

# 招商基金管理有限公司关于招商中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金调整现金替代相关内容的公告

根据招商中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金(基金代码:561910;场内简称:电池ETF;扩位证券简称:电池ETF;以下简称“本基金”)标的指数样本定期调整情况,为更好地维护基金份额持有人利益,根据相关法律法规及《招商中证电池主题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》”)等有关规定,招商基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”或“本公司”)经履行适当程序,决定自2024年6月17日起调整本基金申购赎回所涉及现金替代相关内容,补充标的指数成份券调整后本基金投资北京证券交易所股票的特定风险,并相应修订《招商中证电池主题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》”)相关条款,同时调整《招募说明书》中的基金管理人信息、基金托管人信息相关内容。本次《招募说明书》的修订对本基金原基金份额持有人利益无实质性不利影响,无需召开基金份额持有人大会。具体修订如下:

## 一、《招商中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的修订内容

1、《招募说明书》主要修订内容如下:

章节	原条款内容	修订后条款内容
§9 基金份额的申购与赎回	9.7 申购赎回清单的内容与格式 ..... 3、现金替代相关内容 (1) 现金替代分为4种类型:禁止现金替代(标志为“禁止”)、可以现金替代(标志为“允许”)、必须现金替代(标志为“必须”)和退补现金替代(标志为“退补”)。 .....	9.7 申购赎回清单的内容与格式 ..... 3、现金替代相关内容 (1) 现金替代分为4种类型:禁止现金替代(标志为“禁止”)、可以现金替代(标志为“允许”)、必须现金替代(标志为“必须”)和退补现金替代(标志为“退补”)。 .....

<p>退补现金替代适用于<u>深圳证券交易所</u>上市的成份证券，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>.....</p> <p>(4) 退补现金替代</p> <p>1) 适用情形</p> <p>退补现金替代的证券目前<u>仅</u>适用于标的指数中<u>深圳证券交易所</u>股票。</p> <p>.....</p> <p>3) 替代金额的处理程序</p> <p>.....</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>深圳证券交易所</u>连续竞价期间，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>深圳证券交易所</u>申报被替代证券的交易指令。</p> <p>.....</p> <p>特例情况：若自 T 日起，<u>深圳证券交易所</u>正常交易日已达到 20 日而该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购</p>	<p>退补现金替代适用于<u>除上海证券交易所外的其他证券交易所</u>上市的成份证券，是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代，根据基金管理人买卖情况，与投资者进行退款或补款。</p> <p>.....</p> <p>(4) 退补现金替代</p> <p>1) 适用情形</p> <p>退补现金替代的证券目前适用于标的指数中<u>除上海证券交易所外的其他证券交易所</u>股票。</p> <p>.....</p> <p>3) 替代金额的处理程序</p> <p>.....</p> <p><u>基金管理人有权根据基金投资的需要自主决定不买入或不卖出部分被替代证券，或者不进行任何买入、卖出证券的操作，基金管理人可能不买入或不卖出被替代证券的情形包括但不限于市场流动性不足、技术系统无法实现以及基金管理人认为不应买入或卖出的其他情形。</u></p> <p>.....</p> <p>实时申报的原则为：基金管理人在<u>除上海证券交易所外的其他证券交易所</u>连续竞价期间，根据收到的上海证券交易所申购赎回确认记录，在技术系统允许的情况下实时向<u>除</u></p>
--	--

	<p>投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>	<p><u>上海证券交易所外的其他证券交易所</u>申报被替代证券的交易指令。 ..... 特例情况：若自 T 日起，<u>除上海证券交易所外的其他证券交易所</u>正常交易日已达到 20 日而<u>相应证券交易所上市的</u>该证券正常交易日低于 2 日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本（包括买入价格与交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还申购投资者或申购投资者应补交的款项，以替代金额与所卖出的部分被替代证券实际卖出收入（卖出价格扣除交易费用）加上按照最近一次收盘价计算的未卖出的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还赎回投资者或赎回投资者应补交的款项。</p>
<p>§ 18 风 险 揭 示</p>	<p>18.4 本基金特有的风险 .....</p>	<p>18.4 本基金特有的风险 ..... <u>26、北京证券交易所证券投资风险</u> <u>北京证券交易所主要服务于创新型中小企业，在发行、上市、交易、退市等方面的规则与其他交易场所存在差异。本基金如投资北京证券交易所证券，可能面临的风险包括但不限于：</u></p>

	<p><u>(1) 中小企业经营风险</u></p> <p><u>北京证券交易所上市企业为创新型中小企业，该类企业往往具有规模小、对技术依赖高、迭代快、议价能力不强等特点，抗市场风险和行业风险能力较弱，存在因产品、经营模式、相关政策变化而出现经营失败的风险；另一方面，部分中小企业可能尚处于初步发展阶段，业务收入、现金流及盈利水平等具有较大不确定性，或面临较大波动，个股投资风险加大。</u></p> <p><u>(2) 股价大幅波动风险</u></p> <p><u>北京证券交易所在证券发行、交易、投资者适当性等方面与沪深证券交易所的制度规则存在一定差别，包括北京证券交易所竞价交易较沪深证券交易所设置了更宽的涨跌幅限制（上市后的首日不设涨跌幅限制，其后涨跌幅限制为 30%），可能导致较大的股票价格波动。</u></p> <p><u>(3) 企业退市风险</u></p> <p><u>根据北京证券交易所退市制度，上市企业退市情形较多，一旦所投资的北京证券交易所上市企业进入退市流程，有可能退入新三板创新层或基础层挂牌交易，或转入退市公司板块，本基金可能无法及时将该企业调出投资组合，从而面临退出</u></p>
--	---

		<p><u>难度较大、流动性变差、变现成本较高以及股价大幅波动的风险，可能对基金净值造成不利影响。</u></p> <p><u>(4) 流动性风险</u></p> <p><u>北京证券交易所投资门槛较高，初期参与的主体可能较少；此外，由于北京证券交易所上市企业规模小，部分企业股权较为集中，由此可能导致整体流动性相对较弱，若投资者在特定阶段对个券形成一致预期，由此可能导致基金面临持有股票无法正常交易及其他相关流动性风险。</u></p> <p><u>(5) 监管规则变化的风险</u></p> <p><u>北京证券交易所相关法律、行政法规、部门规章、规范性文件和交易所业务规则，可能根据市场情况进行修改完善，或者补充制定新的法律法规和业务规则，可能对基金投资运作产生影响，或导致本基金部分投资运作相应调整变化。</u></p>
--	--	--

2、《招募说明书》中调整了基金管理人信息、基金托管人信息相关内容，具体见修订后的《招募说明书》。

二、本次修订后的《招募说明书》自2024年6月17日起生效，投资者可访问本公司网站（[www.cmfchina.com](http://www.cmfchina.com)）进行查阅。本基金基金产品资料概要将进行相应更新。

风险提示：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，基金管理人并不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，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。投资有风险，敬请投资者在投资基金前应认真阅读《基金合同》、招募说明书和基金产品资料概要等基金法律文件，全面认识基金产品的风险收益特征，在了解产品情况及听取销售机构适当性意见的基础上，根据自身的风险承受能力、投资期限和投资目标，对基金投资作出独立决策，选择合适的基金产品。敬请投资者在购买基金前认真考虑、谨慎决策。

特此公告。

招商基金管理有限公司

2024年6月15日