

兴业中证A500指数增强型证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1. 兴业中证A500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已获中国证监会2024年11月26日证监许可[2024]1683号文准予募集注册。中国证监会对本基金募集的注册并不代表其对本基金的投资价值和市场前景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. 本基金的基金类别是股票型证券投资基金,基金运作方式是契约型开放式,基金存续期限为不定期。

3. 本基金的基金管理人和登记机构为兴业基金管理有限公司(以下简称“本公司”、“兴业基金”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

4. 本基金募集对象包括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2025年1月8日至2025年1月21日通过基金管理人指定的销售机构公开发售。本基金的募集期限不超过3个月,自基金份额开始发售之日起计算。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集期限,并及时公告,但最长不超过法定募集期限。本基金不设募集规模上限。

6. 本基金通过兴业基金管理有限公司直销机构及其他销售机构进行公开发售,基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并在基金管理人网站公示。基金份额发售机构办理本基金开户、认购等业务的网点、日期、时间和程序等事项参照各基金份额发售机构的具体规定。

7. 本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金份额总额不少于2亿元、基金份额募集金额不少于2亿元人民币且基金份额认购人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金份额发售,并在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,向中国证监会办理基金备案手续。

投资人欲购买本基金,需开立本公司基金账户。基金募集期内本公司直销机构为投资人办理开立基金账户的手续。投资人的开户和认购申请可同时办理,但若开户无效,认购申请也将同时无效。

8. 通过基金管理人直销机构以外的销售机构首次认购本基金A类基金份额的,每个基金账户单笔最低认购金额为1元;首次认购本基金C类基金份额的,每个基金账户单笔最低认购金额为1元。追加认购本基金A类、C类基金份额的单笔最低金额为1元。

通过基金管理人直销机构首次认购本基金A类基金份额的,每个基金账户单笔最低认购金额为1元;首次认购本基金C类基金份额的,每个基金账户单笔最低认购金额为1元。追加认购本基金A类、C类基金份额的最低金额为1元。

在不违反前述规定的前提下,各销售机构对最低认购限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。本基金募集期间对单个基金份额持有人最高累计认购金额不设限制,如本基金单个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%,基金管理人可以采取比例确认等方式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投资者变相规避前述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。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。

基金管理人可根据市场情况,调整本基金上述认购和追加认购的最低金额或单个投资人最高累计认购金额。

9. 基金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认购申请,申请的成功与否以基金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,投资人应及时查询并妥善行使合法权利。由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

10. 本公告仅对“兴业中证A500指数增强型证券投资基金”发售的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解“兴业中证A500指数增强型证券投资基金”的详细情况,请详细阅读《兴业中证A500指数增强型证券投资基金基金合同》(以下简称“《基金合同》”)、《兴业中证A500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》”),本基金基金产品资料概要等信息披露文件。

11. 本公司及本基金的基金管理人及招募说明书提示性公告刊登在规定报刊上,《基金合同》、《兴业中证A500指数增强型证券投资基金托管协议》、《兴业中证A500指数增强型证券投资基金招募说明书》、《兴业中证A500指数增强型证券投资基金基金产品资料概要》及本公司公告将同时发布在本公司网站(www.cib-fund.com.cn)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csic.gov.cn/fund>)。投资人亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金招募相关事宜。

12. 投资人可以拨打本公司的客户服务电话(40000-95561)咨询购买事宜。

13. 本公司可综合各种情况对募集安排做适当调整并及时公告。

14. 风险提示
投资人拟认购(或申购)本基金时应认真阅读招募说明书、基金合同、基金产品资料概要等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,自行做出投资决策,全面认识本基金产品的风险收益特征,并承担基金投资中出现的各类风险,包括但不限于系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,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。

本基金标的指数为中证A500指数。该指数以2004年12月31日为基日,以1000点为基点。指数编制方法如下:

(1) 样本空间
同中证指数的样本空间。

(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
对于样本空间内符合可投资性筛选条件的证券,剔除中证ESG评价结果在C及以下的上市公司证券;

(4) 选取同时满足以下条件的证券作为待选样本:
样本空间内总市值排名前1500;属于沪股通或深股通证券范围;对主板证券,在所属中证三级行业中自由流通市值占比不低2%。

(5) 在待选样本中,优先选取三级行业自由流通市值最大或总市值在样本空间内排名前1%的证券作为指数组合。

(6) 在剩余待选样本中,从各中证一级行业按照自由流通市值选取一定数量证券,使样本数量达到500只,且各一级行业自由流通市值分布与样本空间尽可能一致。

(7) 指数计算
指数计算公式为:

报告期样本的调整市值 = \sum (证券价格 \times 调整股本数 \times 权重因子) $\times 1000$

其中,调整市值 = \sum (证券价格 \times 调整股本数 \times 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%,前五大样本权重合计不超过40%。

(8) 指数样本和权重调整
1) 定期调整

指数组合每年半度调整一次,样本调整实施时间为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日,权重因子随样本定期调整而调整,调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前,权重因子一般固定不变。每次调整的样本比例一般不超过10%。定期调整设置缓冲区,若主板样本在所属中证三级行业中自由流通市值占比不低1%,仍作为待选样本;选择方法(4)中的入选顺序在前400名的新样本优先入选,在前600名的老样本优先保留。

2) 临时调整

特殊情况不将对指数进行临时调整。当样本退市时,将其从指数组合中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理,参见计算与维护细则。当沪股通或深股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通条件,指数将相应调整。

3) 有关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:<https://www.csindex.com.cn>。

本基金为股票指数增强型基金,投资者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。本基金采用指数增强型投资策略,面临着特有风险,包括但不限于增强策略失效的风险。详见招募说明书“风险提示”部分。

若出现标的指数不符合要求(因成份股价格波动等指数编制方法变动之外的因素导致的指数不符合要求的情形除外)、指数编制机构退出等情形,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,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。因此,投资人将面临基金合同可能终止的风险。

除此之外本基金特定风险还包括:跟踪误差控制未达约定目标的风险,指数的指数组合回报与股票市场平均回报偏弱的风险、标的指数组合波动的风险、基金管理人和指数编制机构退出等情形,基金管理人召集基金份额持有人大会对解决方案进行表决,基金管理人将面临跟踪误差控制未达约定目标的风险。

本基金可投资于股票指数期货,股指期货作为一种金融衍生品,具备一些特有的风险。投资股指期货所面临的主要风险是市场风险、流动性风险、基差风险、保证金风险、信用风险和操作风险。

本基金可投资于国债期货,国债期货作为一种金融衍生品,具备一些特有的风险点,包括杠杆风险、期货价格与基金投资品种价格的相关度降低带来的风险等。

本基金可投资资产支持证券,资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券的主要风险包括资产风险及证券化风险。

本基金的投资范围包括存托凭证,若投资,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。

本基金若参与融资交易,可能存在杠杠风险和对手方交易风险等融资交易特别风险。本基金若参与转融通证券出借业务,转融通证券出借业务的风险包括但不限于流动性风险、信用风险、市场风险等,这些风险可能会给基金净值带来一定的负面影响和损失。

投资人应充分考虑自身的风险承受能力,并对认购(或申购)基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。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。

本基金的过往业绩并不预示未来表现,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。

本基金单一投资者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情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规另有规定的,从其规定。

1. 本次基金份额发售基本情况

1. 基金名称:兴业中证A500指数增强型证券投资基金

2. 基金简称:兴业中证A500指数增强A(基金代码:022770);兴业中证A500指数增强C(基金代码:022771)

3. 基金类别:股票型证券投资基金

4. 基金的运作方式:契约型开放式

5. 基金份额发售面值:本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

6. 基金份额类别

本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购基金时收取认购费用,申购费用,并不再从本类基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为A类基金份额;在投资人认购、申购基金时不收取认购费用,申购费用,而是从本类基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为C类基金份额。

本基金A类、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

基金管理人:兴业基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

类、C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以当日发售在外的该类别基金份额总数。

投资者可自行选择认购、申购的基金份额类别。

在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无不利影响的情况下,经履行适当程序,基金管理人可增加、减少或调整基金份额类别设置,停止现有基金份额类别的销售,对基金份额分类办法及规则进行调整并在调整实施之日前依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告,不需要召开基金份额持有人大会。

7. 基金的存续期限:不定期

8. 投资目标:本基金为股票指数增强型基金,在对中证A500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,力争获取高于标的指数的收益。

9. 风险收益特征:

本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的组合相似的风险收益特征。

10. 销售机构

(1) 直销机构
1) 名称:兴业基金管理有限公司直销中心

住所:福建省福州市鼓楼区五四路137号信和广场25楼

法定代表人:叶文耀

办公地址:上海市浦东新区银城路167号兴业银行大厦13、14层

联系人:王珏

电话:021-22211885

传真:021-22211997

网址:www.cib-fund.com.cn

2) 名称:兴业基金管理有限公司网上直销系统

网址:<https://trade.cib-fund.com.cn/etradings/>

3) 名称:兴业基金管理微信公众账号

微信号:“兴业基金”或者“cibfund”

(2) 其他销售机构

其他销售机构名单详见基金管理人网站公示。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构,并在基金管理人网站公示。

11. 基金份额初始面值

本基金为股票指数增强型基金,其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金,具有与标的指数以及标的指数所代表的组合相似的风险收益特征。

12. 认购资金的划拨

个人投资者办理认购申请时应将足额认购资金通过银行转账转入本公司指定的直销专户。

账户名称:兴业基金管理有限公司

开户银行:兴业银行上海分行营业部

银行账号:2162001001005999005

(2) 网上直销

1) 识别开户及认购的时间

认购时间为本基金的基金份额发售日(周六、周日正常营业),全天24小时接受开户及认购业务。

2) 开户及认购程序

(1) 请参照公布于本公司网站(<https://trade.cib-fund.com.cn/etradings/>)上的《兴业基金管理有限公司开放式基金网上交易开户指南》以及《兴业基金管理有限公司开放式基金网上直销交易指南》办理相关开户和认购等业务;

(2) 尚未开通兴业基金网上直销的个人投资者,可以直接登录本公司网站(www.cib-fund.com.cn),根据页面提示进行开户操作,在开户申请提交成功后可直接登录网上直销系统进行认购;

(3) 已经开通兴业基金网上直销的个人投资者,请直接登录兴业基金网上直销系统进行网上认购。

(4) 注意事项

(1) 个人投资者认购时要注明所购买的基金名称或基金代码。

(2) 个人投资者T日提交开户申请后,应于T+2日后(包括该日)到本公司直销机构查询确认结果,或通过本公司客户服务系统、网上直销系统查询。

(3) 个人投资者T日提交认购申请后,应于T+2日后(包括该日)到本公司直销机构查询认购接受结果,或通过本公司客户服务系统查询。认购确认结果可于基金成立后到本公司直销机构查询,或通过本公司客户服务系统、网上直销系统查询。

(4) 若投资者的认购资金在认购申请当日17:00之前未到达本公司指定的直销专户,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。

(5) 为确保投资者资金及时准确入账,建议投资者将加盖银行业务受理章的转账单据传真至本公司直销柜台。

(6) 以下情况将被视为无效认购,款项将退至投资者指定的资金结算账户:

1) 投资者已缴款,但未办理开户手续或开户不成功的;

2) 投资者已缴款,但未办理认购申请或认购申请未被确认的;

3) 投资者缴款金额少于其申请的认购金额的;

4) 投资者缴款时间晚于基金认购结束日本公司规定时间的;

5) 其它导致认购无效的情况。

(7) 投资者若未按上述规定划款项,造成认购无效的,兴业基金管理有限公司及其直销银行的开户银行不承担责任。

13. 清算与交割

1) 若本基金的基金合同生效,则有效认购款项在基金合同生效前产生的利息将折算为相应类别的基金份额归基金份额持有人所有,其中利息及利息转份额以登记机构的记录为准。

2) 适当性匹配:投资者的风险评估结果与我司产品风险等级相匹配,投资者得到直销柜台匹配告知后签署《投资者风险匹配告知书及投资者确认函》,直销柜台予以受理交易。若不签署,不受理交易。

3) 风险不匹配:投资者的风险评估结果与我司产品风险等级不匹配,投资者得到直销柜台不匹配告知后签署《风险不匹配警示函及投资者确认书》,直销柜台予以受理