

招商上证科创板综合价格指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告

重要提示

1. 招商上证科创板综合价格指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)的发售已获中国证监会证监许可[2025]119号文准予注册。

2. 本基金类型为股票型证券投资基金。

3. 本基金的管理人为招商基金管理有限公司(以下简称“招商基金”或“本公司”),托管行为交通银行股份有限公司,登记机构为招商基金管理有限公司。

4. 本基金自2025年11月10日至2025年11月28日具体办理业务时间见各销售机构的相关公告或拨打客户服务电话咨询)通过直销机构公开发售。基金管理人根据认购的情况可适当调整募集时间,并及时公告,但最长不超过法定募集期限。

5. 本基金的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,发起资金提供方以及法律法规规定或中国证监会允许购买本基金的其他投资人。

6. 本基金的投资机构包括直销机构和非直销销售机构。

7. 投资者欲购买本基金,需开立登记机构提供的基金账户。发行体内公司、本公司直销柜台及网站为投资者办理开户和认购手续,除法律法规另有规定外,一个投资者只能开设和使用一个基金账户。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。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、合约上或其他障碍,投资者不得使用贷款、融资券等筹集的非自有资金投资本基金。

8. 投资人在基金募集期内可以多次认购基金份额,A类基金份额的认购费按每笔认购申请单独计算,认购申请一经受理不得撤销。投资人通过非直销销售机构认购,单个基金账户首次单笔最低认购金额为1元(含认购费),追加认购单笔最低金额为1元(含认购费),具体认购金额由各非直销销售机构制定和调整。通过本基金管理人官网直销平台认购,单个基金账户首次单笔最低认购金额为1元(含认购费),追加认购单笔最低金额为1元(含认购费)。通过本基金管理人直销柜台认购,单个基金账户的首次单笔最低认购金额为50万元(含认购费),追加认购单笔最低金额为1元(含认购费)。

9. 基金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行使法律权利。

10. 投资者如欲购买款项在募集期间持有的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有,其中利息折算的具体额度以登记机构的记录为准。

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《招商上证科创板综合价格指数增强型发起式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相关说明书中特别列明的条款,请参见刊登在中国证券报。

12. 本基金的招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站(www.cmfchina.com)。投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金发售的有关事宜。

13. 非直销销售机构的销售网点以及开户和认购等事项详见各非直销销售机构在各销售城市主要媒介刊登的公告或在各销售网点公布的公告。对于未开设销售网点地区的投资者,可拨打各公司的客户服务电话(400-887-9655)垂询认购事宜。

14. 在发售期间,基金管理人可根据有关法律法规规定调整销售机构,并在基金管理人网站公示。销售机构可以根据情况变化增减或者减少其销售网点、网站。请留意本公司网站公示及各非直销销售机构的公告,或拨打本公司及各非直销销售机构客户服务电话咨询。

15. 本公司会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

(1) 本基金投资于股票型基金(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,降低单一投资品种所带来的个别风险。基金不同于银行存款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。基金在投资过程中可能面临各种风险,既包括市场风险,也包括自身的管理风险,技术风险和合规风险等。

(2) 巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个开放日基金的净赎回申请超过上一日基金总份额的百分之十时,投资人可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

(3) 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,投资人对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。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书、基金定期报告等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,并根据自身的投资目的、投资风格、投资经验、资产状况判断基金是否适合投资人承受风险能力。

(4) 本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场价格波动等因素而发生波动,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,理性选择投资市场,并承担基金投资中出现的各种风险,包括:因整体政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险;个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资人连续大量购入基金产生的流动性风险,投资者申购、赎回失败的风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等。

本基金的具体运作特点详见基金合同和招募说明书的约定。本基金的一般风险及特定风险详见招募说明书的“风险揭示”部分。

本基金的特定风险包括:

1) 指数回报与股票市场平均回报偏高的风险

标的指数并不能完全代表整个股票市场。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差。

2) 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。

3) 基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险

由于标的指数调整成份股或变更编制方法,标的指数成份股发生配股或增发等行为导致成份股在标的指数中的权重发生变动,成份股派发现金红利、新股上市配售、成份股停牌、流动性差等原因使本基金无法及时调整投资组合以及与基金运作相关的费用等因素使本基金产生跟踪偏离度和跟踪误差。

4) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争控制本基金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%,年化跟踪误差不超过0.8%,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。

5) 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和管理,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服务,本基金将根据基金合同的约定在此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,基金合同份额持有人大会无法召开或表决未通过的,基金合同将终止。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,或者终止基金合同的风险。

6) 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和管理,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服务,本基金将根据基金合同的约定在此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,基金合同份额持有人大会无法召开或表决未通过的,基金合同将终止。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,或者终止基金合同的风险。

7) 市场指数变更的风险

根据基金合同的约定,因标的指数的编制与发布等原因,导致原标的指数不宜继续作为本基金的标的指数及业绩比较基准,本基金可能变更其他的指数,基金的投资组合及调整,基金收益风险特征可能发生变化,投资人需承担投资组合所带来风险的变化及成本。

8) 主动增强投资的风险

根据本基金的投资目标和投资策略,为了获得超越指数的投资回报,可以在被动跟踪指数的基础上进行一些优化调整,如在一定幅度内降低或提高成份股的权重、替换或者增加一些非成份股。调整投资组合的决策存在一定的不确定性,其投资收益率可能高于指数组合收益但也有可能低于指数组合收益。

9) 契税风险

本基金可投资港股通股票,在交易时间内提交订单但未被确认的港股买入参考汇率和卖出参考汇率,并不等于最终结算汇率。港股通交易日终,中国证券登记结算有限责任公司进行盘后换汇,将换汇成本以成交金额分摊至每笔交易,确定交易实际使用的结算汇率。故本基金投资面临汇率风险。

10) 端外市场的风险

本基金将通过内地与香港股票市场交易互联互通机制投资于香港市场,在市场进入、投资额度、可投资对象、交易规则、税费政策等方面都有一定的限制,而且此类限制可能会影响投资,这些限制因素可能对本基金进入或退出当地市场造成障碍,从而对投资收益以及正常的申购赎回产生直接或间接的影响。

11) 港股通股票交易风险,特别是对于买卖深股通股票的投资者,可能面临以下特殊风险:

A.香港市场证券交易规则与内地股票交易规则,可能对买卖深股通股票的投资者造成不利影响。

B.只有内地和香港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;

C.香港出现台风、黑色暴雨或者联合声明规定的其他情形时,联交所将可能暂停、投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险;出现内地交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时,内地交易所证券交易服务公司将可能暂停提供或者全部暂停港股股票交易,投资者将面临暂停或恢复期间无法进行港股通交易的风险;

D.投资者因港股通股票交易分派、转换、上市公司的收购等情况或者异常情况,所取得的港股通股票以外的联交所上市证券,只能通过港股通卖出,但不得买入,交易所另有规定的除外;因港股通股票交易分派或者转换等情况取得的联交所上市股票的认购权在联交所上市的,可以通过港股通卖出,但不得买入;因港股通股票交易分派、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者卖出;

E.代理投票。由于中国结算是在汇总投资者意愿后再向香港结算提交投票意愿,中国结算对投资者设置的定期申报机制的定期到期后就结束;投票没有权益登记日的,以投票截止日的持有作为计算基准;投票数量超出持有量的,按照比例分配持有基数,以投票所处的因素可能会给本基金带来特殊交易风险。

F.港股通股票买卖保证金制度,由于保证金交易具有杠杆性,当出现不利行情时,股价指数较小的变动就可能会使投资者权益遭受较大损失。港股通采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

G.国债期货采用保证金交易制度,由于保证金交易具有杠杆性,当相应期限国债收益率出现不利变动时,可能会导致投资人权益遭受较大损失。国债期货采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

H.本基金参与股票期权交易,由于股票期权交易具有杠杆性,当相应期限股票期权收益率出现不利变动时,可能会导致投资人权益遭受较大损失。股票期权采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

I.本基金参与股票期权交易,由于股票期权交易具有杠杆性,当相应期限股票期权收益率出现不利变动时,可能会导致投资人权益遭受较大损失。股票期权采用每日无负债结算制度,如果没有在规定的时间内补足保证金,按规定将被强制平仓,可能给投资带来重大损失。

J.本基金投资的资产支持证券,可能带来以下风险:

①信用风险:基金所投资的资产支持证券之债务人出现违约,或在交易过程中发生交

基金管理人:招商基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
登记机构:招商基金管理有限公司

收违约,或由于资产支持证券信用质量降低导致证券价格下降,造成基金财产损失。

②利率风险:市场利率波动会直接影响资产支持证券的收益率和价格的变动,一般而言,如果市场利率上升,本基金持有资产支持证券将面临价格下降、本金损失的风险,而如果市场利率下降,资产支持证券的再投资收益将面临下降的风险。

③流动性风险:受资产支持证券市场规模及交易活跃程度的影响,资产支持证券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出,存在一定的流动性风险。

④提前偿付风险:债务人可能会由于利率变化等原因进行提前偿付,从而使基金资产面临损失。

⑤参与融资和转融通证券出借业务的风险

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双方交易风险等融资业务的风险。

⑥存托凭证的风险

本基金的投资范围包括存托凭证,可能面临存托凭证价格大幅波动甚至出现较大亏损的风险,以及与存托凭证发行机制相关的风险,包括存托凭证持有人与境外基础证券发行人之间的法律地位,享有权利等方面存在差异可能引发的风险;存托凭证持有人在分红派息、行使表决权等方面的特殊安排可能引发的风险;存托凭证持有人与境外基础证券发行人的关系,以及存托凭证持有人能否有效行使相关权利的风险。

⑦债券回购风险

债券回购为提升基金组合收益提供了可能,但也存在一定的风险。例如:回购交易中,交易对手在回购到期时不能偿还全部或部分证券或价款,造成基金资产损失的风险;回购利率高于债券投资收益而带来的风险;由于回购操作导致投资总收益放大,进而放大基金组合的风险;回购对手可能无法及时归还证券、无法支付应付补偿及借用券费用的风险;⑧定期报告披露风险

⑨定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑩定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑪定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑫定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑬定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑭定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑮定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑯定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑰定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑱定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑲定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

⑳定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉑定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉒定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉓定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉔定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉕定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉖定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉗定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉘定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉙定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉚定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉛定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉜定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉝定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉞定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉟定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等的不确定,可能会影响基金资产的估值。

㉟定期报告披露风险:本基金定期报告披露的时间等