

招商中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金份额发售公告

基金管理人：招商基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
登记机构：招商基金管理有限公司
重要提示

- 招商中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）的发售已获中国证监会证监许可【2024】1433号文准予注册。
- 本基金类型为契约型开放式、ETF联接基金。
- 本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司（以下简称“招商基金”或“本公司”），托管人为中国工商银行股份有限公司，登记机构为招商基金管理有限公司。
- 本基金自2024年10月25日至2024年11月14日（具体办理业务时间见各销售机构的相关业务公告或拨打客户服务电话咨询）通过销售机构公开发售。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间，并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
- 募集规模上限
 本基金首次募集规模上限为80亿元人民币（不含募集期利息，下同）。基金募集过程中，募集规模接近、达到或超过80亿元时，基金可提前结束募集。在募集期内任何一日（含首日），若当日募集截止时后基金份额累计有效认购申请金额（不包括利息，下同）合计超过80亿元，基金管理人将采取末日比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生末日比例确认时，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。

- 当发生部分确认时，当日投资者认购的认购费率按照认购申请确认金额所占的费率计算，当日投资者认购申请确认金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。
- 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
- 本基金的销售机构包括直销机构和非直销销售机构。
- 投资者欲购买本基金，需开立登记机构提供的基金账户。发行期内本公司、本公司直销柜台及网站均提供投资者办理开户和认购手续。
- 投资者在募集期内可以多次认购基金份额，A类基金份额的认购费按每笔认购申请单独计算，认购申请一经受理不得撤销。投资者通过非直销销售机构认购，单个基金账户首次单笔最低认购金额为1元（含认购费），追加认购单笔最低金额为1元（含认购费），具体认购金额由各非直销销售机构制定和调整。通过本基金管理人官网交易平台认购，单个基金账户首次单笔最低认购金额为1元（含认购费），追加认购单笔最低金额为1元（含认购费）。通过本基金管理人直销柜台认购，单个基金账户的首次单笔最低认购金额为50万元（含认购费），追加认购单笔最低金额为1元（含认购费）。
- 基金销售机构（包括各非直销销售机构和本公司直销机构）对认购申请的处理并不代表申请一定成功，而仅代表销售机构确实接收到认购申请。认购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。

- 投资者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，其中利息转份额的具体数额以登记机构的记录为准。
- 本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请仔细阅读刊登在基金管理人网站（www.cmfchina.com）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）上的《招商中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）等法律文件。本基金的基金合同及招募说明书提示性公告以及本公告将同时刊登在中国证券报上。
- 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.cmfchina.com），投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格及了解本基金发售的相关事宜。
- 非直销销售机构的销售网点以及开户和认购等事项详见各非直销销售机构在各销售城市当地主要报刊刊登的公告或在各销售网点发布的公告。对于位于未开设销售网点地区的投资者，可拨打本公司的客户服务电话（400—887—9656（免长途费））垂询认购事宜。
- 在发售期间，基金管理人可根据有关法律法规规定调整销售机构，并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况增加或减少其销售城市、网点，请留意本公司网站公示及各非直销销售机构的公告，或拨打本公司及各非直销销售机构客户服务电话咨询。
- 本公司可综合各种情况对发售安排做适当调整，并可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

- 1) 证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是通过分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。
- 2) 巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过上一日本基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

- 3) 基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资人承担的风险也越大。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，并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投资人的风险承受能力相适应。
- 4) 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，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因整体政治、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，由于基金投资人连续大量赎回基金产生的流动性风险，投资者申购、赎回失败的风险，基金管理人因基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特有风险等。

- 5) 本基金的具体的运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特定风险详见招募说明书的“风险提示”部分。
- 6) 本基金的特定风险包括：
 - 1) 投资于目标ETF基金带来的风险
 - 由于主要投资于目标ETF，在多数情况下将维持较高的目标ETF投资比例，基金净值可能会随目标ETF的净值波动而波动，目标ETF的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。所以本基金会面临诸如目标ETF的管理风险及操作风险、目标ETF基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、目标ETF的技术风险等风险。
 - 2) 跟踪偏离风险
 - 本基金主要投资于目标ETF基金份额，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回。以下因素可能会影响到基金的投资组合与跟踪基准之间产生偏离：
 - ①目标ETF与标的指数的偏离。
 - ②基金买卖目标ETF时所产生的价格差异、交易成本 and 交易冲击。
 - ③基金调整资产配置结构时所产生的跟踪误差。
 - ④基金申购、赎回因素所产生的跟踪误差。
 - ⑤基金现金资产拖累所产生的跟踪误差。
 - ⑥基金的管理费、托管费等费用所产生的跟踪误差。
 - ⑦其他因素所产生的偏差。
 - 3) 与目标ETF业绩差异的风险
 - 本基金为与目标ETF的联接基金，但在运作方式、交易方式等方面与目标ETF不同，本基金的业绩表现与目标ETF的业绩表现可能出现差异。
 - 4) 其他投资于目标ETF的风险
 - 如参考目标ETF IOPV决策和IOPV计算错误的风险、目标ETF退市风险、申购赎回失败风险等。
 - 5) 标的指数的风险
 - 标的指数的编制、标的指数的指数编制、数据发布等环节出现问题而引起本基金依据标的指数投资而产生的风险。因标的指数编制方法的不成熟也可能导致指数调整较大，增加基金投资成本，并有可能因此而增加跟踪误差，影响投资收益。
 - 6) 标的指数的波动风险
 - 标的指数的构成成份券价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。
 - 7) 标的指数的回报与股票市场的平均回报偏离的风险
 - 标的指数并不能完全代表整个股票市场。标的指数的回报率与股票市场的平均回报率可能存在偏离。
 - 8) 跟踪误差控制未达约定目标的风险
 - 本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在4%以内，但因标的指数编制规则调整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出现较大偏差。

- 9) 指数编制机构停止服务的风险
 本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起一个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式，与其他基金合并，或者终止基金合同等，并在6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。投资人将面临转换运作方式，与其他基金合并，或者终止基金合同等风险。
- 10) 指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。
- 11) 成份券停牌的风险
 标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份券停牌时可能面临如下风险：基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

- 12) 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
- 13) 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
- 14) 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
- 15) 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (2) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (3) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

7. 本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务无法在到期日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而去交交易机会。
8. 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
9. 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
10. 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
11. 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (2) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

7. 本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务无法在到期日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而去交交易机会。
8. 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
9. 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
10. 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
11. 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (2) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

7. 本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务无法在到期日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而去交交易机会。
8. 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
9. 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
10. 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
11. 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (2) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

7. 本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务无法在到期日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而去交交易机会。
8. 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
9. 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
10. 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
11. 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (2) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

7. 本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务无法在到期日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而去交交易机会。
8. 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
9. 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
10. 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
11. 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (2) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

7. 本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务无法在到期日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而去交交易机会。
8. 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
9. 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
10. 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
11. 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (2) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

7. 本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务无法在到期日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而去交交易机会。
8. 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
9. 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
10. 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
11. 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 (2) 对于认购本基金C类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用=（认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 本基金认购费用=认购金额+认购资金利息/基金份额初始面值
 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
 认购金额=认购金额-认购费用
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值

7. 本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务无法在到期日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而去交交易机会。
8. 本基金的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、发起资金提供方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境内投资者。
9. 本基金的发售日期自2024年10月25日至2024年11月14日。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间并及时公告，但最长不超过法定募集期限。
10. 办理认购的销售机构
 请见本公告“六、本次基金发售当事人或中介机构”中“（三）销售机构”。
11. 基金的认购费用及认购份额
 1. 基金面值
 本基金基金份额初始面值为人民币1.00元。
2. 认购价格
 本基金按初始面值发售，认购价格为每份基金份额人民币1.00元。
3. 认购费用
 本基金分为A、C两类基金份额，其中A类基金份额收取认购费用，C类基金份额不收取认购费用。本基金A类基金份额的认购费率按照认购金额进行分档，投资人在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

4. 本基金A类基金份额的认购费率见下表：

认购金额M	认购费率
M<100万元	0.80%
100万元≤M<300万元	0.60%
300万元≤M<500万元	0.40%
M≥500万元	1000元/笔

5. 本基金A类基金份额的认购费用由A类基金份额的认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、登记等各项费用。
6. 认购份额的计算
 (1) 对于认购本基金A类基金份额的投资者，认购份额的计算公式为：
 认购费用适用认购费率时，认购份额的计算公式如下：
 认购金额=认购金额/（1+认购费率）
 认购费用=认购金额-认购金额
 认购份额=（净认购金额+认购资金利息）/基金份额初始面值
 认购费用为固定金额时，认购