

摩根沪深300自由现金流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：摩根基金管理(中国)有限公司
基金托管人：中国光大银行股份有限公司
二零二五年三月二十六日

重要提示

1. 摩根沪深300自由现金流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2025年3月7日经中国证券监督管理委员会证监许可[2025]428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基金投资价值或收益做出任何判断、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摩根基金管理(中国)有限公司(以下简称“基金管理人”),基金托管人为中国光大银行股份有限公司,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和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发售面值为人民币1.00元,认购价格为1.00元。
6. 本基金自2025年4月7日至2025年4月18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,办理网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购的日期均为2025年4月7日至2025年4月18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,基金管理人将作出相应调整并及时公告。如上海证券交易所对网下股票认购的时间进行调整,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依法调整认购时间,但最长不得超过发售期,并予以公告。
7. 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使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及其指定的发售代理机构以现金进行的认购;网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。
8. 投资者认购本基金时必须具有证券账户,证券账户是指上海证券交易所A股账户或基金账户。上海证券交易所基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易。如投资者需要使用沪深300自由现金流指数成份股在上海证券交易所上市股票参与网下股票认购基金申购,申购前应在上海证券交易所A股账户;如投资者需要使用沪深300自由现金流指数成份股中的深圳证券交易所以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。
9. 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。投资者认购时还应遵守销售机构有关认购的相关要求,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。
10. 募集规模上限
本基金首次募集规模上限为人民币80亿元(不含募集期利息和认购费用,下同)。本基金募集过程中募集规模超过80亿元人民币时,基金提前结束募集。在募集期结束后,若认购累计有效申购份额总额超过80亿份(折合金额80亿元人民币),基金管理人将采取全额比例确认的方式进行规模的有效控制。当发生比例确认时,基金管理人将及时公告比例确认情况与结果。未确认部分的比例确认原则为:按照时间优先的原则,由产生的原由投资人自行承担。认购申请确认比例的计算方法如下:认购申请确认比例=80亿份有效认购申购份额/投资者认购申购确认比例=提交的认购申请确认比例/认购申请确认比例
“有效认购申购份额”是指投资者认购申购确认份额中不包含募集期利息和认购费用。
当认购发生部分确认时,认购申请确认比例不受认购最低限额的限制,将按照认购申请确认比例对每笔有效认购申购份额进行部分确认处理,因对每笔认购申购处理精度等原因,最终确认的累计有效认购份额(不包括募集期利息和认购费用)可能会略超过80亿份。最终认购申请确认比例以本基金登记结算机构的确认数据为准。
11. 网上现金认购以基金份额为上限,单一账户网上现金认购申请确认份额为1000份或其整数倍,最高不得超过99,999,000份。投资者可多次认购,累计认购份额不设上限。
网下现金认购以基金份额申请。投资者通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额为1000份或其整数倍;投资者通过基金管理人办理网下现金认购的,每笔认购份额须在1000份以上(含1000份),投资者可多次认购,累计认购不设上限。
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沪深300自由现金流指数的成份股和已经公告的备选成份股。单只股票股票认购申报股数为1000股,超过1000股的部分须为100股的整数倍。投资者可多次申报,申报一经确认,认购申请即被冻结。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如能撤销以销售机构的约定为准。
12. 基金份额发售机构(销售机构)受理认购申请并不代表申请一定成功,而仅代表发售机构收到认购申请,认购的确认以基金管理人的确认结果为准。对于认购申请和认购份额的确认情况,投资者可以查询并妥善行使合法权利。
13. 本公告对本基金发售的有关事项和程序予以说明。投资者欲了解“摩根沪深300自由现金流交易型开放式指数证券投资基金”相关情况,请阅读法律法规及基金管理人官网(www.jm.com.cn)和中国证监会基金电子披露网站(<http://ediscr.gov.cn/fund>)上的《摩根沪深300自由现金流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”)。
14. 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。
15. 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本基金管理人网站公示。
16. 对未开通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。
17. 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。
18. 本基金募集期结束后,基金管理人确定本基金的申购赎回代理券商名单,并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。
19. 本基金标的指数为沪深300自由现金流指数。

- (1) 样本空间
沪深300指数样本。
- (2) 选择方法
1) 从样本空间中选取同时满足以下条件的上市公司证券作为待选样本:
① 按照中国一级行业分类,不属于金融及房地产行业;
② 非由现金流和无形资产构成,且由自由现金流和经营活动产生的现金流量净额、过去一年购建固定资产、无形资产和其他长期资产支付的现金、企业价值=公司总市值+总负债-货币资金;
③ 连续5年经营活动产生的现金流量净额为正;
④ 盈利质量由高到低排序位于样本空间前80%,其中盈利质量=(过去一年经营活动产生的现金流量净额/过去一年净利润)×100%。
2) 将待选样本按照自由现金流率由高到低排序,选取排名前50的证券作为指数样本,其中自由现金流率=自由现金流/企业价值。
- (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=∑(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,以使指数样本采用自由现金流加权,单个样本权重不超过10%。
有关标的指数的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:www.csindex.com.cn。
20. 风险提示
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种风险,包括:投资于本基金标的指数、市场风险、流动性风险、其他风险等。本基金跟踪沪深300自由现金流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的跟踪偏离风险、跟踪误差控制未达约定目标的风险、指数编制机构停止服务风险、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、退休金替代方式的风险、基金份额赎回对价的变现风险、第三方机构服务的风险、交易结算模式风险、股指期货投资的风险、股指期货合约展期风险、参与融资融券业务的风险、投资于存托凭证的风险、基金合同提前终止的风险、基金管理人职责终止风险等。
本基金可参与股指期货投资,存在因投资股指期货而带来的风险,包括市场风险、市场流动性风险、跟踪偏离性风险、基差风险、信用风险、作业风险等。
本基金可参与融资融券业务,存在因融资融券而带来的风险,包括市场风险、流动性风险、保证金风险、基差风险、信用风险、操作风险等。
本基金可根据法律法规的规定参与融资,可能存在杠杆风险和对手方交易风险等融资业务特有风险。
本基金可以参与转融通证券出借业务,可能面临因此带来的流动性风险、信用风险及市场风险等投资风险。
本基金可以参与存托凭证的投资,除与其他投资于境内市场股票的基金所面临的共同风险外,本基金还将面临中国存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与中国存托凭证发行机制相关的风险。
本基金基金合同生效后,如连续50个工作日出现基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元情形的,基金合同终止,且不再召开基金份额持有人大会。故基金份额持有人可能面临基金合同提前终止的风险。
本基金为股票型指数基金,其短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。本基金主要采用完全复制跟踪标的指数的表现,具有与标的指数相似的风险收益特征。
完整的风险提示内容请查阅本基金的《招募说明书》“风险揭示”章节。

- 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。销售机构根据定期报告对投资者适当性风险承受能力与基金的风险等级进行划分,并据此提出适当性匹配意见。投资者在投资本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,全面了解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、投资期限和资金状况,对基金做出自主投资决策,选择合适基金产品。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,由投资者自行承担。
- 一、本次基金发售基本情况
(一) 本基金的基本情况
基金名称:摩根沪深300自由现金流交易型开放式指数证券投资基金
基金简称:摩根沪深300自由现金流ETF
认购代码:563093
证券代码:563900
证券简称:现金流
扩认购代码:沪深300自由现金流ETF 摩根
(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。
(七) 业绩比较基准
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和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沪深300自由现金流指数。
本基金的业绩比较基准为标的指数的指数,即沪深300自由现金流指数收益率。
(九) 基金份额发售机构
1. 发售机构
主承销人:东方证券股份有限公司
注册地址:上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦
办公地址:上海市黄浦区中山南路119号东方证券大厦
法定代表人:陈耀庭
客服电话:95503
公司网址:www.dfq.com.cn
2. 网下现金发售及网下股票发售直销机构:
名称:摩根基金管理(中国)有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层
法定代表人:王培慧

总经理:王琼慧
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]156号
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。
组织形式:有限责任公司
实缴资本:25000万元
存续期间:持续经营
公司网址:am.jmorgon.com.cn
3. 网上现金发售代理机构
详见本公告“七、本次发售当事人或中介机构”
4. 网下股票发售代理机构
详见本公告“七、本次发售当事人或中介机构”
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
自2025年4月7日至2025年4月18日,本基金向个人投资者、机构投资者、合格境外投资者同时发售。其中,办理网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购的日期均为2025年4月7日至2025年4月18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。

(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使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及其指定的发售代理机构以现金进行的认购;网下股票认购是指投资者通过基金管理人及其指定的发售代理机构以股票进行的认购。
(二)认购费用
本基金的认购采用“份额认购”的原则。投资者在一天之内如果有多笔认购,适用费率按单笔分别计算。

认购份额区间	费率
50万份以下	0.8%
50万份以上(含),100万份以下	0.5%
100万份以上(含)	每笔人民币1,000元

基金管理人办理网下现金认购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,按照不超过0.8%的标准收取一定的佣金。
本基金的认购费用不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等基金募集发生的各项费用。

(三)基金的认购
1. 网上现金认购
本基金认购金额、认购份数的计算如下:
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=认购金额-认购佣金
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0.8%,则需准备的资金金额计算如下:
认购金额=10,000×1.000×0.8%=80元
认购金额=10,000×1.000×(1+0.8%)=10,080元
即投资者需准备10,080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
(1)通过基金管理人进行网下现金认购的认购金额和利息折算的份额的计算:
通过基金管理人进行网下现金认购的投资者,认购以基金份额申请,认购费用、认购金额的计算公式为:
认购费用=认购份额×认购价格×认购费率
(或若适用固定费用的,认购费用=固定费用)
认购金额=认购份额×认购价格×(1+认购费率)
(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)
利息折算的份额=认购金额产生的利息/认购价格(保留至整数位)
总认购份额=认购份额+利息折算的份额

其中:认购费用由基金管理人在投资人认购确认时收取,投资人须以现金方式交纳认购费用。认购金额、认购费用的计算保留到小数点后2位,小数点2位以后的部分四舍五入,由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。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:某投资者在本公司直销网点认购300,000份基金份额,假定认购金额产生的利息为30元,则需准备的资金金额计算如下:
认购费用=300,000×1.000×0.8%=2,400.00元
认购金额=300,000×1.000×(1+0.8%)=302,400.00元
利息折算的份额=30/1.000=30份(保留至整数位)
该投资者所得基金份额为:
总认购份额=300,000+30=300,030份

即,若该投资者通过基金管理人认购本基金300,000份,则该投资者的认购金额为302,400.00元,其中认购费用2,400.00元,并可获得利息转换的份额30份,则可得300,030份基金份额。
(2)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:
$$\text{认购份额} = \frac{n}{\sum_{i=1}^n \text{P}_i} \text{ (第 } i \text{ 只股票在网下股票认购期最后一日的均价} \times \text{有效认购数量)} / \text{基金份额面值}$$
$$\text{认购费用/佣金} = \text{认购份额} \times \text{基金份额面值} \times \text{认购费率或佣金比率}$$

(“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:
$$\text{认购份额} = \frac{n}{\sum_{i=1}^n \text{P}_i} \text{ (第 } i \text{ 只股票在网下股票认购期最后一日的均价} \times \text{有效认购数量)} / \text{基金份额面值}$$
$$\text{认购费用/佣金} = \text{基金份额面值} \times \text{认购份额} \times (1 + \text{认购费率或佣金比率}) \times \text{认购费率或佣金比率}$$
$$\text{净认购份额} = \text{认购份额} - \text{认购费用或佣金} / \text{基金份额面值}$$

(“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/佣金保留到整数位,小数点后舍去。
通过发售代理机构进行网下股票认购,不收取认购费用。
例三:某投资者持有沪深300自由现金流指数成份股中股票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费用。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率为0.8%,则其可得到的基金份额和需支付的认购费用如下:
认购金额=(10,000×25.50+1.00×(20,000×6.50))×1.00=385,000份
认购佣金=1×385,000×0.8%=3,080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3,080元的认购费用。

例四:续例三,假设该投资者选择以基金份额的方式支付认购费用,则投资者最终可得净认购份额为:
认购份额=(10,000×25.50+1.00×(20,000×6.50))×1.00=385,000份
认购佣金=1.00×385,000×(1+0.8%)×0.8%=3,055元
净认购份额=385,000-3,055.00÷1.00=381,945份

三、投资者开户须知
投资者认购本基金时需具有证券账户,证券账户是指上海证券交易所A股账户或基金账户。
(1) 如投资者需新开立证券账户,则应注意:
① 上海证券交易所基金账户只能进行基金份额的现金认购和二级市场交易;如投资者需要使用沪深300自由现金流指数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;如投资者需要使用沪深300自由现金流指数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,建议投资者在进行认购前至少2个工作日办理开户手续。
(2) 如投资者已开立证券账户,则应注意:
① 如投资者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者当日无法进行认购,建议投资者在进行认购的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:2025年4月7日至2025年4月18日上午9:30-11:30和下午1:00-3:00(周六、日及其他法定节假日不受理)。
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。

(二)网下现金认购程序
1. 通过基金管理人进行网下现金认购程序
(1) 业务办理时间:
基金发售日的8:30~16:00。发售日每天16:00后、周六、日及其他法定节假日不受理客户的开户申请。
基金发售日的8:30~17:00。发售日每天17:00后、周六、日及其他法定节假日不受理客户的认购申请。
(2) 投资者在本公司直销柜台办理网下现金认购须提供下列资料:
个人投资者办理基金账户开户申请时须提交下列材料:
1) 有效身份证件复印件
2) 指定银行收款账户证明
3) 印章卡
4) 《账户开户申请表》
5) 《普通专业投资者告知书及投资者确认函》
6) 《投资者风险测评问卷》(普通投资者填写)
7) 专业投资者资格证明材料(如需)
8) 《个人税收居民身份声明》
9) 港澳台人士及外籍人士投资资格证明材料(如需),包括境内居住证明和收入证明。

个人投资者开立基金账户必须本人亲自办理;委托他人代办的,还需提供经公证的委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件。

个人投资者办理认购申请时须提交下列材料:

- ◇《ETF认购业务申请表》
- ◇《摩根基金管理(中国)有限公司交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》
- ◇《风险不匹配警示函及投资者确认书》(如需)
- 委托他人代办的,还需提供委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件。
- 机构客户办理基金交易账户和基金账户开户申请时须提交下列材料:
- 1)机构有效身份证明文件复印件;
- 2)金融机构资格证明复印件(如需);
- 3)产品备案/批复材料(如需);
- 4)《账户开户/销户申请表》;
- 5)《账户类业务授权委托书》(机构客户);
- 6)银行开户证明文件复印件;
- 7)法人、授权代表、账户类经办人、账单收件人、预留交易印鉴授权人的身份证件复印件;
- 8)《印鉴卡》;
- 9)《投资者风险测评问卷》(普通投资者填写);
- 10)《普通/专业投资者告知书及投资者确认函》;
- 11)《控制人税收居民身份声明》(如需);
- 12)《机构税收居民身份声明》(如需);
- 13)《非自然人客户受益所有人信息登记表》及相关受益所有人证明材料;
- 14)专业投资者资格认定材料(如需)。

机构投资者认购基金的申请,应当提供下列材料:

- ◇《ETF认购业务申请表》
- ◇《摩根基金管理(中国)有限公司交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》;
- ◇《风险不匹配警示函及投资者确认书》(如需);
- ◇本公司要求的其他交易相关材料;

认购资金的划拨:

投资者办理认购应将足额资金通过银行汇入下列任一银行账户,资金应包含认购金额以及对应的认购费用:

户名	摩根基金管理(中国)有限公司直销专户
账号	31001550400050002872
开户银行	中国建设银行上海市分行营业部
人民币大额支付系统联行号	105290036005
户名	摩根基金管理(中国)有限公司
账号	100119072901331315
开户银行	中国工商银行上海市分行第二营业部
人民币大额支付系统联行号	102290019077
户名	摩根基金管理(中国)有限公司
账号	216089238510001
开户银行	招商银行上海分行营业部
人民币大额支付系统联行号	308290003020

2.通过发售代理机构的网下现金认购程序

1)业务办理时间:2025年4月7日至2025年4月18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. 投资者填写认购委托单,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。

(二)网下股票认购程序

1.通过管理人进行网下股票认购程序

(1)基金发售日的8:30~16:00,发售日每天16:00后、周六、日及其他法定节假日不受理客户的开户申请。

基金发售日的8:30~17:00,发售日每天17:00后、周六、日及其他法定节假日不受理客户的认购申请。

(2)投资者在本公司直销柜台办理网下股票认购须提供下列资料:

个人投资者办理基金账户开户申请时须提交下列材料:

- 1)有效身份证明文件原件
- 2)指定银行收款账户证明
- 3)印鉴卡
- 4)《账户开户申请表》
- 5)《普通/专业投资者告知书及投资者确认函》
- 6)《投资者风险测评问卷》(普通投资者填写)
- 7)专业投资者资格证明材料(如需)
- 8)《个人税收居民身份声明》
- 9)港澳台人士及外籍人士投资资格证明材料(如需),包括境内居住证明和收入证明。

个人投资者开立基金账户必须本人亲自办理;委托他人代办的,还需提供经公证的委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件。

个人投资者办理认购申请时须提交下列材料:

- ◇《ETF认购业务申请表》
- ◇《摩根基金管理(中国)有限公司交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》
- ◇《风险不匹配警示函及投资者确认书》(如需)
- 委托他人代办的,还需提供委托代办书、代办人的有效身份证明文件及复印件。
- 机构客户办理基金交易账户和基金账户开户申请时须提交下列材料:
- 1)机构有效身份证明文件复印件;
- 2)金融机构资格证明复印件(如需);
- 3)产品备案/批复材料(如需);
- 4)《账户开户/销户申请表》;
- 5)《账户类业务授权委托书》(机构客户);
- 6)银行开户证明文件复印件;
- 7)法人、授权代表、账户类经办人、账单收件人、预留交易印鉴授权人的身份证件复印件;
- 8)《印鉴卡》;
- 9)《投资者风险测评问卷》(普通投资者填写);
- 10)《普通/专业投资者告知书及投资者确认函》;
- 11)《控制人税收居民身份声明》(如需);
- 12)《机构税收居民身份声明》(如需);
- 13)《非自然人客户受益所有人信息登记表》及相关受益所有人证明材料;
- 14)专业投资者资格认定材料(如需)。

机构投资者认购基金的申请,应当提供下列材料:

- ◇《ETF认购业务申请表》
- ◇《摩根基金管理(中国)有限公司交易型开放式指数证券投资基金风险揭示书》;
- ◇《风险不匹配警示函及投资者确认书》(如需);
- ◇本公司要求的其他交易相关材料;

2.通过发售代理机构的网下股票认购程序:

(1)业务办理时间:2025年4月7日至2025年4月18日,具体时间以各发售代理机构的规定为准。

(2)认购手续:

投资者在认购本基金时,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如需撤销以销售机构的规定为准。

特别提示:

- 1) 已经公告的即将被调出沪深300自由现金流指数的成份股不得用于认购本基金。
- 2) 限制个股认购规模:基金管理人可根据网下股票认购日前3个月的个股的交易量、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至少3个工作日公告限制认购规模的个股名单。
- 3) 临时拒绝个股认购: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。
- 4) 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义务。

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。网下股票认购所募集的股票由登记机构予以冻结,冻结期间的股票权益及股息归属按照相关业务规则处理。

(二)网下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,不折算为投资者基金份额。

(三)通过基金管理人进行网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息,将折算为基金份额归投资者所有,其中利息转份额以基金管理人的记录为准。

(四)投资者进行网下股票认购的,认购股票按照交易所和登记机构的规则和流程办理股票的冻结与过户,该股票自认购日至登记机构进行股票过户日的冻结期间所产生的权益归认购投资人本人所有。

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。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;基金管理人应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(税后);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:摩根基金管理(中国)有限公司

注册地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层
办公地址:中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路479号42层和43层
法定代表人:王璟慧
总经理:王璟慧
成立日期:2004年5月12日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字[2004]56号
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。组织形式:有限责任公司
实缴注册资本:贰亿伍仟万元人民币
存续期间:持续经营
公司网址:am.jpmorgan.com/cn

(一)基金托管人
名称:中国光大银行股份有限公司
住所:北京市西城区太平桥大街25号、甲25号中国光大中心
邮政编码:100033
法定代表人:吴利军
成立日期:1992年6月18日
批准设立机关及批准设立文号:国务院、国函[1992]7号
组织形式:股份有限公司
注册资本:590.85551亿元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:证监基金字[2002]75号

(二)销售机构
1.网下现金及网下股票发售直销机构
摩根基金管理(中国)有限公司
2.网下现金发售代理机构
1)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
2)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
3)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
4)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址: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:肖海峰
客服电话:95548
公司网址:sd.citics.com
5)长江证券股份有限公司
注册地址:湖北省武汉市江汉区淮海路88号
办公地址:湖北省武汉市江汉区淮海路88号
法定代表人:刘正斌
客服电话:95579或4008-888-999
公司网址:www.95579.com
6)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(部位:自编01)
法定代表人:陈可
客服电话:95548
公司网址:www.gzsc.com.cn

3.网下股票发售代理机构
1)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
2)中信证券(山东)有限责任公司
注册地址: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:肖海峰
客服电话:95548
公司网址:sd.citics.com
3)国投证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦
办公地址:深圳市福田区福田街道福华一路119号安信金融大厦
法定代表人:段文秀
客服电话:95517
公司网址:www.essence.com.cn
4)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(部位:自编01)
法定代表人:陈可
客服电话:95548
公司网址:www.gzsc.com.cn
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。
4.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:上海市浦东新区浦东南路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(募集验资)
名称:安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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:毛敬宁
电话:010-58153000
传真:010-58188298
联系人:许培菁
经办注册会计师:许培菁、张亚旋
投资者可通过摩根基金管理(中国)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:am.jpmorgan.com/cn
附件:
一、网下股票认购清单

摩根基金管理(中国)有限公司
2025年3月26日

附件一
基金募集期间网下股票认购清单如下表所示。已公告的将被调出标的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。根据法律法规本基金不得持有的标的指数成份股,将不能用于认购本基金。为保护投
资人利益,基金管理人可根据实际认购情况,全部或部分拒绝成份股的认购申报。如遇基金标的指数
成分股调整,则最终确认可接受股票认购的清单以最终调整公告的成分股清单为准。

网下股票认购清单

证券代码 Code	证券中文简称 Stock Name	证券代码 Code	证券中文简称 Stock Name	证券代码 Code	证券中文简称 Stock Name
000063	中兴通讯	002311	海大集团	600887	伊利股份
000333	美的集团	002352	顺丰控股	600900	长江电力
000338	潍柴动力	002422	科伦药业	600938	中国海油
000538	云南白药	002714	牧原股份	600941	中国移动
000661	长春高新	003816	中国广核	601088	中国神华
000708	中信特钢	300628	亿联网络	601225	陕西煤业
000725	京东方A	300750	宁德时代	601600	中国铝业
000786	北新建材	600018	上港集团	601633	长城汽车
000792	盐湖股份	600023	浙能电力	601816	京沪高铁
000807	云铝股份	600031	三一重工	601857	中国石化
000858	五粮液	600066	宇通客车	601877	正泰电器
000895	双汇发展	600219	南山铝业	601888	中国中免
000975	山金国际	600406	国电南瑞	601898	中煤能源
000983	山西焦煤	600482	中国动力	601919	中远海控
000999	华谊三九	600489	中金黄金	603993	洛阳钼业
002001	新和成	600585	海螺水泥	688009	中国通号
002027	分众传媒	600690	海尔智家		