

关于招商可转债分级债券型证券投资基金办理 周期性份额折算、分拆业务的公告

根据《招商可转债分级债券型证券投资基金基金合同》(简称“《基金合同》”),及深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定,招商可转债分级债券型证券投资基金(简称“本基金”)将在 2016 年 12 月 15 日办理周期性份额折算、分拆业务。相关事项提示如下:

一、基金份额的折算及场内份额的分拆的基准日

根据本基金《基金合同》的规定,基金合同生效日起每 3 年为一个运作期(含基金合同生效日当年),自基金合同生效后每个基金运作期结束年份的 12 月 15 日(遇节假日顺延)为基准日进行周期性份额折算。基金份额折算频率为每三年折算一次。本基金成立于 2014 年,根据《基金合同》的约定,本次周期性份额折算基准日为 2016 年 12 月 15 日。

二、份额折算、分拆对象

基金份额折算基准日登记在册的所有招商可转债分级债券型证券投资基金之基础份额(包括场外份额和场内份额,场内简称“转债分级”,基金代码 161719)、招商可转债分级债券型证券投资基金之 A 份额(场内简称“转债优先”,基金代码 150188)、招商可转债分级债券型证券投资基金之 B 份额(场内简称“转债进取”,基金代码 150189)。

三、基金份额的折算与场内基金份额的分拆

1、基金份额的折算

本基金将分别对招商可转债份额和招商转债 A 份额、招商转债 B 份额进行份额折算, 份额折算后招商转债 A 份额和招商转债 B 份额的基金份额参考净值、招商可转债份额的基金份额净值均调整为 1.000 元。其中招商可转债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; 招商可转债份额的场内份额经折算后的份额数, 以及招商转债 A 份额、招商转债 B 份额折算成招商可转债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。

1) 招商可转债份额

份额折算原则: 折算不改变招商可转债份额持有人的资产净值, 其持有的招商可转债份额持有人净值折算调整为 1.000 元, 相应折算会增加新的招商可转债份额。

场外招商可转债份额持有人份额折算后获得新增场外招商可转债份额, 场内招商可转债份额持有人份额折算后获得新增场内招商可转债份额。

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

其中:

$NAV_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前招商可转债份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前招商可转债份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后原招商可转债份额持有人持有的转换后招商可转债份额的份额数

2) 招商转债 A 份额

份额折算原则: 折算不改变招商转债 A 份额持有人的资产净值, 其持有的招商转债 A 份额折算成净值为 1.000 元的场内招商可转债份额。

$$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_A^{\text{前}} \times NUM_A^{\text{前}}}{1.000}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前招商转债 A 份额净值

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前招商转债 A 份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后原招商转债 A 份额持有人持有的转换后招商可转债份额的份额数

3) 招商转债 B 份额

份额折算原则：折算不改变招商转债 B 持有人的资产净值，其持有的招商转债 B 的份额折算成净值为 1.000 元的场内招商可转债份额。

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

其中：

$NAV_B^{\text{前}}$ 为折算前招商转债 B 份额净值

$NUM_B^{\text{前}}$ 为折算前招商转债 B 份额的份额数

$NUM_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后原招商转债 B 份额持有人持有的转换后招商可转债份额的份额数

4) 持有场外招商可转债份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新的场外招商可转债份额；持有场内招商可转债份额的基金份额、招商转债 A 份额、招商转债 B 份额的持有人将按前述折算方式获得新的场内招商可转债份额。

2、场内基金份额的分拆

在基金份额折算后，场内招商可转债份额将按照 7:3 的比例分拆成招商转债 A 份额、招商转债 B 份额。届时，分拆后的招商转债 A 份额、招商转债 B 份额与招商可转债份额的场内份额和场外份额的净值均为 1.000 元。下一运作期内，分

拆后的招商转债 A 份额、招商转债 B 份额将顺延上一运作期内招商转债 A 份额与招商转债 B 份额的关系约定。

3、折算前后，按基金份额净值计算，投资者持有的基金份额价值，除保留位数因素影响外，无实质变化。

四、份额折算期间的业务办理

（一）份额折算基准日（即 R 日，2016 年 12 月 15 日），本基金暂停接受申购（包括定期定额申购，下同）、赎回（包括定期定额赎回，下同）、转换、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）、配对转换业务申请；招商转债 A、招商转债 B 交易正常。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）份额折算基准日后的第一个工作日（即 R+1 日，2016 年 12 月 16 日），本基金暂停接受申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务申请，招商转债 A、招商转债 B 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）份额折算基准日后的第二个工作日（即 R+2 日，2016 年 12 月 19 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，本基金恢复接受申购、赎回、转换、转托管、配对转换业务申请，招商转债 A、招商转债 B 于当日上午开市至 10:30 暂停场内交易，并于上午 10:30 起恢复交易。

（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》，本基金完成份额折算后的次一交易日（即 2016 年 12 月 19 日）招商转债 A、招商转债 B 的前收盘价为前一交易日（即 2016 年 12 月 16 日）的基金份额净值。由

于招商转债 A、招商转债 B 折算前可能存在折溢价交易情形，招商转债 A、招商转债 B 的基金市值在折算前后可能发生变化。

五、重要提示

投资者若希望了解基金份额折算业务详情，请登陆本公司网站：
www.cmfchina.com 或者拨打本公司客服电话：400-887-9555（免长途费）。

本公司承诺以诚实信用、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。投资者投资于基金前应认真阅读基金的基金合同、招募说明书等文件。投资有风险，敬请投资人认真阅读基金的相关法律文件，并选择适合自身风险承受能力的投资品种进行投资。

特此公告

招商基金管理有限公司

2016 年 12 月 12 日