圆信永丰中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告

基金管理人：圆信永丰基金管理有限公司
基金托管人：国泰君安证券股份有限公司
发售时间：2021 年 11 月 15 日–2021 年 11 月 26 日

重要提示

1、圆信永丰中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）的募集已获中国证监会证监许可［2021］3074 号文准予注册。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投资价值、市场前景和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金是股票型证券投资基金，基金的运作方式是契约型开放式。

3、本基金的基金管理人和登记机构为圆信永丰基金管理有限公司（以下简称“本公司”），基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

4、本基金的发售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、发起资金提供方、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构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、本基金基金份额将自 2021 年 11 月 15 日– 2021 年 11 月 26 日（具体办理业务时间见各销售机构的相关业务公告或拨打客服电话咨询）分别通过本公司直销中心、本公司电子直销及本公司指定的其他销售机构的销售网点（以下统称“销售网点”）公开发售。

6、投资者欲购买本基金，须开立本公司基金账户。投资者不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。如果投资者在开立基金账户的销售机构以外的其他销售机构购买本基金，则需要在该销售网点办理登记基金账号业务，然后再认购本基金。

7、投资者有效认购款项在募集期内产生的利息折算为基金份额计入基金份额持有人账户归其所有，具体份额数以登记机构的记录为准。

8、投资者认购基金份额采用全额缴款的认购方式，投资者认购时，需按基金销售机构规定的方式全额缴款。基金投资者在募集期内可以多次认购基金份额，但已受理的认购申请不允许撤销。

9、投资者在当日（T 日）规定时间内提交的认购申请，通常可在 T+2 日后（包括 T+2 日）到基金销售网点查询交易确认情况。销售机构受理申请并不表示对该申请已经成功的确认，而仅仅代表销售机构确实收到了认购申请。认购申请的成功确认以基金登记机构的确认结果为准。投资者可在基金合同生效后到认购申请提交的销售网点查询最终成交确认情况和认购的份额。投资者应及时查询认购申请及认购份额的确认结果并妥善行使合法权利。

10、本公告仅对本基金基金份额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，请详细阅读登载在规定信息披露媒介的《圆信永丰中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》。本基金的基金合同、招募说明书、托管协议及本公告将发布在本公司网站（www.gtsfund.com.cn）、中国证监会基金电子披露网站（http://eid.csrc.gov.cn/fund），投资者亦可通过本公司网站下载有关申请表格和了解基金募集相关事宜。

11、各销售机构的销售网点以及开户、认购等具体事项详见各销售机构的相关业务公告。

12、在募集期间，各销售机构可能还将适时调整或增加部分基金销售城市。具体城市名单、联系方式及相关认购事宜，请留意近期本公司及各销售机构的公告，或拨打本公司及本公司指定的其他销售机构的客户服务咨询电话。本公司在募集期内还可能调整或增加新的销售机构，投资者可留意相关公告信息或基金管理人网站或拨打本公司客户服务电话进行查询。

13、投资者可拨打本公司的客户服务电话 4006070088 或（021）60366818 咨询认购事宜，也可拨打本公司指定的其他销售机构的客户服务电话咨询认购事宜。

14、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 4006070088 或 021–60366818 咨询认购事宜。

15、基金管理人可综合各种情况对发售安排做适当调整，并可根据基金销售情况适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

16、风险提示：证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。基金分为股票型基金、混合型基金、债券型基金、货币市场基金等不同类型，投资人投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。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。

一、投资于本基金的风险

1、市场风险

证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生风险，主要包括：

（1）政策风险。因国家宏观政策（如货币政策、财政政策、行业政策、地区发展政策等）发生变化，导致市场价格波动而产生风险。

（2）经济周期风险。证券市场是国民经济的晴雨表，而经济运行具有周期性的特点。宏观经济运行状况将对证券市场的收益水平产生影响，从而产生风险。

（3）利率风险。金融市场利率的波动会导致证券市场价格和收益率的变动。利率直接影响着债券的价格和收益率，影响着企业的融资成本和利润。因此基金投资收益水平会受到利率变化的影响。

（4）购买力风险。基金投资的收益可能因为通货膨胀的影响而导致购买力下降，从而使基金的实际收益下降。如果发生通货膨胀，基金投资于证券所获得的收益可能会被通货膨胀抵消，从而影响基金资产的保值增值。

2、信用风险

债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括交易对手不愿意或无法履约的风险。

3、债券收益率曲线变动风险

债券收益率曲线变动风险是指与收益率曲线非平行移动有关的风险，单一的久期指标并不能充分反映这一风险的存在。

4、再投资风险

再投资风险反映了利率下降对固定收益证券利息收入再投资时的收益率的影响。具体为当利率下降时，基金从投资的固定收益证券所得的利息收入进行再投资时，将获得较以前低的收益率。

5、流动性风险

流动性风险可视为一种综合性风险，它是其他风险在基金管理和公司整体经营方面的综合体现。在某些情况下某些投资品种的流动性不佳，由此可能影响到基金投资收益的实现。开放式基金要随时应对投资者的赎回，如果基金资产不能迅速转变成现金，或者变现为现金时使资金净值产生不利的影响，都会影响基金运作和收益水平。尤其是在发生巨额赎回时，如果基金资产变现能力差，可能会产生基金仓位调整的困难，导致流动性风险，可能影响基金份额净值。基金管理人并不保证完全避免此类风险的发生但本基金将通过一系列风险控制指标加强对流动性风险的跟踪、防范和控制，努力去克服流动性风险。

（1）基金申购、赎回安排

投资人在开放日办理基金份额的申购和赎回，具体办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日的交易时间，若本基金参与港股通交易且该工作日为非港股通交易日时，则基金管理人可根据实际情况决定本基金是否开放申购、赎回及转换业务，具体以届时提前发布的公告为准；但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

（2）拟投资市场、行业及资产的流动性风险评估

本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标、本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的非标的指数成份股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债的纯债部分及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

在正常的市场情况下，本基金拟投资市场、行业及资产的流动性均较好。

1）股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、港股通标的股票）

本基金投资组合中的股票遵守基金合同、相关法律法规和中国证监会规定的其他情况，基金经理在公司内部投资制度规定和授权的范围内进行投资。

对于流通受限资产，例如股票停牌、非公开发行股票等，本基金将及时关注相关披露信息，并通过多种方式对上市公司进行调研和分析，按照严格的投资决策流程和风险控制制度进行合理的分散化投资，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

2）债券

在债券投资方面，基金管理人将通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析相补充的方法，确定资产在非信用类固定收益类证券（国债、中央银行票据等）和信用类固定收益类证券（如企业债、公司债等）之间的配置比例，灵活应用期限结构策略、类属策略、信用策略、息差策略、互换策略等，合理管理并控制组合流动性风险。

3）资产支持证券

对于资产支持证券，本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征，来估计资产违约风险和提前偿付风险，根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息的现金流支付，并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。

4）股指期货、国债期货

在股指期货、国债期货的投资方面，基金管理人以投资组合的套期保值为目标，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，适当参与股指期货、国债期货的投资。

5）债券回购

本基金在基础组合的基础上，使用基础组合持有的债券进行回购融入短期资金滚动操作，投资于收益率高于融资成本的其它获利机会，从而获得杠杆放大收益。

本基金将加强开放式基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险的管理，合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整。

7）其他金融工具

对于其他金融工具，如银行存款、同业存单、货币市场工具等，该类资产具有较高的流动性，本基金按照严格的投资决策流程和风险控制制度进行投资，并保持该类金融工具的高流动性

（3）巨额赎回情形下的流动性风险管理措施

基金管理人根据相关内部管理制度与法律法规的要求执行对于本基金巨额赎回的事前监测、事中管控与事后评估机制。当本基金发生基金合同约定的巨额赎回且现金类资产不足以支付赎回款项时，基金管理人在当日接受赎回申请比例不低于上一开放日基金总份额的 10% 的前提下，通过压力测试等手段充分评估基金组合资产变现能力、投资比例变动与基金单位份额净值波动，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，审慎接受、确认赎回申请，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值，切实保护存量基金份额持有人的合法权益。

如发生单个开放日内单个基金份额持有人申请赎回的基金份额超过前一开放日的基金总份额的 10%情形时，本基金管理人可以对该单个基金份额持有人超出 10%部分的赎回申请实施延期办理，延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额，以此类推，直到全部赎回为止。对于该基金份额持有人未超过上述比例的部分，基金管理人有权根据本招募说明书“巨额赎回的处理方式”中“（1）全额赎回”或“（2）部分延期赎回”的约定方式与其他基金份额持有人的赎回申请一并办理。但是，如该持有人在提交赎回申请时选择取消赎回，则其当日未获受理的部分赎回申请将被撤销。

（4）实施备用的流动性风险管理工具的情形、程序及对投资者的潜在影响

本基金可能实施备用的流动性风险管理工具，以更好地应对流动性风险。基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施，包括但不限于：①延期办理巨额赎回申请；②暂停接受赎回申请；③延缓支付赎回款项；④收取短期赎回费，本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取不低于 1.5%的赎回费；⑤暂停基金估值，当特定资产占前一估值日基金资产净值 50%以上的，经与基金托管人协商确认后，本基金将暂停基金估值；⑥摆动定价机制；⑦启用侧袋机制。

当基金管理人实施流动性风险管理工具时，可能对投资者具有一定的潜在影响，包括但不限于不能申购本基金、赎回申请不能确认或者赎回款项延迟到账、如持有期限少于 7 日会产生较高的赎回费造成收益损失等。提示投资者了解自身的流动性偏好、合理做好投资安排。

（5）实施侧袋机制对投资者的影响

侧袋机制是一种流动性风险管理工具，是将特定资产分离至专门的侧袋账户进行处置清算，并以处置变现后的款项向基金份额持有人进行支付，目的在于有效隔离并化解风险。但基金启用侧袋机制后，侧袋账户份额将停止披露基金份额 净值，并不得办理申购、赎回和转换，仅主袋账户份额正常开放赎回，因此启用侧袋机制时持有基金份额的持有人将在启用侧袋机制后同时持有主袋账户份额和侧袋账户份额，侧袋账户份额不能赎回，其对应特定资产的变现时间具有不确定性，最终变现价格也具有不确定性并且有可能大幅低于启用侧袋机制时的特定资产的估值，基金份额持有人可能因此面临损失。

实施侧袋机制期间，因本基金不披露侧袋账户份额的净值，即便基金管理人在基金定期报告中披露报告期末特定资产可变现净值或净值区间的，也不作为特定资产最终变现价格的承诺，因此对于特定资产的公允价值和最终变现价格，基金管理人不承担任何保证和承诺的责任。

基金管理人将根据主袋账户运作情况合理确定申购政策，因此实施侧袋机制后主袋账户份额存在暂停申购的可能。

启用侧袋机制后，基金管理人计算各项投资运作指标和基金业绩指标时仅需考虑主袋账户资产，基金业绩指标应当以主袋账户资产为基准，因此本基金披露的业绩指标不能反映特定资产的真实价值及变化情况。

6、管理风险

在基金管理运作过程中基金管理人的知识、经验、判断、决策、技能等，会影响其对信息的占有和对经济形势、证券价格走势的判断，从而影响基金收益水平。基金管理人和基金托管人的管理水平、管理手段和管理技术等因素的变化也会影响基金收益水平。

7、操作或技术风险

基金的相关当事人在各业务环节的操作过程中，可能因内部控制存在缺陷或者人为因素造成操作失误或违反操作规程而引致风险，如越权违规交易、交易错误和 IT 系统故障等。

此外，在本基金的各种交易行为或后台运作中，可能因为技术系统的故障或者差错而影响交易的正常进行甚至导致基金份额持有人利益受到影响。这种技术风险可能来自基金管理人、基金托管人、登记机构、销售机构、证券交易所和证券登记结算机构等。

8、合规性风险

指基金管理或运作过程中，违反国家法律、法规的规定，或者基金投资违反法规及基金合同有关规定的风险。

9、本基金特有风险

（1）本基金为股票型证券投资基金，因此，本基金不仅需承受证券市场的系统性风险，而且需承受宏观经济周期、行业周期、公司经营状况等影响投资回报的各种因素可能带来的风险。

同时，由于上市公司之间差异较大，如果基金管理人在选择投资标的时出现投资失误，可能导致本基金的投资回报低于业绩比较基准。

（2）投资资产支持证券的风险

本基金的投资范围包括资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具，风险主要包括资产风险及证券化风险。资产风险来源于资产本身，包括价格波动风险、流动性风险等；证券化风险主要包括信用评级风险、法律风险等。

（3）与指数化投资相关的特定风险

1）标的指数波动的风险

标的指数成份股的价格可能受到政治因素、经济因素、上市公司经营状况、投资人心理和交易制度等各种因素的影响而波动，导致指数波动，从而使基金收益水平发生变化，产生风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%，业绩表现将会随着标的指数的波动而波动；同时本基金将维持较高的股票仓位，在股票市场下跌的过程中，可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

2）标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能代表整个股票市场。标的指数成份股的平均回报率与整个股票市场的平均回报率可能存在偏离。

3）基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能使基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离：

①标的指数调整成份股或变更编制方法，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度与跟踪误差；

②标的指数成份股发生配股、增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变化，使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差；

③成份股派发现金红利、送配等所获收益导致基金收益率偏离标的指数收益率，从而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

④由于成份股摘牌或流动性差等因素，基金无法及时调整投资组合或承担冲击成本而产生跟踪偏离度和跟踪误差；

⑤基金投资过程中的证券交易成本，以及基金管理费、托管费、销售服务费等，可能导致本基金在跟踪指数时产生收益上的偏离；

⑥在本基金指数化投资过程中，基金管理人的管理能力，例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等，都会对本基金的收益产生影响，从而影响本基金对标的指数的跟踪程度；

⑦基金现金资产的拖累会影响本基金对标的指数的跟踪程度；

⑧如果本基金采取成份股替代策略，基金投资组合与标的指数构成的差异可能导致基金收益率与标的指数收益率产生偏离；

⑨其他因素产生的偏离。如因受到最低买入股数的限制，基金投资组合中个别股票的持有比例与标的指数中该股票的权重可能不完全相同；因缺乏卖空、对冲机制及其他工具造成的指数跟踪成本较大；因基金申购与赎回带来的现金变动；因指数发布机构指数编制错误等，由此产生跟踪偏离度与跟踪误差。

4）成份股停牌的风险

标的指数成份股可能因各种原因临时或长期停牌，发生成份股停牌时基金可能因无法及时调整投资组合而导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

5）跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力求控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%，但因标的指数编制规则调整或其他因素可能导致跟踪误差超过上述范围，本基金净值表现与指数价格走势可能发生较大偏离。另外，本基金采取量化增强策略，可在一定幅度内减少或增加部分标的指数成份股的投资比例，甚至从投资组合中剔除个别标的指数成份股，或在标的指数成份股之外进行投资，也可能导致本基金跟踪误差超过约定目标。

6）标的指数变更的风险

根据基金合同规定，如发生导致标的指数变更的情形，基金管理人可以依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数。若标的指数发生变更，本基金的投资组合将相应进行调整。届时本基金的风险收益特征可能发生变化，且投资组合调整可能产生交易成本和机会成本。投资者须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

7）指数编制机构停止服务的风险

本基金的标的指数由指数编制机构发布并管理和维护，未来指数编制机构可能由于各种原因停止对指数的管理和维护，本基金将根据基金合同的约定自该情形发生之日起十个工作日向中国证监会报告并提出解决方案，如更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决，基金份额持有人大会未成功召开或就上述事项表决未通过的，基金合同终止。投资人将面临更换基金标的指数、转换运作方式，与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

自指数编制机构停止标的指数的编制及发布至解决方案确定期间，基金管理人应按照指数编制机构提供的最近一个交易日的指数信息遵循基金份额持有人利益优先原则维持基金投资运作，该期间由于标的指数不再更新等原因可能导致指数表现与相关市场表现存在差异，影响投资收益。

（4）采用量化策略进行投资管理可能引致的特定风险

1）量化增强策略的风险

本基金在一定的跟踪误差约束范围内，追求超越业绩比较基准的投资回报。为此，本基金可能在一定幅度内减少或增加部分标的指数成份股的投资比例，甚至从投资组合中剔除个别标的指数成份股，或在标的指数成份股之外进行投资。由于量化策略的表现存在不确定性，本基金进行增强投资的结果既可能超越业绩比较基准，也可能落后于业绩比较基准。

2）数据错误风险

量化策略投资以广泛覆盖各类信息源的数据库为基础，接入了包括宏观经济、行业信息、公司财务、证券与期货交易行情等在内的多种数据，相关数据通常来源于不同的数据提供商，且按不同的需求和规范进行预处理。数据源错误或预处理过程中出现的错误可能影响量化模型的输出结果，形成数据错误风险。

3）模型风险

本基金采用量化模型指导投资决策，定量方法的缺陷在一定程度上也会影响本基金的表现。一方面，面对不断变换的市场环境，量化投资策略所遵循的模型理论均处于不断发展和完善的过程中；另一方面，在定量模型的具体设定中，核心参数假定的变动均可能影响整体效果的稳定性；最后，定量模型存在对历史数据的依赖。因此，在实际运作过程中，市场环境的变化可能导致遵循量化模型构建的投资组合在一定程度上无法达到预期的投资效果。

（5）港股投资的风险

本基金除了投资于 A 股市场外，还可在法律法规规定的范围内投资香港联合交易所上市的股票。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临汇率风险、香港市场风险、市场制度以及交易规则不同等境外证券市场投资所面临的特有风险，包括但不限于：

1）市场联动的风险

与内地 A 股市场相比，港股市场上外汇资金流动更为自由，海外资金的流动对港股价格的影响巨大，港股价格与海外资金流动表现出高度相关性，本基金在参与港股市场投资时受到全球宏观经济和货币政策变动等因素所导致的系统风险相对更大。

2）汇率风险

本基金可以投资于港股通股票，以人民币募集和计价，尽管投资人以人民币申购和赎回，但在现行港股通机制下，港股的买卖是以港币报价，以人民币进行支付，并且资金不留港（港股交易后结算的净资金余额头寸以换汇的方式兑换为人民币），故本基金每日的港股买卖结算将进行相应的港币兑人民币的换汇操作，本基金承担港元对人民币汇率波动的风险，以及因汇率大幅波动引起账户透支的风险，港元对人民币汇率的变化将会影响本基金以人民币计价的基金资产净值，从而对基金的收益产生影响。

另外本基金对港股买卖每日结算中所采用的报价汇率可能存在报价差异，本基金可能需额外承担买卖结算汇率报价点差所带来的损失；同时根据港股通的规则设定，本基金在每日买卖港股申请时将参考汇率买入/卖出价冻结相应的资金，该参考汇率买入价和卖出价设定上存在比例差异，以抵御该日汇率波动而带来的结算风险，本基金将因此而遭遇资金被额外占用进而降低基金投资效率的风险。

3）股价波动较大的风险

港股市场实行 T+0 回转交易机制（即当日买入的股票，在交收前可以于当日卖出），同时对个股不设涨跌幅限制，加之香港市场结构性产品和衍生品种类相对丰富以及做空机制的存在；港股股价受到意外事件影响可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动，本基金的波动风险可能相对较大。

4）港股通额度限制的风险

现行的港股通规则，对港股通设有额度限制。本基金可能因为港股通额度不足，而不能及时买入看好的投资标的，进而错失投资机会的风险。

5）港股通可投资标的范围调整带来的风险

现行的港股通规则，对港股通下可投资的港股范围进行了限制，并定期或不定期根据范围限制规则对其体的可投资标的进行调整，对于调出投资范围的港股，只能卖出不能买入，本基金存在因港股通可投资标的范围调整而不能及时买入看好的投资标的，进而错失投资机会的风险。

6）港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险

根据现行的港股通规则，只有两地均为交易日且能够满足结算安排的交易日才为港股通交易日，存在港股通交易日不连贯的情形（如内地市场因法定节假日、公休日等原因休市而香港市场照常交易但港股通不能如常进行交易），导致基金所持的港股组合在后续港股通交易日开市交易中集中体现市场反应，造成其价格波动骤然增大，进而导致本基金所持港股组合在资产估值上出现波动增大的风险。

7）交收制度带来的风险

香港市场实行 T+2 日（T 日买卖股票，资金和股票在 T+2 日才进行交收）的交收安排，本基金在 T 日（港股通交易日）卖出股票，T+2 日（港股通交易日，即为卖出当日之后第二个港股通交易日）在香港市场完成清算交收，卖出的资金在 T+3 日才能回到人民币资金账户。因此交收制度的不同以及港股通交易日的设定原因，本基金可能面临卖出港股后资金不能及时到账，造成支付赎回款日期比正常情况延后导致出现流动性风险。

8）港股通下对公司行为的处理规则带来的风险

根据现行的港股通规则，本基金因所持港股通股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者其他异常情况，所取得的港股通股票以外的香港联交所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通股票权益分派或者转换等情形取得的香港联交所上市股票的认购权利在香港联交所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非联交所上市证券，可以享有相关权益，但不得通过港股通买入或卖出。

本基金存在因上述规则，利益得不到最大化甚至受损的风险。

9）香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联交所规定，在交易所认为上市公司所要求的停牌合理而且必要时，上市公司方可采取停牌措施。此外，不同于内地 A 股市场的停牌制度，香港联交所对停牌的具体时长并没有量化规定，只是确定了“尽量缩短停牌时间”的原则；同时与 A 股市场对存在退市可能的上市公司根据其财务状况在证券简称前加入相应标记（例如，ST 及 *ST 等标记）以警示投资者风险的做法不同，在香港联交所市场没有风险警示板，香港联交所采用非量化的退市标准且在上市公司退市过程中拥有相对较大的主导权，使得香港联交所上市公司的退市情形较 A 股市场相对复杂。因该等制度性差异，本基金可能存在因所持个股遭遇非预期性的停牌甚至退市而给基金带来损失的风险。

10）港股通规则变动带来的风险

本基金是在港股通机制和规则下参与香港联交所证券的投资，受港股通规则的限制和影响，本基金存在因港股通规则变动而带来基金投资受阻或所持资产组合价值发生波动的风险。

11）其他可能的风险

除上述显著风险外，本基金参与港股通投资，还可能面临其他风险，包括但不限于：

①除因股票交易而发生的佣金、交易征费、交易费、交易系统费、印花税、过户费等税费外，在不进行交易时也可能要继续缴纳证券组合费等项费用，本基金存在因费用估算不准而导致账户透支的风险；

②在香港市场，部分中小市值港股成交量则相对较少，流动较为缺乏，本基金投资此类股票可能因缺乏交易对手而面临个股流动性风险；

③在本基金参与港股通交易中若香港联交所与内地交易所的证券交易服务公司之间的报盘系统或者通信链路出现故障，可能导致 15 分钟以上不能申报和撤销申报的交易中断风险；

④存在港股通香港结算机构因极端情况下无法交付证券和资金的结算风险；港股通境内结算实施分级结算原则，导致本基金可能面临以下风险：

i）因结算参与人未完成与中国结算的集中交收，导致本基金应收资金或证券被暂不交付或处置；

ii）结算参与人对本基金出现交收违约导致本基金未能取得应收证券或资金；

iii）结算参与人向中国结算发送的有关本基金的证券划付指令有误导致本基金权益受损；

iv）其他因结算参与人未遵守相关业务规则导致本基金利益受到损害的情况。

（6）投资股指期货的风险

①股指期货交易采用保证金交易方式，潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险；

②股指期货合约到期时，本基金的账户如仍持有未平仓合约，交易所将按照交割结算价将账户持有的合约进行现金交割，因此无法继续持有到期合约，具有到期日风险；

③持仓组合品种变现时，由于市场流动性严重不足或头寸持有集中度过大导致未在合理价位成交，存在变现损失风险；

④股指期货设置了涨跌停板限制，本基金的账户中股指期货持仓可能无法平仓，存在流动性风险；

⑤交易所设置了持仓限制，本基金的账户中股指期货持仓超过限制比例，会被交易所或期货公司强行平仓，存在强行平仓风险；

⑥交易所设置了强制减仓限制，本基金的账户中股指期货持仓符合交易所强制减仓范围的，存在强制减仓的风险。

（7）投资国债期货的风险

国债期货交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，国债期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的价格波动不一致而面临基差风险。

10、其他风险

（1）在符合本基金投资理念的新型投资工具出现和发展后，如果投资于这些工具，基金可能会面临一些特殊的风险；

（2）因技术因素而产生的风险，如计算机系统不可靠产生的风险；

（3）因基金业务快速发展而在制度建设、人员配备、内控制度建立等方面不完善而产生的风险；

（4）因人为因素而产生的风险，如内幕交易、欺诈行为等产生的风险；

（5）对主要业务人员如基金经理的依赖可能产生的风险；

（6）战争、自然灾害等不可抗力可能导致基金资产有遭受损失的风险，以及证券市场、基金管理人及基金销售机构可能因不可抗力无法正常工作，从而产生影响基金的申购和赎回按正常时限完成的风险；

（7）金融市场危机、行业竞争、代理商违约、基金托管人违约等超出基金管理人自身直接控制能力之外的风险，也可能导致基金或者基金份额持有人利益受损；

（8）其他意外导致的风险。

一、基金募集基本情况

（一）基金名称

圆信永丰中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

基金简称：圆信永丰中证 500 指数增强发起

（二）基金类型

股票型证券投资基金

（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）基金代码

A 类基金份额代码：013878；C 类基金份额代码：013879

（六）基金份额发售面值

本基金基金份额发售面值为人民币 1.00 元

（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、发起资金提供方、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构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）基金的投资目标

本基金为股票型指数增强基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的组合管理与风险控制，力争获取高于标的指数的投资收益。

（九）销售机构

一）直销机构

1、圆信永丰基金管理有限公司直销中心

上海直销中心办公地址：上海市浦东新区世纪大道 1528 号陆家嘴基金大厦 19 楼

电话：021–60366073

传真：021–60366001

厦门直销中心办公地址：厦门市思明区展鸿路 82 号金融中心大厦 21 楼 2102 室

电话：0592–3016513

传真：0592–3016501

网址：www.gtsfund.com.cn

2、电子直销

1）名称：圆信永丰基金管理有限公司电子直销

交易网站：www.gtsfund.com.cn

客服电话：4006070088；021–60366818

2）名称：圆信永丰基金管理有限公司电子直销系统之微信交易端口

圆信永丰基金微信公众号：gtsfund4006070088

客服电话：4006070088；021–60366818

二）其他销售机构

（1）国泰君安证券股份有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区商城路 618 号

办公地址：上海市南京西路 768 号国泰君安大厦

客服电话：95521/400–8888–666

网址：www.gtja.com

（2）厦门银行股份有限公司

注册地址：厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦

办公地址：厦门市思明区湖滨北路 101 号商业银行大厦

法定代表人：吴世群

客服电话：400–858–8888

公司网址：www.xmbankonline.com

（3）中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号 2–6 层

住所：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：陈共炎

客服电话：4008–888–888

公司网址：www.chinastock.com.cn

（4）申万宏源证券有限公司

英文名称：Shenwan Hongyuan Securities Co., Ltd.

注册地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址：上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层（邮编：200031）

法定代表人：杨玉成

电话：021–33389888

传真：021–33388224

客服电话：95523 或 4008895523

网址：www.swhysc.com

联系人：余洁

（5）申万宏源西部证券有限公司

英文名称：Shenwan Hongyuan Securities (Western) Co., Ltd.

注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室

办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室（邮编：830002）

法定代表人：王献军

电话：0991–2307105

传真：0991–2301927

客户服务电话：400–800–0562

网址：www.swhysc.com

联系人：梁丽

（6）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：黄炎勋

电话：95517

公司网址：www.essence.com.cn

（7）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.newone.com.cn

客户服务电话：95565、4008888111

（8）华福证券有限责任公司

注册地址：福建省福州市鼓楼区鼓屏路 27 号 1# 楼 3 层、4 层、5 层

办公地址：中国上海市浦东新区滨江大道 5129 号陆家嘴滨江中心 N1 幢

法定代表人：黄金琳

客服电话：400–88–96326

公司网址：www.hfzq.com.cn

（9）上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

客服电话：400–1818–188

公司网址：www.1234567.com.cn

（10）上海挖财基金销售有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区杨高南路 799 号 5 层

法定代表人：吕柳霞

电话：021–50810673

公司网址：www.wacaijijin.com

基金管理人可根据有关法律法规的规定，调整销售机构或选择其他符合要求的机构销售本基金，并在基金管理人网站公示。

（十）募集时间安排与基金合同生效

1、本基金的募集期自基金份额发售之日起最长不得超过三个月，募集时间详见基金份额发售公告。

2、本基金的募集期为 2021 年 11 月 15 日– 2021 年 11 月 26 日。在募集期内，本基金向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、发起资金提供方、合格境外机构投资者和人民币合格境外机构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发售。基金管理人有权根据基金募集的实际情况按照相关程序延长或缩短募集期，此类变更适用于所有销售机构。基金募集期若经延长，最长不得超过前述募集期限。

3、本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在发起资金提供方使用发起资金认购本基金的总金额不少于 1000 万元人民币且承诺发起资金认购的基金份额持有期限自基金合同生效日起不少于 3 年的条件下，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，验资报告需对发起资金提供方及其持有份额进行专门说明，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，在基金募集行为结束前，任何人不得动用。

4、基金合同不能生效时募集资金的处理方式

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 日内返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）；

（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。

5、基金存续期内的基金份额持有人数量和资产规模

基金合同生效之日起 3 年后的对应日，若基金资产净值低于 2 亿元，基金合同自动终止，且不得通过召开基金份额持有人大会延续基金合同期限。

《基金合同》生效满 3 年后，连续 20 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，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并 6 个月内召集基金份额持有人大会。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

6、如遇突发事件，以上基金募集期的安排可以依法适当调整并按规定予以公告。

（十一）基金认购方式与费率

1、认购方式

本基金认购采用金额认购方法。

2、认购费率

本基金 A