

# 东方红中证港股通高股息投资指数型证券投资基金 基金份额发售公告

基金管理人:上海东方证券资产管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

二〇二五年七月十一日

重要提示

1、东方红中证港股通高股息投资指数型证券投资基金(以下简称本基金)的募集申请经中国证券监督管理委员会(以下简称中国证监会)2025年4月14日证监许可〔2025〕790号文准予注册。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做出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金是契约型开放式、股票型证券投资基金。

3、本基金A类基金份额的基金代码为024227,C类基金份额的基金代码为024228。

4、本基金的基金管理人和基金登记机构为上海东方证券资产管理有限公司(以下简称本公司、基金管理人或东方红资产管理),基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

5、本基金的募集期为2025年7月28日(含)至2025年8月15日(含)。基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期,此类变更适用于所有销售机构。基金募集期若延长,最长不得超过3个月。

6、本基金的销售机构包括基金管理人的直销机构和代销机构。直销机构包括基金管理人的直销中心和网上交易系统。代销机构具体名单请见基金管理人网站披露的基金销售机构名录。

7、本基金的发售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。

8、投资者购买本基金应使用本公司的开放式基金账户。若投资者已经开立本公司的开放式基金账户,则无须再另行开立基金账户,直接以此基金账户办理认购申请即可。未开立基金账户的投资者可通过本基金直销机构、代销机构办理开立基金账户的手续。

9、投资者的有效认购款项在基金募集期间产生的利息归投资者所有,如基金合同生效,则折算为基金份额计入投资者的账户,利息和具体利息折算份额以登记机构的记录为准。

10、本基金根据认购费用、申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。

A类基金份额:在投资人认购、申购基金时收取认购费、申购费,而不从本类别基金财产中计提销售服务费;

C类基金份额:在投资人认购、申购基金时不收取认购费、申购费,而是从本类别基金财产中计提销售服务费。

本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码,并分别计算基金份额净值。投资人认购基金份额时可自行选择基金份额类别。

11、在募集期内,通过基金管理人直销中心及网上交易系统办理本基金认购业务的,本基金各类基金份额的单笔最低认购金额为10元人民币(含认购费),通过其他销售机构办理本基金认购业务的,各类基金份额的单笔最低认购限额及交易级差以各销售机构的具体规定为准。

单个投资人累计认购基金份额的比例达到或者超过基金份额总数的50%,或者出现变相规避50%集中度情形的,基金管理人有权对该等认购申请进行部分确认或拒绝接受该等认购申请。投资人认购的基金份额以登记机构的确认为准。

12、本基金的最低募集总额为2亿份(不包括利息折算的份额),最低募集金额为2亿元人民币(不包括利息)。

本基金可设置募集规模上限,如设置,具体募集规模上限及募集规模控制的方案详见届时公告。若本基金设置募集规模上限,基金合同生效后不受此规模限制。

13、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,投资人应及时查询并妥善行使合法权利,否则,由此产生的投资人任何损失由投资人自行承担。

14、各销售机构的销售网点以及开户、认购等事项的详细情况请向各销售机构咨询。未开设销售网点的地方的投资者,可拨打本公司的客户服务电话400-920-0808咨询认购事宜。

15、在募集期间,基金管理人可根据有关法律法规的要求,对本基金的销售机构进行变更或增减,具体请以基金管理人网站披露的本基金相关份额的销售机构名单及相关信息为准。

16、基金管理人可综合各种情况对本基金的募集安排做适当调整。

17、本公告仅对本基金份额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,请阅读发布于本公司网站(www.dfh.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csirc.gov.cn/fund/>)上的基金合同、托管协议、招募说明书及基金产品资料概要。

18、风险提示:

本基金是一只股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金是指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金标的指数为中证港股通高股息投资指数。

(1) 样本空间  
中证香港300指数样本中符合港股通条件的证券。

(2) 可投资性筛选  
过去一年日均成交金额不低于5000万港元。

(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,选取过去三年连续分红且过去三年股利支付率的均值和过去一年股利支付率均大于0且小于1的上市公司证券作为待选样本;

2) 对待选样本按照过去三年平均股息率由高到低排名,选取排名靠前的30只证券作为指数样本。

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([www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn))。

本基金投资于指数成份股及备选股成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%,其投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书、基金产品资料概要及基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断

市场,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,自行承担投资风险。投资人获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:本基金的特有风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、技术风险、操作风险、投资特定品种(包括回购、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、科创板股票、存托凭证、参与融资、转融通证券出借业务、北交所股票、港股通标的股票等)的风险,本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险和其他风险等。本基金特定风险主要是指指数化投资风险,包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险,标的指数计算出错的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌风险等。基金管理人提醒投资人基金投资的“卖者尽责、买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

本基金可投资于科创板股票,会面临因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于股价波动风险、退市风险、流动性风险、投资集中风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境变化,选择将部分基金资产投资于科创板或选择不将基金资产投资于科创板,基金资产并非必然投资于科创板。

本基金可投资国内依法发行上市的存托凭证,基金净值可能受到存托凭证的境外基础证券价格波动影响,与存托凭证的境外基础证券、境外基础证券的发行人及境内外汇机制相关的风险可能直接或间接成为本基金风险。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于存托凭证或选择不将基金资产投资于存托凭证,基金资产并非必然投资于存托凭证。

本基金可投资北京证券交易所(以下简称“北交所”)股票,北交所主要服务于创新型中小企业,在发行、上市、交易、退市等方面的规定与其他交易所存在差异。基金投资北交所股票,将面临因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括但不限于上市后公司经营风险、股价波动风险、流动性风险、退市风险、投资集中风险、转板风险、监管规则变化的风险等。本基金可根据投资策略需要或市场环境变化,选择将部分基金资产投资于北交所股票或选择不将基金资产投资于北交所股票,基金资产并非必然投资于北交所股票。

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制(以下简称“港股通机制”)买卖规定范围内的香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动的风险之外,本基金还会面临港股通机制下因投资环境、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行T+0回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比A股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯

可能带来的风险(在内地开市香港休市的情况下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。

本基金可投资于资产支持证券,可能面临与基础资产相关联的风险如信用风险、现金流预测风险和原始权益人的风险等,以及与资产支持证券相关联如市场利率风险、流动性风险、评级风险、提前偿付及延期偿付风险等。

本基金可投资股票指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品,金融衍生产品具有杠杆效应且价格波动剧烈,会放大收益或损失,在某些情况下甚至会导致投资亏损高于初始投资金额。本基金可根据投资策略需要或市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于金融衍生品或选择不将基金资产投资于金融衍生品,基金资产并非必然投资金融衍生品。

具体风险提示请查阅本基金招募说明书“风险揭示”章节内容。

本基金单一投资人持有基金份额数不得达到或超过基金份额总数的50%,但在本基金运作过程中因基金份额赎回等基金管理人无法予以控制的情形导致被动达到或超过50%的除外。法律法规或监管机构另有规定的,从其规定。

当本基金持有特定资产且存在或潜在大额赎回申请时,基金管理人履行相应程序后,可以启用侧袋机制,具体详见基金合同和招募说明书“侧袋机制”等有关章节。侧袋机制实施期间,基金管理人将对基金简称进行特殊标识,并且不办理侧袋账户的申购赎回。请基金份额持有人仔细阅读相关内容并关注本基金启用侧袋机制时的特定风险。

19、基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金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本基金业绩表现的保证。

## 一、本次募集的基本情况

(一) 基金名称、简称和代码

基金名称:东方红中证港股通高股息投资指数型证券投资基金

基金简称:东方红中证港股通高股息投资指数

A类基金份额简称:东方红中证港股通高股息投资指数A,基金代码:024227

C类基金份额简称:东方红中证港股通高股息投资指数C,基金代码:024228

(二) 基金类型和运作方式

基金类型:股票型证券投资基金

基金运作方式:契约型开放式

(三) 基金存续期限

不定期。

(四) 基金份额面值

发售面值为1.00元人民币。

(五) 基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

(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) 募集规模

本基金的最低募集份额总额为2亿份(不包括利息折算的份额),最低募集金额为2亿元人民币(不包括利息)。

本基金可设置募集规模上限,如设置,具体募集规模上限及募集规模控制的方案详见届时公告。若本基金设置募集规模上限,基金合同生效后不受此规模限制。

(八) 销售机构

1、本基金的直销机构包括直销中心和网上交易系统。网上交易系统包括基金管理人公司网站([www.dfh.com](http://www.dfh.com))、东方红资产管理APP、基金管理人微信号和基金管理人指定且授权的电子交易平台。

2、销售机构的具体名单请见基金管理人披露的基金销售机构名录,基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择符合要求的机构代理销售本基金,并在基金管理人网站披露基金销售机构的名录及相关信息。

(九) 基金募集期

本基金的募集期限为自基金份额发售之日起不超过3个月。

本基金自2025年7月28日(含)至2025年8月15日(含)面向投资者公开发售。基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期,此类变更适用于所有销售机构。基金募集期若延长,最长不得超过3个月。

二、发售方式及相关规定

1、本基金在募集期内面向投资者公开发售。

2、本基金基金份额发售面值为人民币1.00元,本基金认购价格为人民币1.00元/份。

3、本基金认购采用金额认购的方式。

4、投资者认购基金份额采用全额缴款的认购方式。投资者认购时,需按销售机构规定的方式全额缴款。

5、投资者在募集期内可以多次认购基金份额,须按每次认购所对应的费率档次分别计费。已受理的认购申请不得撤销。

6、认购的限额

在募集期内,通过基金管理人直销中心及网上交易系统办理本基金认购业务的,本基金各类基金份额的最低认购金额为单笔10元人民币(含认购费),通过其他销售机构办理本基金认购业务的,各类基金份额的单笔最低认购限额及交易级差以各销售机构的具体规定为准。

7、单个投资人累计认购基金份额的比例达到或者超过基金份额总数的50%,或者出现变相规避50%集中度情形的,基金管理人有权对该等认购申请进行部分确认或拒绝接受该等认购申请。投资人认购的基金份额以登记机构的确认为准。

8、投资者购买本基金应使用本公司的开放式基金账户。若投资者已经开立本公司的开放式基金账户,则无须再另行开立基金账户,直接以此基金账户办理认购申请即可。未开立基金账户的投资者可通过本基金直销机构、代销机构办理开立基金账户的手续。

9、投资者认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书、基金产品资料概要及基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断

市场,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,自行承担投资风险。投资人获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:本基金的特有风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、技术风险、操作风险、投资特定品种(包括回购、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、科创板股票、存托凭证、参与融资、转融通证券出借业务、北交所股票、港股通标的股票等)的风险,本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险和其他风险等。本基金特定风险主要是指指数化投资风险,包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险,标的指数计算出错的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌风险等。基金管理人提醒投资人基金投资的“卖者尽责、买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

10、风险提示:

本基金是一只股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金是指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金标的指数为中证港股通高股息投资指数。

(1) 样本空间  
中证香港300指数样本中符合港股通条件的证券。

(2) 可投资性筛选  
过去一年日均成交金额不低于5000万港元。

(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,选取过去三年连续分红且过去三年股利支付率的均值和过去一年股利支付率均大于0且小于1的上市公司证券作为待选样本;

2) 对待选样本按照过去三年平均股息率由高到低排名,选取排名靠前的30只证券作为指数样本。

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([www.csindex.com.cn](http://www.csindex.com.cn))。

本基金投资于指数成份股及备选股成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%,其投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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。

投资有风险,投资人认购(或申购)基金时应认真阅读招募说明书、基金产品资料概要及基金合同等信息披露文件,自主判断基金的投资价值,全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断

市场,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,自行承担投资风险。投资人获得基金投资收益的同时,亦承担基金投资中出现的各类风险,可能包括:本基金的特有风险、市场风险、管理风险、流动性风险、信用风险、技术风险、操作风险、投资特定品种(包括回购、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券、科创板股票、存托凭证、参与融资、转融通证券出借业务、北交所股票、港股通标的股票等)的风险,本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险和其他风险等。本基金特定风险主要是指指数化投资风险,包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险,标的指数计算出错的风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌风险等。基金管理人提醒投资人基金投资的“卖者尽责、买者自负”原则,在投资人作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负责。

11、风险提示:

本基金是一只股票型基金,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金是指数型基金,具有与标的指数相似的风险收益特征。</