

招商中证800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:招商基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
登记机构:中国证券登记结算有限责任公司

二〇二五年九月

重要提示

1. 招商中证800自由现金流交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“招商中证800自由现金流ETF”、“本基金”)的募集已获中国证监会证监许可〔2025〕564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”),托管人为平安银行股份有限公司,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2025年9月23日至2025年10月29日进行发售。投资者可选择网上现金认购、网下现金认购两种方式(本基金暂不开通网下股票认购)。如深圳证券交易所对网上现金认购时间作出调整,本公司将适时相应回应并及时公告。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. 本基金网上现金认购和网下现金认购合计首次募集规模上限为20亿元人民币(不包括募集利息和认购费用)。

本基金募集过程中,网上现金认购和网下现金认购合计首次募集规模接近,达到或超过20亿元人民币的,基金提前募集结束,下一个工作日之后不再接受新的网上现金认购和网下现金认

购。在募集期间任何一天(含第一天)当曰募集截止时间后网上现金认购和网下现金认购合计累计有效认购份额总额超过20亿元(折合为金额20亿元人民币),基金管理人将采取末日比例确认的方式实现规模的有效控制。当发生末日比例确认时,基金管理人将及

时公告比例确认结果及结果,未确认部分的认购款项将在募集结束后退还给投资人。

网上现金认购和网下现金认购合计确认比例=〔20亿元-末日之前网

上现金认购和网下现金认购合计有效认购份额总额〕/末日网上现金认购和网下现金认

购合计有效认购份额总额。

中证指数有限公司在上市后根据申购赎回清单和组合基金内各只证券的实时成交数据,计算基金净值参考值(10PV),并将计算结果向深圳证券交易所发送,由深圳证券交

易所对发布,供投资人交易、申购、赎回基金份额时参考。10PV与实时的基金份额净值可能在差异,10PV计算也可能出现错误,投资人若参考10PV进行投资决策可能导致损失,需由投资人自行承担。

(9) 投资人申购失败的风险

如果投资人申购未能提供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符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金,或者基金投资组合中不具备足额的符合要求的赎回对价,或者基金管理人根据基金合同的的规定拒绝投资者的赎回申请,则投资者的赎回申请失败。基金管理人可根据基金份额规模变化的因素调整最小申购赎回单位,由此可能导致投资人按原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,而只能在二级市场卖出全部赎回基金份额。

(11) 基金赎回对价的变现风险

本基金赎回对价包括现金替代、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,部分成份股流动性差等因素,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。

(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

投资人操作失误而失败,折价套利会因成份股无法卖出而受影响。

(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出现差错,包括组合证券名单、数量、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,申购赎回的正常进行将受影响。

(14) 退市风险

因本基金不再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提前终止上市,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各种原因,导致代理申购、赎回业务受到限制、暂停或终止,由此影响对投资者申购赎回业务的影响。

(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

变化,制度调整可能给投资者带来风险。同样的风险还可能来自于证券、期货交易所及其他

代理机构。

(3) 证券、期货交易所、登记机构、基金托管人及其他代理机构可能违约,导致基金或投

资人无法赎回。

(16) 申购赎回单标示设置风险

基金管理人在进行申购赎回单的现金替代标识设置时,将充分考虑由此引发的市场

套利等行为对基金持有人可能造成的影响。但基金管理人不能保证极端情况下申购赎回

回单标示设置的完全合理性。

(17) 基金收益分配后基金份额净值低于面值的风险

当本基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时,基于本基金的特

点,本基金收益分配无法以弥补亏损为前提,收益分配后可能存在基金份额净值低于面值

的风险。投资人应及时查询并妥善行使表决权,否则,由此产生的投资者任何损失由投资者

自行承担。

(18) 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《招商中证800自由现金流交易型开放式指

数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”),《招商中证800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”)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公告将同时刊登在《中国证券报》。

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照各发售代

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

(1) 证券投资资金(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

风险,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不仅于银行储蓄和债券等能够提供固定收益的金融工具。投资人购买基金,既可能按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面临的损失。

(2) 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

金的预期收益越高,投资人承担的风险也越大。本基金属于股票型基金,其预期收益将远

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

券,具有与标的指数相似的风险收益特征。

(3) 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,投资人投资于本基金前,应全面了解

本基金的特性,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、基金额管理风险、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) 指数波动的风险

本基金投资于标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

股票市场下跌的情况下,可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

(2) 基数波动的风险

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。

(3) 基数指数计算出错的风险

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。届时本基金的风险特征可能发生变化,自投资组合调整可能产生交易成

本。投资人须承担因标的指数变更而产生的风险与成本。

(4) 基金投资组合回报与标的指数回报的偏离风险

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) 基数成份券现金红利、送配等所获收益导致基金收益率偏离的指数收益率,从而

产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3) 由于成份股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。

4) 基金投资组合的平均交易成本,以及基金管理费和基金托管费等,可能导致基金

在跟踪指数时收益上的偏离。

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) 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

差异可能产生的偏差。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

收益率将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,投资人投资于本基金前,应全面了解

本基金的特性,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、基金额管理风险、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) 指数波动的风险

本基金投资于标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

股票市场下跌的情况下,可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。

(2) 基数成份券现金红利、送配等所获收益导致基金收益率偏离的指数收益率,从而

产生跟踪偏离度和跟踪误差。

3) 由于成份股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。

4) 基金投资组合的平均交易成本,以及基金管理费和基金托管费等,可能导致基金

在跟踪指数时收益上的偏离。

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) 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

差异可能产生的偏差。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

收益率将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,投资人投资于本基金前,应全面了解

本基金的特性,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、基金额管理风险、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) 指数波动的风险

本基金投资于标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

股票市场下跌的情况下,可能面临基金净值与标的指数同步下跌的风险。