

摩根中证A500增强策略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、摩根中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)的募集已于2025年3月7日经中国证监会监督管理委员会证监许可[2025]425号文注册。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风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金为交易型开放式、股票型指数证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为摩根基金管理(中国)有限公司(以下简称“本基金管理人”),基金托管人为中信证券股份有限公司,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、本基金基金份额初始面值为人民币1.00元,认购价格为1.00元。

6、本基金自2025年4月21日至2025年4月30日止进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购两种方式(本基金暂不开通网下股票认购)。网上现金、网下现金发售日期为2025年4月21日至2025年4月30日。

具体业务办理时间遵循发售机构的相关规定。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整,本基金管理人将作出相应调整并及时公告。本基金管理人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。

7、网上现金认购是指投资者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上系统以现金方式进行的认购;网下现金认购是指投资者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。

8、投资者认购本基金时需具有证券账户,证券账户是指上海证券交易所A股账户或基金账户。上海证券交易所基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易。如投资者需要使用中证A500指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与基金的申购、赎回,则应开立上海证券交易所A股账户。

9、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。投资者已提交的身份证件或身份证明文件如已过有效期,请及时办理相关更新手续,以免影响认购。

10、募集规模上限

本基金首次募集规模上限为人民币20亿元(不含募集期利息和认购费用,下同)。

本基金募集过程中募集规模达到或超过20亿元人民币时,基金提前结束募集。在募集期结束后,若认购累计有效申请份额总额超过20亿份(折合为金额20亿元人民币),基金管理人将采取全额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。未确定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人自行承担。

11、认购申请确认比例的计算方法如下:认购申请确认比例=20亿份/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20亿份。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。

12、基金首次募集规模上限为人民币20亿元(不含募集期利息和认购费用,下同)。

本基金募集过程中募集规模达到或超过20亿元人民币时,基金提前结束募集。在募集期结束后,若认购累计有效申请份额总额超过20亿份(折合为金额20亿元人民币),基金管理人将采取全额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。未确定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人自行承担。

13、认购申请确认比例的计算方法如下:认购申请确认比例=20亿份/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20亿份。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。

14、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请参阅各发售代理机构的具体规定。

15、在发售期间,除本公司所列的发售代理机构外,如增加其他发售代理机构,基金管理人将及时在基金管理人网站公示。

16、对未开设销售网点的地方的投资者,请拨打本基金管理人的客户服务电话(400-889-4888)咨询购买事宜。

17、基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

18、基金募集结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单,并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,如投资人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。

19、本基金的指数为中证A500指数。

(1) 指数样本空间
同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) 选股方法
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;

(2) 选取同时满足以下条件的证券作为待选样本:

A. 样本空间内总市值排名前1500;
B. 属于沪股通或深股通证券范围;

C. 对主板证券,在所属中证三级行业自由流通市值占比不低于2%;

3) 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%的证券作为指数样本。

4) 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。

(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=Σ(证券价格×调整股本数×权重因子)。调整股本数的计算方法,除修正方法外参考见《指数编制规则》。

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。

20、风险提示
本基金投资于证券、期货市场,基金净值会因为证券、期货市场价格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种风险,包括:投资于本基金的特定风险、市场风险、流动性风险、其他风险等等。本基金是跟踪中证A500指数的增强策略交易型开放式基金,投资本基金可能遇到的特定风险包括: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、基金投资组合回报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、指数编制机构停止服务的风险、标的指数变更的风险、增强策略的风险、基金份额二级市场交易价格折溢价的风险、参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险、成份股停牌的风险、成份股退市的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退伙基金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、交易结算模式风险、股指期货的投资风险、股票期权的投资风险、参与融资及转融通证券出借业务的风险、投资者从托凭证的风险、基金合同提前终止的风险、基金管理人职责终止风险等。

本基金为增强策略ETF,面临特有的风险,包括但不限于:(1)增强策略失效的风险,即本基金采用主动管理策略选股,可能存在策略失效,无法战胜指数收益的风险;(2)潜在的交易风险,即基金因主动增强策略调整,指数定期调样等原因发生大幅调仓时,由于难以在一个交易日内完成调整,可能出现股票持仓方向暴露,被其他投资者抢先交易成份证券,进而影响基金的投资收益的风险。

本基金可参与股指期货投资,存在因投资股指期货而带来的风险,包括市场风险、市场流动性风险、结算流动性风险、基差风险、信用风险、作业风险等。

本基金可参与股票期权投资,存在因投资股票期权而带来的风险,包括市场风险、流动性风险、保证金风险、基差风险、信用风险、操作风险等。

本基金可参与转融通证券出借业务,可能面临因此带来的流动性风险、信用风险及市场风险等投资风险。

基金管理人:摩根基金管理(中国)有限公司 基金托管人:中信证券股份有限公司

二零二五年四月七日

总认购份额=认购份额+利息折算的份额

其中:认购费用由基金管理人在投资人认购确认时收取,投资人须以现金方式交纳认购费用。认购金额、认购费用的计算保留到小数点后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财产承担。利息折算的基金份额保留至整数位,小数部分舍去,舍去部分计入基金财产。

例二:某投资者在本公司直销网点认购300,000份基金份额,假定认定金额产生的利息为30元,则需准备的资金金额计算如下:

认购费用=300,000×1.00×0.8%=2,400.00元

认购金额=300,000×1.00×(1+0.8%)=302,400.00元

利息折算额=30/1.00=30(保留至整数位)

该投资者所得基金份额为:

总认购份额=300,000+30=300,030份

即,若该投资者通过基金管理人认购本基金300,000份,则该投资者的认购金额为302,400.00元,其中认购费用2,400.00元,并可获得利息转换的份额30份,则可得到300,030份基金份额。

(2)通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算:与通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算相同。

三、投资人开户须知

投资人认购本基金时需具备证券账户,证券账户是指上海证券交易所A股账户或基金账户。

(1)如投资者需新开立证券账户,则应注意:

①上海证券证券交易所基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易;如投资者需要使用中证A500指数成份股中的上海证券交易所上市股票参与基金的申购、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,建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。

(2)如投资者已开立证券账户,则应注意:

①如投资者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者当日无法进行认购,建议投资者在进行认购的1个工作日前办理指定交易或转指定交易手续。

(3)使用专用席位的机构投资人则无需办理指定交易。

四、本基金的认购程序

(一) 网上现金认购程序

1、业务办理时间:2025年4月21日至2025年4月30日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00(周六、日及其他法定节假日不受理)。

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的认购。

(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。

(二) 网下现金认购程序

1、通过代理人进行网下现金认购程序

(1)业务办理时间:

基金发售日的8:30~16:00。发售日每天16:00后、周六、日及其他法定节假日不受理客户的开户申请。

基金发售日的8:30~17:00。发售日每天17:00后、周六、日及其他法定节假日不受理客户的认购申请。

(2)投资者在本公司直销柜台办理网下现金认购须提供下列资料:

个人投资者办理基金账户开户申请时须提交下列材料:

1)有效身份证件原件

2)指定银行收款账户证明

3)印鉴卡

4)《账户开户申请表》

5)《普通/专业投资者告知书及投资者确认函》

6)《投资者风险测评问卷》(普通投资者填写)

7)专业投资者资格证明材料(如需)

8)《个人税收居民身份声明》

9)港澳台人士及外籍人士投资资格证明材料(如需),包括境内居住证明和收入证明。

投资人办理基金账户开户申请时必须本人亲自办理;委托他人代办的,还需提供经公证的委托代办书,代办人的有效身份证件复印件及复印件。

个人投资者办理认购申请时须提交下列材料:

1)有效身份证件复印件

2)指定银行收款账户证明

3)印鉴卡

4)《账户开户申请表》

5)《普通/专业投资者告知书及投资者确认函》

6)《投资者风险测评问卷》(普通投资者填写);

7)专业投资者资格证明材料(如需)。

委托他人代办的,还需提供委托代办书,代办人的有效身份证件复印件及复印件。

机构客户办理基金交易账户和基金账户开户申请时须提交下列材料:

1)机构有效身份证明文件复印件;

2)金融结构资格证明复印件(如需);

3)产品备案/批复材料(如需);

4)《账户开户/销户申请表》;

5)《账户类业务授权委托书》(机构客户);

6)银行开户证明文件复印件;

7)法人、授权代表、账户类经办人、账单收件人、预留交易印鉴授权人的身份证件复印件;

8)《印鉴卡》;

9)《投资者风险测评问卷》(普通投资者填写);

10)《普通/专业投资者告知书及投资者确认函》;

11)《控制人税收居民身份声明》(如需);

12)《机构税收居民身份声明》(如需);

13)《非自然人客户受益所有人信息登记表》及相关受益所有人证明材料;

14)专业投资者资格认定材料(如需)。

机构投资者认购基金的申请,应当提供下列材料:

①《ETF认购业务申请表》

②《摩根基金管理(中国)有限公司交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》

③《风险不匹配警示函及投资者确认书》(如需);

④本公司要求的其他交易相关材料;

认购资金的划拨:

投资者办理认购前应将足额资金通过银行汇入下列任一银行账户,资金应包含认购金额以及对应的认购费用:

户名:摩根基金管理(中国)有限公司直销客户
账号:31001560