

易方达中证A50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

基金管理人:易方达基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

二零二五年六月

重要提示

1.易方达中证A50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”)根据中国证监会监督管理委员会《关于准予易方达中证A50增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》(证监许可[2024]1859号)进行募集。

2.本基金为交易型开放式、股票型证券投资基金。

3.本基金的管理人为易方达基金管理有限公司(以下简称“本公司”),托管人为招商银行股份有限公司,本基金登记结算机构为中国证券登记结算有限责任公司。

4.本基金自2025年6月16日至2025年6月15日进行发售。本基金的投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式(本基金暂不开通网下股票认购),其中网下现金认购的日期为2025年6月16日至2025年6月15日,网上现金认购的日期为2025年7月1日至2025年6月15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。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。

5.网上现金认购是指投资人通过具有基金销售业务资格的上海证券交易所会员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人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。

6.投资人认购本基金时需具有上海证券交易所A股账户或上海证券交易所证券投资基金账户,如投资者需要参与网下现金或网上现金认购,应使用上海证券交易所A股账户或上海证券交易所以证券投资基金账户;上海证券交易所证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。如投资者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。

7.投资人应保证用于认购的资金来源合法,投资人应有权自行支配,不存在任何法律上、合约上或其他方面的障碍。投资人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。投资人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。

7.本基金的认购费用或认购佣金不超过认购份额的0.80%。

8.募集规模上限

本基金首次募集规模上限为80亿元人民币(不包括募集期利息和认购费用,下同)。

在募集期间任一(含第一天)当曰募集截止时间后累计有效认购申请份额总额超过80亿份(折合为金额80亿元人民币),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。

未日认购申请确认比例的计算方法如下:

未日认购申请确认比例=(80亿份-末日之前有效认购申请份额总额)/末日有效认购申请份额总额

未日投资认购申请确认份额=末日提交的有效认购申请份额×末日认购申请确认比例

“末日之前有效认购申请份额总额”和“末日有效认购申请份额总额”都不包括募集期利息和认购费用。

当发生部分确认时,将按照末日认购申请确认比例对末日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,最终确认的本基金累计有效认购份额(不包括募集期利息和认购费用)可能会略微超过80亿份。末日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结算机构的记录为准。

9.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。

10.网上现金认购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。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1,000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10万份以上(含10万份)。在本基金首次募集规模上限内,投资人可以多次认购,单个投资人的累计认购不设上限,但需符合相关法律法规、业务规则以及本基金发售规模控制方案的规定。

11.网上现金认购申请提交后,投资人可以在当日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。

12.销售机构对认购申请的受理并不表示对该申请的成功确认,而仅代表销售机构确实接受了认购申请,申请的认购确认应以登记结算机构的确认登记为准。投资人可以在基金合同生效后到各销售渠道查询最终成交确认情况和认购的份额。

13.本基金《基金合同》生效后,符合基金上市交易条件的,本基金基金份额可申请在上海证券交易所上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

14.本公司仅对易方达中证A50增强策略交易型开放式指数证券投资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,请详细阅读刊登在本公司网站(www.efunds.com.cn)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csfc.gov.cn/fund/>)上的《易方达中证A50增强策略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.efunds.com.cn)。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。

16.在发售期间,除本公司所列的发售代理机构外,如增加其他网下发售代理机构,将在基金管理人网站公示。

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电话(4008818088)及直销中心联系电话(020-85102506)咨询购买事宜。

19.基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

20.本基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单,报上海证券交易所,经上海证券交易所有关部门认可后,在基金管理人网站公示。基金上市后,指定交易申办手续由代销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。

21.指数编制方案

本基金的指数为中证A50指数。

(1) 样本空间

中证A50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:

所属中证三级行业内过去一年日均自由流通市值排名第一;

样本空间内过去一年日均总市值排名前三;

属于沪深或深股通证券范围。

3) 在待选样本中,选取过去一年日均自由流通市值最大的50只证券作为指数样本,同时满足各中证二级行业入选数量不少于1只。

(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、除数修正方法参见中证指数有限公司网站发布的计算与维护细则。权重因子介于0和1之间,以使单个样本权重不超过10%,前五大权重合计不超过40%。

有关的指数具体编制方案等指数信息详见中证指数有限公司网站,网址:www.csindex.com.cn。

22.风险提示

本基金股票资产占基金资产的比例不低于80%,投资标的指数成份股及备选成份股的资产不高于基金总资产的80%,其投资目标是在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报。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,投资有风险,投资者在投资基金前,请认真阅读本基金招募说明书、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,充分考虑自身的承受能力,理性判断市场,自主判断基金的投资价值,对投资基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策,承担基金投资中可能出现的各类风险。

投资基金可能遇到的主要风险包括:本基金特有风险、市场风险、管理风险、流动性风险、本基金法律文件中涉及基金风险特征的表述与销售机构对基金的风险评级可能不一致的风险、税收风险及其他风险等。本基金特有风险包括:(1)与指数化投资相关的特定风险,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,部分成份股权重较大的风险、标的指数发布时间较短的风险、标的指数编制方案带来的风险,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,标的指数值计算出错的风险,指数编制机构因发布服务的风险等;(2)采用主动增强策略进行投资管理可能引致的风险,包括增强策略失败风险、潜在抢先交易风险、申赎成本增加风险等;

(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,投资组合证券停牌的风险,投资人申购失败的风险、投资人赎回失败的风险,申购赎回清单中设置较低的申购/赎回份额上限的风险,深市证券申赎处理规则带来的风险,申购赎回清单差错风险,申购赎回清单识别设置不

合理的风险、基金份额赎回对价的变现风险、套利风险、基金分红特殊安排的风险、第三方机构服务的风险、退市风险等;(4)投资特定品种(包括股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品、资产支持证券、存托凭证等)的特有的风险;(5)参与转融通证券出借业务的风险等。

本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。投资基金可能面临的一般风险及特别风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金为股票型基金,理论上其预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报。长期来看,本基金具有与业绩比较基准相近的风险水平。

根据本基金现行适用的清算交收和申赎处理规则,当日竞价买入的基金份额,当日可以赎回,当日申购的基金份额,当日可以竞价卖出,次一交易日可以赎回。

投资人投资于本基金前请认真阅读证券交易所和登记结算机构关于ETF的相关业务规则及其不时的更新,确保具备相关专业知识、清楚了解相关规则流程后方可参与本基金的认购、申购、赎回及交易。投资人一旦认购、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及业务规则已经认可。

本基金为采取增强策略的ETF,可能面临增强策略失效风险,即由于采用主动增强策略选股,可能存在策略失效,无法战胜指数收益的风险;可能存在潜在抢先交易风险,即由于主动增强策略调整、指数定期调样等原因发生大幅调仓时,难以在一个交易日内完成调整,可能出现股票持仓向暴露,被其他投资者抢先建仓、抬高股价,进而造成基金建仓成本升高、投资收益下降的风险;还可能存在投资者申赎成本增加风险,即基金管理根据投资运作需要发生大幅调仓时,投资者按申购赎回清单所提交的申购/赎回对应的可能与基金实际调仓买卖情况存在较大差异,从而可能增加投资者申赎成本并影响投资损益。

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起的投资风险,由投资者自行负责。此外,本基金以1元初始面值募集资金,在市场波动等因素的影响下,存在单位份额净值跌破1元初始面值的风险。

基金不同于银行储蓄,基金投资人投资于基金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,投资人进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

基金经理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并不构成对本基金表现的保证。

一、本次发售基本情况

(一) 基金名称

易方达中证A50增强策略交易型开放式指数证券投资基金

基金代码:512030

认购代码:512033

场内简称:A50增

扩位简称:中证A50增强ETF易方达

(二) 基金运作方式和类型

交易型开放式、股票型证券投资基金

(三) 基金存续期限

不定期

(四) 基金份额面值

本基金基金份额发售面值为人民币1.00元。

(五) 基金投资目标

在控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度及年化跟踪误差的基础上,追求超越业绩比较基准的投资回报。

(六) 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。

(七) 发售机构

广发证券股份有限公司

注册地址:广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室

办公地址:广州市天河区马场路26号广发证券大厦

法定代表人:林传辉

联系人:黄岚

客户服务电话:95675

网址:www.gf.com.cn

(八) 发售时间安排与基金合同生效

本基金的募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

本基金将自2025年6月16日至2025年6月15日进行发售。本基金的投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式(本基金暂不开通网下股票认购),其中网下现金认购的日期为2025年6月16日至2025年6月15日,网上现金认购的日期为2025年7月1日至2025年6月15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。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。

基金管理人将募集的资金应当存入专门账户,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。若3个月的募集期满,本基金仍未达到基金备案条件,基金管理人应承担全部募集费用并终止募集。

若3个月的募集期满,本基金仍未达到基金备案条件,基金管理人应承担全部募集费用并终止募集。

(九) 募集资金利息的处理方式

通过基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。

2.通过发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构,按照不超过0.80%的标准收取一定的佣金。

3.投资人多次提交现金认购申请的,须按每笔认购所对应的费率档次分别计费。

(十) 网上现金认购

1.认申购费率

本基金的认申购采用份额认申购的原则。认申购费用或认申购佣金由认申购基金份额的投资人承担,认申购费率不超过0.80%,主要用于基金的市场推广、销售、登记结算等募集期间发生的各项费用。认申购费率如下表所示:

认申购份额(S)	认申购费率
3150份	0.80%
50万份≤S<100万份	0.60%
S≥100万份	1.00%/笔

1.通过基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。

2.通过发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构,按照不超过0.80%的标准收取一定的佣金。

3.投资人多次提交现金认购申请的,须按每笔认购所对应的费率档次分别计费。

(十一) 网下现金认购

1.认申购费率

通过发售代理机构进行网上现金认购的投资者,认购以基金份额申请,认申购佣金、认购金额的计算公式:

认申购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

(或若适用固定费用的,认申购佣金 = 固定费用)

认申购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

(或若适用固定费用的,认申购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用)