

# 易方达中证全指红利质量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

二零二六年一月

重要提示

1. 易方达中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会《关于准予易方达中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》(证监许可[2026]50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、指数基金。

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. 本基金将自2026年2月2日至2026年2月6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2026年2月2日至2026年2月6日,网上现金认购的日期为2026年2月2日至2026年2月6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以及资金账户。如投资者需要参与网下现金认购或网上现金认购,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明文件如已过有效期限,请及时办理相关更新手续,以免影响认购。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。

8. 本基金按规定收取的认购费用或认购佣金不超过认购份额的0.30%。

9. 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)。

10. 在募集期内任何一天(含第一天)当日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。

11. 末日认购申请确认比例的计算方法如下:

末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

12. 末日投资者认购申请确认份额=末日提交的有效认购申请份额×末日认购申请确认比例

13. “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。

14. 当发生部分确认时,将按照末日有效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,最终确认的基金份额累计有效认购份额(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。

15. 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。

16. 网上现金认购申请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。

17. 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。

18. 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,申请的成功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机构查询最终成交确认情况和认购的份额。

19. 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。

20. 本公告仅对易方达中证全指红利质量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](http://www.efunds.com.cn))和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csirc.gov.cn/fund>)上的《易方达中证全指红利质量交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《基金合同》。

21. 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对本基金表现的保证。

22. 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)。

23. 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)及直销中心电话(020-85102506)咨询购买事宜。

24. 基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。

25. 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,经上海证券交易所所有相关部门认可后,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,如投资者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。

26. 指数编制方案

本基金标的指数为中证全指红利质量指数。

(1) 样本空间

中证全指指数的样本空间

(2) 可投资性筛选

对样本空间的股票,按照过去一年日均总市值和过去一年日均成交金额分别由高到低排名,剔除任一排名后 20% 的证券。

(3) 选取方法

1) 对于样本空间中符合可投资性筛选条件的证券,选取满足以下条件的上市公司证券:

a. 过去三年连续现金分红

b. 过去三年平均股利支付率大于10%且小于100%

2) 对于中所选证券,按照过去三年平均现金股息率由高到低排名,剔除排名后 50% 的证券;

3) 对中剩余证券,按照过去 12 个季度 ROE 标准差由低到高排名,选取排名前 80% 的证券作为待选样本;

4) 计算待选样本质量因子指标,各指标具体计算如下:

a. ROE= 净利润/净资产

b. △ROE= ROE 同比变化值

c. OCFD= 最近一年经营活动现金净流量/总资产

d. DP= 最近一年现金分红/总资产

5) 根据中行业分类,区分金融行业与非金融行业,分别计算上述指标的标准化 Z 值,据此计算各个证券的综合得分,具体如下:

a. 综合得分(非金融行业)=(Z(ROE)+Z(△ROE)+Z(OCFD)+Z(DP))/4

b. 综合得分(金融行业)=(Z(ROE)+Z(△ROE)+Z(DP))/3

6) 从待选样本中选取综合得分最高的 50 只证券作为指数样本。

(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 =  $\sum(\text{证券价格} \times \text{调整股本数} \times \text{权重因子})$ 。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,以使指数样本采用标准化后的综合得分倾斜加权且满足单个样本权重不超过 10%,前五大样本权重合计不超过 40%,单个一级行业样本权重合计不超过 30%。

有关标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](http://www.csindex.com.cn)。

27. 风险提示

本基金投资于中证全指红利质量指数成份股及备选股的资产不低于

非现金基金资产的80%且不低于基金资产净值的90%,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,投资者在投资本基金前,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,充分考虑自身的风险承受能力,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。

投资本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的基本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)指数化投资的风险,包括标的指数组合与股票市场平均回报偏高的风

险、标的指数组合的风险、部分成份股权重较大的风险、标的指数组合发布时间较

短的风险、标的指数组合带来的风险、基金投资组合回报与标的指数组合回报偏

离的风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、标的指数组合计算出错的风险、指

数编制机构停止服务的风险等;(2)ETF运作的风险,包括参考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、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/赎回上限的风险、深市和京市成份证券申赎处理规则带来的风

险、退市风险等;(3)投资特定品种(包括股指期货、国债期货、股票期权等)的特有风

险;(4)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,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。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指

数的表现,具有与标的指数组合相似的风险收益特征。

本基金场内投资采用证券公司交易和结算模式,即本基金参与证券交易所

场内投资部分将通过基金管理人选定的证券经纪机构进行场内交易,并由选定的

证券经纪机构作为结算参与人代理本基金进行结算,该种交易和结算模式可能增

加本基金投资运作过程中的信息系统风险、操作风险、交易指令传输和资金使

用效率降低的风险、无法完成当日估值的风险、交易结算风险、基金投资非公

开信息披露的风险等。

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。

投资者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同时的更新,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。投资者一旦认购、申购或赎

回本基金,即表示对基金认购、申购、赎回及所涉及的登记方式以及申购赎回所涉

及涉及证券、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。

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发的投资风险,由投资者自行负责。此

外,本基金以1元初始面值进行募集,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。

10. 网上现金认购申请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,申请的成功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机构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,本基金份额可

以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. 本公告仅对易方达中证全指红利质量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](http://www.efunds.com.cn))和中国证监会基金电子披露网

站(<http://eid.csirc.gov.cn/fund>)上的《易方达中证全指红利质量交易型开

放式指数证券投资基金招募说明书》及《基金合同》。

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](http://www.efunds.com.cn))。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金

募集相关事宜。

16. 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。

17. 在发售期间,除本公告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。

18. 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)及直销中心电话(020-85102506)咨询购买事宜。

19. 基金管理人可综合