

招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)基金份额发售公告

二〇二一年十一月

重要提示

- 1、招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金(QDII)(以下简称“招商中证香港科技ETF(QDII)”、“本基金”)的募集已获中国证监会证监许可〔2021〕1611号文批准。
- 2、本基金是交易型开放式指数证券投资基金。
- 3、本基金的管理人为招商基金管理有限公司(以下简称“本公司”),托管人为中国银行股份有限公司,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2021年11月5日至2021年12月23日进行发售。投资者可选择网上现金认购和网下现金认购两种方式。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利用深圳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人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。
- 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”)。
已有深圳证券账户的投资人不必再办理开户手续。
尚无深圳证券账户的投资人,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深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券账户的开户手续。有关开设深圳证券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。

如投资者需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳 A 股账户或深圳证券交易所证券投资基金账户；深圳证券交易所证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。

已购买过由本公司担任登记机构的基金的投资者，其拥有的本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。投资人在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。投资人在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。

9、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。

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行使合法权利。

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《招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）基金合同》（以下简称“基金合同”）、《招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）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《上海证券报》。

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)。

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

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。当投资人赎回时，所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如对本招募说明书有任何疑问，应寻求独立及专业的财务意见。

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。本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金、货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证香港科技指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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%。本基金投资于境内外证券市场，基金净值会因为境内外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，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、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，流动性风险，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）投资于境内外市场并以 ETF 方式运作的风险

本基金为境内募集和上市交易、投资于境内外证券市场、跟踪特定指数的交易型开放式指数基金，涉及到境内外多个证券市场（目前本基金投资的证券市场主要包括上海证券交易所、深圳证券交易所、香港证券交易所），境外证券交易所、期货交易所、证券与期货登记机构的交易规则、业务规则和市场惯例与境内有较大差异，基金管理人和相关市场参与主体涉及跨境业务的处理能力、经验、系统等有待验证，从而导致本基金的运作可能受到影响而带来风险。

（2）投资港股通标的股票的风险

本基金将会投资于法律法规规定范围内的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) 汇率风险

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。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。

2) 香港市场风险

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。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。

3) 香港交易市场制度或规则不同带来的风险

香港市场交易规则有别于内地 A 股市场规则，在“内地与香港股票市场交易互联互通机制”下参与香港股票投资还将面临包括但不限于如下特殊风险：

a) 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，因此每日涨跌幅空间相对较大；

b) 只有内地与香港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、黑色暴雨或者香港联合交易所规定的其他情形时，香港联合交易所将可能停市，投资者将面临在停市期间无法进行港股通交易的风险；出现内地证券交易所证券交易服务公司认定的交易异常情况时，内地证券交易所证券交易服务公司可能暂停提供部分或者全部港股通服务，投资者将面临在暂停服务期间无法进行港股通交易的风险。

d) 交收制度带来的基金流动性风险

由于香港市场实行 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）才能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，而造成支付赎回替代款日期比正常情况延后而给投资者带来流动性风险，同时也存在不能及时调整基金资产组合中港股投资比例，造成比例超标的风险。

e) 香港联合交易所停牌、退市等制度性差异带来的风险

香港联合交易所规定，在交易所认为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，香港联合交易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，在香港联合交易所市场没有风险警示板，香港联合交易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，使得香港联合交易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。

4) 港股通制度限制或调整带来的风险

a) 港股通额度限制

现行的港股通规则，对港股通设有每日额度上限的限制；本基金可能因为港股通市场每日额度不足，在香港联合交易所开市前阶段，新增的买单申报将面临失败的风险；在香港联合交易所持续交易时段或者收市竞价交易时段，当日本基金将面临不能通过港股通进行买入交易的风险。

b) 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具体的可投资标的进行调整，对于调出在投资范围的港股，只能卖出不能买入；本基金可能因为港股通可投资标的范围的调整而不能再进行调出港股的买入交易风险及股价波动风险。

c) 港股通交易日设定的风险

根据现行的港股通规则，只有内地与香港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（如内地市场因放假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），而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而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。

d) 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标的股票权益分派、转换、上市公司被收购等情形或者异常情况，所取得的港股通标的股票以外的香港联合交易所上市证券，只能通过港股通卖出，但不得买入；因港股通标的股票权益分派或者转换等情形取得的香港联合交易所上市股票的认购权利在香港联合交易所上市的，可以通过港股通卖出，但不得行权；因港股通标的股票权益分派、转换或者上市公司被收购等所取得的非香港联合交易所上市证券，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。

e) 代理投票

由于中国证券登记结算有限责任公司是在汇总投资者意愿后再向香港中央结算有限公司提交投票意愿，中国证券登记结算有限责任公司对投资者设定的意愿征集期比香港中央结算有限公司的征集期稍早结束；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；投票数量超出持有数量的，按照比例分配持有基数。

5) 法律和政治风险

由于香港市场适用不同法律法规的原因，可能导致本基金的某些投资行为受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失的可能性。此外，香港市场可能会不时采取某些管制措施，如资本或外汇管制、没收资产以及征收高额税收等，从而对基金收益以及基金资产带来不利影响。

6) 会计制度风险

香港市场对上市公司日常经营活动的会计处理、财务报表披露等会计核算标准的规定可能与境内存在一定差异，可能导致基金经理对公司盈利能力、投资价值的判断产生偏差，从而给本基金投资带来潜在风险。

7) 税务风险

香港市场在税务方面的法律法规可能与境内存在一定差异，可能会要求基金就股息、利息、资本利得等收益向当地税务机构缴纳税金，该行为会使基金收益受到一定影响。

此外，香港市场的税收规定可能发生变化，或者实施具有追溯力的修订，从而导致基金向该市场所在地缴纳在基金销售、估值或者出售投资当日并未预计的额外税项。

(3) 指数下跌风险

本基金采取指数化投资策略，被动跟踪标的指数。当指数下跌时，基金不会采取防守策略，由此可能对基金资产价值产生不利影响。

(4) 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，甚至导致跟踪误差控制未达约定目标：

- 1) 基金有投资成本、各种费用及税收，而指数编制不考虑费用和税收，这将导致基金收益率落后于标的指数收益率，产生负的跟踪偏离度。
- 2) 指数成份券派发现金红利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) 当标的指数调整成份券构成，或成份券公司发生配股、增发等行为导致该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停牌或流动性差等情形时，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，都会对基金收益产生影响，从而影响基金跟踪偏离度和跟踪误差。
- 6) 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相同；因指数发布机构指数编制错误等产生的跟踪偏离度与跟踪误差。

(5) 跟踪误差控制未达约定目标的风险

本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.3%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离。

(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内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。但若标的指数及业绩比较基准变更对基金投资无实质性影响（包括但不限于编制机构变更、指数更名等），基金管理人可在履行适当程序后变更标的指数和业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告。

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。

(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额的符合要求的赎回对价，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

基金管理人或者基金管理人委托其他机构计算并通过证券交易所发布基金份额参考净值（IOPV），供投资者交易、申购、赎回基金份额时参考。由于计算公式、汇率数据来源及来源时间不同，IOPV 与实时的基金份额净值可能存在差异，与投资者申购赎回的实际结算价格也可能存在差异，IOPV 计算还可能出现错误，投资者若参考 IOPV 进行投资决策可能导致损失，需投资者自行承担。

（9）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。

（10）基金份额赎回对价的变现风险

本基金赎回对价目前包括现金替代、现金差额及其他对价。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。

（11）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使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。

（12）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政策可能改变，投资组合需随之调整，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风险与成本。

（13）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，由此影响对投资者申购赎回服务的风险。

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理解偏差的风险。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。

4) 本基金的标的指数由指数编制机构提供。基金管理人无法确保相关指数的持续可用性。倘若指数编制机构停止服务(包括指数编制机构终止必要的许可等情形), 本基金将在履行适当程序后更换标的指数或终止基金合同。

(14) 基金份额二级市场交易价格折溢价的风险

尽管本基金的运作力求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但基金份额在证券交易所的交易价格受诸多因素影响, 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。

此外, 本基金规模受到外汇额度的限制, 如继续接受申购可能导致突破国家外管局批准的外汇额度时, 本基金将暂停申购, 可能会因为一级市场基金份额供给不足而导致二级市场出现折溢价现象, 后续因国家外管局批准基金管理人新增外汇额度以及本基金恢复申购业务而可能使得该折溢价现象有所收敛, 上述折溢价的变化可能导致本基金二级市场交易价格出现较大波动。

(15) 投资资产支持证券风险

本基金的投资范围包含资产支持证券, 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: 市场利率波动会导致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, 资产支持证券利息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再投资风险。

(16) 投资股指期货风险

本基金投资于股指期货。投资于股指期货需承受市场风险、信用风险、流动性风险、操作风险和法律风险等。由于股指期货通常具有杠杆效应，价格波动比标的工具更为剧烈，有时候比投资标的资产要承担更高的风险。并且由于股指期货定价复杂，不适当的估值有可能使基金资产面临损失风险。股指期货采用保证金交易制度，由于保证金交易具有杠杆性，当出现不利行情时，股价指数微小的变动就可能会使投资人权益遭受较大损失。股指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，可能给投资带来损失。

(17) 投资国债期货风险

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。

(18) 投资股票期权风险

本基金参与股票期权交易以套期保值为主要目的，投资股票期权的主要风险包括价格波动风险、市场流动性风险、强制平仓风险、合约到期风险、行权失败风险、交易违约风险等。影响期权价格的因素较多，有时会出现价格较大波动，而且期权有到期日，不同的期权合约又有不同的到期日，若到期日当天没有做好行权准备，期权合约就会作废，不再有任何价值。此外，行权失败和交收违约也是股票期权交易可能出现的风险，期权义务方无法在较首日备齐足额资金或证券用于交收履约，会被判为交收违约并受罚，相应地，行权投资者就会面临行权失败而失去交易机会。

(19) 参与融资及转融通证券出借业务的风险

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发生无法及时变现支付赎回对价的风险；（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借券费用的风险；（3）市场风险：证券出借后可能面临出借期间无法及时处置证券的市场风险。

此外，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手方交易风险等融资业务特有风险。

(20) 存托凭证的投资风险

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的股东在法律地位、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；存托协议自动约束存托凭证持有人的风险；因多地上市造成存托凭证价格差异以及波动的风险；存托凭证持有人权益被摊薄的风险；存托凭证退市的风险；已在境外上市的基础证券发行人，在持续信息披露监管方面与境内可能存在差异的风险；境内外法律制度、监管环境差异可能导致的其他风险。

(21) 操作或技术风险

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、期货交易所、证券、期货登记机构等等。

(22) 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。

(23) 引入境外托管人的风险

基金由境外托管人提供境外资产托管服务，存在因适用法律不同导致基金资产损失的风险：由于境外所适用法律法规与中国法律法规有所不同的原因，可能导致本基金的某些投资及运作行为在境外受到限制或合同不能正常执行，从而使得基金资产面临损失风险。

本基金法律文件风险收益特征表述与销售机构基金风险评价可能不一致的风险。

本基金法律文件投资章节有关风险收益特征的表述是基于投资范围、投资比例、证券市场普遍规律等做出的概述性描述，代表了一般市场情况下本基金的长期风险收益特征。销售机构（包括直销机构和其他销售机构）根据相关法律法规对本基金进行风险评价，不同的销售机构采用的评价方法也不同，因此销售机构的风险等级评价与基金法律文件中风险收益特征的表述可能存在不同，投资人在购买本基金时需按照销售机构的要求完成风险承受能力与产品风险之间的匹配检验。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的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》、《基金合同》、《基金产品资料概要》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。

基金管理人建议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线（4008879555），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。在对自己的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况、收益预期和风险承受能力等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。

基金管理人提请投资人特别注意，因基金份额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。

一、本次基金发售的基本情况

（一）基金名称

招商中证香港科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）

（二）基金简称

基金简称：招商中证香港科技 ETF（QDII）

场内简称：香港科技 50ETF

基金代码：159750

（三）基金的类别

股票型证券投资基金、指数基金、QDII 基金

（四）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。

本基金的发售币种为人民币，基金管理人可以在不违反法律法规且对基金份额持有人无实质性不利影响的前提下，增加新的销售币种，该事项无须召开基金份额持有人大会，相关业务规则届时由基金管理人确定并提前公告。

(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。

(九) 基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构

招商基金管理有限公司

2、网下现金认购的发售代理机构

具体名单详见本公告“八、本次发售当事人或中介机构（三）基金份额发售机构 2、网下现金认购的发售代理机构”。

3、网上现金认购的发售代理机构

网上现金发售代理机构为具有基金销售业务资格的深圳证券交易所会员单位，具体名单详见本公告“八、本次发售当事人或中介机构（三）基金份额发售机构 3、网上现金认购的发售代理机构”。

（十）募集时间安排与基金合同生效

本基金自 2021 年 11 月 5 日至 2021 年 12 月 23 日进行发售。投资者可选择网上现金认购和网下现金认购两种方式。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并及时公告。

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，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，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。

（十一）募集期利息的处理方式

基金募集期间募集的资金应当存入专门账户，在募集行为结束前，任何人不得动用。有效认购款项在募集期间产生利息的处理方式在招募说明书中列示。

二、基金的认购费用

（一）认购费用

认购费用由投资人承担，认购费率如下表所示：

基金管理人办理网下现金认购时按照上表所示费率收取认购费用。发售代理机构办理网上现金认购、网下现金认购时可参照上述费率结构，按照不超过认购份额 0.8%的标准收取一定的佣金。投资者申请重复现金认购的，须按每笔认购申请所对应的费率档次分别计费。

本基金认购费用由认购人承担，不列入基金财产，主要用于本基金募集期间发生的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

基金管理人可以针对特定投资人（如养老金客户等）开展网下现金认购的费率优惠活动，详见基金管理人届时发布的相关公告。

（二）认购费用计算公式与收取方式

1、通过发售代理机构进行网上现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购佣金、认购金额的计算公式为：

认购佣金 = 认购价格 × 认购份额 × 佣金比率

（若适用固定费用的，认购佣金 = 固定费用）

认购金额 = 认购价格 × 认购份额 × (1 + 佣金比率)

（若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 × 认购份额 + 固定费用）

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

总认购份额 = 认购份额 + 利息折算的份额

认购佣金由发售代理机构收取，投资人需以现金方式交纳认购佣金。

网上现金认购的有效认购款项在募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，利息和具体的份额以登记机构的记录为准。利息折算份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足 1 份的部分归入基金资产。

例：某投资人通过某发售代理机构采用现金方式认购 100,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.8%，认购资金在募集期间产生的利息为 2.00 元，则需准备的认购资金金额及募集期间利息折算的份额计算如下：

认购佣金 = $1.00 \times 100,000 \times 0.8\% = 800.00$ 元

认购金额 = $1.00 \times 100,000 \times (1 + 0.8\%) = 100,800.00$ 元

利息折算份额 = $2.00 / 1.00 = 2$ 份

总认购份额 = $100,000 + 2 = 100,002$ 份

即：某投资人通过某发售代理机构采用现金方式认购 100,000 份本基金，假设该发售代理机构确认的佣金比率为 0.8%，认购资金在募集期间产生的利息为 2.00 元，该投资人需准备 100,800.00 元资金，加上认购资金在募集期间产生的利息折算的份额后，一共可以得到 100,002 份本基金基金份额。

2、通过基金管理人进行网下现金认购的投资人，认购以基金份额申请，认购费用、认购金额的计算公式为：

认购费用 = 认购价格 \times 认购份额 \times 认购费率

(若适用固定费用的，认购费用 = 固定费用)

认购金额 = 认购价格 \times 认购份额 \times (1 + 认购费率)

(若适用固定费用的，认购金额 = 认购价格 \times 认购份额 + 固定费用)

利息折算的份额 = 利息 / 认购价格

总认购份额 = 认购份额 + 利息折算的份额

认购费用由基金管理人在投资者认购时收取，投资者需以现金方式交纳认购费用。

网下现金认购的有效认购款项在募集期产生的利息将折算为基金份额归基金份额持有人所有，利息和具体的份额以基金管理人的记录为准。利息折算份额的计算采用截尾法保留至整数位，不足 1 份的部分归入基金资产。

例：某投资人（非特定投资人）通过基金管理人采用现金方式认购 50,000 份本基金，假设认购资金在募集期间产生的利息为 1.00 元，则需准备的认购资金金额及募集期间利息折算的份额计算如下：

$$\text{认购费用} = 1.00 \times 50,000 \times 0.8\% = 400.00 \text{ 元}$$

$$\text{认购金额} = 1.00 \times 50,000 \times (1 + 0.8\%) = 50,400.00 \text{ 元}$$

$$\text{利息折算份额} = 1.00 / 1.00 = 1 \text{ 份}$$

$$\text{总认购份额} = 50,000 + 1 = 50,001 \text{ 份}$$

即：某投资人（非特定投资人）通过基金管理人采用现金方式认购 50,000 份本基金，假设认购资金在募集期间产生的利息为 1.00 元，该投资人需准备 50,400.00 元资金，加上认购资金在募集期间产生的利息折算的份额后，一共可以得到 50,001 份本基金基金份额。

通过发售代理机构进行网下现金认购的认购金额的计算与通过发售代理机构进行网上现金认购的认购金额的计算相同。

三、投资者开户

（一）账户的开立

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”）。

已有深圳证券账户的投资人不必再办理开户手续。

尚无深圳证券账户的投资人，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深圳分公司的开户代理机构办理深圳证券账户的开户手续。有关开设深圳证券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。

（二）账户使用注意事项

- 1、如投资者需要参与网下现金或网上现金认购，应使用深圳 A 股账户或深圳证券投资基金账户；深圳证券投资基金账户只能进行本基金的现金认购和二级市场交易。
- 2、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者，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。

四、网上现金认购的程序

(一) 业务办理时间：

2021 年 11 月 5 日至 2021 年 12 月 23 日上午 9:30-11:30 和下午 1:00-3:00 (周六、周日和节假日不受理)。

(二) 认购手续：

投资者直接通过发售代理机构办理认购。

- 1、开立深圳证券交易所 A 股账户或证券投资基金账户。
- 2、在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。
- 3、投资者网上现金认购流程、需提交的文件等应遵循代理发售机构及深圳证券交易所的有关规定。

五、网下现金认购的程序

(一) 直销机构

1、业务办理时间：2021 年 11 月 5 日至 2021 年 12 月 23 日的 9:00-16:00 (当日 16:00 之后的委托将作废，需于下一工作日重新提交申请，周六、周日、节假日不受理申请)。

2、认购手续：

(1) 投资者通过基金管理人办理网下现金认购手续时须提交如下资料：

- 1) 个人投资者提供身份证件原件及复印件；
- 2) 机构投资者提供企业营业执照正本或副本原件及加盖单位公章的复印件；事业法人、社会团体或其他组织提供民政部门或主管部门颁发的注册登记证书原件及加盖单位公章的复印件；法定代表人授权委托；业务经办人有效身份证件原件及复印件（身份证、军人证或护照）；
- 3) 深圳证券交易所 A 股账户卡或证券投资基金账户卡（原件和复印件）；
- 4) 盖银行受理章的汇款凭证回单原件及复印件；
- 5) 填写《招商旗下基金（ETF）网下现金认购申请表》（一式两份（原件））；
- 6) 《招商旗下基金（ETF）网下认购业务授权委托书》；
- 7) 《ETF 基金网下认购客户信息登记表》；
- 8) 《ETF 基金网下认购投资者风险识别能力和承受能力调查问卷/信息收集表》；
- 9) 本公司直销柜台要求提供的其他有关材料。

(2) 投资者应在办理认购申请当日下午 16:30 之前，将足额认购资金（含手续费）汇入本公司指定的任一直销专户。本公司的直销专户如下：

深圳直销账户 ---- 账户一：

户名：招商基金管理有限公司 - 直销专户

开户行：招商银行股份有限公司深圳总行大厦营业部

账号：813189188810001

深圳直销账户 ---- 账户二：

户名：招商基金管理有限公司

开户行：工商银行深圳分行喜年支行

账号：4000032419200009325

深圳直销账户 ---- 账户三:

户名：招商基金管理有限公司

开户行：中国银行深圳分行福田支行

账号：756257923700

北京直销账户：

户名：招商基金管理有限公司 - 直销专户

账号：860189209810001

开户行：招商银行北京分行

上海直销账户：

户名：招商基金管理有限公司 - 直销专户

账号：216089179510001

开户行：招商银行上海分行

(3) 注意事项：

- 1) 投资者在银行填写划款凭证时, 请注明购买的基金名称和基金代码;
- 2) 若投资者的认购资金在认购申请当日 16:30 之前未到本公司指定的直销资金专户, 则以资金到账日作为受理申请日(即有效申请日);
- 3) 投资者在认购时不能使用招商基金管理公司的开放式基金账户, 而需使用深圳证券交易所 A 股账户卡或证券投资基金账户卡;
- 4) 为了保证客户资金及时准确入账, 建议投资者将加盖银行业务章的转账汇款回单复印件传真至我公司客户服务部直销柜台:(0755) 83196360、83199266;
- 5) 投资者若未按上述规定划付款项, 造成认购无效的, 招商基金管理有限公司及直销网点清算账户的开户银行不承担任何责任。

(二) 发售代理机构

1、业务办理时间: 2021 年 11 月 5 日至 2021 年 12 月 23 日, 具体业务办理时间以各发售代理机构的规定为准。

2、认购手续:

- (1) 开立深圳 A 股账户或证券投资基金账户。
- (2) 按发售代理机构的规定, 在认购前向资金账户中存入足够的认购资金。
- (3) 投资者可通过填写认购委托单, 同时填写委托该发售代理机构代为办理网下现金认购的委托申请书。

具体认购手续以各发售代理机构的规定为准。

六、清算与交割

- (一) 本基金权益由登记结构在发售结束后完成过户登记。
- (二) 网上现金认购、网下现金认购的有效认购资金在募集期间产生的利息, 将折算为基金份额归投资人所有, 其中利息转份额的具体数额以基金管理人及登记机构的记录为准。

七、基金的验资与基金合同生效

(一) 基金备案的条件

本基金自基金份额发售之日起 3 个月内，在基金募集份额总额不少于 2 亿份，基金募集金额不少于 2 亿元人民币且基金认购人数不少于 200 人的条件下，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，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。

(二) 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 日内退还投资人已缴纳的款项，并加计银行同期活期存款利息。
- 3、如基金募集失败，基金管理人、基金托管人及发售代理机构不得请求报酬。基金管理人、基金托管人和发售代理机构为基金募集支付之一切费用应由各方各自承担。

八、本次发售当事人或中介机构

(一) 基金管理人

名称：招商基金管理有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

设立日期：2002 年 12 月 27 日

注册资本：人民币 13.1 亿元

法定代表人：王小青

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

电话：(0755) 83199596

传真：(0755) 83076974

联系人：赖思斯

(二) 基金托管人

名称：中国银行股份有限公司

住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

首次注册登记日期：1983 年 10 月 31 日

注册资本：人民币贰仟玖佰肆拾叁亿捌仟柒佰柒拾玖万壹仟贰佰肆拾壹元整

法定代表人：刘连舸

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字【1998】24 号

托管部门信息披露联系人：许俊

传真：(010) 66594942

中国银行客服电话：95566

(三) 基金份额发售机构

1、网下现金发售直销机构

地址：广东省深圳市福田区深南大道 7028 号时代科技大厦 7 层招商基金客户服务部直销柜台

电话：(0755) 83196359

传真：(0755) 83196360

备用传真：(0755) 83199266

联系人：冯敏

2、网下现金认购的发售代理机构

暂无。基金管理人可根据实际情况变更网下现金认购的发售代理机构，并予以公告。

3、网上现金认购的发售代理机构

投资者可直接通过以下具有基金销售业务资格及深圳证券交易所会员资格的证券公司办理网上现金认购业务（排序不分先后）：

爱建证券、安信证券、渤海证券、财达证券、财通证券、财信证券、长城证券、长江证券、川财证券、大通证券、大同证券、德邦证券、第一创业、东北证券、东方财富、东方证券、东海证券、东莞证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、方正证券、光大证券、广发证券、国都证券、国海证券、国金证券、国开证券、国联证券、国融证券、国盛证券、国泰君安、国信证券、国元证券、海通证券、恒泰证券、红塔证券、宏信证券、华安证券、华宝证券、华创证券、华福证券、华金证券、华林证券、华龙证券、华融证券、华泰证券、华西证券、华鑫证券、江海证券、金元证券、九州证券、开源证券、联储证券、民生证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、山西证券、上海证券、申万宏源证券、申万宏源西部证券、世纪证券、首创证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、万联证券、网信证券、五矿证券、西部证券、西南证券、长城国瑞、湘财证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、银泰证券、英大证券、甬兴证券、粤开证券、招商证券、浙商证券、中航证券、中金财富、中金公司、中山证券、中泰证券、中天证券、中信建投、中信山东、中信证券、中信证券华南、中银证券、中邮证券、中原证券（排名不分先后）。

本基金募集期结束前获得基金销售业务资格的深圳证券交易所会员可通过深圳证券交易所开放式基金销售系统办理本基金的网上现金认购业务。如深圳证券交易所更新具有基金销售业务资格的会员单位名单，则以相关机构的最新公告为准。

4、基金管理人可根据有关法律法规，选择其他符合要求的机构代理发售本基金。

(四) 基金份额登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

住所：北京市西城区太平桥大街 17 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 17 号

法定代表人：周明

联系电话：(010) 59378888

传真：(010) 59378907

联系人：朱立元

(五) 律师事务所和经办律师

名称：上海源泰律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 256 号华夏银行大厦 14 楼

负责人：廖海

电话：(021) 51150298

传真：(021) 51150398

经办律师：刘佳、张雯倩

联系人：刘佳

(六) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)

注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼

执行事务合伙人：付建超

电话：021-6141 8888

传真：021-6335 0177

经办注册会计师：汪芳、罗佳

联系人：汪芳

招商基金管理有限公司

2021 年 11 月 2 日