

上投摩根中证碳中和 60 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：上投摩根基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

二零二二年十一月三十日

重要提示

1、上投摩根中证碳中和 60 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 2022 年 10 月 24 日经中国证券监督管理委员会证监许可【2022】2567 号文注册。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作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金为交易型开放式、股票型指数证券投资基金。

3、本基金的基金管理人为上投摩根基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”），基金托管人为交通银行股份有限公司，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。

5、本基金基金份额初始面值为人民币 1.00 元，认购价格为 1.00 元。

6、本基金自 2022 年 12 月 12 日起至 2022 年 12 月 22 日止进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。其中，网上现金发售的日期为 2022 年 12 月 20 日至 2022 年 12 月 22 日，网下现金发售日期为 2022 年 12 月 12 日至 2022 年 12 月 22 日，网下股票发售的日期为 2022 年 12 月 12 日至 2022 年 12 月 22 日。具体业务办理时间遵循发售机构的相关规定。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本基金管理人将作出相应调整并及时公告。本基金管理人可根据认购的情况适当调整募集时间，但最长不超过法定募集期限，并予以公告。

7、本基金的网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

8、本基金的网下现金发售代理机构为：国泰君安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、长江证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

网下股票发售代理机构为：国泰君安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司。

9、投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或基金账户。

但需注意，使用上海证券交易所基金账户只能进行现金认购和二级市场交易，如投资者使用本基金标的指数成份股和已公告的备选成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或者基金的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者使用本基金标的指数成份股和已公告的备选成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

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。投资者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。

投资人应根据法律法规及证券交易所相关规定进行股票认购，并及时履行因股票认购导致的份额减持所涉信息披露等义务。

10、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规定费率结构收取一定的佣金。

11、募集规模上限

本基金首次募集规模上限为人民币 50 亿元（不含募集期利息和认购费用，下同）。

本基金网上现金认购和网下现金认购（以下简称“现金认购”）的合计首次募集规模上限为人民币 40 亿元（不含募集期利息和认购费用，下同）。

1)、现金认购采取“全程比例确认”的方式对上述规模限制进行控制。具体

处理方式如下：

(1) 募集结束后，若本基金募集期内的现金认购有效认购申请全部确认后不超过人民币 40 亿元，则投资者在募集期内提交的现金认购有效认购申请全部予以确认。

(2) 募集结束后，若本基金募集期内的现金认购有效认购申请全部确认后

超过人民币 40 亿元，将对募集期内的现金认购有效认购申请采用“全程比例确

认”的原则给予部分确认，未确认部分将在募集期结束后退还给投资者。
当发生

比例确认时，基金管理人将及时公告比例确认情况和结果。认购申请确认比例的

计算方法如下（不含募集期利息和认购费用）：

募集期有效认购申请确认比例=40 亿份/(募集期内有效网上现金认购份额+募集期内有效网下现金认购份额)。

网上现金认购和网下现金认购的投资者有效认购申请确认份额=投资者在募集期内提交的有效认购份额×募集期有效认购申请确认比例

(3) 当发生部分确认时，本基金登记结算机构按照募集期有效认购申请确认比例对募集期每笔现金认购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，最终确认的本基金的现金认购有效认购份额（不含募集期利息和认购费用）可能会略微高于或低于 40 亿份。最终投资者有效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。

2)、对于网下股票认购，募集结束后，基金管理人可以根据拟跟踪指数的基本情况、参与认购股票的流动性和数量、招募说明书的规定等多种因素拒绝全部或部分的认购申报。

12、投资者办理网上现金认购的，以基金份额申请。投资者应以上海证券账户认购，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。

投资者办理网下现金认购的，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。

投资者办理网下股票认购的，以单只股票股数申报，投资者应以 A 股账户认购。用以认购的股票必须是基金的标的指数成份股和已公告的备选成份股（具体名单以基金份额发售公告及后续相关公告为准）。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。

网上现金认购可多次申报，申报一经确认，认购资金即被冻结。网下股票认购申报一经确认，认购股票即被冻结。网下现金认购、网下股票认购申请提交后不得撤销。

投资者可以多次认购，在本基金首次募集规模上限内，单个投资者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。

13、基金份额发售机构（发售代理机构和/或直销机构）受理认购申请并不表示对该申请是否成功的确认，而仅代表销售网点确实收到了认购申请。申请是否有效应以登记机构或基金管理人的确认为准。投资者应及时在《上投摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（以下简称“《基金合同》”）生效后到其办理认购业务的销售网点查询认购确认情况，基金管理人及发售代理机构不承担对确认结果的通知义务。

14、本公告仅对本基金发售的有关事项和规定予以说明。投资人欲了解“上投摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金”的详细情况，请详细阅读刊登在本基金管理人官网（<https://www.cifm.com>）和中国证监会基金电子披露网站（<http://eid.csrc.gov.cn/fund>）上的《上投摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“《招募说明书》”）。

15、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，除本公告所列的发售代理机构外，如增加其他发售代理机构，本基金管理人将及时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，请拨打本基金管理人的客户服务电话（400 889 4888）咨询购买事宜。

18、本基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整。本基金管理人拥有对本基金份额发售公告的最终解释权。

19、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，指定交易未在申购赎回代理券商的投资人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。

20、风险提示

(1) 本基金标的指数为中证碳中和 60 指数，其从沪深市场中选取清洁能源与储能等深度低碳领域、火电等高碳减排领域的 60 只上市公司证券作为指数样本，以反映对碳中和贡献较大的上市公司证券的整体表现。

1) 样本空间:

同中证全指指数的样本空间

2) 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，选取深度低碳和高碳减排两大领域的上市公司证券作为待选样本：

?深度低碳领域：清洁能源与储能、绿色交通、减碳与固碳技术等；

?高碳减排领域：火电、钢铁、建材、有色金属、化工、建筑等；

②从深度低碳与高碳减排领域，按两者样本数 7:3 的比例，合计选取 60 只待选样本作为指数样本：

对于深度低碳领域的待选样本，按照过去一年日均总市值由高到低排名，选取排名靠前的 42 只证券作为指数样本；

对于高碳减排领域的待选样本，分别计算其在各细分领域内的过去一年日均总市值排名和中证碳减排评价分数排名，并以两者的算术平均作为综合排名，选取各细分领域内综合排名靠前的 3 只，合计 18 只证券作为指数样本。

3) 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 (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%。

有关标的指数具体编制方案及基本信息详见如下网址：

(2) 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，投资者在投资本基金前，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：管理风险与操作风险、技术风险、不可抗力、本基金的特定风险等等。本基金是跟踪中证碳中和 60 指数的交易型开放式基金，投资本基金可能遇到的特定风险包括：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风险、指数编制机构停止服务的风险、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、成份股停牌的风险、成份股退市的风险、退市风险、投资者申购失败的风险、投资者赎回失败的风险、退补现金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、投资资产支持证券、股指期货、股票期权的风险、参与融资及转融通证券出借业务的风险、投资于存托凭证的风险、流动性风险等。

本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

(3) 投资者在进行投资决策前，请仔细阅读本基金的《招募说明书》、基金产品资料概要及《基金合同》。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。销售机构根据法规要求对投资者类别、风险承受能力和基金的风险登记进行划分，并提出适当性匹配意见。投资者在投资基金前应认真阅读基金合同、招募说明书和基金产品资料概要等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。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，由投资者自行负责。

一、本次基金发售基本情况

（一）本基金的基本情况

基金名称：上投摩根中证碳中和 60 交易型开放式指数证券投资基金

基金简称：上投摩根中证碳中和 60ETF

认购代码：560963

证券代码：560960

场内简称：碳 60ETF

扩位简称：碳中和 60 指数 ETF

(二) 基金类别：股票型指数证券投资基金

(三) 基金运作方式：交易型开放式

(四) 存续期限：不定期

(五) 基金份额初始面值：每份基金份额初始面值为 1.00 元人民币

(六) 投资目标

本基金进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

(七) 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。

(八) 标的指数及业绩比较基准

本基金的标的指数为中证碳中和 60 指数。

本基金的业绩比较基准为标的指数，即中证碳中和 60 指数收益率。

(九) 基金份额发售机构

1、发售协调人

主协调人：光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：刘秋明

客服电话：95525

网址：www.ebscn.com

2、网下现金发售代理机构：

(1) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

客服电话：95521 或 400-8888-666

公司网址：www.gtja.com

(2) 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

客服电话：95575

公司网址：www.gf.com.cn

(3) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路111号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

公司网址：www.cmschina.com

(4) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101

办公地址：北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦

法定代表人：陈亮

客服电话：4008-888-888 或 95551

公司网址：www.chinastock.com.cn

(5) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路228号华泰证券广场

法定代表人：张伟

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(6) 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

客服电话：95548

公司网址：www.citics.com

(7) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座

法定代表人：冯恩新

客服电话：95548

公司网址：sd.citics.com

(8) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：李新华

客服电话：95579 或 4008-888-999

公司网址：www.95579.com

(9) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李峰

客服电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(10) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室 (部位：自编 01) ，
1001 室

办公地址：广州市天河区临江大道 395 号 901 室（部位：自编 01），
1001 室

法定代表人：胡伏云

客服电话：95548

公司网址：www.gzs.com.cn

3、通过基金管理人进行的网下现金认购暂未开通，如后续开通，基金管理人将另行公告，请投资者关注。

4、网下股票发售代理机构：

（1）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市静安区南京西路 768 号国泰君安大厦

法定代表人：贺青

客服电话：95521 或 400-8888-666

公司网址：www.gtja.com

(2) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区福田街道福华一路 111 号

法定代表人：霍达

客服电话：95565

公司网址：www.cmschina.com

(3) 华泰证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市建邺区江东中路 228 号华泰证券广场

法定代表人：张伟

客服电话：95597

公司网址：www.htsc.com.cn

(4) 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

客服电话：95548

公司网址：www.citics.com

(5) 中信证券（山东）有限责任公司

注册地址：山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址：青岛市市南区东海西路 28 号龙翔广场东座

法定代表人：冯恩新

客服电话：95548

公司网址：sd.citics.com

(6) 中泰证券股份有限公司

注册地址：济南市市中区经七路 86 号

办公地址：上海市花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 18 层

法定代表人：李峰

客服电话：95538

公司网址：www.zts.com.cn

(7) 中信证券华南股份有限公司

注册地址：广州市天河区临江大道395号901室（部位：自编01），
1001室

办公地址：广州市天河区临江大道395号901室（部位：自编01），
1001室

法定代表人：胡伏云

客服电话：95548

公司网址：www.gzs.com.cn

5、网上现金发售代理机构

网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司办理。

6、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的代理机构，并在基金管理人网站公示。

7、发售时间安排与基金合同生效

本基金自 2022 年 12 月 12 日至 2022 年 12 月 22 日止进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。其中，网上现金发售的日期为 2022 年 12 月 20 日至 2022 年 12 月 22 日，网下现金发售日期为 2022 年 12 月 12 日至 2022 年 12 月 22 日，网下股票发售的日期为 2022 年 12 月 12 日至 2022 年 12 月 22 日。具体业务办理时间遵循发售机构的相关规定。如上海证券交易所对网上现金认购时间作出调整，本基金管理人将作出相应调整并及时公告。本基金管理人可根据认购的情况适当调整募集时间，但最长不超过法定募集期限，并予以公告。

基金募集期满，本基金符合法律法规规定的基金合同生效条件的，基金管理人应按照规定在办理基金验资和备案手续后公告本基金合同生效。基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

如果在发售期间未达到《招募说明书》规定的基金备案条件，基金可在募集期限内继续销售，直到达到基金备案条件。若三个月的募集期满，本基金仍未达到基金备案条件，基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担，将已募集资金加计银行同期活期存款利息，在募集期结束后 30 日内退还给认购人。

(十) 募集期间认购资金利息及股票收益的处理方式

网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记结算机构清算交收后至划入基金托管专户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资者基金份额；投资者以股票认购的，认购股票由登记机构予以冻结，冻结期间的权益归投资者所有。

二、认购方式与相关规定

（一）认购方式

投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购 3 种方式。

网上现金认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构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者通过基金管理人指定的发售代理机构以现金进行的认购。通过基金管理人进行的网下现金认购暂未开通，如后续开通，基金管理人将另行公告，请投资者关注。

网下股票认购是指投资者通过基金管理人指定的发售代理机构以股票进行的认购。

（二）认购费用

认购费用或认购佣金由认购基金份额的投资人承担，主要用于基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用，不列入基金资产。

认购费率如下表所示：

- 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。
现暂未开通，如后续开通，基金管理人将另行公告，请投资者关注。
- 2、通过发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购时可参照上述费率结构，按照不高于 0.5% 的标准收取一定的佣金。
- 3、投资者申请重复现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

(三) 基金的认购

1、网上现金认购

本基金认购佣金、认购金额的计算如下：

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

(或若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用)

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

(或若适用固定费用的, 认购佣金 = 固定费用) 净认购金额 = 认购价格 × 认购份额

认购佣金由发售代理机构收取, 投资者需以现金方式交纳认购佣金。

例一: 某投资者到某发售代理机构网点认购 10,000 份本基金份额, 假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.5%, 则需准备的资金金额计算如下:

认购佣金 = $10,000 \times 1.00 \times 0.5\% = 50$ 元

认购金额 = $10,000 \times 1.00 \times (1 + 0.5\%) = 10,050$ 元

即投资者需准备 10,050 元资金, 方可认购到 10,000 份本基金基金份额。

2、网下现金认购

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

3、网下股票认购

通过发售代理机构进行网下股票认购的投资者，认购以单只股票股数申请，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费用/佣金。认购份额和认购费用/佣金的计算公式为：

(1) 如投资人选择以现金支付认购费用/佣金则其可得到的基金份额和需支付的认购费用/佣金如下：

$$\text{认购费用/佣金} = \text{认购份额} \times \text{基金份额面值} \times \text{认购费率或佣金比率}$$

(“网下股票认购期最后一日的均价、有效认购数量”由基金管理人确认，具体规定见相关公告。)

(2) 如投资人选择以基金份额的方式交纳认购费用/佣金则其可得到的基金份额和需支付的认购费用/佣金如下：

$$\begin{aligned} \text{认购费用/佣金} &= \text{基金份额面值} \times \text{认购份额} / (1 + \text{认购费率或佣金比率}) \\ &\times \text{认购费率或佣金比率} \end{aligned}$$

$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购费用或佣金} / \text{基金份额面值}$$

（“网下股票认购期最后一日的均价、有效认购数量”由基金管理人确认，具体规定见相关公告。）

认购费用/佣金小数点后舍去。

例三：某投资者持有中证碳中和 60 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 25.50 元和 6.50 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例为 0.5%，则其可得到的基金份额和需支付的认购佣金如下：

$$\text{认购份额} = (10,000 \times 25.50) \div 1.00 + (20,000 \times 6.50) \div 1.00 = 385,000 \text{ 份}$$
$$\text{认购佣金} = 1 \times 385,000 \times 0.5\% = 1,925 \text{ 元}$$

即投资者可认购到 385,000 份本基金基金份额，并需另行支付 1,925 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为：

认购份额 = $(10,000 \times 25.50) \div 1.00 + (20,000 \times 6.50) \div 1.00 =$
385,000 份

认购佣金 = $1.00 \times 385,000 \div (1 + 0.5\%) \times 0.5\% = 1,915$ 元

净认购份额 = $385,000 - 1,915.00 \div 1.00 = 383,085$ 份

三、投资人开户须知

投资人认购本基金时需具有上海证券交易所 A 股账户或基金账户（以下统称证券账户）。

1、如投资人需新开立证券账户，则应注意：

① 基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易，如投资人需要使用中证碳中和 60 指数成份股和已公告的备选成份股中的上海证券交易所上市股票参与网下股票认购或基金份额的申购、赎回，则应开立上海证券交易所 A 股账户；如投资者需要使用中证碳中和 60 指数成份股和已公告的备选成份股中的深圳证券交易所上市股票参与网下股票认购，则还应开立深圳证券交易所 A 股账户。

② 开户当日无法办理指定交易，建议投资人在进行认购前至少 2 个工作日办理开户手续。

2、如投资人已开立证券账户，则应注意：

① 如投资人未办理指定交易或指定交易在不办理本基金发售业务的证券公司，需要指定交易或转指定交易在可办理本基金发售业务的证券公司。

② 当日办理指定交易或转指定交易的投资人当日无法进行认购，建议投资人在进行认购的 1 个工作日前办理指定交易或转指定交易手续。

3、使用专用席位的机构投资者则无需办理指定交易。

四、本基金的认购程序

（一）网上现金认购程序

1、业务办理时间：2022 年 12 月 20 日至 2022 年 12 月 22 日上午 9：30-11：30 和下午 1：00-3：00。

2、认购手续：

（1）开立上海证券交易所 A 股账户或基金账户，办理指定交易在发售代理机构利用上海证券交易所网上系统以现金进行的认购。

（2）在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

(3) 投资人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。

(二) 网下现金认购程序

通过发售代理机构的网下现金认购程序

1) 业务办理时间：2022 年 12 月 12 日至 2022 年 12 月 22 日，具体时间以各发售代理机构的规定为准。

2) 认购手续：

a. 开立上海证券交易所 A 股账户或基金账户，办理指定交易或转指定交易。

b. 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。

c. 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下现金认购的委托申请书。申报一经确认，认购资金即被冻结。

(三) 网下股票认购程序

通过发售代理机构的网下股票认购程序：

(1) 业务办理时间：2022 年 12 月 12 日至 2022 年 12 月 22 日，具体时间以各发售代理机构的规定为准。

(2) 认购手续

1) 如投资人以中证碳中和 60 指数成份股中的上海证券交易所上市股票认购本基金，需开立上海证券交易所 A 股账户，办理指定交易或转指定交易。使用专用席位的机构投资者则无需办理指定交易。

2) 如投资人以中证碳中和 60 指数成份股中的深圳证券交易所上市股票认购本基金，需开立上海证券交易所 A 股账户或基金账户，以及深圳证券交易所 A 股账户。

3) 在 A 股账户中具备足够的符合要求的中证碳中和 60 指数成份股和已公告的备选成份股。

4) 投资者填写认购委托单。申报一经确认，认购股票即被冻结。

特别提示：

1) 投资者应根据法律法规及上海证券交易所及深圳证券交易所相关交易规则的规定，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等义务。

2) 本基金募集期间，对于在网下股票认购期间价格波动异常或认购申报数量异常的个股，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。

3) 网下股票认购以单只股票股数申报，用以认购的股票必须是中证碳中和 60 指数成份股和已公告的备选成份股。单只股票最低认购申报股数为 1000 股，超过 1000 股的部分须为 100 股的整数倍。投资人可以多次提交认购申请。如网下股票认购期间全部投资人对单只股票累计申报数量合计超过该只股票在中证碳中和 60 指数中权重占比的，基金管理人有权全部或部分拒绝该股票的认购申报。

4) 我司将不接受中证碳中和 60 指数成分股涉及上海证券交易所和深圳证券交易所上市的上市公司董事、监事、高级管理人员、大股东和特定股东参与本基金的网下股票认购。

五、清算与交割

(一) 基金募集期间募集的资金存入专门账户，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。募集的股票按照交易所和登记机构的规则和流程予以冻结，该股票自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认购投资人所有。

(二) 网上现金认购和通过发售代理机构进行网下现金认购的有效认购资金在登记机构清算交收后至划入基金托管账户前产生的利息，计入基金财产，不折算为投资人基金份额。

(三) T 日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，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人于网上现金认购结束后的第 4 个工作日内将实际到位的认购资金划往其预先开设的基金募集专户。

(四) T 日通过发售代理机构提交的网下现金认购申请，由该发售代理机构冻结相应的认购资金。在网下现金认购的最后一个工作日，各发售代理机构将每一个投资者账户提交的网下现金认购申请汇总后，通过上海证券交易所上网定价发行系统代该投资者提交网上现金认购申请。之后，登记机构进行清算交收，并将有效认购数据发送发售协调人，发售协调人将实际到位的认购资金划往预先开设的基金募集专户。

(五) 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过户至中国证券登记结算有限公司深圳分公司的证券认购专户。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认购佣金，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，并根据基金管理人提供的有效认购申请股票数据，按照交易所和登记机构的规则和流程，将投资者申请认购的股票过户到本基金的证券账户。

六、基金的验资与基金合同生效

基金募集期限届满，本基金具备基金备案条件的，基金管理人应当自募集期限届满之日起 10 日内聘请符合《中华人民共和国证券法》规定的会计师事务所进行验资，自收到验资报告之日起 10 日内，向中国证监会提交验资报告，办理基金备案手续。自中国证监会书面确认之日起，基金备案手续办理完毕，基金合同生效。基金管理人应当在收到中国证监会确认文件的次日予以公告。

基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用，不得从基金财产中列支。

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，登记机构应予以解冻，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；

3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及销售机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和销售机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

七、本次发售当事人或中介机构

(一) 基金管理人

名称：上投摩根基金管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

办公地址：中国（上海）自由贸易试验区富城路 99 号震旦国际大楼 25 层

法定代表人：陈兵

总经理：王大智

成立日期：2004 年 5 月 12 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基字[2004]56 号

经营范围：基金管理业务、发起设立基金以及经中国证监会批准的其他业务。

组织形式：有限责任公司

实缴注册资本：25000 万元

存续期间：持续经营

公司网址：www.cifm.com

(二) 基金托管人

名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

住所：中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号（邮政编码：200120）

办公地址：上海市长宁区仙霞路 18 号（邮政编码：200336）

法定代表人：任德奇

成立时间：1987 年 3 月 30 日

批准设立机关及批准设立文号：国务院国发(1986)字第 81 号文和中国人民银行银发 [1987] 40 号文

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字 [1998] 25 号

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期和长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑与贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项业务；提供保管箱服务；经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务；经营结汇、售汇业务。

注册资本：742.63 亿元人民币

组织形式：股份有限公司

存续期间：持续经营

（三）销售机构

1、网下现金发售代理机构国泰君安证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、长江证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司和网下股票发售代理机构国泰君安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中信证券（山东）有限责任公司、中泰证券股份有限公司、中信证券华南股份有限公司代理销售本基金，代销机构的具体信息请参见本发售公告第一部分“本次基金发售基本情况”的“（九）基金份额发售机构”。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其它符合要求的代理机构，并在基金管理人网站公示。

2、网上现金发售代理机构为具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司。

(四) 登记结算机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：于文强

联系人：顾俊峰

电话：(021) 68870184

传真：(021) 68870311

(五) 律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

联系电话：021-5115 0298

传真：021-5115 0398

经办律师：刘佳、姜亚萍

(六) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦
507 单元 01 室

办公地址：中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：金诗涛

经办注册会计师：陈熹、金诗涛

投资者可通过上投摩根基金管理有限公司提供的以下途径咨询有关情况：

客户服务电话：400-889-4888

网址：<https://www.cifm.com>

附件：

一、网下股票认购清单

上投摩根基金管理有限公司

2022年11月30日