

# 永赢基金管理有限公司

## 永赢中证 A500 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：永赢基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

二零二五年一月

## 目录

重要提示.....	- 1 -
第一部分 本次募集的基本情况.....	- 9 -
第二部分 发售方式及相关规定.....	- 18 -
第三部分 投资者的开户.....	- 19 -
第四部分 网上现金认购的程序.....	- 20 -
第五部分 网下现金认购的程序.....	- 21 -
第六部分 网下股票认购的程序.....	- 24 -
第七部分 清算与交割.....	- 25 -
第八部分 基金的验资与备案.....	- 26 -
第九部分 本基金募集当事人或中介机构.....	- 27 -
第十部分 网下股票认购清单.....	- 32 -

## 重要提示

1、永赢中证 A500 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 2024 年 12 月 4 日获中国证监会证监许可（2024）1761 号文注册。中国证监会对本基金募集申请的注册，并不表明其对本基金的投资价值、市场前景和收益做出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

2、本基金是交易型开放式、股票型证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为永赢基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“永赢基金”），基金托管人为中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”），本基金的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。个人投资者指依据有关法律法规规定可投资于证券投资基金的自然人；机构投资者指依法可以投资证券投资基金的、在中华人民共和国境内合法登记并存续或经有关政府部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体或其他组织；合格境外投资者指符合《合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者境内证券期货投资管理办法》及相关法律法规规定使用来自境外的资金进行境内证券期货投资的境外机构投资者，包括合格境外机构投资者和人民币合格境外机构投资者。

5、本基金的发售期为 2025 年 1 月 9 日至 2025 年 1 月 22 日。投资者可以选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。如深圳证券交易所对网上现金认购时间做出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。本公司可根据募集情况适当延长或缩短本基金的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。

6、本基金的网上现金发售通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位办理。

7、本基金的网下现金发售通过基金管理人及基金管理人指定的发售代理机构进行，网下股票发售通过基金管理人及其指定的发售代理机构进行。发售代理机构请见“第九部分 本基金募集当事人或中介机构”之“三、基金份额销售机构”。各销售机构的办理地点、办理日期、办理时间和办理程序等事项参照各销售机构的具体规定。

8、投资者认购本基金时需具有深圳证券交易所 A 股账户（以下简称“深圳 A 股账户”）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“深圳证券交易所证券投资基金账户”）。如投资人需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户，但需注意，使用深圳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，如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用深圳 A 股账户。如投资人以上海证券交易所股票进行网下股票认购的，除了持有深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户外，还应持有上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人认购基金份额的托管证券公司和上海 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

9、本基金认购费用或认购佣金比率不超过 0.8%。

#### 10、募集规模上限

本基金首次募集规模上限为 20 亿元人民币（不包括募集期利息和认购费用，下同）。

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 20 亿份（折合为金额 20 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。

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 =  $(20 \text{ 亿份} - \text{末日之前有效认购申请份额总额}) / \text{末日有效认购申请份额总额}$

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

“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，本基金登记结算机构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 20 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计算并确认的结果为准。

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 1,000 份或其整数倍。投资人在认购时间内可多次提交认购申报，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 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 5 万份以上（含 5 万份），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

网下股票认购以单只股票股数申报，用于认购的股票必须是符合要求的标的指数的成份股和已经公告的备选成份股（具体名单详见本公告“第十部分 网下股票认购清单”）。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限。

12、网上现金认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。投资者可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购资金即被冻结。网下现金认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

网下股票认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

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。在基金合同生效后，投资人可通过其办理认购的销售网点查询认购确认情况。

14、本公告仅对本基金募集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 2025 年 1 月 3 日登载于本公司网站（<http://www.maxwealthfund.com>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）的《永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》。

15、各销售机构的销售网点以及开户和认购等事项的详细情况请向各销售机构咨询。对于未开设销售网点地区的投资者，可拨打本公司的客户服务电话 400-805-8888 咨询认购事宜。

16、在募集期内，本基金可视情形调整销售机构，敬请留意近期本公司网站公示的基金销售机构名录及各销售机构的公告，或拨打本公司及各销售机构客户服务电话咨询。

17、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机构名单后予以公告。本基金上市后，未托管在申购赎回代理机构的基金份额只能进行二级市场买卖，如投资者需进行本基金的申购赎回交易，须指定交易或转指定交易到本基金的申购赎回代理机构。

#### 18、风险提示：

本基金标的指数为中证A500指数。编制方案为：

##### （1）选样空间：

同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）选样方法

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：

- 样本空间内总市值排名前1500；
- 属于沪股通或深股通证券范围；

➤ 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<sup>1</sup>。

#### (4) 指数计算

指数计算公式为：

$$\text{报告期指数} = \frac{\text{报告期样本的调整市值}}{\text{除数}} \times 1000$$

其中，调整市值 =  $\Sigma$ (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%。

#### (5) 指数样本和权重调整

##### 1) 定期调整

指数样本每半年调整一次，样本调整实施时间分别为每年6月和12月的第二个星期五的下一交易日。

权重因子随样本定期调整而调整，调整时间与指数样本定期调整实施时间相同。在下一个定期调整日前，权重因子一般固定不变。每次调整的样本比例一般不超过10%。定期调整设置缓冲区，若主板老样本在所属中证三级行业内自由流通市值占比不低于1%，仍作为待选样本；选样方法（4）中的入选顺序在前400名的新样本优先进入，在前600名的老样本优先保留。

##### 2) 临时调整

特殊情况下将对指数进行临时调整。当样本退市时，将其从指数样本中剔除。样本公司发生收购、合并、分拆等情形的处理，参照计算与维护细则处理。当沪股通或深股通证券范围发生变动导致样本不再满足互联互通资格时，指数将相应

---

<sup>1</sup> 每步选样时，计算指数样本一级行业自由流通市值占比，确定相较样本空间市值占比最低的行业，选取该行业自由流通市值最大证券作为指数样本，重复该步骤直至样本数量达到 500 只。

调整。

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，网址：<http://www.csindex.com.cn/>。

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，投资人在投资本基金前，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，包括但不限于：市场风险、信用风险、管理风险、流动性风险、操作风险、合规性风险、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、本基金的特定风险、及其他风险等。本基金的特定风险包括：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、标的指数变更的风险、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、退市风险、指数编制机构停止服务的风险、成份股停牌的风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、基金场内份额赎回对价的变现风险、退补现金替代方式的风险、第三方机构服务的风险、投资资产支持证券的风险、股指期货、国债期货、股票期权等金融衍生品投资风险、参与转融通证券出借业务的风险、参与融资交易的风险、投资科创板股票的风险、存托凭证投资风险等。

本基金为股票型基金，理论上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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

本基金为指数基金，投资者投资于本基金面临跟踪误差控制未达约定目标、指数编制机构停止服务、成份股停牌等潜在风险，详见本招募说明书“风险提示”部分。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、企业债、公司债、次级债、地方政府债、金融债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存



单、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。在正常市场环境下本基金的流动性风险适中。在特殊市场条件下，如证券市场的成交量发生急剧萎缩、基金发生巨额赎回以及其他未能预见的特殊情形下，可能导致基金资产变现困难或变现对证券资产价格造成较大冲击，发生基金份额净值波动幅度较大、无法进行正常赎回业务、基金不能实现既定的投资决策等风险。

本基金将股指期货纳入到投资范围当中，股指期货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，股价、指数微小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。股指期货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，按规定将被强制平仓，可能给投资带来重大损失。

本基金将国债期货纳入到投资范围当中，国债期货是一种金融合约。投资于国债期货需承受市场风险、基差风险、流动性风险等。国债期货采用保证金交易制度，当相应期限国债收益率出现不利变动时，可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货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，按规定将被强制平仓，可能给投资带来较大损失。

本基金将股票期权纳入到投资范围当中，股票期权交易采用保证金交易的方式，投资者的潜在损失和收益都可能成倍放大，尤其是卖出开仓期权的投资者面临的损失总额可能超过其支付的全部初始保证金以及追加的保证金，具有杠杆性风险。

本基金可投资资产支持证券，资产支持证券（ABS）是一种债券性质的金融工具，其向投资者支付的本息来自于基础资产池产生的现金流或剩余权益。与股票和一般债券不同，资产支持证券不是对某一经营实体的利益要求权，而是对基础资产池所产生的现金流和剩余权益的要求权，是一种以资产信用为支持的证券，所面临的风险主要包括交易结构风险、各种原因导致的基础资产池现金流与对应证券现金流不匹配产生的信用风险、市场交易不活跃导致的流动性风险等，由此可能造成基金财产损失。

本基金可投资存托凭证，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，存托凭证的境外基础证券的相关风险可能直接或间接成为本基金的风险。

本基金可根据投资策略需要或不同市场环境的变化,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,基金资产并非必然参与存托凭证投资。

本基金可投资科创板股票,可能面临退市风险、市场风险、流动性风险等特有风险,从而可能给基金净值带来不利影响或损失。本基金根据投资策略需要或市场环境变化,可选择将部分基金资产投资于科创板股票或选择不将基金资产投资于科创板股票,基金资产并非必然投资于科创板股票。

投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人也不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资有风险,投资者在投资本基金前,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,理性判断市场,谨慎做出投资决策,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

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,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现,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。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则,在投资者做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

19、本公司可综合各种情况对募集安排作出适当调整。

## 第一部分 本次募集的基本情况

### 一、基金名称

永赢中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

基金代码：159386

场内简称：A500ETF 永赢

### 二、基金类型

股票型证券投资基金、指数基金

### 三、基金运作方式

交易型开放式

### 四、基金存续期限

不定期

### 五、基金份额面值

本基金的基金份额发售面值为人民币 1.00 元。

### 六、基金募集对象

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。

### 七、基金投资目标

紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

### 八、基金投资范围

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于标的指数成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行

上市的非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、企业债、公司债、次级债、地方政府债、金融债、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生品（包括股指期货、国债期货、股票期权）、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务和转融通证券出借业务。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除衍生品投资需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；衍生品及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

如法律法规或监管机构对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以对该比例做相应调整。

## 九、基金的最低募集份额总额

本基金的最低募集份额总额为 2 亿份。

## 十、销售机构

本基金销售机构名单详见本公告“九、本基金募集当事人或中介机构”部分内容。

本基金募集期内，本公司可能增加新的销售机构，并在基金管理人网站公示。投资人可留意相关公告或拨打本公司客户服务电话进行查询。

## 十一、基金募集期与发售时间

根据有关法律、法规、基金合同的规定，本基金的募集期为自基金份额发售之日起至基金份额停止发售之日止，最长不超过 3 个月。

本基金的发售期为 2025 年 1 月 9 日至 2025 年 1 月 22 日。投资者可以选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。如深圳证券交易所对网上现金认购时间做出调整，本公司将作出相应调整并及时公告。本公司可根据募集情况适当延长或缩短本基金的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。

## 十二、基金备案与基金合同生效

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 亿份，基金募集金额（含网下股票认购所募集的股票市值）不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，基金募集期届满或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。

基金募集达到基金备案条件的，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；否则基金合同不生效。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。

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户，网下股票认购募集的股票按证券交易所及登记机构的规则和流程予以冻结，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

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。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票，按证券交易所及登记机构的规则予以解冻，基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作；
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报

酬。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

### 十三、募集资金利息及募集期认购股票的处理方式

基金募集期间网上现金认购、网下现金认购的有效认购款项在募集期间产生的利息，将折算为基金份额归基金份额持有人所有，其中利息转份额的数额以登记机构的记录为准。投资人以股票认购的，认购股票由发售代理机构予以冻结，网下股票认购所募集的股票在网下股票认购日至登记机构进行股票过户日（不含）的冻结期间所产生的权益归投资者所有。

### 十四、基金认购费用

认购费用由投资人承担，具体的认购费率如下：

认购份额（S）	认购费率
S < 50 万份	0.80%
50 万份 ≤ S < 100 万份	0.50%
S ≥ 100 万份	1000 元/笔

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。基金管理人办理网下股票认购时不收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购、网下股票认购时可参照上述费率结构收取一定的佣金。投资人可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

### 十五、认购金额、认购费用、认购份额的计算

#### 1、网上现金认购

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

$$\text{认购佣金} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

（或若适用于固定费用的，认购佣金=固定费用）

$$\text{认购金额} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{佣金比率})$$

（或若适用于固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

$$\text{总认购份额} = \text{认购份额} + \text{认购金额产生的利息} / \text{认购价格}$$

网上现金认购的有效认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网上现金认购的利息和具体份额以登记机构的记录为

准。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。

认购佣金由发售代理机构向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

例一：某投资人通过某发售代理机构以网上现金认购方式认购1,000份本基金基金份额，假设该发售代理机构确认的佣金比率为0.8%，假设认购金额产生的利息为10元，则投资人需支付的认购佣金和需准备的认购金额计算如下：

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 1,000 \times 0.8\% = 8 \text{元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 1,000 \times (1 + 0.8\%) = 1,008 \text{元}$$

$$\text{总认购份额} = 1,000 + 10 / 1.00 = 1,010 \text{份}$$

即，若该投资人通过发售代理机构以网上现金认购方式认购本基金份额1,000份，则需缴纳认购金额1,008元，其中认购佣金8元；假设该笔认购金额产生的利息为10元，加上认购资金的募集期间产生的利息折算的份额后，则可得到1,010份基金份额。

## 2、网下现金认购

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

$$\text{认购费用} = \text{认购份额} \times \text{认购价格} \times \text{认购费率}$$

（或若适用于固定费用的，认购费用=固定费用）

$$\text{认购金额} = \text{认购份额} \times \text{认购价格} \times (1 + \text{认购费率})$$

（或若适用于固定费用的，认购金额=认购价格×认购份额+固定费用）

$$\text{总认购份额} = \text{认购份额} + \text{认购金额产生的利息} / \text{认购价格}$$

认购费用由基金管理人向投资人收取，投资人需以现金方式交纳认购费用。网下现金认购款项在基金募集期间产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有。网下现金认购的利息和具体份额以登记机构的记录为准。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：某投资人通过基金管理人以网下现金认购方式认购100,000份本基金，认购费率为0.80%，假设认购资金募集期间产生的利息为50元，则投资人需支付的认购费用和需准备的认购资金金额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 100,000 \times 0.80\% = 800 \text{元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 100,000 \times (1 + 0.80\%) = 100,800 \text{元}$$

总认购份额 = 100,000 + 50 / 1.00 = 100,050 份

即，若该投资人通过基金管理人采用网下现金认购方式认购本基金份额 100,000 份，则需缴纳 100,800 元认购资金，其中认购费用 800 元；假设该笔认购金额产生的利息为 50 元，加上募集期间利息折算的份额后一共可以得到 100,050 份基金份额。

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算同通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算。

### 3、网下股票认购

网下股票认购以单只股票股数申报，用于认购的股票必须是符合要求的标的指数的成份股和已经公告的备选成份股（具体名单可详见本公告“第十部分网下股票认购清单”）。

认购份额和认购费用/佣金的计算公式为：

认购份额 =  $\sum_{i=1}^n$  （第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价 × 有效认购数量） / 认购价格

其中：

（1）i 代表投资人提交认购申请的第 i 只股票，n 代表投资者提交的股票总只数，如投资人仅提交了 1 只股票的申请，则 n = 1。

（2）“第 i 只股票在网下股票认购期最后一日的均价”由基金管理人根据证券交易所的当日行情数据，以该股票的总成交金额除以总成交股数计算，以四舍五入的方法保留小数点后两位。若该股票在当日停牌或无成交，则以同样方法计算最近一个交易日的均价作为计算价格。

若某只股票在网下股票认购期最后一日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生了除息、送股（转增）、配股等权益变动，由于投资人获得了相应的权益，基金管理人将按如下方式对该股票在网下股票认购期最后一日的均价进行调整：

1) 除息：调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 - 每股现金股利或股息

2) 送股：调整后价格 = 网下股票认购期最后一日均价 / (1 + 每股送股比例)

3) 配股：调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比



例) / (1+每股配股比例)

4) 送股且配股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例) / (1+每股送股比例+每股配股比例)

5) 除息且送股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 - 每股现金股利或股息) / (1+每股送股比例)

6) 除息且配股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例 - 每股现金股利或股息) / (1+每股配股比例)

7) 除息、送股且配股: 调整后价格 = (网下股票认购期最后一日均价 + 配股价 × 配股比例 - 每股现金股利或股息) / (1+每股送股比例+每股配股比例)

(3) “有效认购数量”是指由基金管理人确认的并由登记机构完成清算交收的股票股数。

其中: ①对于经公告限制认购规模的个股, 基金管理人可确认的认购数量上限为:

$$q^{\max} = (Cash + \sum_{j=1}^n p_j q_j) \times 105\% \times w / p$$

$q^{\max}$  为限制认购规模的单只个股最高可确认的认购数量;

$Cash$  为网上现金认购和网下现金认购的合计申请数额;

$p_j q_j$  为除限制认购规模的个股和基金管理人全部或部分临时拒绝的个股以外的其他个股在网下股票认购期最后一日均价和认购申报数量乘积;

$w$  为该股按均价计算的其在网下股票认购期最后一日标的指数中的权重。认购期间, 如标的指数发布指数调整公告, 则基金管理人根据公告调整后的成份股名单及标的指数编制规则计算调整后的标的指数构成权重, 作为计算依据;

$p$  为该股在网下股票认购期最后一日的均价。

如果投资者申报的个股认购数量总额大于基金管理人可确认的认购数量上限, 则根据认购日期的先后按照先到先得的方式确认。如同一天申报的个股认购数量全部确认将突破基金管理人可确认上限的, 则按比例分配确认。

② 若某一股票在股票认购日至登记机构进行股票过户日的冻结期间发生司法执行, 则基金管理人将根据登记机构确认的实际过户数据对投资者的有效认购

数量进行相应调整。

(4) 在基金管理人及发售代理机构允许的条件下，投资人可选择以现金或基金份额的方式支付认购费用/佣金。投资人如以基金份额方式支付认购费用/佣金的，其最终确认得到的净认购份额将小于上述计算公式中的认购份额。

认购佣金由发售代理机构在投资者认购确认时收取，在发售代理机构允许的条件下，投资者可选择以现金或基金份额的方式支付认购佣金。认购份额和认购佣金的计算公式为：

1) 投资者选择以现金方式支付认购佣金，则需支付的认购佣金按以下公式计算：

$$\text{认购佣金} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} \times \text{佣金比率}$$

(或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用)

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额}$$

2) 投资者选择以基金份额方式支付佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。以基金份额支付佣金，则认购佣金和可得到的基金份额按以下公式计算：

$$\text{认购佣金} = \text{认购价格} \times \text{认购份额} / (1 + \text{佣金比率}) \times \text{佣金比率}$$

(或若适用固定费用的，认购佣金=固定费用)

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购佣金} / \text{认购价格}$$

例三：某投资者持有本基金标的指数成份股中股票A和股票B各10,000股和20,000股，至某发售代理机构网点认购本基金，选择以现金支付认购佣金。假设网下股票认购期最后一日股票A和股票B的均价分别为14.94元和4.50元，基金管理人确认的有效认购数量为10,000股股票A和20,000股股票B，发售代理机构确认的佣金比率为0.8%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购份额} = (10,000 \times 14.94) / 1.00 + (20,000 \times 4.50) / 1.00 = 239,400 \text{份}$$

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 239,400 \times 0.8\% = 1915.20 \text{元}$$

即，该投资者可认购到239,400份本基金基金份额，并需另行支付1,915.20元的认购佣金。

例四：续例三，假设该投资者选择以基金份额的方式交纳认购佣金，则投资

者最终可得的净认购份额计算如下：

$$\text{认购佣金} = 1.00 \times 239,400 / (1 + 0.8\%) \times 0.8\% = 1,900.00 \text{元}$$

$$\text{净认购份额} = 239,400 - 1,900 / 1.00 = 237,500 \text{份。}$$

即，该投资者可认购到237,500份本基金基金份额，并已通过基金份额方式支付1,900.00元的认购佣金。

## 第二部分 发售方式及相关规定

一、本基金在募集期内向个人和机构投资者同期发售。

二、投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。网上现金认购是指投资人通过基金管理人指定的发售代理机构利用深圳证券交易所网上系统以现金进行认购。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认购。网下股票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股票进行认购。

三、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 1,000 份或其整数倍。投资人在认购时间内可多次提交认购申报，累计认购份额不设上限。

四、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 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 5 万份以上（含 5 万份），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

五、网下股票认购以单只股票股数申报，用于认购的股票必须是符合要求的标的指数的成份股和已经公告的备选成份股（具体名单详见本公告“第十部分 网下股票认购清单”）。投资人应以 A 股账户认购。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限。

六、网上现金认购本基金时，需按发售代理机构的规定，备足认购资金，办理认购手续。投资者可多次申报，不可撤单，申报一经确认，认购资金即被冻结。网下现金认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理相关认购手续，并备足认购资金。网下现金认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。网下股票认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

### 第三部分 投资者的开户

1、投资人认购本基金时需具有深圳证券交易所 A 股账户（以下简称“深圳 A 股账户”）或深圳证券交易所证券投资基金账户（以下简称“深圳证券交易所证券投资基金账户”）。

（1）已有深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。

（2）尚无深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的投资者，需在认购前持本人身份证到中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的开户代理机构办理深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户的开户手续。有关开设深圳 A 股账户和深圳证券交易所证券投资基金账户的具体程序和办法，请到各开户网点详细咨询有关规定。

#### 2、账户使用注意事项

（1）如投资人需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户，但需注意深圳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，则应开立深圳 A 股账户。

（2）如投资人以深圳证券交易所上市交易的本基金成份股或备选成份股进行网下股票认购的，应开立并使用深圳 A 股账户。

（3）如投资人以上海证券交易所股票进行网下股票认购的，除了持有深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户外，还应持有上海证券交易所 A 股账户（以下简称“上海 A 股账户”），且该两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有，并注意投资人认购基金份额的托管证券公司和上海 A 股账户指定交易证券公司应为同一发售代理机构。

（4）已购买过由永赢基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资人，其所持有的永赢基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

## 第四部分 网上现金认购的程序

### 一、业务办理时间

2025 年 1 月 9 日至 2025 年 1 月 22 日上午 9:30-11:30 和下午 13:00-15:00(周六、周日及法定节假日不受理)。如深圳证券交易所对网上现金认购时间做出调整,本公司将相应调整并及时公告。

二、认购限额: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 1,000 份或其整数倍。投资人在认购时间内可多次提交认购申报,累计认购份额不设上限。

### 三、认购手续

- 1、开立深圳证券交易所 A 股账户或深圳证券投资基金账户。
- 2、在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。
- 3、投资者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。

具体时间和认购手续以深圳证券交易所和发售代理机构的相关规则为准。

## 第五部分 网下现金认购的程序

### 一、直销机构

#### 1、业务办理时间

2025 年 1 月 9 日至 2025 年 1 月 22 日上午 9:00 至下午 17:00(周末和法定节假日不受理)。

2、认购限额：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 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 5 万份以上（含 5 万份），投资人可多次认购，累计认购份额不设上限，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

3、认购手续：投资者须先开立深圳证券交易所 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户，然后向本公司直销网点提供下列资料办理基金的认购手续。

#### 1) 个人投资者办理基金认购申请时须提交下列材料：

①交易前须提供投资者身份信息等证明资料，详见基金管理人官网规则指南专区中的《账户业务办理指南》；（首次认购时提供，但已开立永赢基金开放式基金账户的投资者无需提供）

②填妥并由本人签字的《个人投资者 ETF 基金网下认购业务申请表》；

③出示深圳证券交易所的 A 股证券账户卡或深圳证券交易所证券投资基金账户卡，并提供由本人签字的复印件；

④出示本人现行有效的法定身份证件，并提供由本人签字的正反面复印件；

⑤提供加盖银行受理印章的银行付款凭证回单联或加盖个人印鉴（签字）的网上银行付款凭证复印件；

⑥本公司要求的其他资料。

#### 2) 机构投资者办理基金认购申请时须提交下列材料：

①交易前须提供投资者身份信息等证明资料，详见基金管理人官网规则指南专区中的《账户业务办理指南》；（首次认购时提供，但已开立永赢基金开放式基金账户的投资者无需提供）

②填妥并加盖预留印鉴及授权经办人签字的《机构投资者 ETF 基金网下认购

业务申请表》；

③出示深圳证券交易所的 A 股证券账户卡或深圳证券交易所证券投资基金账户卡，并提供加盖预留印鉴的复印件；

④提供加盖银行受理印章的银行付款凭证回单联或划款指令的复印件；

⑤本公司要求的其他资料。

#### 4、资金划拨

投资者认购本基金时，须将足额的认购资金，自与投资者同一身份的银行账户，汇入本公司下述指定的直销中心专户，并在所填写票据的汇款用途中注明“投资者姓名及认购的基金名称”。本公司直销中心账户如下：

户名：永赢基金管理有限公司

账号：30010122000582559

开户行：宁波银行鄞州中心区支行

大额支付号：313332082060

投资者若因未向上述指定账户足额划付认购资金，造成其认购不成功的，本公司及本公司直销中心账户的开户银行不承担任何责任。

#### 5、注意事项

(1) 若投资人的认购资金在认购申请当日 17:00 之前未到本公司指定的直销资金专户，则当日提交的申请顺延受理。申请受理日期（即有效申请日）以资金到账日为准。在本基金发行截止日的 17:00 之前，若投资者的认购资金未到达本公司指定账户，则投资者提交的认购申请将可被认定为无效认购。

(2) 投资人汇款时，应提示银行柜台人员务必准确完整地传递汇款信息，包括汇款人和用途栏内容。

#### 二、发售代理机构

##### 1、业务办理时间：

具体时间以各发售代理机构的规定为准。

2、认购限额：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 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 5 万份以上（含 5 万份），投资人



可多次认购，累计认购份额不设上限，法律法规、中国证监会或基金合同另有规定的除外。

### 3、认购手续：

- (1) 开立深圳证券交易所 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户。
- (2) 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。
- (3) 投资人填写认购委托单，同时填写委托该发售代理机构代为办理网上现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。

具体时间和认购手续以基金管理人或各发售代理机构的规定为准。

## 第六部分 网下股票认购的程序

### 一、业务办理时间

2025 年 1 月 9 日至 2025 年 1 月 22 日上午 9:30-11:30 和下午 13:00-15:00(周六、周日及法定节假日不受理)，具体时间以发售代理机构的规定为准。

二、认购限额：网下股票认购以单只股票股数申报，用于认购的股票必须是符合要求的标的指数的成份股和已经公告的备选成份股（具体名单详见本公告“第十部分网下股票认购清单”）。单只股票最低认购申报股数为 1,000 股，超过 1,000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资人可多次提交认购申请，累计申报数不设上限。

### 三、认购手续

投资人在认购本基金时，需按销售机构的规定，到销售网点办理认购手续，并备足认购股票。网下股票认购申请提交后在销售机构规定的时间之后不得撤销。

具体认购程序以发售代理机构的规定为准。

四、特别提示：投资者应该根据法律法规及深圳证券交易所相关交易规则的规定进行网下股票认购，并及时履行因网下股票认购导致的股份减持所可能涉及的信息披露义务。

## 第七部分 清算与交割

### 一、网上现金认购

投资人通过发售代理机构提交的网上现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金，登记机构进行清算交收。

### 二、网下现金认购

投资人通过基金管理人提交的网下现金认购申请，由基金管理人进行有效认购款项的清算交收。投资人通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由登记机构进行清算交收。

本基金权益登记由登记机构在基金发售结束后完成过户登记。

### 三、网下股票认购

网下股票认购期内每日日终，发售代理机构将当日的股票认购数据按投资人证券账户汇总发给基金管理人。T日日终（T日为本基金发售期最后一日），发售代理机构将股票认购数据按投资者证券账户汇总发送给基金管理人，基金管理人收到股票认购数据后初步确认各成份股的有效认购数量。T+1日起，登记机构根据基金管理人提供的确认数据将投资者上海市场网下认购股票进行冻结，并将投资者深圳市场网下认购股票划转至中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司的 ETF 证券认购专户。以基金份额方式支付认购费用/佣金的，基金管理人根据发售代理机构提供的数据计算投资者应以基金份额方式支付的认购费用/佣金，并从投资者的认购份额中扣除，为发售代理机构增加相应的基金份额。登记机构根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，将上海和深圳的股票分别过户至本基金在上海、深圳开立的证券账户。基金合同生效后，登记机构根据基金管理人提供的投资者净认购份额明细数据进行投资者认购份额的初始登记。

## 第八部分 基金的验资与备案

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2亿份,基金募集金额(含网下股票认购所募集的股票市值)不少于2亿元人民币且基金认购人数不少于200人的条件下,基金募集期届满或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。

基金募集达到基金备案条件的,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;否则基金合同不生效。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。

基金管理人应将基金募集期间募集的资金存入专门账户,网下股票认购募集的股票按证券交易所及登记机构的规则和流程予以冻结,在基金募集行为结束前,任何人不得动用。

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。对于基金募集期间网下股票认购所募集的股票,按证券交易所及登记机构的规则予以解冻,基金管理人不承担相关股票冻结期间交易价格波动的责任。登记机构及发售代理机构将协助基金管理人完成相关资金和证券的退还工作;
- 3、如基金募集失败,基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

## 第九部分 本基金募集当事人或中介机构

### 一、基金管理人

永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪大厦 21、22、23、27 层

法定代表人：马宇晖

联系人：沈望琦

联系电话：（021）5169 0188

传真：（021）5169 0177

网址：www.maxwealthfund.com

### 二、基金托管人

名称：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

成立日期：1995 年 10 月 25 日

组织形式：股份有限公司（上市）

注册资本：14,820,546,829 元人民币

存续期间：无限期

联系电话：95548-3

### 三、基金份额销售机构

#### 1、网下现金、网下股票发售直销机构

永赢基金管理有限公司

住所：浙江省宁波市鄞州区中山东路 466 号

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 210 号 21 世纪大厦 27 层

法定代表人：马宇晖

联系电话：（021）5169 0103

传真：（021）6887 8782、6887 8773

联系人：施筱程

客服热线：400-805-8888

网址：[www.maxwealthfund.com](http://www.maxwealthfund.com)

## 2、网下现金发售代理机构

### （1）华泰证券股份有限公司

地址：中国江苏省南京市江东中路 228 号华泰证券广场

客服电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

### （2）中信证券股份有限公司

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

客服电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

### （3）中信证券华南股份有限公司

地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室

客服电话：95548

公司网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

### （4）中信证券（山东）有限责任公司

地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

客服电话：95548

公司网址：[www.sd.citics.com](http://www.sd.citics.com)

### （5）长江证券股份有限公司

地址：湖北省武汉市江汉区淮海路 88 号

客服电话：95579

公司网址：[www.95579.com](http://www.95579.com)

### （6）东方财富证券股份有限公司

地址：西藏自治区拉萨市柳梧新区国际总部城 10 栋楼

客服电话：95357

网址：[www.18.cn](http://www.18.cn)

### 3、网下股票发售代理机构

(1) 华泰证券股份有限公司

地址：中国江苏省南京市江东中路 228 号华泰证券广场

客服电话：95597

网址：[www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(2) 中信证券股份有限公司

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

客服电话：95548

公司网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(3) 中信证券华南股份有限公司

地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室

客服电话：95548

公司网址：[www.gzs.com.cn](http://www.gzs.com.cn)

(4) 中信证券（山东）有限责任公司

地址：青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

客服电话：95548

公司网址：[www.sd.citics.com](http://www.sd.citics.com)

(5) 国投证券股份有限公司

地址：深圳市福田区福田街道福华一路 119 号

客服电话：95532

公司网址：[www.essence.com.cn](http://www.essence.com.cn)

(6) 海通证券股份有限公司

地址：上海市黄浦区中山南路 888 号海通外滩金融广场

客服电话：95553

网址：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金，并在基金管理人网站公示。

### 4、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位办理，具体名单如下：爱建证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东莞证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国投证券、国新证券、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、华源证券、江海证券、金元证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源、申万宏源西部、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、麦高证券、五矿证券、西部证券、西南证券、湘财证券、诚通证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、长城国瑞、长城证券、长江证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）等。

如会员单位名单有所增加或减少，请以深圳证券交易所的具体规定为准，本基金管理人将不就此事项进行公告。

基金管理人可根据情况变更或增减销售机构，并及时在基金管理人网站公示。

#### 四、 登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

联系人：郑奕莉

电话：021-58872935

传真：021-68870311

#### 五、 出具法律意见书的律师事务所



名称：上海源泰律师事务所

住所：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

办公地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：（021）51150298

传真：（021）51150398

联系人：刘佳

经办律师：刘佳、张雯倩

## 六、 审计基金财产的会计师事务所

名称：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

办公地址：北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

执行事务合伙人：毛鞍宁

电话：010-58153000

传真：010-85188298

联系人：石静筠

经办注册会计师：石静筠、沈熙苑

## 七、 发售费用

本次基金发售中发生的与基金有关的法定信息披露费、会计师费和律师费等发行费用，不从基金财产中支付。

## 第十部分 网下股票认购清单

本基金募集期间，网下股票认购名单如下表所示，但是募集期结束前已公告的将被调出中证 A500 指数的成份股不得用于认购本基金。基金管理人可根据网下股票认购日前 3 个月个股的交易量、价格波动及其他异常情况，决定是否对个股认购规模进行限制，并在网下股票认购日前公告限制认购规模的个股名单。对于在网下股票认购期间价格波动异常、认购申报数量异常或长期停牌的个股，基金管理人可不经公告，全部或部分拒绝该股票的认购申报。如遇中证 A500 指数成份股调整，则最终确认可接受网下股票认购的清单以最终调整公告为准。

代码	简称	代码	简称	代码	简称	代码	简称
000001.SZ	平安银行	002472.SZ	双环传动	600031.SH	三一重工	601319.SH	中国人保
000002.SZ	万科 A	002475.SZ	立讯精密	600036.SH	招商银行	601328.SH	交通银行
000009.SZ	中国宝安	002493.SZ	荣盛石化	600038.SH	中直股份	601398.SH	工商银行
000034.SZ	神州数码	002497.SZ	雅化集团	600039.SH	四川路桥	601567.SH	三星医疗
000035.SZ	中国天楹	002508.SZ	老板电器	600048.SH	保利发展	601601.SH	中国太保
000039.SZ	中集集团	002517.SZ	恺英网络	600050.SH	中国联通	601607.SH	上海医药
000063.SZ	中兴通讯	002532.SZ	天山铝业	600066.SH	宇通客车	601615.SH	明阳智能
000066.SZ	中国长城	002541.SZ	鸿路钢构	600085.SH	同仁堂	601618.SH	中国中冶
000069.SZ	华侨城 A	002544.SZ	普天科技	600089.SH	特变电工	601628.SH	中国人寿
000100.SZ	TCL 科技	002555.SZ	三七互娱	600096.SH	云天化	601636.SH	旗滨集团
000157.SZ	中联重科	002558.SZ	巨人网络	600104.SH	上汽集团	601668.SH	中国建筑
000301.SZ	东方盛虹	002572.SZ	索菲亚	600111.SH	北方稀土	601669.SH	中国电建
000333.SZ	美的集团	002594.SZ	比亚迪	600115.SH	中国东航	601677.SH	明泰铝业
000338.SZ	潍柴动力	002601.SZ	龙佰集团	600118.SH	中国卫星	601689.SH	拓普集团
000400.SZ	许继电气	002603.SZ	以岭药业	600129.SH	太极集团	601727.SH	上海电气
000408.SZ	藏格矿业	002607.SZ	中公教育	600131.SH	国网信通	601728.SH	中国电信
000423.SZ	东阿阿胶	002624.SZ	完美世界	600141.SH	兴发集团	601766.SH	中国中车
000425.SZ	徐工机械	002625.SZ	光启技术	600143.SH	金发科技	601799.SH	星宇股份
000519.SZ	中兵红箭	002648.SZ	卫星化学	600150.SH	中国船舶	601800.SH	中国交建
000538.SZ	云南白药	002709.SZ	天赐材料	600153.SH	建发股份	601816.SH	京沪高铁
000547.SZ	航天发展	002714.SZ	牧原股份	600160.SH	巨化股份	601857.SH	中国石油
000568.SZ	泸州老窖	002738.SZ	中矿资源	600161.SH	天坛生物	601866.SH	中远海发
000617.SZ	中油资本	002739.SZ	万达电影	600166.SH	福田汽车	601868.SH	中国能建
000623.SZ	吉林敖东	002756.SZ	永兴材料	600176.SH	中国巨石	601872.SH	招商轮船
000625.SZ	长安汽车	002812.SZ	恩捷股份	600177.SH	雅戈尔	601877.SH	正泰电器
000629.SZ	钒钛股份	002821.SZ	凯莱英	600183.SH	生益科技	601880.SH	辽港股份

000630.SZ	铜陵有色	002831.SZ	裕同科技	600188.SH	兖矿能源	601888.SH	中国中免
000651.SZ	格力电器	002916.SZ	深南电路	600196.SH	复星医药	601899.SH	紫金矿业
000661.SZ	长春高新	002920.SZ	德赛西威	600233.SH	圆通速递	601919.SH	中远海控
000708.SZ	中信特钢	002938.SZ	鹏鼎控股	600256.SH	广汇能源	601966.SH	玲珑轮胎
000725.SZ	京东方 A	003816.SZ	中国广核	600258.SH	首旅酒店	601985.SH	中国核电
000733.SZ	振华科技	300001.SZ	特锐德	600276.SH	恒瑞医药	601988.SH	中国银行
000738.SZ	航发控制	300002.SZ	神州泰岳	600309.SH	万华化学	601989.SH	中国重工
000768.SZ	中航西飞	300003.SZ	乐普医疗	600315.SH	上海家化	603000.SH	人民网
000786.SZ	北新建材	300012.SZ	华测检测	600316.SH	洪都航空	603019.SH	中科曙光
000792.SZ	盐湖股份	300014.SZ	亿纬锂能	600325.SH	华发股份	603077.SH	和邦生物
000807.SZ	云铝股份	300015.SZ	爱尔眼科	600332.SH	白云山	603087.SH	甘李药业
000818.SZ	航锦科技	300017.SZ	网宿科技	600335.SH	国机汽车	603129.SH	春风动力
000830.SZ	鲁西化工	300024.SZ	机器人	600346.SH	恒力石化	603259.SH	药明康德
000831.SZ	中国稀土	300033.SZ	同花顺	600352.SH	浙江龙盛	603260.SH	合盛硅业
000858.SZ	五粮液	300037.SZ	新宙邦	600362.SH	江西铜业	603288.SH	海天味业
000878.SZ	云南铜业	300054.SZ	鼎龙股份	600372.SH	中航机载	603290.SH	斯达半导
000887.SZ	中鼎股份	300058.SZ	蓝色光标	600392.SH	盛和资源	603392.SH	万泰生物
000932.SZ	华菱钢铁	300059.SZ	东方财富	600399.SH	抚顺特钢	603456.SH	九洲药业
000933.SZ	神火股份	300068.SZ	南都电源	600406.SH	国电南瑞	603486.SH	科沃斯
000938.SZ	紫光股份	300073.SZ	当升科技	600415.SH	小商品城	603501.SH	韦尔股份
000960.SZ	锡业股份	300088.SZ	长信科技	600418.SH	江淮汽车	603568.SH	伟明环保
000963.SZ	华东医药	300114.SZ	中航电测	600426.SH	华鲁恒升	603588.SH	高能环境
000967.SZ	盈峰环境	300118.SZ	东方日升	600438.SH	通威股份	603596.SH	伯特利
000975.SZ	山金国际	300122.SZ	智飞生物	600460.SH	士兰微	603605.SH	珀莱雅
000977.SZ	浪潮信息	300124.SZ	汇川技术	600482.SH	中国动力	603606.SH	东方电缆
000988.SZ	华工科技	300136.SZ	信维通信	600486.SH	扬农化工	603613.SH	国联股份
000998.SZ	隆平高科	300142.SZ	沃森生物	600487.SH	亨通光电	603650.SH	彤程新材
000999.SZ	华润三九	300144.SZ	宋城演艺	600489.SH	中金黄金	603659.SH	璞泰来
001914.SZ	招商积余	300182.SZ	捷成股份	600497.SH	驰宏锌锗	603688.SH	石英股份
001965.SZ	招商公路	300207.SZ	欣旺达	600498.SH	烽火通信	603799.SH	华友钴业
001979.SZ	招商蛇口	300212.SZ	易华录	600499.SH	科达制造	603806.SH	福斯特
002001.SZ	新和成	300223.SZ	北京君正	600515.SH	海南机场	603816.SH	顾家家居
002007.SZ	华兰生物	300251.SZ	光线传媒	600516.SH	方大炭素	603833.SH	欧派家居
002008.SZ	大族激光	300253.SZ	卫宁健康	600519.SH	贵州茅台	603882.SH	金域医学
002025.SZ	航天电器	300274.SZ	阳光电源	600521.SH	华海药业	603885.SH	吉祥航空
002027.SZ	分众传媒	300285.SZ	国瓷材料	600529.SH	山东药玻	603899.SH	晨光股份
002028.SZ	思源电气	300296.SZ	利亚德	600535.SH	天士力	603939.SH	益丰药房
002044.SZ	美年健康	300308.SZ	中际旭创	600547.SH	山东黄金	603986.SH	兆易创新
002049.SZ	紫光国微	300315.SZ	掌趣科技	600549.SH	厦门钨业	603993.SH	洛阳钼业
002050.SZ	三花智控	300316.SZ	晶盛机电	600563.SH	法拉电子	605117.SH	德业股份
002064.SZ	华峰化学	300339.SZ	润和软件	600570.SH	恒生电子	605358.SH	立昂微
002065.SZ	东华软件	300346.SZ	南大光电	600584.SH	长电科技	605499.SH	东鹏饮料

002074.SZ	国轩高科	300347.SZ	泰格医药	600585.SH	海螺水泥	688002.SH	睿创微纳
002078.SZ	太阳纸业	300383.SZ	光环新网	600588.SH	用友网络	688005.SH	容百科技
002085.SZ	万丰奥威	300390.SZ	天华新能	600637.SH	东方明珠	688008.SH	澜起科技
002120.SZ	韵达股份	300394.SZ	天孚通信	600660.SH	福耀玻璃	688009.SH	中国通号
002128.SZ	电投能源	300395.SZ	菲利华	600667.SH	太极实业	688012.SH	中微公司
002129.SZ	TCL 中环	300408.SZ	三环集团	600674.SH	川投能源	688036.SH	传音控股
002131.SZ	利欧股份	300413.SZ	芒果超媒	600690.SH	海尔智家	688041.SH	海光信息
002138.SZ	顺络电子	300418.SZ	昆仑万维	600704.SH	物产中大	688047.SH	龙芯中科
002145.SZ	中核钛白	300433.SZ	蓝思科技	600741.SH	华域汽车	688063.SH	派能科技
002151.SZ	北斗星通	300438.SZ	鹏辉能源	600754.SH	锦江酒店	688072.SH	拓荆科技
002152.SZ	广电运通	300450.SZ	先导智能	600755.SH	厦门国贸	688099.SH	晶晨股份
002156.SZ	通富微电	300454.SZ	深信服	600760.SH	中航沈飞	688111.SH	金山办公
002176.SZ	江特电机	300457.SZ	赢合科技	600763.SH	通策医疗	688120.SH	华海清科
002179.SZ	中航光电	300459.SZ	汤姆猫	600765.SH	中航重机	688122.SH	西部超导
002180.SZ	纳思达	300474.SZ	景嘉微	600771.SH	广誉远	688126.SH	沪硅产业
002185.SZ	华天科技	300476.SZ	胜宏科技	600795.SH	国电电力	688169.SH	石头科技
002195.SZ	岩山科技	300496.SZ	中科创达	600803.SH	新奥股份	688180.SH	君实生物
002202.SZ	金风科技	300529.SZ	健帆生物	600820.SH	隧道股份	688188.SH	柏楚电子
002223.SZ	鱼跃医疗	300558.SZ	贝达药业	600839.SH	四川长虹	688223.SH	晶科能源
002230.SZ	科大讯飞	300567.SZ	精测电子	600845.SH	宝信软件	688235.SH	百济神州
002236.SZ	大华股份	300568.SZ	星源材质	600859.SH	王府井	688256.SH	寒武纪
002240.SZ	盛新锂能	300573.SZ	兴齐眼药	600862.SH	中航高科	688271.SH	联影医疗
002241.SZ	歌尔股份	300595.SZ	欧普康视	600867.SH	通化东宝	688303.SH	大全能源
002245.SZ	蔚蓝锂芯	300601.SZ	康泰生物	600879.SH	航天电子	688390.SH	固德威
002266.SZ	浙富控股	300604.SZ	长川科技	600885.SH	宏发股份	688396.SH	华润微
002268.SZ	电科网安	300627.SZ	华测导航	600886.SH	国投电力	688599.SH	天合光能
002271.SZ	东方雨虹	300628.SZ	亿联网络	600887.SH	伊利股份	688617.SH	惠泰医疗
002273.SZ	水晶光电	300661.SZ	圣邦股份	600893.SH	航发动力	688777.SH	中控技术
002281.SZ	光迅科技	300676.SZ	华大基因	600895.SH	张江高科	688981.SH	中芯国际
002292.SZ	奥飞娱乐	300699.SZ	光威复材	600900.SH	长江电力		
002294.SZ	信立泰	300724.SZ	捷佳伟创	600905.SH	三峡能源		
002318.SZ	久立特材	300750.SZ	宁德时代	600919.SH	江苏银行		
002340.SZ	格林美	300751.SZ	迈为股份	600938.SH	中国海油		
002352.SZ	顺丰控股	300759.SZ	康龙化成	600941.SH	中国移动		
002353.SZ	杰瑞股份	300760.SZ	迈瑞医疗	600988.SH	赤峰黄金		
002368.SZ	太极股份	300763.SZ	锦浪科技	600998.SH	九州通		
002371.SZ	北方华创	300782.SZ	卓胜微	601006.SH	大秦铁路		
002372.SZ	伟星新材	300832.SZ	新产业	601012.SH	隆基绿能		
002384.SZ	东山精密	300866.SZ	安克创新	601018.SH	宁波港		
002389.SZ	航天彩虹	300896.SZ	爱美客	601021.SH	春秋航空		
002405.SZ	四维图新	300919.SZ	中伟股份	601058.SH	赛轮轮胎		
002407.SZ	多氟多	300999.SZ	金龙鱼	601088.SH	中国神华		

002409.SZ	雅克科技	301236.SZ	软通动力	601100.SH	恒立液压		
002410.SZ	广联达	600000.SH	浦发银行	601111.SH	中国国航		
002414.SZ	高德红外	600004.SH	白云机场	601117.SH	中国化学		
002415.SZ	海康威视	600007.SH	中国国贸	601127.SH	赛力斯		
002422.SZ	科伦药业	600008.SH	首创环保	601155.SH	新城控股		
002432.SZ	九安医疗	600009.SH	上海机场	601166.SH	兴业银行		
002436.SZ	兴森科技	600010.SH	包钢股份	601168.SH	西部矿业		
002439.SZ	启明星辰	600011.SH	华能国际	601179.SH	中国西电		
002444.SZ	巨星科技	600018.SH	上港集团	601186.SH	中国铁建		
002456.SZ	欧菲光	600019.SH	宝钢股份	601216.SH	君正集团		
002459.SZ	晶澳科技	600026.SH	中远海能	601225.SH	陕西煤业		
002460.SZ	赣锋锂业	600027.SH	华电国际	601233.SH	桐昆股份		
002463.SZ	沪电股份	600028.SH	中国石化	601238.SH	广汽集团		
002465.SZ	海格通信	600029.SH	南方航空	601288.SH	农业银行		
002466.SZ	天齐锂业	600030.SH	中信证券	601318.SH	中国平安		

永赢基金管理有限公司

2025年1月3日