

招商中证卫星产业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:招商基金管理有限公司
基金托管人:中国银河证券股份有限公司
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

二〇二三年三月

重要提示

1. 招商中证卫星产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“招商中证卫星产业ETF”、“本基金”)的募集已获中国证监会证监许可(2023)381号文准予注册。

2. 本基金的基金类别是股票型证券投资基金,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”),托管人为中国银河证券股份有限公司,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. 本基金自2023年4月7日至2023年4月18日进行发售,投资者可选择网上现金认购和网下现金认购2种方式。本基金目前暂不开通网下股票认购业务,如深圳证券交易所对网上现金认购时间作出调整,本公司将作出相应调整及公布的公告。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人通过基金管理人指定的发售代理机构用深圳证券交易所系统以现金进行的认购。

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的认购。

7. 投资人认购本基金时需具有深圳证券账户,即在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司开立的深圳证券交易所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“深圳证券投资基金账户”)。

已有深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无深圳A股账户或深圳证券投资基金账户的投资人,需在认购前持本人身份证件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。

深圳证券投资基金账户只能进行基金份额的网上现金认购,网下现金认购及二级市场交易。

如投资人需要通过申购赎回代理机构参与本基金的申购、赎回,应同时持有并使用深圳A股账户与上海A股账户,且这两个账户的证件号码及名称属于同一投资人所有,并以投资人用以申购、赎回的深圳证券交易所股票的托管人和上海A股账户的指定交易证券公司应为同一申购赎回代理机构,否则无法办理本基金的申购和赎回。已购买过由招商基金管理有限公司担任登记机构的基金的投资人,其拥有的招商基金管理有限公司开放式基金账户不能用于认购本基金。

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。投资人认购时间内可以多次认购,累计认购份额不设上限,但法律法规或监管部门另有规定的除外。投资人认购申报提交后不可撤销,认购申报一经确认,认购资金即被冻结。

网下现金认购以基金份额申请,投资人通过发售代理机构办理网下现金认购的,每笔认购份额需为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),超过部分须为1万份的整数倍。投资人认购时间内可以多次认购,累计认购份额不设上限,但法律法规或监管部门另有规定的除外。投资人认购申报提交后不可撤销,认购申报一经确认,认购资金即被冻结。

9. 募集期间,本基金募集规模上限为20亿元人民币(不包括募集期间利息和认购费用)。除基金管理人相关公告另有规定,基金合同生效后将不再受此募集资金规模的限制。

10. 投资人在认购本基金时,需按基金管理人或其指定的发售代理机构的规定,备足认购资金,办理认购手续,认购申请提交后如需撤销以基金管理人或其指定的发售代理机构的规定为准。

11. 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受认购申请。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,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者自行承担。

12. 本公司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,请详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《招商中证卫星产业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”),《招商中证卫星产业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司将同时刊登在中国证监会网站。

13. 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见各发售代理机构的具体规定。

14. 在发售期间,除本公司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的销售网点,将及时公告。

15. 本公司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. 本公司可综合各种情况对发售安排做适当调整。

17. 投资者如有任何问题,可拨打本公司客户服务电话(400-887-9555(免长途费))进行咨询。

18. 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。本基金为股票型基金,其预期风险收益水平相对会高于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券及备选成份券,具有与标的指数相似的风险特征。

本基金投资于标的指数成份券(含存托凭证)和备选成份券(含存托凭证)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80%。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,并承担基金投资中出现的各类风险,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。

本基金特有的风险包括:

(1) 指数化投资的风险

本基金投资的指数成份券及备选成份券的资产不低于基金资产净值的90%,业绩表现将会随着标的指数的波动而波动;同时本基金在多数情况下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) 标的指数的风险

标的指数不能完全代表整个股票市场。标的指数成份券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) 标的指数波动的风险

标的指数成份券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。

(4) 标的指数计算出错的风险

尽管中证指数有限公司将采取一切必要措施以确保指数的准确性,但不对任何保证,也不因指数的任何错误对任何人负责。因此,如果标的指数值出现错误,投资人参考指数值进行投资决策,则可能导致损失。

(5) 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化的情形,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。若标的指数发生变化,本基金的投资者将相应进行调整。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化而产生的风险与成本。

(6) 标的指数可回溯历史数据时间较短的风险

根据本基金的指数编制方案,其可回溯历史数据的时间较短,无法代表过往的业绩表现,也不预示未来走势。

(3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

以下因素可能导致基金投资组合的收益率与标的指数的收益率发生偏离:

1) 标的指数调整成份券或变更编制方法,使本基金在相应的组合调整中产生跟踪偏离度和跟踪误差。

2) 标的指数成份券发生配股、增发等行为导致成份券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) 成份券派发现金红利、送股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) 由于成份券停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,以及基金管理费和托管费等,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,例如跟踪误差的水平、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基金对标的指数的跟踪程度。

8) 特殊情况下,如果本基金采取成份券替代策略,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,如因受到最低买入价格的限制,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) 跟踪误差控制未达标的可能

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内,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差。

(5) 指数编制机构停止服务的风险

本基金的指数由指数编制机构发布并管理,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内向中国证监会报告并提出解决方案,如指数编制机构与基金管理人、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服务的指数的编制及发布至解决方案确定并实施前,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合同的约定自该情形发生之日起十个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案,如指数编制机构与基金管理人、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。投资人将面临转换运作方式,与其他基金合并、或者终止基金合同等风险。

(6) 基金交易价格与份额净值发生偏离的风险

尽管本基金将通过有效的套利机制使基金份额二级市场交易价格的折溢价控制在一定范围内,基金份额在证券交易所的交易价格受供求关系等众多因素影响,存在不同于基金份额净值的情形,即存在价格折溢价的风险。

(7) 成份券停牌的风险

标的指数成份券可能因各种原因临时或长期停牌,发生成份券停牌时可能面临如下风险:

1) 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。

2) 停牌成份券可能因其权重占比、市场复牌预期、现金替代标识等因素影响本基金二级市场价格的折溢价水平。

3) 若成份券停牌时间较长,在约定时间内仍未能及时买入或卖出的,则该部分款项将按照约定方式进行结算(具体内容见招募说明书“基金份额的申购与赎回”之“申购赎回清单的内容与格式”相关约定),由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4) 在极端情况下,标的指数成份券可能大面积停牌,基金可能无法及时卖出成份券以获取足够的赎回份额,由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施,投资者将面临无法赎回全部或部分ETF份额的风险。

(8) 参考IOPV决策和IOPV计算错误的风险

基金管理人将按照约定方式进行结算(具体内容见招募说明书“基金份额的申购与赎回”之“申购赎回清单的内容与格式”相关约定),由此可能影响投资者的投资损益并使基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

5) 在极端情况下,标的指数成份券可能大面积停牌,基金可能无法及时卖出成份券以获取足够的赎回份额,由此基金管理人可能在申购赎回清单中设置较低的赎回份额上限或者采取暂停赎回的措施,投资者将面临无法赎回全部或部分ETF份额的风险。

(9) 投资人申购失败的风险

如果投资者申购时未能符合要求的申购对价,或者基金管理人根据基金合同的规定拒绝投资者的申购申请,则投资者的申购申请失败。

(10) 投资人赎回失败的风险

如果投资人提出赎回申请时持有的要求的基金份额不足以支付赎回金额,则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金额。

(11) 投资人申购赎回错误的风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错,包括组合证券名、单量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错,投资人利益将受损,申购赎回的正确性将进行重新确认。

(12) 套利风险

鉴于证券市场的交易机制和技术约束,套利完成需要一定的时间,因此套利存在一定风险。同时,买卖一篮子股票和ETF存在冲击成本和交易成本,所以折溢价在一定范围内也不能形成套利。另外,当一篮子股票中存在涨停、跌停、临时停牌等情况时,溢价套利会因成份券无法买入而受影响,折价套利会因成份券无法卖出而受影响。

(13) 申购赎回单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错,包括组合证券名、单量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错,投资人利益将受损,申购赎回的正确性将进行重新确认。

(14) 退市风险

因本基金管理人不能符合证券交易所上市条件被终止上市,或被基金份额持有人大会决议终止上市,基金份额不能继续进行二级市场交易。

(15) 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,由此影响对投资人申购赎回业务的服务。

2) 登记机构可能调整结算制度,对投资者基金份额、组合证券及资金的结算方式发生调整,制度调整可能给投资者带来风险。同样的风险可能还来自于证券期货交易所及其他代理机构。

3) 证券期货交易所、登记机构、基金管理人及其他代理机构可能违约,导致基金合同不能履行。

(16) 申购赎回单差错风险

基金管理人或其指定的发售代理机构在进行网上现金认购的,投资人应按要求准备足额的现金,或者基金管理人根据成份券市值规模变化等因素调整最小申购赎回金额。

(17) 基金收益对价的变现风险

本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。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,投资人变现后的价值与赎回时的赎回对价的价值有差异,存在变现风险。

(18) 赎回金额对价的变现风险

本基金赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额等。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,投资人变现后的价值与赎回时的赎回对价的价值有差异,存在变现风险。

(19) 申购赎回单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错,包括组合证券名、单量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错,投资人利益将受损,申购赎回的正确性将进行重新确认。

(20) 投资者申购赎回单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错,包括组合证券名、单量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错,投资人利益将受损,申购赎回的正确性将进行重新确认。

(21) 投资者申购赎回单差错风险

如果基金管理人提供的当日申购赎回清单内容出现差错,包括组合证券名、单量、现金替代标志、现金替代比率、替代金额等出错,投资人利益将受损,申购赎回的正确性将进行重新确认。

(22) 参与融资融券业务出借证券的风险

本基金可参与转融通证券出借业务,面临的风险包括但不限于:

1) 流动性风险:面临大额赎回时,可能因证券出借原因无法及时变现而发生赎回失败,导致投资人利益受损。

2) 信用风险:证券出借对手方可能无法及时归还证券,无法支付相应权益补偿及债券券款的费用风险;3) 市场风险:证券出借后可能面临出借期间无法及时处置的风险。

(23) 存托凭证的投资风险

本基金投资的存托凭证是基于存托凭证的资产,资产净值的90%,业绩表现将随着标的指数的波动而波动;同时本基金在多数情况下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。

(24) 基金投资的股票型基金的风险

本基金投资的股票型基金,资产净值的90%,业绩表现将随着标的指数的波动而波动;同时本基金在多数情况下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。

(25) 基金投资的混合型基金的风险