

A08 信息披露 | Disclosure

招商中债-0-3年长三角地方政府债交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1.招商中债-0-3年长三角地方政府债交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“招商中债-0-3年长三角地方债ETF”、“本基金”)的募集已获中国证监会证监许可(2019)2927号文准予注册。

2.本基金的基金类别是债券型证券投资基金,基金运作方式是交易型开放式。

3.本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司(以下简称“本公司”),托管人为浙商银行股份有限公司,本基金的登记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者。

5.本基金自2020年6月22日至2020年9月21日进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购和网下债券认购3种方式。其中,网下现金认购和网下债券认购的日期为2020年6月22日至2020年9月21日,网上现金认购的日期为2020年9月17日至2020年9月21日,如上海证券交易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。基金管理人可根据认购的情况及市场情况适当调整发售时间,并及时公告。

6.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利用上海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者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。网下债券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债券进行认购。

7.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(以下简称“上海A股账户”)或上海证券交易所证券投资基金账户(以下简称“上海基金账户”)。

(1)上海基金账户只能进行基金的现金认购和二级市场交易,如投资人需要参与网下债券认购或基金的申购、赎回,则应开立上海A股账户。

(2)投资者开立证券账户,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上海分公司的开户代理机构办理上海A股账户或上海基金账户的开户手续。有关开设上海A股账户和上海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。

(3)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。

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者当日无法进行认购,建议投资者在进行认购前至少1个工作日办理指定交易或转指定交易手续。

使用专用交易单元的机构投资者则无需办理指定交易。

8.网上现金认购以基金份额申请,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,投资人在认购时间内可以多次认购,累计认购份额不设上限,投资人在认购期间内可多次申报,认购一经确认,认购资金即被冻结。

网下现金认购以基金份额申请,投资人每笔认购份额为1,000份或其整数倍,投资人在认购期间内可以多次认购,累计认购份额不设上限。投资者的认购申请提交后,在基金管理人或发售代理机构规定的时间内之后不得撤销。

网下债券认购以单只债券券数申报,用以认购的债券必须是本基金标的指数成份券或已公告的备选成份券。单只债券最低认购申报数为1手(人民币1000元面值债券为1手),超过1手的部分须为1手的整数倍。投资者通过基金管理人(利用网下债券认购的,单笔认购份额须为50万份以上(含50万份)),投资人可以多次提交认购申请,累计申报不设上限。

9.投资人在认购本基金时,需按基金管理人或发售代理机构的规定,足额认购资金或债券,办理认购手续。

10.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接收到认购申请。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进行合法权利。

11.本公告仅对本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,请仔细阅读刊登在基金管理人网站(www.cmfchina.com)和中国证监会基金电子披露网站(<http://eid.csrc.gov.cn/fund>)上的《招商中债-0-3年长三角地方政府债交易型开放式指数证券投资基金合同》(以下简称:“基金合同”)、《招商中债-0-3年长三角地方政府债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”)等法律文件。本基金的基金合同及招募说明书提示性公告以及本公告将同时刊登在《中国证券报》。

12.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。

13.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,或已有发售代理机构增加新增的销售网点,将及时公告。

14.本公司可根据基金销售情况适当延长或缩短本基金发售时间,并及时公告。

15.本公司综合各种情况对发售安排做适当调整。

16.投资者如有任何问题,可拨打本公司客户服务电话400-887-9656(免长途费)进行咨询。

17.风险提示

证券投资基金(以下简称“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。投资人购买基金,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,投资人承担的风险也越大。本基金为债券型基金,其预期收益或水平将相应会高于货币市场基金,低于混合型基金、股票型基金。本基金主要投资于标的指数成份券及备选成份券,具有与标的指数相似的风险收益特征。

本基金投资于标的指数的成份券及备选成份券的资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的90%。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,并基于自身风险承受能力出现的各类风险,包括:市场风险、基金管理风险、流动性风险、本基金特有的风险等。本基金的具体风险详见招募说明书“风险揭示”章节。

本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它基金业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资人在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》等信息披露文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断本基金是否和自身的风险承受能力相适应。

本基金的特有风险包括:

(1)标的指数回报与债券市场平均回报偏离的风险

标的指数并不能完全代表债券市场,标的指数的成份债券的平均回报率与整个债券市场的平均回报率可能存在偏离。

(2)标的指数波动的风险

标的指数的成份券的价格可能受到政治因素、经济因素、公司经营状况、投资人心理和交易规模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。

(3)跟踪偏离风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率无法紧密跟踪标的指数的收益率:

1)基金有投资成本,各种费用及税收,而指数编制时不考虑费用和税收,这将导致基金收益率落后于标的指数收益率,产生正的跟踪偏离度。

2)指数成份券发现金利息等因素将导致基金收益率超过标的指数收益率,产生正的跟踪偏离度。

3)标的指数调整成份券构成,或成份券在指数中的权重发生变化,或标的指数变更编制方法时,基金在相应的组合调整中可能暂时扩大与标的指数的构成差异,而且会产生相应的交易成本,导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

4)投资者申购、赎回可能带来一定的现金流或变现需求,在遭遇标的指数成份券流动性差等情形时,基金可能无法及时调整投资组合或承担冲击成本,导致跟踪偏离度和跟踪误差扩大。

5)在基金进行指数化投资过程中,基金管理人的管理技能,例如跟踪指数的水平、技术手段、买入卖出的时机选择等,都会对基金收益产生影响,从而影响基金跟踪标的跟踪误差。

6)其他因素产生的偏离。如因受到最低买入手数的限制,基金投资组合中个别债券的持有比例与标的指数中该债券的权重可能不相同;因指数发布机构数据处理错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

(4)投资人赎回失败的风险

基金管理人可能根据成份券市值规模变化等因素调整最小申购、赎回单位,由此可能导致投资人赎回最小申购、赎回单位申购并持有的基金份额,可能无法按照新的最小申购、赎回单位全部赎回。

(5)基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价主要为组合证券。在组合证券变现过程中,由于市场变化、部分成份券流动性差等因素,导致投资人变现后的价值与赎回时赎回对价的价值有差异,存在变现风险。

(6)基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

本基金收益分配原则为按收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不以弥补亏损为前提,收益分配后可能存在基金份额净值低于面值的风险。

(7)标的指数变更的风险

尽管可能性很小,但根据基金合同规定,如出现变更标的指数的情形,本基金将变更标的指数。基于原标的指数的投资策略可能改变,投资组合面临下调的风险,基金的收益风险特征将与新的标的指数保持一致,投资者须承担此项调整带来的调整与成本。

(8)第三方机构服务的风险

本基金的多项服务委托第三方机构办理,存在以下风险:

1)申购赎回代理机构因多种原因,导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止,由此可能对投资者申购赎回服务的风险。

2)登记机构可能调整结算规则,对投资者基金份额、组合证券及资金等的结算方式发生变化,制度调整可能给投资者带来理解偏差。同样的风险还可能来自于证券交易所及其他代理机构。

3)证券交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约,导致基金或投资者利益受损。

(9)操作技术风险

相关当事人在业务各环节操作过程中,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等原因可能引致风险,例如,申购赎回清单编制错误、越权违规交易、欺诈行为、交易错误、IT系统故障等风险。

在基金的各种交易行为或者后台运作中,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或者导致投资者的利益受到影响。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、证券登记结算机构等等。

18.基金管理人认为本基金投资者在选择本基金之前,通过正规的途径,如:招商基金客户服务热钱(4008879656)、招商基金公司网站(www.cmfchina.com)或者通过其他非直销销售机构,对本基金进行充分、详细的了解,在自己的资金状况、投资期限、收益预期和风险承受能力做出客观合理的评估后,再做出是否投资的决定。投资者应确保在投资本基金后,即使出现短期的亏损也不会给自己的正常生活带来很大的影响。

19.基金管理人提醒投资者特别注意,因本基金份额拆分、分红等行为导致基金份额净值变化,不会改变基金的风险收益特征,不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。因基金份额拆分、分红等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值,在市场波动等因素的影响下,基金投资仍有可能出现亏损或基金份额净值仍有可能低于初始面值。

20.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,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。请投资者正确认识和对待本基金基金未来可能的收益和风险。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引起的投资风险,由投资人自行承担。

证券简称:长三角

扩位证券简称:长三角地方债ETF

认购代码:511003

证券代码:511000

(三)基金的类别

债券型证券投资基金

基金运作方式

交易型开放式

(五)基金存续期限

不定期

(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)基金投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

(八)募集对象

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者。

(九)基金份额发售机构

1.发售机构

招商证券股份有限公司

注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人:霍达

电话:(0755)82960223

传真:(0755)82960141

联系人:林生迎

客户服务电话:95565

网址:www.newone.com.cn

2.网下现金认购和网下债券认购的直销机构

招商基金管理有限公司

3.网下现金认购和网下债券认购的发售代理机构

具体名单详见本公告“九、本次发售当事人或中介机构”(三)销售机构

2.网下现金认购和网下债券认购的发售代理机构

具体名单详见本公告“九、本次发售当事人或中介机构”(三)销售机构

基金管理人:招商基金管理有限公司

基金托管人:浙商银行股份有限公司

登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

总行:浙江省杭州市萧山区阡陌路1788号

法定代表人:刘辉

办公地址:深圳市福田区深南大道7088号

电话:(0755)83199636

传真:(0755)83076974

联系人:魏思思

(二)基金托管人

名称:浙商银行股份有限公司

住所:浙江省杭州市萧山区阡陌路1788号

法定代表人:刘辉

联系人:邓帆

电话:(0571)-88261570

传真:(0571)-88288888

成立时间:1993年04月16日

组织形式:股份有限公司

注册资本:人民币18,718,696,778元

存续期间:持续经营

(三)销售机构

1.网下现金认购和网下债券认购的直销机构

直销机构:招商基金管理有限公司

招商基金机构业务部

地址:北京市西城区月坛南街1号院3号楼1801

电话:(010)56374044

联系人:贾晓航

地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1088号上海招商银行大厦南塔15楼

电话:(021)38677388

联系人:胡慧娟

地址:深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦23楼

电话:(0755)