、股票期权,股指期货、股票期权采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货、股票期权采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规则将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

本基金可投资存托凭证,面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。

本基金可投资于资产支持证券,资产支持证券的风险主要与资产质量有关,比如债务人违约可能性的高低,债务人行使抵消权可能性的高低,资产收益受自然灾害、战争、罢工的影响程度,资产收益与外部经济环境变化的相关性等。如果资产支持证券受上述因素的影响程度低,则资产风险小,反之则风险高。

本基金根据法律法规和基金合同的约定参与融资及转融通证券出借交易业务,可能存在市场风险、流动性风险、信用风险等特定风险。

基金存续期内,连续50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5000万元情形的,本基金将根据基金合同的约定进行基金财产清算并终止,且无需召开基金份额持有人大会。因此本基金面临自动清算的风险。

本基金为契约型开放式基金,基金规模将随着基金投资者对基金份额的申购和赎回而不断波动。基金投资者的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现,而导致基金的投资组合流动性不足;或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低,造成基金资产变现的损失,从而产生流动性风险。

投资人应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、《基金产品资料概要》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销资格的其他机构购买和赎回基金,基金管理人名单详见本公告以及基金管理人官网。

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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人投资基金的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。

13、本基金单一投资人持有基金份额不得达到或超过基金份额总数的50%,但在基金运作过程中因基金份额赎回等形式导致被动达到或超过50%的除外,如本基金单一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%,基金管理人有权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单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避前述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。

## 一、本次基金份额发售基本情况

(一) 基金名称及代码

基金名称:财通中证500指数增强型证券投资基金

基金代码:018633(A类)、018634(C类)

(二) 基金的类别

股票型证券投资基金

(三) 基金的运作方式

契约型开放式

(四) 基金存续期限

不定期

(五) 基金份额初始面值(认购价格)

每份基金份额初始面值为人民币1.00元

(六) 基金的投资目标

## 基金管理人:财通基金管理有限公司

## 基金托管人:中信证券股份有限公司

二〇二三年六月

本基金为股票型指数增强基金,在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上,结合增强型的主动投资,进行积极的组合管理和风险控制,力求实现超越标的指数的业绩表现,谋求基金资产的长期增值。

(七) 募集对象

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。

(八) 基金份额类别

本基金根据销售费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购时收取认购、申购费用,但不从本类别基金份额中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用,而从本类别基金份额中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为:计算日某类别基金份额净值=计算日该类别基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间暂不开通互换交易业务。如后续开通此项业务的,无需召开基金份额持有人大会审议,但调整前基金份额持有人需及时公告。

(九) 基金募集方式

通过基金管理人指定的销售机构发售。

(十) 销售渠道与销售地点

1. 直销中心

本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上交易平台

财通基金管理有限公司

地址:上海市银城中路68号时代金融中心43/45楼

电话:021-2053 7888

传真交易专线:021-6888 8169

直销联系人:何亚玲

发售期间,客户可以通过本公司客服中心电话400-820-9888(免长途话费)进行募集相关事宜的问询、开放式基金的投资咨询及投诉等。

网上交易平滑地址:[www.ctfund.com](http://www.ctfund.com)

官方APP:财通基金

财通基金微管家(微信号:ctfund88)

2. 代销机构

代销机构的联系方式请见本公告的附件,如在募集期间新增代销机构,则将及时登录于基金管理人网站。

如本次募集期间代销机构新增营业网点则由该代销机构另行公告。

(十一) 募集时间安排与基金合同生效

本基金的募集期限为2023年6月26日至2023年7月14日。基金管理人可根据认购的情况,依法合规和基金合同的规定适当延长或缩短募集期限,但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

本基金自基金份额发售之日起至基金合同生效前,投资人将基金资产净值归入基金管理人名下,基金管理人将基金资产净值归入基金合同生效后的基金资产。

本基金基金份额净值不小于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规和基金合同的规定决定停止基金发售,基金管理人应在10日内聘请法定验资机构验资,自书面验资报告之日起10日内,向中国证监会办理基金备案手续。

本基金合同生效后,基金管理人将向基金合同当事人发出基金合同生效的书面确认函。

(十二) 销售费用

本基金采用金额认购的方式。

(十三) 认购费用

(一) 本基金采用金额认购的方式。

(二) 本基金认购采取全额缴款认购的方式。投资人认购时,需按销售机构规定的方式准备足额的认购款项。

(三) 基金募集期间,投资人可多次认购基金份额,但已受理的认购申请不允许撤销。

(十四) 认购费用

(一) 本基金A类基金份额在认购时收取认购费用。

(二) 本基金C类基金份额不收取认购费用。

(十五) 基金份额的认购费率

本基金A类基金份额的认购费率如下所示:

单笔认购金额(M)	认购费率
M < 100万	1.2%
100万 ≤ M < 300万	0.8%
300万 ≤ M < 500万	0.4%
M ≥ 500万	1000元/笔

(注:M:认购金额;单位:元)

A类基金份额的认购费用不列入基金财产,主要用于基金的市场推广、销售、登记等募集期间发生的各项费用。

投资人多次认购A类基金份额的,须按每笔认购所对应的费率档次分别计算。

(十六) 认购份额的计算

认购份额的计算结果均以人民币元为单位,四舍五入,保留到小数点后2位;认购金额保留到小数点后2位;认购费用保留到小数点后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份额持有人承担。

当认购费用适用比例费率时,认购份额的计算方法如下:

净认购金额 = 认购金额 / (1 + 认购费率)

认购费用 = 认购金额 - 净认购金额

认购份额 = (净认购金额 - 认购金额) / 基金份额发售面值

当认购费用为固定金额时,认购份额的计算方法如下:

认购费用 = 固定金额

净认购金额 = 认购金额 - 认购费用

认购份额 = (净认购金额 + 认购金额) / 基金份额发售面值

例一:某投资人认购本基金A类基金份额10,000元,认购费率1.2%,假定募集期间产生的利息为1元,则可认购的A类基金份额为:

净认购金额 = 10,000 / (1 + 1.2%) = 9,881.42元

认购费用 = 10,000 - 9,881.42 = 118.58元

认购份额 = (9,881.42 + 1.00) / 1.00 = 9,882.42份

即:该投资人投资10,000元认购本基金A类基金份额,可得到9,882.42份A类基金份额。

(十七) 基金份额的认购限制

(一) 投资者在本公司直销中心首次认购最低金额为50,000元人民币(含认购费),追加认购每笔最低金额1,000元人民币(含认购费)。通过本公司网上交易平台办理本基金认购业务的不受直销中心最低认购金额的限制,最低认购金额为单笔1元(含认购费)。各销售渠道对本基金最低认购金额及交易级差有其他规定的,以各销售机构的业务规定为准。

(二) 基金投资者认购本基金的金额不得超过基金资产净值的50%比例要求,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。

(十八) 基金募集期间的利息处理方式

有效认购款项在募集期间产生的利息