

关于招商国证生物医药指数分级证券投资基金 办理不定期份额折算业务的公告

根据《招商国证生物医药指数分级证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）第二十一部分中关于不定期份额折算的相关规定，当招商国证生物医药指数分级证券投资基金（以下简称“本基金”）之招商国证生物医药 B 份额（场内简称：生物药 B，交易代码：150272）的基金份额参考净值达到 0.250 元后，本基金将进行不定期份额折算。

截至 2015 年 7 月 8 日（T-1 日），本基金招商国证生物医药 B 份额的基金份额参考净值为 0.212 元，达到基金合同规定的不定期份额折算阈值 0.250 元。根据本基金基金合同以及深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定，本基金将以 2015 年 7 月 9 日（T 日）为基准日办理不定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

本次不定期份额折算的基准日为 2015 年 7 月 9 日（T 日）。

二、基金份额折算对象

基金份额折算基准日登记在册的招商国证生物医药份额（场内简称：生物医药，基金代码：161726）、招商国证生物医药 A 份额（场内简称：生物药 A，交易代码：150271）及招商国证生物医药 B 份额。

三、基金份额折算方式

招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额、招商国证生物医药份额按照《基金合同》“第二十一部分、基金份额折算”规则进行不定期份额折算。

在基金份额折算基准日，本基金将分别对招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额和招商国证生物医药份额进行份额折算，份额折算后本基金将确保招商国证生物医药 A 份额和招商国证生物医药 B 份额的比例为 1:1，份额折算后招商国证生物医药份额的基金份额净值、招商国证生物医药 A 份额和招商国证生物医药 B 份额的基金份额参考净值均调整为 1 元。具体折算原则及公式如下：

（1）招商国证生物医药 B 份额

份额折算原则：

份额折算前招商国证生物医药 B 份额的资产净值与份额折算后招商国证生物医药 B 份额

的资产净值相等。

$$NUM_B^{\text{后}} = \frac{NAV_B^{\text{前}} \times NUM_B^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$ 为折算前招商国证生物医药 B 份额参考净值

$NUM_B^{\text{前}}$ 为折算前招商国证生物医药 B 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后招商国证生物医药 B 份额的份额数

(2) 招商国证生物医药 A 份额

份额折算原则：

① 份额折算前后招商国证生物医药 A 份额与招商国证生物医药 B 份额的份额数始终保持 1: 1 配比；

② 份额折算前招商国证生物医药 A 份额的资产净值与份额折算后招商国证生物医药 A 份额的资产净值及新增场内招商国证生物医药份额的资产净值之和相等；

③ 份额折算前招商国证生物医药 A 份额的持有人在份额折算后将持有招商国证生物医药 A 份额与新增场内招商国证生物医药份额。

$$NUM_A^{\text{后}} = NUM_B^{\text{后}}$$
$$NUM_{\text{商品}}^{\text{场内新增}} = \frac{NUM_A^{\text{前}} \times NAV_A^{\text{前}} - NUM_A^{\text{后}} \times 1.000}{1.000}$$

其中：

$NUM_A^{\text{后}}$ 为折算后招商国证生物医药 A 份额的份额数

$NUM_B^{\text{后}}$ 为折算后招商国证生物医药 B 份额的份额数

$NUM_{\text{商品}}^{\text{场内新增}}$ 为份额折算前招商国证生物医药 A 份额持有人在份额折算后所持有的新增的场内招商国证生物医药份额的份额数

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前招商国证生物医药 A 份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前招商国证生物医药 A 份额的份额数

(3) 招商国证生物医药份额：

份额折算原则：

份额折算前招商国证生物医药份额的资产净值与份额折算后招商国证生物医药份额的资产净值相等。

$$NUM_{\text{商品}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{商品}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{商品}}^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_{\text{商品}}^{\text{前}}$ 为折算前招商国证生物医药份额净值

$NUM_{\text{商品}}^{\text{前}}$ 为折算前招商国证生物医药份额的份额数

$NUM_{\text{商品}}^{\text{后}}$ 为折算后原招商国证生物医药份额持有人持有的招商国证生物医药份额的份额数

招商国证生物医药份额的场外份额经折算后的份额数采用截尾法保留到小数点后两位；招商国证生物医药份额的场内份额经折算后的份额数，以及招商国证生物医药 A 份额折算成招商国证生物医药份额的场内份额数均取整计算（最小单位为 1 份），余额计入基金财产。

四、基金份额折算期间的基金业务办理

（一）不定期份额折算基准日（即 2015 年 7 月 9 日）(T 日)，本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务；招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额将于 2015 年 7 月 9 日(T 日)上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 7 月 9 日(T 日)上午 10:30 之后复牌。当日晚间，基金管理人计算当日基金份额净值及份额折算比例。

（二）不定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2015 年 7 月 10 日）(T+1 日)，本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管、配对转换业务，招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额暂停交易。当日，本基金注册登记人及基金管理人为持有人办理份额登记确认。

（三）不定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2015 年 7 月 13 日）(T+2 日)，基金管理人将公告份额折算确认结果，持有人可以查询其账户内的基金份额。当日，本基金恢复办理申购（含定期定额投资）、赎回、转托管、配对转换业务，招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额将于 2015 年 7 月 13 日(T+2 日)上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 7 月 13 日(T+2 日)上午 10:30 之后复牌。

（四）根据《深圳证券交易所证券投资基金交易和申购赎回实施细则》，2015 年 7 月 13 日(T+2 日)招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额即时行情显示的前收盘价为 2015 年 7 月 10 日(T+1 日)的招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额的基金份额参考净值，2015 年 7 月 13 日(T+2 日)当日招商国证生物医药 A 份额和招商国证生物医药 B 份额均可能出现交易价格大幅波动的情形。敬请投资者注意投资风险。

五、重要提示

1、本基金招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额将于 2015 年 7 月 9 日(T 日)上午开市至 10:30 停牌，并于 2015 年 7 月 9 日(T 日)上午 10:30 之后复牌。

2、本基金招商国证生物医药 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征，但在不定期份额折算后招商国证生物医药 A 份额持有人的风险收益特征将发生较大变化，由持有单一的较低风险收益特征的招商国证生物医药 A 份额变为同时持有较低风险收益特征的招商国证生物医药 A 份额与较高风险收益特征的招商国证生物医药份额，因此原招商国证生物医药 A 份额持有人预期收益实现的不确定性将会增加；此外，招商国证生物医药份额为跟踪中证大宗商品指数的基础份额，其份额净值将随市场涨跌而变化，因此原招商国证生物医药 A 份额持有人还可能会承担因市场下跌而遭受损失的风险。

3、本基金招商国证生物医药 B 份额表现为高风险、高收益的特征，不定期份额折算后其杠杆倍数将大幅降低，将恢复到初始的 2 倍杠杆水平，相应地，招商国证生物医药 B 份额净值随市场涨跌而增长或者下降的幅度也会大幅减小。

4、由于招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额份额折算前可能存在折溢价交易情形，不定期份额折算后，招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额份额的折溢价率可能发生较大变化。特提请参与二级市场交易的投资者注意折溢价所带来的风险。

5、根据深圳证券交易所的相关业务规则，招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额、招商国证生物医药份额的场内份额经折算后的份额数均取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有极小数量招商国证生物医药 A 份额、招商国证生物医药 B 份额和场内招商国证生物医药份额的持有人，存在折算后份额因为不足 1 份而导致相应的资产被强制归入基金资产的风险。

6、招商国证生物医药 B 份额折算基准日的份额净值与折算阈值 0.250 元可能有一定差异。

7、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前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。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

招商基金管理有限公司

2015 年 7 月 9 日