

# 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日经中国证券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、网下现金发售2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及资料。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）。

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，若认购累计有效申购份额总额超过20亿份（折合为金额20亿元人民币），基金管理人将采取全程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人自行承担。

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/有效认购申购份额总额

投资者认购申请确认份额=提交的有效认购申购份额×认购申请确认比例

“有效认购申购份额总额”、“投资者认购申请确认份额”都不包括募集期利息和认购费用。

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购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。

11、网上现金认购以基金份额申请。单一账户每笔认购份额须为1000份或其整数倍，最高不得超过99,999,000份。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

网下现金认购以基金份额申请。投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的，每笔认购份额须为1000份或其整数倍；投资人通过基金管理人办理网下现金认购的，每笔认购份额须在1000份以上（含1000份）。投资人可多次认购，累计认购份额不设上限。

网上现金认购可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。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。

12、基金份额发售机构（发售代理机构和/或直销机构）受理认购申请并不代表该申请一定成功，而仅代表销售机构确实收到认购申请。认购的确认以登记机构或基金管理人的确认结果为准。对于认购申请和认购份额的确认情况，投资人可以查询并妥善行使合法权利。投资者应及时在基金合同生效后到其办理认购业务的销售网点查询认购确认情况，基金管理人及发售代理机构不承担对确认结果的通知义务。

13、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解“摩根中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金”的详细情况，请详细阅读刊登在本基金管理人官网（am.jpmorgan.com/cn）和中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund）上的《摩根中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）。

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参照各发售代理机构的具体规定。

15、在发售期间，除本公告所列的发售代理机构外，如增加其他发售代理机构，本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、本基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

18、基金募集期结束后，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，指定交易未在中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、本基金标的指数为中证A500指数。

（1）指数样本空间

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）选择方法

1）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内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=∑（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%。

有关标的指数具体编制方案及成份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：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、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、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，可能出现股票调仓方向暴露，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。

本基金可根据法律法规的规定参与融资，可能存在杠杆风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。

本基金可以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

本基金可以参与存托凭证的投资，除与其他仅投资于境内市场股票的风险所面临的共同风险外，本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险，以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。

本基金基金合同生效后，如连续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，基金合同终止，且不需召开基金份额持有人大会。故基金份额持有人可能面临基金合同提前终止的风险。

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选股成份，具有与标的指数相似的风险收益特征。

请个人投资者阅读并充分了解《摩根基金管理（中国）有限公司用户隐私政策》（https://www.cifm.com/service/ETGuide/rules/201908/t20190822\_144519.html），知照并同意摩根基金管理（中国）有限公司就为您开立基金账户并提供相应基金业务服务之目的及法律法规和监管规定（如反洗钱、投资者适当性管理、实名制等）的要求，根据上述隐私政策和法律法规和监管规定收集、使用、存储或以其他方式处理您的个人信息，您的个人信息包括个人基本资料、个人身份信息、个人财产信息等信息，其中包括部分敏感个人信息。如果您不同意我们处理您的相关个人信息，我们将无法为您提供基金账户以及相应的基金业务相关的服务。

对于机构投资者，如涉及提供第三方个人信息的，应当确保个人信息来源合法并且确保管理人处理其个人信息不违反该第三方的授权同意。机构投资者请提醒该第三方阅读《摩根基金管理（中国）有限公司用户隐私政策》，特别地应当根据《个人信息保护法》相关规定告知管理人将如何处理其个人信息，并获得该第三方同意。

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》、《基金产品资料概要》及《基金合同》。

## 一、本次基金发售基本情况

- （一）本基金的基本情况  
基金名称：摩根中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金  
基金简称：摩根中证A500增强策略ETF  
认购代码：563553  
证券代码：563550  
证券简称：增强A500  
扩位简称：A500增强ETF摩根
- （二）基金类别：股票型指数证券投资基金
- （三）基金运作方式：交易型开放式
- （四）存续期限：不定期
- （五）基金份额初始面值：每份基金份额初始面值为1.00元人民币
- （六）投资目标

在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

（七）发售对象  
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）标的指数及业绩比较基准  
本基金的标的指数为中证A500指数。  
本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证A500指数收益率。  
（九）基金份额发售机构

1.发售协调人  
中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

客服电话：95548

公司网址：www.citics.com

2.网下现金发售直销机构：

名称：摩根基金管理（中国）有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层

法定代表人：王琼慧

总经理：王琼慧

成立日期：2004年5月12日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2004]56号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

组织形式：有限责任公司

实缴注册资本：25,000万元

存续期间：持续经营

公司网址：am.jpmorgan.com/cn

3.网下现金发售代理机构

详见本公告“七、本次发售当事人或中介机构”

4.网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

5、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的代理机构，并在基金管理人网站公示。

6.发售时间安排与基金合同生效

自2025年4月21日至2025年4月30日，本基金向个人投资者、机构投资者、合格境外投资者同时发售。网上现金发售日期及网下现金发售日期均为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。

## 二、认购方式与相关说明

（一）认购方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购认购2种方式（本基金暂不开通网下股票认购）。

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进行的认购。

（二）认购费用

本基金的认购采用“份额认购”的原则。投资者在一天之内如果有多笔认购，适用费率按单笔分别计算。

认购费率：投资者可选择网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构，按照不高于0.8%的标准收取一定的佣金。

本基金的认购费用不列入基金财产，主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集期发生的各项费用。

（三）基金的认购

1.网上现金认购

本基金认购佣金、认购金额的计算如下：

认购金额=认购价格×认购份额×（1+佣金比率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

认购佣金=认购价格×认购份额×佣金比率

（或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用）

净认购金额=认购价格×认购份额

认购佣金由发售代理机构收取，投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例一：某投资者到某发售代理机构网点认购10,000份本基金份额，假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.8%，则需准备的资金金额计算如下：

认购佣金=10,000×1.00×0.8%=80元

认购金额=10,000×1.00×（1+0.8%）=10,080元

即投资者需准备10,080元资金，方可认购到10,000份本基金基金份额。

2.网下现金认购

（1）通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额和利息折算的份额的计算：

通过基金管理人进行网下现金认购的投资者，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用=认购份额×认购价格×认购费率

（或若适用固定费用的，认购费用=固定费用）

认购金额=认购价格×认购份额×（1+认购费率）

（或若适用固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

利息折算的份额=认购金额产生的利息/认购价格（保留至整数位）

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，假定认购金额产生的利息为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

利息折份额=30/1.00=30份（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。

（1）如投资者需新开立证券账户，则应注意：

①上海证券交易所以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以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者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予受理）。

2.认购手续：

（1）开立上海证券交易所以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.通过管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予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予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）有效身份证件文件原件

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。

个人投资者开立基金账户必须本人亲自办理；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文件及复印件。

个人投资者办理认购申请时须提交下列材料：

◇《ETF认购业务申请表》

◇《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》

◇《风险不匹配警示函及投资者确认书》（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文件及复印件。

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）机构有效身份证件文件复印件；

2）金融机构资格证明复印件（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）《自然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）。

机构投资者投资基金的申请，应当提供下列材料：

◇《ETF认购业务申请表》

◇《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》；

◇《风险不匹配警示函及投资者确认书》（如需）；

◇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：

（一）基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

（二）网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认

购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管账户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额。

（三）通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归投资者所有，其中利息转份额以基金管理人的记录为准。

## 六、基金的验资与基金合同生效

基金募集期限届满，本基金具备基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起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。自基金管理人办理完毕基金备案手续并取得中国证监会书面确认之日起，《基金合同》生效；基金管理人在收到中国证监会确认文件的次日对《基金合同》生效事宜予以公告。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

如果募集期限届满，未满足基金备案条件，基金管理人应当承担下列责任：

1、以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用；

2、在基金募集期限届满后30日内退还投资者已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息（税后）；

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

## 七、本次发售当事人或中介机构

（一）基金管理人

名称：摩根基金管理（中国）有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层

法定代表人：王琼慧

总经理：王琼慧

成立日期：2004年5月12日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2004]56号

经营范围：基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。

组织形式：有限责任公司

实缴注册资本：贰亿伍仟万元人民币

存续期间：持续经营

公司网址：am.jpmorgan.com/cn