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

2017-12-12

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2017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2017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1.000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

$$NAV_{\text{白酒}}^{\text{后}} = \frac{NAV_{\text{白酒}}^{\text{前}} \times NUM_{\text{白酒}}^{\text{前}} - (NAV_{A}^{\text{前}} - 1.000)/2 \times NUM_{\text{白酒}}^{\text{前}}}{NUM_{\text{白酒}}^{\text{前}}}$$

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 =

$$\frac{NUM_{A}^{\text{前}} \times (NAV_{A}^{\text{前}} - 1.000)}{NAV_{\text{白酒}}^{\text{后}}}$$

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

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

$NUM_{\text{白酒}}^{\text{前}}$ 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

$$NAV_{基础}^{后}=\frac{NAV_{基础}^{前}\times NUM_{基础}^{前}-(NAV_{A}^{前}-1.000)/2\times NUM_{基础}^{前}}{NUM_{基础}^{前}}$$

招商中证白酒份额持有人新增的招商中证白酒份额= $\frac{NUM_{基础}^{前}}{2}\times\frac{NAV_{A}^{前}-1.000}{NAV_{基础}^{后}}$

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：

$NAV_{A}^{前}$ 为折算前招商中证白酒 A 份额参考净值

$NAV_{基础}^{后}$ 为折算后招商中证白酒份额净值

$NUM_{基础}^{前}$ 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 2017 年 12 月 15 日），本基金暂停办理申购、赎回、转托管（包括场外转托管、跨系统转托管，下同）业务、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 2017 年 12 月 18 日），本基金暂停办理申购、赎回、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 2017 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，本基金恢复办理申购、赎回、转托管、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。

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》，2017 年 12 月 19 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（2017 年 12 月 18 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，2017 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 2017 年 12 月 19 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 2017 年 12 月 19 日当日可能出现交易价格大幅波动的情形。

五、重要提示

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

2017年12月12日