

财通基金管理有限公司

财通华晟量化选股混合型证券投资基金

基金份额发售公告

基金管理人:财通基金管理有限公司
基金托管人:长沙银行股份有限公司

二〇二五年八月

【重要提示】

1、财通华晟量化选股混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)根据2025年5月29日中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]1157号文进行募集。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价值和收益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、本基金为契约型开放式、混合型。

3、本基金的管理人为财通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本公司”),基金托管人为长沙银行股份有限公司(以下简称“长沙银行”),注册登记机构为财通基金管理有限公司。

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、本基金自2025年8月18日至2025年9月17日,通过本公司的直销中心、网上交易平台及其他销售渠道公开发售,具体名单请见本公告的附件。本公司可根据基金销售情况,依据法律法规和基金合同的规定适当延长或缩短基金募集期限,并及时公告。但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

各销售机构的销售网点、业务办理日期和具体时间等事项以各销售机构在其各销售城市当地的公告为准。在募集期间,除本公司所列的代销机构外,如本基金增加其他代销机构的,本公司将及时登载于基金管理人网站。基金管理人可综合各种情况对募集安排做适当调整。

投资人如有任何问题,可拨打本公司的客户服务电话400-820-9888(免长途话费)咨询购买事宜。

6、投资人欲购买本基金,需开立本注册登记机构提供的基金账户。投资人可在不同销售机构开户,但每个投资者只允许开立一个基金账户。若已经在本基金注册登记机构开立开放式基金账户的,则不需要再办理开户手续。募集期内本公司直销中心和指定的基金销售机构网站同时为投资者办理开户和认购手续。开户和认购申请可同时办理。若投资者在不同的销售机构处重复开立基金账户导致认购失败的,基金管理人和销售机构不承担认申购失败责任。

7、本基金认购最低限额:投资者在基金管理人直销中心首次认购最低金额为50,000元人民币(含认购费),追加认购每笔最低金额1,000元人民币(含认购费)。通过基金管理人网上交易平台办理本基金认申购业务的不受直销中心最低认购金额的限制,最低认购金额为单笔1元(含认购费)。各销售机构对本基金最低认购金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。投资人可在募集期内可多次认购基金份额,但认购申请一经销售机构受理,则不可以撤销。

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

9、销售机构对投资者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,申请的成功确认应以基金注册登记机构的确认登记为准。投资人可以在基金合同生效后到原认购网点查询认购成功确认情况。

10、本公司仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解本基金的详细情况,请详细阅读2025年8月9日发布本公司网站(www.ctfund.com)等指定网站上的《财通华晟量化选股混合型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)等文件,投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格并了解本基金份额发售的相关事宜。本基金的基金合同及招募说明书提示性公告和本公告将同时刊登在中国证券报》。

11、基金管理人提示投资人充分了解基金投资的风险和收益特征,根据自身的风险承受能力,审慎选择适合自己的基金产品。基金管理人依照尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在投资人做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担。投资人对投资基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

12、风险提示:

本基金为证券投资基金,证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此,宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业与个券业绩的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩,从而产生市场风险,投资者在投资基金前,应全面了解本基金的产品特性、理性判断市场,并承担基金投资中出现的各种风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、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。本基金的一般风险及特别风险详见本基金招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金是混合型基金,股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为60%~95%(其中投资于港股通的股票的比例占股票资产的0~50%),属于股票仓位偏高且相对稳定的基金品种,受股票市场系统性风险影响较大,如果股票市场出现整体下跌,本基金的净值表现将受到影响。

本基金可以投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所有限公司(以下简称“香港联合交易所”)上市的股票(以下简称“港股通股票”的),会面临港股通机制下因投资环境、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。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,本基金并非必然投资港股。

本基金的投资范围包括科创板股票,科创板股票交易实施更加严格的投资者适当性管理制度,投资者门槛高;随着后期上市企业的增加,部分股票可能面临交易不活跃、流动性差等风险;且投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期,存在本基金持有股票无法成交的风险。科创板退市制度较主板更为严格,退市时间短,退市速度快,退市情形多,且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节,上市公司退市风险更大,可能给基金资产净值带来不利影响。因科创板上市企业均为科技创新型企业,其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似,基金难以通过分散投资降低投资风险,若股票价格向波动,将影响基金资产净值波动。

本基金的投资范围包括存托凭证,面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。

本基金的投资范围包括资产支持证券,资产支持证券的风险主要与资产质量有关,比如债务人违约可能性的高低、债务人行使抵消权可能性的高低,资产收益受自然灾害、战争、罢工的影响程度,资产收益与外部经济环境变化的相关性等。如果资产支持证券受上述因素的影响程度低,则资产风险小,反之则风险高。

本基金可投资股指期货、股票期权,股指期货、股票期权采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,指数价格微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货、股票期权采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按規定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

本基金的投资范围包括国债期货,国债期货的投资可能面临市场风险,基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险,基差风险是期货市场的特有的风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流动性风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险,可能导致基金资产损失。

本基金采用量化模型构建投资组合,量化模型仅是选股模型,本基金并不基于量化模型进行高频交易。在实际运作过程中,本基金通过量化模型选择股票并构建股票投资组合,存在失效导致基金亏损的风险;同时,宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等重大变化也可能会影响模型的有效性,无法达到预期的投资效果。

本基金为契约型开放式基金,基金规模将随着基金投资者对基金份额的申购和赎回而不断波动。基金投资者的连续大量赎回可能使基金资产难以按照预先期望的价格变现,而导致基金的投资组合流动性不足;或者投资组合持有的证券由于外部环境影响或基本面发生重大变化而导致流动性降低,造成基金资产变现的损失,从而产生流动性风险。

投资人应当认真阅读《基金合同》《招募说明书》《基金产品资料概要》等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金,基金管理人单列见本公告以及基金管理人官网。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。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。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

13、本基金单一投资者持有基金份额数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。如本基金单一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%,基金管理人有权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单一投资人持有基金份额的比例达到或者超过50%,或者变相规避前述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。

(一)本次基金份额发售基本情况

(一)基金名称及代码

基金名称:财通华晟量化选股混合型证券投资基金

基金代码:024594(A类),024595(C类)

(二)基金的类别

混合型证券投资基金

(三)基金的运作方式

契约型开放式

(四)基金存续期限

不定期

(五)基金份额初始面值(认购价格)

每份基金份额初始面值为人民币1.00元

(六)基金的投资目标

在严格控制风险的前提下,充分挖掘和利用市场中潜在的投资机会,力争为基金份额持有人创造超越业绩比较基准的投资回报。

(七)募集对象

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)基金份额类别

本基金根据认购/申购费用及销售费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购、申购时收取认购、申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为A类基金份额;在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用,而从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为C类基金份额。

本基金A类和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类和C类基金份额将分别计算和公告基金份额净值,计算公式为:计算日某类别基金份额净值=计算日该类别基金份额的基金资产净值/计算日发售在外的该类别基金份额总数。

投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别。本基金不同基金份额类别之间的转换规定见招募说明书或相关公告。

(九)基金募集期

通过基金管理人指定的销售机构发售。

(十)销售渠道与销售地点

1、直销中心

本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上交易平台

财通基金管理有限公司

地址:上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43、45楼

电话:021-2053 7888

传真交易专线:021-6888 8169;021-6888 8661

直销联系人:何亚玲

网上交易平台地址:www.ctfund.com

财通基金微管家(微信号:ctfund88)

发售期间,客户可以通过本公司客户服务电话400-820-9888(免长途话费)进行募集相关事宜的问询、开放式基金的投资咨询及投诉等。

2、代销机构

本基金的其他销售机构信息详见基金管理人网站。基金管理人可根据有关法律法规的规定,选择符合要求的机构销售本基金,依据实际情况增加或减少销售机构,并在基金管理人网站上公示最新的销售机构名单。

如本次募集期间代销机构新增营业网点则由该代销机构另行公告。

(十一)募集时间安排与基金合同生效

本基金的募集期限为2025年8月18日至2025年9月17日。基金管理人可根据认购的情况,依据法律法规和基金合同的规定适当延长或缩短募集期限,但整个募集期限自基金份额发售之日起不超过三个月。

本基金自基金份额发售之日起3个月内,在基金募集份额总额不少于2亿元,基金募集金额不少于2亿元人民币且基金份额认购人数不少于200人的条件下,基金管理人依据法律法规及招募说明书可以决定停止基金发售,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。

12、风险提示:

本基金为证券投资基金,证券市场的变化将影响到基金的业绩。因此,宏观和微观经济因素、国家政策、市场变动、行业与个券业绩的变化、投资人风险收益偏好和市场流动程度等影响证券市场的各种因素将影响到本基金业绩,从而产生市场风险,投资者在投资基金前,应全面了解本基金的产品特性、理性判断市场,并承担基金投资中出现的各种风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、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。

本基金是一般风险及特别风险详见本基金招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金是混合型基金,股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为60%~95%(其中投资于港股通的股票的比例占股票资产的0~50%),属于股票仓位偏高且相对稳定的基金品种,受股票市场系统性风险影响较大,如果股票市场出现整体下跌,本基金的净值表现将受到影响。

本基金可以投资内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所有限公司(以下简称“香港联合交易所”)上市的股票(以下简称“港股通股票”的),会面临港股通机制下因投资环境、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。本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化,选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股,本基金并非必然投资港股。

本基金的投资范围包括科创板股票,科创板股票交易实施更加严格的投资者适当性管理制度,投资者门槛高;随着后期上市企业的增加,部分股票可能面临交易不活跃、流动性差等风险;且投资者可能在特定阶段对科创板个股形成一致性预期,存在本基金持有股票无法成交的风险。科创板退市制度较主板更为严格,退市时间短,退市速度快,退市情形多,且不再设置暂停上市、恢复上市和重新上市环节,上市公司退市风险更大,可能给基金资产净值带来不利影响。因科创板上市企业均为科技创新型企业,其商业模式、盈利风险、业绩波动等特征较为相似,基金难以通过分散投资降低投资风险,若股票价格向波动,将影响基金资产净值波动。

本基金的投资范围包括存托凭证,面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。

本基金的投资范围包括资产支持证券,资产支持证券的风险主要与资产质量有关,比如债务人违约可能性的高低、债务人行使抵消权可能性的高低,资产收益受自然灾害、战争、罢工的影响程度,资产收益与外部经济环境变化的相关性等。如果资产支持证券受上述因素的影响程度低,则资产风险小,反之则风险高。

本基金可投资股指期货、股票期权,股指期货、股票期权采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,指数价格微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货、股票期权采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按規定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

本基金的投资范围包括国债期货,国债期货的投资可能面临市场风险,基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险,基差风险是期货市场的特有的风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流动性风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险,可能导致基金资产损失。

本基金采用量化模型构建投资组合,量化模型仅是选股模型,本基金并不基于量化模型进行高频交易。在实际运作过程中,本基金通过量化模型选择股票并构建股票投资组合,存在失效导致基金亏损的风险;同时,宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等重大变化也可能会影响模型的有效性,无法达到预期的投资效果。

本基金的投资范围包括国债期货,国债期货的投资可能面临市场风险,基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险,基差风险是期货市场的特有的风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流动性风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

本基金可投资股指期货、股票期权,股指期货、股票期权采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,指数价格微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指期货、股票期权采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按規定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

本基金的投资范围包括存托凭证,面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险、与存托凭证发行机制相关的风险等。

本基金的投资范围包括资产支持证券,资产支持证券的风险主要与资产质量有关,比如债务人违约可能性的高低、债务人行使抵消权可能性的高低,资产收益受自然灾害、战争、罢工的影响程度,资产收益与外部经济环境变化的相关性等。如果资产支持证券受上述因素的影响程度低,则资产风险小,反之则风险高。

本基金可投资股指期货,国债期货的投资可能面临市场风险,基差风险、流动性风险。市场风险是因期货市场价格波动使所持有的期货合约价值发生变化的风险,基差风险是期货市场的特有的风险之一,是指由于期货与现货间的价差的波动,影响套期保值或套利效果,使之发生意外损益的风险。流动性风险可分为两类:一类为流动性风险,是指期货合约无法及时以所希望的价格建立或了结头寸的风险,此类风险往往是由市场缺乏广度或深度导致的;另一类为资金量风险,是指资金量无法满足保证金要求,使得所持有的头寸面临被强制平仓的风险。

本基金可参与融资业务。融资业务存在信用风险、投资风险和合规风险等风险,可能导致基金资产损失。

本基金采用量化模型构建投资组合,量化模型仅是选股模型,本基金并不基于量化模型进行高频交易。在实际运作过程中,本基金通过量化模型选择股票并构建股票投资组合,存在失效导致基金亏损的风险;同时,宏观经济环境、股票市场环境、交易规则等重大变化也可能会影响模型的有效性,无法达到预期的投资效果。