

万家上证科创板成长交易型开放式指数证券投资基金 基金份额发售公告

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

重要提示

1.万家上证科创板成长交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)于2024年7月2日经中国证券监督管理委员会证监许可[2024]1022号文准予注册。中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的投资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。

2.本基金为交易型开放式、股票型证券投资基金。

3.本基金的管理人为万家基金管理有限公司(以下简称“本公司”),登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,托管人为国泰君安证券股份有限公司。

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、境内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者。

5.本基金将自2024年10月21日至2024年11月1日进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购2种方式(本基金暂不开通网下股票认购)。

6.网下现金发售的日期为2024年10月21日至2024年11月1日,网上现金发售的日期为2024年10月30日至2024年11月1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。本公司可根据募集情况适当延长或缩短本基金的募集期限,但最长不超过法定募集期限,并予以公告。

7.网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构用上海证券交易所网站上系统以现金方式进行的认购,网下现金认购是指投资人通过基金管理人及其指定的发售代理机构以现金方式进行的认购。募集期间,基金管理人可根据情况变更或增减发售代理机构。

8.投资者认购本基金时需具有上海证券账户,证券账户是指上海证券交易所A股账户(以下简称“上海A股账户”)或上海证券交易所证券投资基金账户(以下简称“上海证券投资基金账户”)。

9.已有上海A股账户或上海证券投资基金账户的投资者不必再办理开户手续。

尚无上海A股账户或上海证券投资基金账户的投资者,需在认购前持本人身份证件到中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的开户代理机构办理上海A股账户或上海证券投资基金账户的开户手续。有关开设上海A股账户和上海证券投资基金账户的具体程序和办法,请到各开户网点详细咨询有关规定。

(1)如投资人需新开立证券账户,则需注意:

10.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。

11.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办理本基金发售业务的证券公司。

12.当办理指定交易或转指定交易的投资者当日上午无法进行认购,建议投资人进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

13.已购买过由万家基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资者,其拥有的万家基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

8.募集规模上限

本基金首次募集规模上限为20亿元人民币(不包括募集期利息和认购费用),除基金管理人相关公告另有规定,基金合同生效后将不再受此募集规模的限制。

(1)募集结束后,若本基金募集期内的有效认购申请全部确认后的总份额不超过20亿份(折合为金额20亿元人民币),则投资者在募集期内提交的有效认购申请全部予以确认。

(2)募集结束后,若本基金募集期内的有效认购申请全部确认后的总份额超过20亿份(折合为金额20亿元人民币),基金管理人将对募集期内的有效认购申请采用“全程比例确认”的原则给予部分确认,未确认部分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。当发生比例确认时,基金管理人将及时公告比例确认情况和结果,认购申请确认比例的计算方法如下(不含募集期利息):

募集期有效认购申请确认比例=20亿份/(募集期内有效网上现金认购份额+募集期内有效网下现金认购份额)。

网上现金认购和网下现金认购的投资者有效认购申请确认份额=投资者在募集期内的有效认购份额/募集期有效认购申请确认比例。

(3)当发生部分确认时,本基金登记机构按照募集期有效认购申请确认比例对募集期有效认购申请份额进行部分确认,因对每笔认购明细处理的精度等原因,最终确认的基本金的现金认购有效认购份额(不含募集期利息)可能会略微高于或低于20亿份。最终投资者有效认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记机构的计算并确认的结果为准。敬请投资者注意,当采用“全程比例确认”的方式,将导致投资者认购申请确认金额低于认购申请金额,可能会出现认购费用的适用费率高于认购申请金额对应的费率的情况。

9.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,网下现金认购以基金份额申请。投资人通过基金管理人和发售代理机构办理网下现金认购时,每笔认购份额须为1000份或其整数倍。投资人可以多次认购,单个投资人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限制的规定。

10.网上现金认购申请提交后,投资人可以在当日上午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。

11.本基金基金份额销售面值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元。

12.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、合约上或其他障碍。

13.销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接受到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的任何损失由投资者自行承担。

14.本公告仅对万家上证科创板成长交易型开放式指数证券投资基金发售的有关事项及规定予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在中国证监会规定信息披露媒介上的《万家上证科创板成长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.wjasset.com)。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.各销售机构的销售网点以及开户、认购等事项的详细情况请向各销售机构咨询。

17.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热线(400-888-0800,万家基金管理公司网站(www.wjasset.com))或者通过其他渠道咨询购买事宜。

18.基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

19.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,报上海证券交易所等有关部门认可后,予以公告或公示。本基金基金份额上市后,未指定交易在申购赎回代理券商的基金份额只能进行二级市场买卖,如投资者需进行本基金基金份额的申购赎回交易,须指定交易或转指定到本基金的申购赎回代理券商。

20.风险提示
本基金标的指数为上证科创板成长指数。

(1)样本空间
指样空间由满足以下条件的科创板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成:

1)上市时间超过6个月,除非上市以来日均总市值排名在科创板市场前5位且上市时间超过3个月;

2)非退市风险警示证券;

3)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
对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券,分别计算如下指标:最新季度营收TTM环比增长率、最新季度扣非净利润TTM环比增长率、过去12个季度营收TTM环比增长率平均、过去12个季度扣非净利润TTM环比增长率、过去12个季度营收TTM环比增长率回得到的增长趋势;

2)将上述指标经过极值和标准化处理后得分相加作为综合得分,按照综合得分由高到底排名,选取排名前50的证券作为指数样本。

(4)指数计算
指数的计算公式为:报告期指数=报告期样本的调整市值/除数×1000。其中,调整市值=Σ(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%。

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官方网站,网址:<http://www.csindex.com.cn>。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券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,应当认真阅读基金招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,全面认识本基金产品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,理性判断市场,自主判断基金的投资价值,对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,承担基金投资中出现的各种风险。投资基金可能遇到的风险包括:市场风险、管理风险、流动性风险、本基金特有的风险和其他风险等。本基金特有的风险包括:(1)投资科创板股票的风险。包括科创板企业退市风险、市场风险、流动性风险、监管规则变化的风险等;(2)指数化投资的风险,包括标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、成份股权重较大的风险、基金投资组合与标的指数回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险等;(3)ETF运作的风险,包括可接受股票认购导致的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、基金交易价格与份额净值发生偏离的风险、成份股停牌的风险、投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险、申购赎回清算差错风险、申购赎回清算单识别设置不合理的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险、第三方机构服务的风险、退市风险等;(4)本基金投资特定品种特有的风险,包括参与股指期货交易风险、参与国债期货交易风险、股票期权投资风险、资产支持证券投资基金风险、存托凭证投资风险、参与融资和融通证券出借业务的风险等。

本基金的投资范围包括存托凭证,除与其他仅投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临投资存托凭证的特殊风险。

本基金为股票型基金,其长期平均风险和预期收益率理论上高于混合型基

金、债券型基金和货币市场基金。

本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪上证科创板成长指数,其风险收益特征与标的指数所表示的市场组合的风险收益特征相似。

本基金的具体风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

在现有结算规则下,投资者申购的基本份额当日可卖出,投资者赎回获得的股票当日可卖出。

投资者投资于本基金前请认真阅读证券交易所及登记机构的相关业务规则及其不时的更新,确保具备相关专业知识后方可参与本基金的认购、申购、赎回及交易。投资者一旦认购、申购或赎回本基金,即表示对基金认购、申购和赎回所涉及的基金份额的证券变更登记方式以及申购赎回所涉及组合证券、现金替代、现金差额等相关的交收方式已经认可。

基金管理人提醒投资者投资基金的“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。此外,本基金以1.00元初始面值进行募集,在市场波动等因素的影响下,存在单位份额净值跌破1.00元初始面值的风险。

基金管理人提醒投资者有可能获得较高的收益,也有可能损失本金。投资基金有风险,投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的招募说明书、《基金合同》及基金产品资料概要。

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。基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。

一、本次募集基本情况

1.基金名称

万家上证科创板成长交易型开放式指数证券投资基金(场内简称:科创板万家;扩位简称:科创板成长ETF;基金认购代码:588073,基金证券代码:588070)。

2.基金运作方式和类型

交易型开放式、股票型证券投资基金。

3.基金存续期限

不定期

4.基金份额发售面值、认购价格

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元。

5.基金销售机构

具体各发售代理机构和直销机构的联系方式请见“八、本次募集当事人和中介机构”的“(三)基金销售机构”的相关内容。基金管理人可根据情况变更或增减发售代理机构,并在基金管理人网站公示。

6.基金投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

7.发售时间安排与基金合同生效

(1)本基金的募集期自基金份额发售之日起最长不得超过3个月。

(2)本基金将自2024年10月21日至2024年11月1日进行发售。其中,网下现金发售的日期为2024年10月21日至2024年11月1日,网上现金发售的日期为2024年10月30日至2024年11月1日。本基金暂不开通网下股票认购。在认购期内,本基金向个人投资者和机构投资者同时发售。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。基金管理人将根据认购时间作出调整,本公司将作出相应调整并及时公告。基金管理人根据认购时间作出调整,本公司将作出相应调整并及时公告。

(3)使用专用席位的机构投资者无需办理指定交易。

(4)已购买过由万家基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资者,其拥有的万家基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

8.募集规模上限

本基金首次募集规模上限为20亿元人民币(不包括募集期利息和认购费用),除基金管理人相关公告另有规定,基金合同生效后将不再受此募集规模的限制。

(1)募集结束后,若本基金募集期内的有效认购申请全部确认后的总份额不超过20亿份(折合为金额20亿元人民币),则投资者在募集期内提交的有效认购申请全部予以确认。

(2)募集结束后,若本基金募集期内的有效认购申请全部确认后的总份额超过20亿份(折合为金额20亿元人民币),基金管理人将对募集期内的有效认购申请采用“全程比例确认”的原则给予部分确认,未确认部分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。当发生比例确认时,基金管理人将及时公告比例确认情况和结果,认购申请确认比例的计算方法如下(不含募集期利息):

募集期有效认购申请确认比例=20亿份/(募集期内有效网上现金认购份额+募集期内有效网下现金认购份额)。

网上现金认购和网下现金认购的投资者有效认购申请确认份额=投资者在募集期内的有效认购份额/募集期有效认购申请确认比例。

(3)当发生部分确认时,本基金登记机构按照募集期有效认购申请确认比例对募集期有效认购申请份额进行部分确认,因对每笔认购明细处理的精度等原因,最终确认的基本金的现金认购有效认购份额(不含募集期利息)可能会略微高于或低于20亿份。最终投资者有效认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。最终认购申请确认结果以本基金登记机构的计算并确认的结果为准。敬请投资者注意,当采用“全程比例确认”的方式,将导致投资者认购申请确认金额低于认购申请金额,可能会出现认购费用的适用费率高于认购申请金额对应的费率的情况。

9.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,网下现金认购以基金份额申请。投资人通过基金管理人和发售代理机构办理网下现金认购时,每笔认购份额须为1000份或其整数倍。投资人可以多次认购,单个投资人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限制的规定。

10.网上现金认购申请提交后,投资人可以在当日上午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。

11.本基金基金份额销售面值为人民币1.00元,认购价格为人民币1.00元。

12.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、合约上或其他障碍。

13.销售机构对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接受到认购申请。认购申请的确认以登记机构的确认结果为准。对于认购申请及认购份额的确认情况,投资者应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的任何损失由投资者自行承担。

14.本公告仅对万家上证科创板成长交易型开放式指数证券投资基金发售的有关事项及规定予以说明,投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在中国证监会规定信息披露媒介上的《万家上证科创板成长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.wjasset.com)。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.各销售机构的销售网点以及开户、认购等事项的详细情况请向各销售机构咨询。

17.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热线(400-888-0800,万家基金管理公司网站(www.wjasset.com))或者通过其他渠道咨询购买事宜。

18.基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

19.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,报上海证券交易所等有关部门认可后,予以公告或公示。本基金基金份额上市后,未指定交易在申购赎回代理券商的基金份额只能进行二级市场买卖,如投资者需进行本基金基金份额的申购赎回交易,须指定交易或转指定到本基金的申购赎回代理券商。

20.风险提示
本基金标的指数为上证科创板成长指数。

(1)样本空间
指样空间由满足以下条件的科创板上市的股票和红筹企业发行的存托凭证组成:

1)上市时间超过6个月,除非上市以来日均总市值排名在科创板市场前5位且上市时间超过3个月;

2)非退市风险警示证券;

3)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
对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券,分别计算如下指标:最新季度营收TTM环比增长率、最新季度扣非净利润TTM环比增长率、过去12个季度营收TTM环比增长率平均、过去12个季度扣非净利润TTM环比增长率、过去12个季度营收TTM环比增长率回得到的增长趋势;

2)将上述指标经过极值和标准化处理后得分相加作为综合得分,按照综合得分由高到底排名,选取排名前50的证券作为指数样本。