

关于招商中证白酒指数分级证券投资基金办理定期份额折算业务的公告

根据《招商中证白酒指数分级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，招商中证白酒指数分级证券投资基金（简称“本基金”）将在 2020 年 12 月 15 日办理定期份额折算业务。相关事项公告如下：

一、基金份额折算基准日

根据基金合同的规定，定期份额折算基准日为每个会计年度的 12 月 15 日（遇节假日顺延）。本次定期份额折算的基准日为 2020 年 12 月 15 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中证白酒 A 份额（场内简称：白酒 A，交易代码：150269）、招商中证白酒份额（场内简称：白酒分级，基金代码：161725）。

三、基金份额折算方式

招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额按照本基金基金合同中规定的净值计算规则进行净值计算，对招商中证白酒 A 份额的约定应得收益进行定期份额折算，每 2 份招商中证白酒份额将按 1 份招商中证白酒 A 份额获得约定应得收益的新增折算份额。在基金份额折算前与折算后，招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒 B 份额的份额配比保持 1：1 的比例。

对于招商中证白酒 A 份额期末的约定应得收益，即招商中证白酒 A 份额每个会计年度基金份额折算基准日的份额净值超出 1.0000 元部分，将折算为场内招商中证白酒份额分配给招商中证白酒 A 份额持有人。招商中证白酒份额持有人持有的每 2 份招商中证白酒份额将按 1 份招商中证白酒 A 份额获得新增招商中证白酒份额的分配。持有场外招商中证白酒份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场外招商中证白酒份额的分配；持有场内招商中证白酒份额的基金份额持有人将按前述折算方式获得新增场内招商中证白酒份额的分配。经过上述份额折算，招商中证白酒 A 份额的参考净值和招商中证白酒份额的基金份额净值将相应调整。

每个会计年度的基金份额折算基准日，本基金将对招商中证白酒 A 份额和招商中证白酒份额进行应得收益的定期份额折算。

招商中证白酒 A 份额本年度应得收益的定期份额折算时，有关计算公式如下：

(1) 招商中证白酒 A 份额

定期份额折算后招商中证白酒 A 份额的份额数 = 定期份额折算前招商中证白酒 A 份额的份额数

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

招商中证白酒 A 份额持有人新增的场内招商中证白酒份额数量 =

$$\frac{NUM_A^{\text{前}} \times (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000)}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前招商中证白酒 A 份额参考净值

$NUM_A^{\text{前}}$ 为折算前招商中证白酒 A 份额的份额数

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后招商中证白酒份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前招商中证白酒份额的份额数

(2) 招商中证白酒 B 份额

每个会计年度的定期份额折算不改变招商中证白酒 B 份额参考净值及其份额数。

(3) 招商中证白酒份额

$$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{基础}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}} - (NAV_A^{\text{前}} - 1.0000) / 2 \times NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}$$

$$\text{招商中证白酒份额持有人新增的招商中证白酒份额} = \frac{NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}}{2} \times \frac{NAV_A^{\text{前}} - 1.0000}{NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}}$$

定期份额折算后招商中证白酒份额的份额数 = 定期份额折算前招商中证白酒份额的份额数 + 招商中证白酒份额持有人新增的招商中证白酒份额的份额数

其中：

$NAV_A^{\text{前}}$ 为折算前招商中证白酒 A 份额参考净值

$NAV_{\text{基础}}^{\text{后}}$ 为折算后招商中证白酒份额净值

$NUM_{\text{基础}}^{\text{前}}$ 为折算前招商中证白酒份额的份额数

招商中证白酒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；招商中证白酒份额的场内份额经折算后的份额数，以及招商中证白酒 A 份额折算成招商中证白酒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

1、定期份额折算基准日（即 2020 年 12 月 15 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、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；招商中证白酒 A 份额、招商中证白酒 B 份额正常交易。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。

2、定期份额折算基准日后的第一个工作日（即 2020 年 12 月 16 日），本基金暂停办理申购（含定期定额投资）、赎回、转换、转托管、配对转换业务，招商中证白酒 A 份额暂停交易，招商中证白酒 B 份额正常交易。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。

3、定期份额折算基准日后的第二个工作日（即 2020 年 12 月 17 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。招商中证白酒 A 份额、招商中证白酒 B 份额正常交易。自该日起，本基金恢复办理赎回、转换、合并、转托管（包括系统内转托管和跨系统转托管（场内转场外））、直销机构场外申购、代销机构单日单基金账户不超过 100 万元的场外申购业务；继续暂停本基金场内申购、分拆、跨系统转托管（场外转场内）业务。相关限制如有调整，以基金管理人届时最新公告为准。

4、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》，2020 年 12 月 17 日招商中证白酒 A 份额即时行情显示的前收盘价将调整为前一交易日（2020 年 12 月 16 日）招商中证白酒 A 份额的基金份额参考净值（四舍五入至 0.001 元）。由于招商中证白酒 A 份额折算前可能存在折溢价交易情形，2020 年 12 月 15 日招商中证白酒 A 份额的收盘价扣除前一期约定收益后的价格与 2020 年 12 月 17 日招商中证白酒 A 份额调整后的前收盘价可能存在较大差异，因此 2020 年 12 月 17 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

1、根据中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会、中国证券监督管理委员会、国家外汇管理局联合发布的《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》，本基金将在 2020 年底前完成规范整改，请投资者关注相关风险以及基金管理人届时发布的相关公告。

2、由于招商中证白酒 A 份额新增份额折算成招商中证白酒份额的场内份额数和招商中证白酒份额的场内份额经折算后的份额数取整计算（最小单位为 1 份），舍去部分计入基金财产，持有较少招商中证白酒 A 份额数或场内招商中证白酒份额数的份额持有人存在无法获得新增场内招商中证白酒份额的可能性。因此，上述份额持有人可在基金份额折算基准日之前将原有份额卖出或者增加持有份额的数量来保证自身权益不受损害。

投资者若希望了解基金定期份额折算业务详情, 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。

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。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

2020 年 12 月 10 日