

招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金可能发生不定期份额折算的风险提示公告

根据《招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)中关于不定期份额折算的相关规定,当招商中证证券公司份额(场内简称:券商分级,基金代码:161720)的基金份额净值达到 1.5000 元,本基金将进行不定期份额折算。

由于近期 A 股市场波动较大,截至 2020 年 7 月 9 日,招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)之基金份额(招商中证证券公司份额)的份额净值接近基金合同规定的不定期份额折算阈值 1.5000 元,因此本基金管理人敬请投资者密切关注招商中证证券公司份额近期的净值波动情况,并警惕可能出现的风险。

针对不定期折算所带来的风险,本基金管理人特别提示如下:

一、本基金之招商中证证券公司 A 份额表现为低风险、收益相对稳定的特征。当发生合同规定的不定期份额折算时,基金份额折算基准日折算前招商中证证券公司 A 份额超出 1.0000 元的部分将折算为招商中证证券公司份额,即,原招商中证证券公司 A 份额的持有人在不定期份额折算后将持有招商中证证券公司 A 份额和招商中证证券公司份额。因此,持有人的风险收益特征将发生一定的变化,由持有单一的较低风险收益特征份额变为同时持有较低风险收益特征份额与较高风险收益特征份额的情况。

二、本基金之招商中证证券公司 B 份额表现为高风险、高收益的特征,不定期份额折算后将恢复到初始杠杆水平,其杠杆倍数将比折算前高。

三、招商中证证券公司 A 份额、招商中证证券公司 B 份额在折算前可能存在折溢价交易情形。不定期份额折算后,其折溢价率可能随之发生较大变化。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。

四、根据合同规定,折算基准日在触发阈值日后才能确定,因此折算基准日招商中证证券公司份额的净值可能与触发折算阈值的 1.5000 元有一定差异。

本基金管理人的其他重要提示：

一、若本基金发生上述不定期份额折算情形，为保证折算期间本基金的平稳运作，本基金管理人可根据深圳证券交易所、中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定暂停招商中证证券公司 A 份额与招商中证证券公司 B 份额的上市交易和招商中证证券公司份额的申购及赎回等相关业务。届时本基金管理人将会对相关事项进行公告，敬请投资者予以关注。

投资者若希望了解基金不定期份额折算业务详情，请参阅基金合同及《招商中证全指证券公司指数分级证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）或者拨打本公司客服电话：400 - 887 - 9555（免长途话费）。

二、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。本基金管理人提醒投资者知晓基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。敬请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。

特此公告。

招商基金管理有限公司

2020 年 7 月 10 日