

招商双债增强分级债券型证券投资基金之双债增强 A 份额 折算和申购与赎回结果的公告

2014-09-02

招商基金管理有限公司（以下简称“本公司”或“基金管理人”）于 2014 年 8 月 27 日在指定媒体及本公司网站（<http://www.cmfchina.com>）发布了《招商双债增强分级债券型证券投资基金之双债增强 A 份额开放申购、赎回业务的公告》（简称“《开放公告》”）、《招商双债增强分级债券型证券投资基金之双债增强 A 份额折算方案公告》（简称“《折算公告》”）。2014 年 8 月 29 日为双债增强 A 的第 3 个基金份额折算基准日及开放申购与赎回日，现将相关事项公告如下：

一、本次双债增强 A 的基金份额折算结果

根据《折算公告》的规定，2014 年 8 月 29 日，双债增强 A 的基金份额净值为 1.02144110 元，据此计算的双债增强 A 的折算比例为 1.02144110，折算后，双债增强 A 的基金份额净值调整为 1.000 元，基金份额持有人原来持有的每 1 份双债增强 A 相应增加至 1.02144110 份。折算前，双债增强 A 的基金份额总额为 109,435,364.78 份，折算后，双债增强 A 的基金份额总额为 111,781,779.38 份。各基金份额持有人持有的双债增强 A 经折算后的份额数采用舍去尾数的方式保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金资产。

投资者自 2014 年 8 月 29 日起（含该日）可在销售机构查询其原持有的双债增强 A 份额的折算结果。

二、本次双债增强 A 开放申购与赎回的确认结果

根据《开放公告》的规定，所有经确认有效的双债增强 A 的赎回申请全部予以成交确认，据此确认的双债增强 A 赎回总份额为 56,860,014.88 份。

截止 2014 年 9 月 1 日,双债增强 B 的份额数为 450,090,136.43 份。根据《基金合同》的规定,本基金《基金合同》生效之日起 2 年内,双债增强 A 的份额余额原则上不得超过 7/3 倍双债增强 B 的份额余额(即 1,050,210,318.33 份,下同)。

对于双债增强 A 的申购申请,如果对双债增强 A 的全部有效申购申请进行确认后,双债增强 A 的份额余额小于或等于 7/3 倍双债增强 B 的份额余额,则所有经确认有效的双债增强 A 的申购申请全部予以成交确认;如果对双债增强 A 的全部有效申购申请进行确认后,双债增强 A 的份额余额大于 7/3 倍双债增强 B 的份额余额,则在经确认后的双债增强 A 份额余额不超过 7/3 倍双债增强 B 的份额余额范围内,对全部有效申购申请按比例进行成交确认。

经本公司统计,2014 年 8 月 29 日,双债增强 A 的有效申购申请总额为 45,500.33 元,有效赎回申请总份额为 56,860,014.88 份。本次双债增强 A 的全部有效申购申请经确认后,双债增强 A 的份额余额将小于 7/3 倍双债增强 B 的份额余额,因此,基金管理人对全部有效申购申请予以成交确认。

本基金管理人已经于 2014 年 9 月 1 日根据上述原则对本次双债增强 A 的全部申购与赎回申请进行了确认,并为投资者办理了有关份额权益的注册登记变更手续。投资者可于 2014 年 9 月 2 日起到各销售网点查询申请与赎回的确认情况。投资者赎回申请成功后,本基金管理人将自 2014 年 9 月 1 日起 7 个工作日内通过相关销售机构将赎回款项划往基金份额持有人账户。

本次双债增强 A 实施基金份额折算及开放申购与赎回结束后,截止 2014 年 9 月 1 日,本基金的总份额为 505,057,400.74 份,其中,双债增强 A 总份额为 54,967,264.31 份,双债增强 B 的基金份额未发生变化,仍为 450,090,136.43 份。目前,双债增强 A 与双债增强 B 的份额配比为 0.122125014:1,因双债增强 A 份额规模缩减从而致使双债增强 A 与双债

增强 B 份额配比发生变化，敬请投资者注意杠杆率变动风险。

根据《基金合同》的规定，双债增强 A 自 2014 年 8 月 30 日起（含该日）的年收益率（单利）根据双债增强 A 的本次开放日，即 2014 年 8 月 29 日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币 1 年期银行定期存款基准利率 3.00%加上 1.3%与 4%之间的最大值进行计算，故：

双债增强 A 的年收益率（单利） = = 4.3%

双债增强 A 的年收益率以百分数形式表示，其计算按照四舍五入的方法保留到以百分比计算的小数点后第 2 位。

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，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者投资于本基金时应认真阅读本基金的《基金合同》和《招募说明书》等相关法律文件。

招商基金管理有限公司

2014 年 9 月 2 日